

# 浙商智多盈债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 浙商智多盈债券   |
| 基金主代码      | 013231  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2021 年 12 月 7 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 124,539,329.29 份  |
| 投资目标       | 在严格控制组合风险的前提下，通过精选债券进行投资，并辅以适度的权益投资，力争实现基金资产的长期稳定投资回报。                                  |
| 投资策略       | 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、国债期货投资策略；4、流动性管理策略；5、股票投资策略；6、存托凭证投资策略；7、信用衍生品投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略 |
| 业绩比较基准     | 中债总指数(全价)收益率×80% + 沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市  |

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金投资于港股通标的股票后，需面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |                 |
| 基金管理人           | 浙商基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 浙商银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 浙商智多盈债券 A   | 浙商智多盈债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 013231  | 013232          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 54,750,375.66 份   | 69,788,953.63 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 浙商智多盈债券 A                           | 浙商智多盈债券 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 315,854.31                          | 388,836.70    |
| 2. 本期利润         | 251,557.46                          | 355,829.32    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0051                              | 0.0048        |
| 4. 期末基金资产净值     | 52,790,363.85                       | 66,803,791.49 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9642                              | 0.9572        |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商智多盈债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|    |        |               |                |                       |     |     |

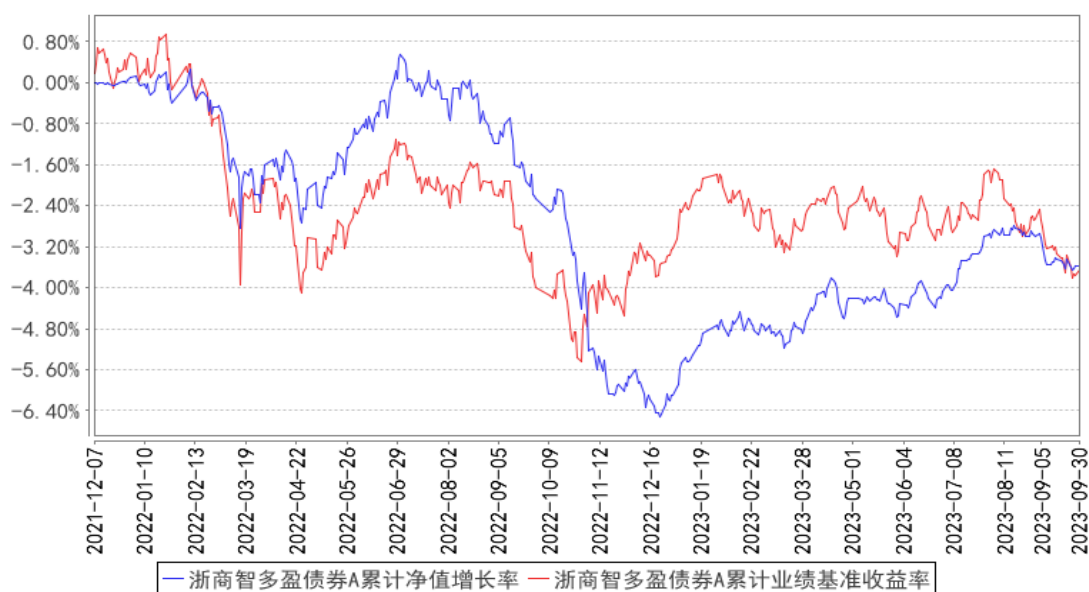
|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.52%  | 0.09% | -0.87% | 0.17% | 1.39%  | -0.08% |
| 过去六个月      | 1.08%  | 0.11% | -1.17% | 0.17% | 2.25%  | -0.06% |
| 过去一年       | -1.34% | 0.16% | 0.37%  | 0.21% | -1.71% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.58% | 0.19% | -3.65% | 0.23% | 0.07%  | -0.04% |

浙商智多盈债券 C

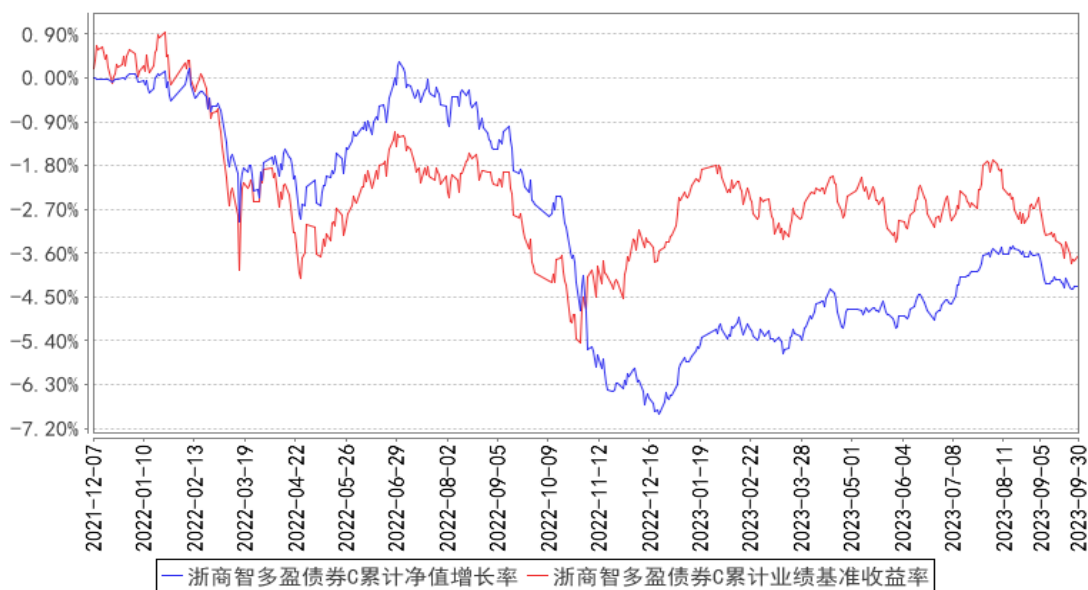
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.42%  | 0.09%     | -0.87%     | 0.17%         | 1.29%  | -0.08% |
| 过去六个月      | 0.87%  | 0.11%     | -1.17%     | 0.17%         | 2.04%  | -0.06% |
| 过去一年       | -1.73% | 0.16%     | 0.37%      | 0.21%         | -2.10% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.28% | 0.19%     | -3.65%     | 0.23%         | -0.63% | -0.04% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浙商智多盈债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浙商智多盈债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                    | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|-----------------------|------------------|------|--------|--|
|     |                       | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 陈亚芳 | 本基金的基金经理，公司固定收益部基金经理  | 2021 年 12 月 7 日  | -    | 7 年    | 陈亚芳女士，约翰霍普金斯大学金融数学硕士。2017 年 3 月加入浙商基金管理有限公司。 |
| 朱靖宇 | 本基金的基金经理，公司固定收益部总经理助理 | 2022 年 10 月 20 日 | -    | 11 年   | 朱靖宇女士，复旦大学硕士。历任广发银行投资经理、国联安基金基金经理。           |
| 刘新正 | 本基金的基金经理，公司智能权益       | 2023 年 4 月 17 日  | -    | 6 年    | 刘新正女士，北京大学硕士，曾任香港鲍尔太平有限公司上海代表处分析师。           |

|  |         |  |  |  |  |
|--|---------|--|--|--|--|
|  | 投资部基金经理 |  |  |  |  |
|--|---------|--|--|--|--|

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司风险管理部将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金主要采用股债轮动配置的策略以获得相对稳定的收益，更多追求组合获得较高的风险收益比。

股票方面，保持中性偏低的股票仓位，以公用事业、机械、化工等行业为主要配置方向。

债券方面，三季度债券市场整体下行，久期维持中性位置，转债仓位小幅上升。

综合来看，本基金的稳健收益目标明确，目前策略的运作均在我们的预期之内，我们将继续按照既定的策略运作本基金。未来我们将更加审慎的从平衡好产品的收益和波动体验角度，持续努力达成基金的目标。

三季度以来，宏观经济方面，6、7 月经济指标回落后 8 月经济指标明显回暖；需求端，8 月消费和出口指数触底回升；生产端，PMI 指数连续 3 个月上行，9 月底回到荣枯线以上，规模以上工业增加值 8 月回升到 4.5%；投资端，制造业投资增速提升，基建投资增速略有放缓，但 8 月专项债加速发行，9 月底今年新增专项债额度发行完毕，将有效支撑三季度基建投资增速。房地产投资增速仍为负数，除竣工面积增速降幅有所收窄外其他数据变化不大。

物价方面，CPI 同比触底反弹，8 月从负数回到 0.1%，PPI 同比降幅收窄，主要受海外原油价格波动影响导致。

货币市场方面，货币政策维持宽松，央行 8 月降息、9 月降准，资金面稳中趋紧。金融数据方面 9 月明显有所改善，9 月社融新增 4.12 万亿元，存量同比增速 9%，其中居民中长期贷款部分同比多增 2000 亿元，说明 8 月以来推进得一系列地产政策对于居民信贷得修复有一定的支撑，M2 存量同比增速 10.3%，社融-M2 剪刀差有所收窄。

大类资产表现方面，整体来看，三季度商品好于债券好于股票。具体走势来看，商品受海外原油供给影响，7 月以来大幅上行；股票呈现 N 形修复态势，债券收益率则是先下后上，股债主要受国内经济和政策影响波动。

展望四季度，一方面，宏观经济当前整体有回暖趋势，库存周期目前从主动去库存转向被动去库存，预计四季度库存见底，同时随着美国库存周期的变化，届时会有中美库存双周期共振，有效刺激工业企业利润和出口的修复；一方面，当前中美利差较大，人民币汇率面临较大贬值压力，银行的息差空间已经降至低点，货币政策未来整体空间较为有限，但特殊再融资债预计将在四季度落地，货币政策需要保持一定的稳定性，配合积极财政政策。所以预计四季度债市整体将趋于平稳，可转债资产和股票资产当前估值水平处于历史中等偏低分位，相对具有一定的性价比，我们将维持当前持仓，随着市场变化做出谨慎调整。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 基金份额净值为 0.9642 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.52%；截至本报告期末本基金 C 基金份额净值为 0.9572 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.42%；同期业绩比较基准收益率为-0.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 9,109,452.55   | 7.31         |
|    | 其中：股票             | 9,109,452.55   | 7.31         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 108,076,384.45 | 86.71        |
|    | 其中：债券             | 108,076,384.45 | 86.71        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 1,000,000.00   | 0.80         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 6,415,885.58   | 5.15         |
| 8  | 其他资产              | 35,629.62      | 0.03         |
| 9  | 合计                | 124,637,352.20 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 3,790,697.15 | 3.17         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,466,518.00 | 1.23         |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 602,978.20   | 0.50         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 70,805.15    | 0.06         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |



|   |               |              |      |
|---|---------------|--------------|------|
| L | 租赁和商务服务业      | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -    |
| P | 教育            | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -            | -    |
| S | 综合            | -            | -    |
|   | 合计            | 5,930,998.50 | 4.96 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| -        | -            | -            |
| 原材料      | -            | -            |
| 非日常生活消费品 | 1,301,070.68 | 1.09         |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 能源       | 582,360.00   | 0.49         |
| 金融       | -            | -            |
| 医疗保健     | -            | -            |
| 工业       | 272,800.00   | 0.23         |
| 信息技术     | -            | -            |
| 通信服务     | 317,109.80   | 0.27         |
| 公用事业     | 705,113.57   | 0.59         |
| 房地产      | -            | -            |
| 合计       | 3,178,454.05 | 2.66         |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600900 | 长江电力   | 56,900  | 1,265,456.00 | 1.06         |
| 2  | 00780  | 同程旅行   | 68,602  | 1,061,272.94 | 0.89         |
| 3  | 600309 | 万华化学   | 10,900  | 962,688.00   | 0.80         |
| 4  | 00883  | 中国海洋石油 | 46,000  | 582,360.00   | 0.49         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台   | 300     | 539,565.00   | 0.45         |
| 6  | 688257 | 新锐股份   | 19,125  | 529,571.25   | 0.44         |
| 7  | 603218 | 日月股份   | 33,100  | 525,628.00   | 0.44         |
| 8  | 001332 | 锡装股份   | 12,310  | 440,574.90   | 0.37         |
| 9  | 603871 | 嘉友国际   | 23,740  | 425,658.20   | 0.36         |
| 10 | 02380  | 中国电力   | 137,697 | 359,389.17   | 0.30         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 8,087,171.51   | 6.76         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 51,112,243.41  | 42.74        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,251,079.23  | 16.93        |
| 4  | 企业债券      | 20,283,339.18  | 16.96        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,379,041.10  | 8.68         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 18,214,589.25  | 15.23        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 108,076,384.45 | 90.37        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 2128038   | 21 农业银行永续债 01  | 100,000 | 10,499,890.96 | 8.78         |
| 2  | 102103355 | 21 齐河城投 MTN001 | 100,000 | 10,379,041.10 | 8.68         |
| 3  | 2228023   | 22 中国银行永续债 01  | 100,000 | 10,302,224.04 | 8.61         |
| 4  | 210215    | 21 国开 15       | 100,000 | 10,202,344.26 | 8.53         |
| 5  | 184079    | 21 沪地 03       | 100,000 | 10,150,578.08 | 8.49         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中不存在被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 17,683.51 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | 17,936.11 |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 10.00     |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 35,629.62 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1  | 110043 | 无锡转债     | 2,536,940.92 | 2.12         |
| 2  | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,914,923.15 | 1.60         |
| 3  | 127005 | 长证转债     | 1,313,068.71 | 1.10         |
| 4  | 110092 | 三房转债     | 1,227,116.36 | 1.03         |
| 5  | 113052 | 兴业转债     | 890,561.86   | 0.74         |
| 6  | 113021 | 中信转债     | 650,013.59   | 0.54         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 7  | 127049 | 希望转 2   | 596,788.62 | 0.50 |
| 8  | 113045 | 环旭转债    | 480,489.74 | 0.40 |
| 9  | 118031 | 天 23 转债 | 469,732.70 | 0.39 |
| 10 | 127056 | 中特转债    | 465,137.00 | 0.39 |
| 11 | 127042 | 嘉美转债    | 463,721.21 | 0.39 |
| 12 | 113641 | 华友转债    | 456,696.22 | 0.38 |
| 13 | 113616 | 韦尔转债    | 452,137.10 | 0.38 |
| 14 | 113065 | 齐鲁转债    | 411,416.55 | 0.34 |
| 15 | 123091 | 长海转债    | 398,463.27 | 0.33 |
| 16 | 113062 | 常银转债    | 380,184.01 | 0.32 |
| 17 | 110062 | 烽火转债    | 366,902.41 | 0.31 |
| 18 | 123035 | 利德转债    | 364,333.58 | 0.30 |
| 19 | 113602 | 景 20 转债 | 358,900.30 | 0.30 |
| 20 | 110079 | 杭银转债    | 349,188.41 | 0.29 |
| 21 | 127050 | 麒麟转债    | 342,162.78 | 0.29 |
| 22 | 110087 | 天业转债    | 304,171.10 | 0.25 |
| 23 | 123107 | 温氏转债    | 285,617.84 | 0.24 |
| 24 | 113519 | 长久转债    | 275,848.05 | 0.23 |
| 25 | 113051 | 节能转债    | 264,879.02 | 0.22 |
| 26 | 128134 | 鸿路转债    | 248,308.93 | 0.21 |
| 27 | 113047 | 旗滨转债    | 239,600.27 | 0.20 |
| 28 | 127017 | 万青转债    | 239,499.62 | 0.20 |
| 29 | 128142 | 新乳转债    | 239,488.08 | 0.20 |
| 30 | 127052 | 西子转债    | 233,931.54 | 0.20 |
| 31 | 127020 | 中金转债    | 196,446.00 | 0.16 |
| 32 | 128132 | 交建转债    | 194,994.90 | 0.16 |
| 33 | 113655 | 欧 22 转债 | 117,416.22 | 0.10 |
| 34 | 113046 | 金田转债    | 108,438.41 | 0.09 |

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 浙商智多盈债券 A     | 浙商智多盈债券 C     |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 49,566,052.86 | 79,785,778.28 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 5,719,762.00  | 64,380.92     |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 535,439.20    | 10,061,205.57 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 54,750,375.66 | 69,788,953.63 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人持有本基金份额变动的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |               |      | 报告期末持有基金情况 |               |         |
|--|----------------|--------------------------|---------------|------|------------|---------------|---------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额          | 份额占比(%) |
| 机构   | 1              | 20230701-20230930        | 39,999,000.00 | 0.00 | 0.00       | 39,999,000.00 | 32.12   |
| 产品特有风险   |                |                          |               |      |            |               |         |
| <p>(1) 赎回申请延期办理的风险<br/>机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险<br/>机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 提前终止基金合同的风险<br/>机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算。</p> <p>(4) 基金规模过小导致的风险<br/>机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> |                |                          |               |      |            |               |         |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商智多盈债券型证券投资基金设立的相关文件；
- 2、《浙商智多盈债券型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《浙商智多盈债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《浙商智多盈债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.zsfund.com](http://www.zsfund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日