

招商中证浙江 100 交易型开放式指数 证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 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贵金属投资明细.....	40
7.9 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.....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	41

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	47
11.1 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	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商中证浙江 100ETF
场内简称	浙江 100ETF
基金主代码	159815
交易代码	159815
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 3 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,038,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	标的指数的成份券的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。当预期成份券发生调整和成份券发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证浙江 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证浙江 100 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
		朱巍

	联系电话	0755-83196666	0571-87659806
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-887-9555	95527
传真		0755-83196475	0571-88268688
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	杭州市拱墅区延安路 368 号
邮政编码		518040	310006
法定代表人		王小青	张荣森(代为履行法定代表人职责)

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-568,697.01
本期利润	-4,900,990.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1522
本期加权平均净值利润率	-14.80%
本期基金份额净值增长率	-12.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,970,339.84
期末可供分配基金份额利润	0.0615
期末基金资产净值	34,009,026.84
期末基金份额净值	1.0615
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.15%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

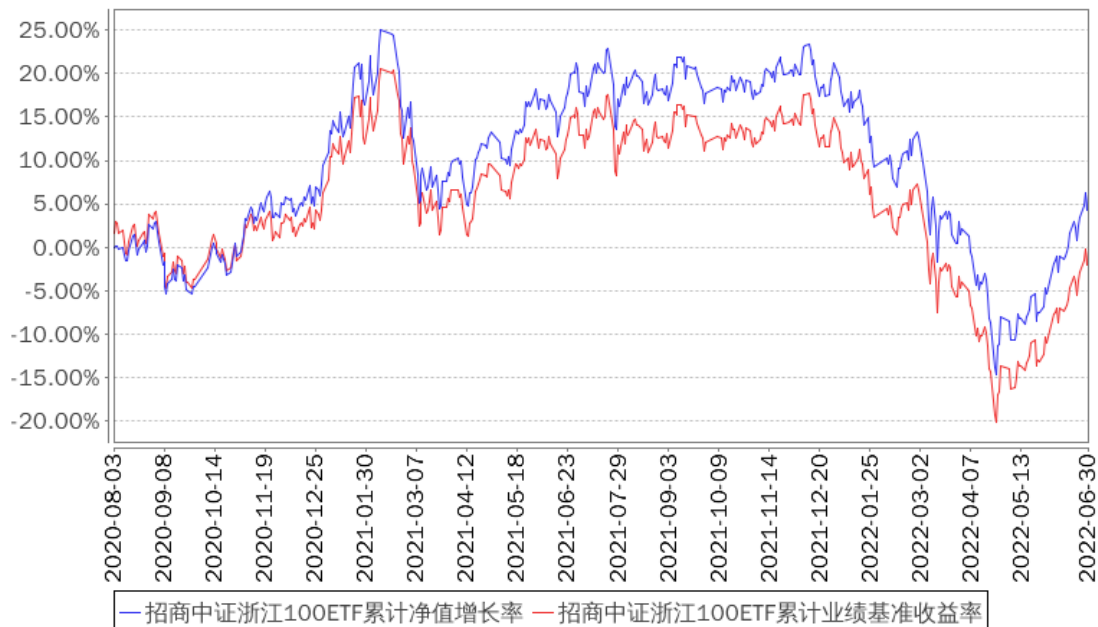
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	11.46%	1.28%	11.22%	1.31%	0.24%	-0.03%
过去三个月	4.58%	1.70%	4.59%	1.74%	-0.01%	-0.04%
过去六个月	-12.42%	1.65%	-13.32%	1.67%	0.90%	-0.02%
过去一年	-12.40%	1.38%	-14.14%	1.40%	1.74%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.15%	1.35%	-0.33%	1.37%	6.48%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额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

招商中证浙江100ETF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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘重杰	本基金基金经理	2020 年 8 月 3 日	-	11	男，本科。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证物联网主题交易

					型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形共发生过五次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内 A 股波动较大，从行业来看业绩表现分化相对较大，煤炭涨幅 31.38%，电子、计算机、传媒、国防军工等行业板块跌幅较大，跌幅超过 20%。本基金的基准指数中证浙江 100 指数报告期内下跌 13.32%。关于本基金的运作，仓位维持在 98.9% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-12.42%，同期业绩基准增长率为-13.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，上半年国内经济先抑后扬。5 月份以前主要受疫情影响，经济数据明显走弱。随着疫情影响消除，经济持续恢复中。流动性在上半年有所波动，但整体维持在合理充裕的区间内。上半年 A 股从恐慌避险到逐级反弹。2022 年 1 到 4 月，实物资产（上游）通胀与经济需求的通缩，在股票定价上则体现为投资者盈利预期的下降与贴现率预期的抬升，既拉低盈利又拉低估值。4 月底以来，“稳增长”政策落地叠加疫情影响逐步消退，基本面预期最悲观时刻或已然过去，A 股市场拾级修复。下半年 A 股市场运行区间有望上移，回调或是配置良机。“稳增长”政策落地叠加疫情影响逐步消退，基本面预期最悲观时刻或已然过去。展望下半年，经济预期上修，风险偏好与风险评价积极变化，对 A 股判断转向乐观，上修上证指数运行区间，回调或是配置良机。下半年 A 股盈利环比逐步改善，盈利预期的上修将是市场的积极支撑；“稳增长”政策持续加码与疫情防控发生积极变化，风险偏好与风险评价可能也有驱动；无风险利率有一定下行空间，但幅度相对有限，非市场下阶段的核心驱动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,043,441.15	529,935.03
结算备付金		7,851.01	-
存出保证金		5,632.86	12,560.37
交易性金融资产	6.4.7.2	33,185,103.71	38,488,259.07
其中：股票投资		33,128,599.00	38,478,459.12
基金投资		-	-
债券投资		56,504.71	9,799.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	1,182,483.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	113.11
资产总计		34,242,028.73	40,213,351.20
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,170,595.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,890.32	10,586.30
应付托管费		2,630.11	3,528.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	222,481.46	192,977.90
负债合计		233,001.89	1,377,688.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,038,687.00	32,038,687.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,970,339.84	6,796,975.70
净资产合计		34,009,026.84	38,835,662.70
负债和净资产总计		34,242,028.73	40,213,351.20

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0615 元，基金份额总额 32,038,687.00 份；

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度

末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

6.2 利润表

会计主体：招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,735,873.02	7,399,612.51
1.利息收入		2,280.03	8,305.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,280.03	8,275.17
债券利息收入		-	30.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-408,823.21	6,660,683.74
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-743,199.41	6,255,283.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,252.66	25,689.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	306,123.54	379,710.41
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,332,293.95	706,948.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,964.11	23,674.60
减：二、营业总支出		165,117.94	331,529.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	49,463.96	91,009.40
2.托管费	6.4.10.2.2	16,488.01	30,336.45
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		0.03	-

8.其他费用	6.4.7.19	99,165.94	210,183.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,900,990.96	7,068,083.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,900,990.96	7,068,083.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,900,990.96	7,068,083.35

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	32,038,687.00	-	6,796,975.70	38,835,662.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	32,038,687.00	-	6,796,975.70	38,835,662.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-4,826,635.86	-4,826,635.86
（一）、综合收益总额	-	-	-4,900,990.96	-4,900,990.96
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	74,355.10	74,355.10
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	-	106,948.54	4,106,948.54
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-	-32,593.44	-4,032,593.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	32,038,687.00	-	1,970,339.84	34,009,026.84
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	74,038,687.00	-	6,960,356.48	80,999,043.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	74,038,687.00	-	6,960,356.48	80,999,043.48

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,000,000.00	-	2,364,605.36	-27,635,394.64
（一）、综合收益总额	-	-	7,068,083.35	7,068,083.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-30,000,000.00	-	-4,703,477.99	-34,703,477.99
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-30,000,000.00	-	-4,703,477.99	-34,703,477.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	44,038,687.00	-	9,324,961.84	53,363,648.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 徐勇 _____ 欧志明 _____ 何剑萍 _____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2093 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 246,038,687.00 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(20)第 00350 号验资报告。《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 8 月 3 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的

相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为中证浙江 100 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致,具体请见 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、存出保证金和应收利息,金额分别为人民币 529,935.03 元、人民币 12,560.37 元和人民币 113.11 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、存出保证金和其他资产—应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在银行存款和存出保证金等项目中,不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准

则下，银行存款、存出保证金和其他资产-应收利息的金额分别为人民币 530,041.15 元、人民币 12,565.97 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 38,488,259.07 元，属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 1.39 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 38,488,260.46 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所

得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,043,441.15
等于：本金	1,043,264.07
加：应计利息	177.08
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,043,441.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,838,011.57	-	33,128,599.00	290,587.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	56,499.75	4.96	56,504.71	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	56,499.75	4.96	56,504.71	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		32,894,511.32	4.96	33,185,103.71	290,587.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,529.50
其中：交易所市场	1,529.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	212,798.78
应付指数使用费	8,153.18
合计	222,481.46

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,038,687.00	32,038,687.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	32,038,687.00	32,038,687.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,291,218.53	-494,242.83	6,796,975.70
本期利润	-568,697.01	-4,332,293.95	-4,900,990.96
本期基金份额交易产生的变动数	-2,002.62	76,357.72	74,355.10
其中：基金申购款	916,992.37	-810,043.83	106,948.54
基金赎回款	-918,994.99	886,401.55	-32,593.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,720,518.90	-4,750,179.06	1,970,339.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,128.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	88.66
其他	62.77
合计	2,280.03

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-528,045.16
股票投资收益——赎回差价收入	-215,154.25
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-743,199.41

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,658,376.51
减：卖出股票成本总额	5,178,968.09
减：交易费用	7,453.58
买卖股票差价收入	-528,045.16

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	4,032,593.44
减：现金支付赎回款总额	1,994,752.44

减：赎回股票成本总额	2,252,995.25
减：交易费用	-
赎回差价收入	-215,154.25

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	18.43
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	28,234.23
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	28,252.66

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	134,849.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	106,599.47
减：应计利息总额	15.85
减：交易费用	0.35
买卖债券差价收入	28,234.23

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	306,123.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	306,123.54

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
------	------------------------------------

1.交易性金融资产	-4,332,293.95
——股票投资	-4,331,493.94
——债券投资	-800.01
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,332,293.95

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,964.11
合计	2,964.11

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	24,795.19
指数使用费	4,946.39
合计	99,165.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
浙商银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	2,897,576.58	32.42%	9,006,721.82	32.24%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	129,051.50	95.70%	225,715.30	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	670.50	32.42%	659.24	43.10%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

		的比例	额	总额的比例
招商证券	2,140.38	32.84%	2,006.73	53.29%

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	49,463.96	91,009.40
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,488.01	30,336.45

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业

务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	2,331,210.00	7.28%	2,491,480.00	7.78%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行-活期	1,043,441.15	2,128.60	2,514,796.81	7,254.33

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	305	11,873.65

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	424	26,873.12

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有浙商银行（601916）120,100 股，市值为人民币 398,732.00 元，占本基金资产净值的比例为 1.17%（2021 年 6 月 30 日：持有 67,200 股，市值为人民币 266,784.00 元，占基金资产净值的比例为 0.50%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 14 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	500	49,999.78	50,003.51	-
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月（含）	新债未上市	100.00	100.02	65	6,499.97	6,501.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指指数成份股、备选成份股）。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	50,003.51	-
AAA 以下	6,501.20	9,799.95
未评级	-	-
合计	56,504.71	9,799.95

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,043,441.15	-	-	-	1,043,441.15
结算备付金	7,851.01	-	-	-	7,851.01
存出保证金	5,632.86	-	-	-	5,632.86
交易性金融资产	-	-	56,504.71	33,128,599.00	33,185,103.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,056,925.02	-	56,504.71	33,128,599.00	34,242,028.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,890.32	7,890.32
应付托管费	-	-	-	2,630.11	2,630.11
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	222,481.46	222,481.46
负债总计	-	-	-	233,001.89	233,001.89

利率敏感度缺口	1,056,925.02	-	56,504.71	32,895,597.11	34,009,026.84
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	529,935.03	-	-	-	529,935.03
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	12,560.37	-	-	-	12,560.37
交易性金融资产	-	-	9,799.95	38,478,459.12	38,488,259.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	113.11	113.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,182,483.62	1,182,483.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	542,495.40	-	9,799.95	39,661,055.85	40,213,351.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,586.30	10,586.30
应付托管费	-	-	-	3,528.78	3,528.78
应付证券清算款	-	-	-	1,170,595.52	1,170,595.52
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,585.66	2,585.66
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,392.24	190,392.24
负债总计	-	-	-	1,377,688.50	1,377,688.50
利率敏感度缺口	542,495.40	-	9,799.95	38,283,367.35	38,835,662.70

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,605.80	-277.51

2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,661.35	287.10
--------------------	----------	--------

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	33,128,599.00	97.41	38,478,459.12	99.08
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	33,128,599.00	97.41	38,478,459.12	99.08

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	1,656,429.95	1,923,922.96
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-1,656,429.95	-1,923,922.96

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：

除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	33,128,599.00
第二层次	56,504.71
第三层次	-
合计	33,185,103.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	33,128,599.00	96.75
	其中：股票	33,128,599.00	96.75
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	56,504.71	0.17
	其中：债券	56,504.71	0.17
	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	-	-
	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	1,051,292.16	3.07
8	其他资产	5,632.86	0.02
9	合计	34,242,028.73	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	23,195,150.73	68.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,485.00	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	802,843.00	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	487,448.00	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,682,449.89	4.95
J	金融业	4,102,929.46	12.06
K	房地产业	170,568.00	0.50
L	租赁和商务服务业	332,619.57	0.98
M	科学研究和技术服务业	861,350.70	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	426,496.00	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	778,601.54	2.29
R	文化、体育和娱乐业	220,640.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	33,103,581.89	97.34

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	134.40	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,882.71	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	25,017.11	0.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002415	海康威视	67,800	2,454,360.00	7.22
2	002142	宁波银行	57,016	2,041,742.96	6.00
3	603799	华友钴业	18,310	1,750,802.20	5.15
4	300347	泰格医药	7,526	861,350.70	2.53
5	600570	恒生电子	16,714	727,727.56	2.14
6	002050	三花智控	25,700	706,236.00	2.08
7	002493	荣盛石化	43,700	672,543.00	1.98
8	600460	士兰微	12,300	639,600.00	1.88

9	600926	杭州银行	42,600	638,148.00	1.88
10	300316	晶盛机电	9,200	621,828.00	1.83
11	002001	新 和 成	26,548	605,559.88	1.78
12	600176	中国巨石	34,407	599,025.87	1.76
13	000963	华东医药	12,700	573,532.00	1.69
14	600763	通策医疗	3,201	558,382.44	1.64
15	601877	正泰电器	15,400	551,012.00	1.62
16	688005	容百科技	3,862	499,897.28	1.47
17	603806	福斯特	7,576	496,379.52	1.46
18	600884	杉杉股份	15,500	460,660.00	1.35
19	300763	锦浪科技	2,140	455,820.00	1.34
20	603606	东方电缆	5,900	451,940.00	1.33
21	002648	卫星化学	17,227	445,317.95	1.31
22	002756	永兴材料	2,900	441,409.00	1.30
23	601689	拓普集团	6,300	431,109.00	1.27
24	603290	斯达半导	1,100	424,490.00	1.25
25	002236	大华股份	25,767	423,094.14	1.24
26	601916	浙商银行	120,100	398,732.00	1.17
27	603816	顾家家居	6,964	394,371.32	1.16
28	605358	立昂微	5,808	391,343.04	1.15
29	601233	桐昆股份	24,200	384,296.00	1.13
30	600352	浙江龙盛	37,300	379,714.00	1.12
31	601108	财通证券	46,650	367,135.50	1.08
32	603456	九洲药业	7,100	367,070.00	1.08
33	603260	合盛硅业	3,100	365,676.00	1.08
34	002120	韵达股份	20,800	354,848.00	1.04
35	603605	珀莱雅	2,013	332,507.34	0.98
36	601878	浙商证券	27,800	316,364.00	0.93
37	002602	世纪华通	64,200	309,444.00	0.91
38	002056	横店东磁	11,600	308,792.00	0.91
39	605117	德业股份	1,100	307,879.00	0.91
40	300033	同花顺	3,100	298,065.00	0.88
41	600521	华海药业	12,800	290,560.00	0.85
42	002326	永太科技	8,800	289,784.00	0.85
43	002624	完美世界	19,414	278,979.18	0.82
44	601865	福莱特	7,300	278,130.00	0.82
45	600177	雅戈尔	39,800	263,874.00	0.78
46	600160	巨化股份	19,300	253,795.00	0.75
47	002508	老板电器	6,800	245,004.00	0.72
48	002273	水晶光电	19,900	240,989.00	0.71
49	300604	长川科技	5,200	234,780.00	0.69
50	300357	我武生物	4,500	234,135.00	0.69
51	600704	物产中大	44,700	229,311.00	0.67

52	300244	迪安诊断	7,081	220,219.10	0.65
53	600415	小商品城	39,400	219,458.00	0.65
54	002372	伟星新材	9,100	218,764.00	0.64
55	300558	贝达药业	3,500	212,800.00	0.63
56	002203	海亮股份	16,926	195,495.30	0.57
57	300144	宋城演艺	12,600	193,410.00	0.57
58	600580	卧龙电驱	13,200	190,344.00	0.56
59	603568	伟明环保	5,600	186,872.00	0.55
60	002444	巨星科技	9,800	184,632.00	0.54
61	002617	露笑科技	16,100	182,413.00	0.54
62	002064	华峰化学	21,300	179,772.00	0.53
63	002430	杭氧股份	5,700	178,182.00	0.52
64	603218	日月股份	6,900	175,260.00	0.52
65	688777	中控技术	2,396	174,332.96	0.51
66	000739	普洛药业	8,415	173,685.60	0.51
67	002250	联化科技	10,514	172,114.18	0.51
68	600208	新潮中宝	61,800	170,568.00	0.50
69	603195	公牛集团	1,100	168,201.00	0.49
70	600596	新安股份	7,300	158,045.00	0.46
71	002389	航天彩虹	8,500	156,060.00	0.46
72	002472	双环传动	4,900	156,016.00	0.46
73	002019	亿帆医药	10,600	148,188.00	0.44
74	603129	春风动力	1,300	147,836.00	0.43
75	002266	浙富控股	30,800	147,532.00	0.43
76	603338	浙江鼎力	2,900	147,030.00	0.43
77	688298	东方生物	1,205	137,550.75	0.40
78	601018	宁波港	34,000	132,600.00	0.39
79	002532	天山铝业	20,000	130,600.00	0.38
80	603225	新凤鸣	11,000	126,940.00	0.37
81	002032	苏泊尔	2,240	126,201.60	0.37
82	688006	杭可科技	1,801	126,178.06	0.37
83	002010	传化智联	17,599	113,161.57	0.33
84	000559	万向钱潮	18,900	112,266.00	0.33
85	688023	安恒信息	676	99,818.16	0.29
86	600126	杭钢股份	19,400	99,328.00	0.29
87	688088	虹软科技	2,917	92,148.03	0.27
88	000967	盈峰环境	18,200	92,092.00	0.27
89	603583	捷昌驱动	2,700	90,153.00	0.27
90	603733	仙鹤股份	3,000	79,800.00	0.23
91	601567	三星医疗	5,600	74,368.00	0.22
92	002563	森马服饰	11,600	68,672.00	0.20
93	300894	火星人	1,700	63,563.00	0.19
94	603305	旭升股份	1,500	45,330.00	0.13

95	600032	浙江新能	2,900	42,485.00	0.12
96	603877	太平鸟	2,000	40,480.00	0.12
97	688819	天能股份	1,015	35,098.70	0.10
98	601921	浙版传媒	3,500	27,230.00	0.08
99	600927	永安期货	1,200	24,204.00	0.07
100	601528	瑞丰银行	2,300	18,538.00	0.05

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601089	福元医药	895	18,839.75	0.06
2	001268	联合精密	218	6,042.96	0.02
3	002124	天邦食品	20	134.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603799	华友钴业	318,980.00	0.82
2	605358	立昂微	231,366.00	0.60
3	688777	中控技术	194,188.62	0.50
4	300144	宋城演艺	160,783.00	0.41
5	600596	新安股份	149,316.80	0.38
6	002472	双环传动	127,196.00	0.33
7	601108	财通证券	119,826.00	0.31
8	601865	福莱特	116,644.00	0.30
9	603260	合盛硅业	108,178.00	0.28
10	600570	恒生电子	105,682.00	0.27
11	603806	福斯特	96,268.00	0.25
12	603456	九洲药业	88,580.00	0.23
13	601878	浙商证券	87,361.00	0.22
14	603816	顾家家居	85,402.00	0.22
15	601877	正泰电器	83,330.00	0.21
16	600460	士兰微	78,008.00	0.20
17	600926	杭州银行	77,140.00	0.20
18	002120	韵达股份	73,157.00	0.19
19	603290	斯达半导	72,405.00	0.19
20	600176	中国巨石	70,793.00	0.18

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688298	东方生物	380,882.32	0.98
2	300244	迪安诊断	302,923.00	0.78
3	600023	浙能电力	238,477.00	0.61
4	600699	均胜电子	189,221.00	0.49
5	603799	华友钴业	177,060.00	0.46
6	002131	利欧股份	175,521.00	0.45
7	002142	宁波银行	154,027.00	0.40
8	002124	天邦食品	131,555.00	0.34
9	600267	海正药业	130,809.00	0.34
10	600570	恒生电子	108,039.00	0.28
11	688023	安恒信息	107,030.52	0.28
12	603606	东方电缆	98,964.00	0.25
13	600926	杭州银行	89,997.00	0.23
14	601877	正泰电器	89,077.00	0.23
15	688005	容百科技	88,068.00	0.23
16	600460	士兰微	84,429.00	0.22
17	603806	福斯特	80,968.00	0.21
18	600176	中国巨石	80,645.00	0.21
19	605117	德业股份	80,285.00	0.21
20	600884	杉杉股份	76,792.00	0.20

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,458,253.16
卖出股票收入（成交）总额	4,658,376.51

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	56,504.71	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,504.71	0.17

7.6 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

金额单位：人民币元

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	113060	浙 22 转债	500	50,003.51	0.15
2	127064	杭氧转债	65	6,501.20	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除海康威视（证券代码 002415）、杭州银行（证券代码 600926）、宁波银行（证券代码 002142）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、海康威视（证券代码 002415）

根据 2021 年 10 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市雨花区税务局责令改正。

根据 2021 年 11 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市雨花区税务局责令改正。

2、杭州银行（证券代码 600926）

根据 2021 年 11 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家外汇管理局青田县支局处以罚款，警告，并责令改正。

根据 2022 年 1 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被舟山银保监分局处以罚款。

根据 2022 年 2 月 25 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳银保监局处以罚款。

根据 2022 年 5 月 31 日发布的相关公告，该证券发行人因违反反洗钱法被央行杭州中心支行处以罚款。

根据 2022 年 6 月 10 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被北京银保监局处以罚款，并责令改正。

3、宁波银行（证券代码 002142）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,632.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,632.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
312	102,688.10	24,761,483.00	77.29%	7,277,204.00	22.71%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	前海人寿保险股份有限公司-分红保 险产品华泰组合	20,002,700.00	62.43%
2	方正证券股份有限公司	2,427,573.00	7.58%
3	招商证券股份有限公司	2,331,210.00	7.28%
4	潘云江	800,615.00	2.50%
5	林丽真	800,054.00	2.50%
6	陈晓丹	500,087.00	1.56%
7	姚曼英	420,000.00	1.31%
8	甘宇阳	200,031.00	0.62%
9	黎平	200,015.00	0.62%
10	陈丽燕	200,000.00	0.62%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持 有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门 负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020 年 8 月 3 日)基金份额总额	246,038,687.00
本报告期期初基金份额总额	32,038,687.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	32,038,687.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金的议案》。会议投票表决起止时间：自 2022 年 4 月 18 日 0:00 起，至 2022 年 5 月 18 日 17:00 止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的本基金基金份额总数小于在权益登记日本基金基金份额总数的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件，故本次基金份额持有人大会召开失败。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	6,040,763.23	67.58%	1,397.47	67.58%	-
招商证券	3	2,897,576.58	32.42%	670.50	32.42%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	5,798.40	4.30%	-	-	-	-
招商证券	129,051.50	95.70%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露
----	------	--------	------

			日期
1	招商基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2022-01-21
3	招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
4	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
5	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-22
6	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2022-03-30
7	招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
8	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-18
9	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-19
10	招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-20
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2022-04-21
12	招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
13	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
14	关于招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-19
15	招商基金管理有限公司关于招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-20
16	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直	上海证券报、基金管	2022-06-09

	销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
17	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20220101-20220630	20,002,700.00	-	-	20,002,700.00	62.43%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资、买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出、卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日