浙商汇金中证浙江凤凰行动 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国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。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产（基金净值）变动表 19
6.4 报表附注 21
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47
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 47
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 47
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 48
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 48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 48
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 48
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.13 投资组合报告附注 48
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
8.3 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 50
§9 开放式基金份额变动 50
§10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
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 51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 51
10.8 其他重大事件 52
§11 影响投资者决策的其他重要信息 55
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 55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	浙商之江凤凰联接
基金主代码	007431
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年07月31日
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,356,659.40份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512190
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019-08-05
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-09-09
基金管理人名称	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF，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	本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金实现投资目标。本基金不参与目标ETF的投资管理。
业绩比较基准	中证浙江凤凰行动50指数收益率×95%+银行人民

	币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为中证浙江凤凰行动 50ETF 的联接基金，通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金的中高风险、中高预期收益的品种。

2.2.1 目标基金产品说明

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	本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证浙江凤凰行动50指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金的中高风险、中高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	浙江浙商证券资产管理有限	中国银行股份有限公司

		公司	
信息披露负责人	姓名	楼小平	许俊
	联系电话	0571-87903297	010-66596688
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95345	95566
传真		0571-87902581	010-66594942
注册地址		浙江省杭州市拱墅区天水巷25号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		310020	100818
法定代表人		盛建龙	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告备置地点	浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浙江浙商证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼

§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01月01日- 2022年06月30日）

本期已实现收益	1,905,412.20
本期利润	872,623.07
加权平均基金份额本期利润	0.0295
本期加权平均净值利润率	1.84%
本期基金份额净值增长率	0.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2022年06月30日）
期末可供分配利润	18,961,806.48
期末可供分配基金份额利润	0.6459
期末基金资产净值	48,560,711.85
期末基金份额净值	1.6542
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2022年06月30日）
基金份额累计净值增长率	65.42%

注：1、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。

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（不包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，为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	5.46%	0.80%	5.26%	0.86%	0.20%	-0.06%
过去三个月	2.82%	1.27%	1.59%	1.37%	1.23%	-0.10%
过去六个月	0.21%	1.30%	-1.05%	1.38%	1.26%	-0.08%
过去一年	3.33%	1.17%	1.98%	1.25%	1.35%	-0.08%

自基金合同生效起至今	65.42%	1.22%	62.26%	1.30%	3.16%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中证浙江凤凰行动50指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。中证浙江凤凰行动50指数由中证指数有限公司编制，由浙江省上市公司中盈利增速高、股息率高且市盈率低的50只股票组成，以反映浙江省内高分红和高成长的上市公司整体表现。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按95%、5%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效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

§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

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券股

份有限公司出资12亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2022年06月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金、浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式基金、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金(FOF)、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金、浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金、浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金、浙商汇金先进制造混合型证券投资基金、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)、浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金、浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金。

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		
马斌博	浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)、浙商汇金先进制造混合型基金及浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金的基金	2019-07-31	2022-02-16	10年	中国国籍，硕士，曾任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司研究员；浙江浙商证券资产管理有限公司研究部研究员、公募基金部基金经理助理、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式

	经理				指数基金及浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；现任浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型基金(LOF)、浙商汇金先进制造混合型基金及浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
周文超	本基金基金经理；浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金的基金经理	2021-04-26	-	12年	中国国籍，硕士，曾任东方证券股份有限公司量化研究员、套利交易员，国泰基金管理有限公司金融衍生品交易员，浙商证券股份有限公司投资经理；现任浙商资管公募权益投资部高级业务副总监；现任浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金及浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
叶方强	本基金基金经理助理；浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙商汇金量化臻选股票型基金的基金经理助理	2021-03-16	-	6年	中国国籍，硕士，曾任浙商证券股份有限公司证券投资交易员，现任浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金、浙

					商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金及浙商汇金量化臻选股票型基金的基金经理助理。
邸明轩	本基金基金经理；浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金的基金经理	2022-03-03	-	5年	中国国籍，硕士，曾任上海海通证券资产管理有限公司投资经理助理；浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理助理；现任浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金及浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数基金联接基金的基金经理。拥有基金从业资格及证券从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其"任职日期"按基金合同生效日填写。证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

本报告期末，本基金基金经理未存在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遵规守信情况的说明

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》、其他相关法律法规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，确保基金资产的安全并以基金资产长期稳定的增长为目标，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 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司

严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

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

本基金为浙商之江凤凰ETF （512190）的联接基金，跟踪的标的指数为中证浙江凤凰行动50指数，该指数选取50家浙江本土的优质、龙头上市公司，以反映和跟踪浙江本土优质企业成长发展状况。本基金通过主要投资于目标ETF的方式，实现对指数跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。报告期内，本基金整体运行稳定，交易和申购赎回正常。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商之江凤凰联接基金份额净值为1.6542元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.21%，同期业绩比较基准收益率为-1.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年市场先后偏好周期、新能源、低估值等风格，受益于低估值选股策略和行业较全面布局，凤凰50指数在过去一年获得了平稳较好收益。展望2022年，在出口增速放缓、房地产投资回落、消费暂未出现明显修复的大背景下，经济下行压力显著增加。面对内外部环境的复杂严峻和不确定性，12月的中央经济工作会议明确指出，2022年经济工作要"稳字当头，稳中求进"。

2022年开年，市场出现较大幅度回调，也在反映对于经济不确定性前景的担忧。但是，我们认为随着"稳增长"政策逐步落地，中国经济将继续展现足够的韧性，企业盈利会出现分化但整体有望平稳。与此同时，高质量发展赛道经历了年初大幅调整后，估值回归更合理水平。面对当前的经济和市场环境，估值性价比仍然是重要的考量因素，因此立足PEG选股思维，坚持兼顾价值与成长的选股策略，构建平衡且分散化的投资组合，仍将是稳妥的投资策略。

投资操作上，本基金将继续严格遵守基金合同，采取跟踪偏离最小化的被动投资策略，为基金投资人谋求与业绩比较基准基本一致的投资回报，并通过严格的风险管理，确保本基金安全稳定运作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运行情况，本基金在本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于2022年01月01日至2022年04月12日持续出现基金净值低于5000万的情形，公司已向中国证监会报告并推进相关应对方案。

§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，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,719,499.02	2,497,052.66
结算备付金		30,159.87	140.73
存出保证金		11,961.00	6,162.01
交易性金融资产	6.4.7.2	45,583,521.30	35,216,446.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		45,583,521.30	35,216,446.44
债券投资		-	-
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		56,690.44	-
应收股利		-	-
应收申购款		264,073.84	4,096.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	584.94
资产总计		49,665,905.47	37,724,483.50
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年06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		-	-
应付赎回款		851,090.19	183,425.72
应付管理人报酬		1,352.27	953.22
应付托管费		270.45	190.63
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		200,463.81	217,403.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	52,016.90	93,709.58
负债合计		1,105,193.62	495,682.67
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,356,659.40	22,552,392.91
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	19,204,052.45	14,676,407.92

净资产合计		48,560,711.85	37,228,800.83
负债和净资产总计		49,665,905.47	37,724,483.50

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.6542元，基金份额总额29,356,659.40份。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
一、营业总收入		935,355.85	4,737,954.56
1.利息收入		13,718.64	8,984.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,718.64	8,984.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,745,408.23	5,722,588.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,668.79	-19,955.62
基金投资收益	6.4.7.11	1,736,739.44	5,742,544.17
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-

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）	6.4.7.17	-1,032,789.13	-1,130,854.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	209,018.11	137,236.10
减：二、营业总支出		62,732.78	102,323.59
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	8,026.27	4,773.61
2．托管费	6.4.10.2.2	1,605.23	954.68
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		-	-
7．税金及附加		6,252.56	20,673.16
8．其他费用	6.4.7.19	46,848.72	75,922.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		872,623.07	4,635,630.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		872,623.07	4,635,630.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		872,623.07	4,635,630.97

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06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）	22,552,392.91	-	14,676,407.92	37,228,800.83
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）	22,552,392.91	-	14,676,407.92	37,228,800.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,804,266.49	-	4,527,644.53	11,331,911.02
（一）、综合收益总额	-	-	872,623.07	872,623.07
（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）	6,804,266.49	-	3,655,021.46	10,459,287.95
其中：1.基金申购款	30,772,573.29	-	17,340,075.04	48,112,648.33
2.基金赎回款	-23,968,306.80	-	-13,685,053.58	-37,653,360.38
（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）	29,356,659.40	-	19,204,052.45	48,560,711.85
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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）	32,936,166.44	-	12,002,425.86	44,938,592.30
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）	32,936,166.44	-	12,002,425.86	44,938,592.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,232,844.09	-	-161,935.70	-13,394,779.79
（一）、综合收益总额	-	-	4,635,630.97	4,635,630.97
（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）	-13,232,844.09	-	-4,797,566.67	-18,030,410.76
其中：1.基金申购款	12,483,005.05	-	5,966,735.75	18,449,740.80
2.基金赎回款	-25,715,849.14	-	-10,764,302.42	-36,480,151.56
（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）	19,703,322.35	-	11,840,490.16	31,543,812.51

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:

盛建龙	盛建龙	高存
————————	————————	————————
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

浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可[2019]350号《关于准予浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》确认，由浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称"浙商资产管理公司"）作为管理人，中国银行股份有限公司（以下简称"中国银行"）作为托管人，于2019年7月30日募集设立。浙商证券股份有限公司（以下简称"浙商股份"）是发售代理机构之一。本基金的募集期间为2019年7月10日至2019年07月26日止，本基金类型为股票型证券投资基金、联接基金，基金的运作方式为契约型开放式，存续期为不定期。

根据《浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》约定，本基金的推广对象为：个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。每份基金资产面值为人民币1.00元。截至2019 年7月30日止，该基金的银行托管专户已收到首次发售募集扣除认购费后的有效认购资金人民币398,408,658.56元，孳生利息人民币39,635.67元，共计人民币398,448,294.23元，上述有效认购资金及挚生利息共折合398,448,294.23份该基金份额。设立募集资金已经毕马威华振（特殊普通合伙）验资，并出具毕马威华振验字第1900398号验资报告。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同的规定而编制。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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2022年01月01日至2022年6月30日的经营成果和基金资产净值变动情况。

6.4.4 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相一致的说明

除6.4.5.1列示的会计政策变更内容外，本基金在本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

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，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,497,052.66元，自应收利息转入的重分类金额为人民币581.75元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2497634.41元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币140.73元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.11元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币140.84元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币6,162.01元，自应收利息转入的重分类金额为人民币3.08元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币6165.09元。

应收申购款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币4,096.72元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币4,096.72元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币584.94元，转出至银行存款的重分类金额为人民币581.75元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币0.11元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币3.08元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币35,216,446.44元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，

交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币35,216,446.44元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元，自应付利息转入的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元。

应付赎回款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币183,425.72元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币183,425.72元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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06月30日
活期存款	3,719,499.02
等于：本金	3,718,754.46
加：应计利息	744.56
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	3,719,499.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		40,273,264.62	-	45,583,521.30	5,310,256.68
其他		-	-	-	-
合计		40,273,264.62	-	45,583,521.30	5,310,256.68

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

本基金于本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金于本报告期末，未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,464.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,681.16
其中：交易所市场	4,681.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	45,870.83
合计	52,016.90

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,552,392.91	22,552,392.91
本期申购	30,772,573.29	30,772,573.29
本期赎回（以“-”号填列）	-23,968,306.80	-23,968,306.80

本期末	29,356,659.40	29,356,659.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

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	13,293,149.22	1,383,258.70	14,676,407.92
本期利润	1,905,412.20	-1,032,789.13	872,623.07
本期基金份额交易产生的变动数	3,763,245.06	-108,223.60	3,655,021.46
其中：基金申购款	18,434,220.97	-1,094,145.93	17,340,075.04
基金赎回款	-14,670,975.91	985,922.33	-13,685,053.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,961,806.48	242,245.97	19,204,052.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	13,233.89
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	419.00
其他	65.75
合计	13,718.64

注：其他为结算保证金应收利息。

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01月01日至2022年06月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-42,941.95
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	51,610.74
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,668.79

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01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	14,841,374.08
减：卖出股票成本总额	14,829,797.00
减：交易费用	54,519.03
买卖股票差价收入	-42,941.95

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
申购基金份额总额	35,366,940.00
减：现金支付申购款总额	12,166,647.78
减：申购股票成本总额	23,148,681.48
减：交易费用	-
申购差价收入	51,610.74

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	25,741,236.37
减：卖出/赎回基金成本总额	23,952,308.20
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	52,104.72

减：交易费用	84.01
基金投资收益	1,736,739.44

6.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期未进行债券投资。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未进行权证投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1.交易性金融资产	-1,067,616.23
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,067,616.23
——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	-34,827.10
合计	-1,032,789.13

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	208,980.81
转换费收入	37.30
合计	209,018.11

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	21,075.64
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	977.89
合计	46,848.72

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

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金未发生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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构

注：本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化，以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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
浙商证券股份有限公司	37,983,835.56	100.00%	16,111,423.76	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	2,098,580.00	100.00%	1,831,772.98	100.00%

注：基金交易指二级市场买卖基金，不包含认购、申购及赎回基金。

6.4.10.1.6 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01月01日至2022年06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
浙商证券股份有限公司	35,374.88	100.00%	4,681.16	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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
浙商证券股份有限	15,004.97	100.00%	395.99	100.00%

公司				

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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的证券投资研究成果和市场信息服务。

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01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,026.27	4,773.61
其中：支付销售机构的客户维护费	57,838.86	36,665.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产净值－本基金持有的目标ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,605.23	954.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产

净值－本基金持有的目标ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内，未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间内，未发生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未持有本基金。

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

本报告期末及上年度末未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金情况。

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01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限	3,719,499.02	13,233.89	2,957,985.78	8,813.87

公司				

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2022年6月30日，本基金持有25,468,500.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为86.76%。于2021年12月31日，本基金持有19,667,400.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为87.21%。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况，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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险和其他价格风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

公司目前的组织架构体系主要有五个层次：一是董事会及专门委员会的风险管理战略性安排，以及监事的监督检查；二是经理层、经理层下设业务委员会的风险管理决策；三是风险管理部门的风控制衡；四是业务部门及业务立项委员会、产品设计委员会的直接管理；五是合规风控专员在业务部门内部的风控制衡。各风险管理层级按照公司《全面风险管理办法》要求在各自职责范围内履行风险管理职责。业务部门、风险管理部门、审计稽核部门共同构成了风险管理三道防线，实施事前、事中与事后的风险防范、监控与评价工作。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在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，以控制相应的信用风险。

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均未持有债券。

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均未持有资产支持证券。

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均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长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均未持有债券。

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均未持有资产支持证券。

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均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末2022年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	3,719,499.02	-	-	-	-	3,719,499.02
结算备付金	30,159.87	-	-	-	-	30,159.87
存出保证金	11,961.00	-	-	-	-	11,961.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,761,619.89	0.00	0.00	0.00	0.00	3,761,619.89
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净	3,761,61	0.00	0.00	0.00	0.00	3,761,619.8

额	9.89					9
上年度末2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	2,497,052.66	-	-	-	-	2,497,052.66
结算备付金	140.73	-	-	-	-	140.73
存出保证金	6,162.01	-	-	-	-	6,162.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,503,355.40	0.00	0.00	0.00	0.00	2,503,355.40
负债	-	-	-	-	-	
负债总计	-	-	-	-	-	-
流动性净额	2,503,355.40	0.00	0.00	0.00	0.00	2,503,355.40

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,719,499.02	-	-	-	-	-	3,719,499.02
结算备付金	30,159.87	-	-	-	-	-	30,159.87
存出保证金	11,961.00	-	-	-	-	-	11,961.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,583,521.30	45,583,521.30
应收清算款	-	-	-	-	-	56,690.44	56,690.44
应收申购款	-	-	-	-	-	264,073.84	264,073.84
资产总计	3,761,619.89	-	-	-	-	45,904,285.58	49,665,905.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	851,090.19	851,090.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,352.27	1,352.27
应付托管费	-	-	-	-	-	270.45	270.45
应交税费	-	-	-	-	-	200,463.81	200,463.81
其他负债	-	-	-	-	-	52,016.90	52,016.90
负债总计	-	-	-	-	-	1,105,193.62	1,105,193.62
利率敏感度缺口	3,761,619.89	-	-	-	-	44,799,091.96	48,560,711.85
上年度末 2021 年	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

12 月 31 日							
资产							
银行存款	2,497,052.66	-	-	-	-	-	2,497,052.66
结算备付金	140.73	-	-	-	-	-	140.73
存出保证金	6,162.01	-	-	-	-	-	6,162.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	35,216,446.44	35,216,446.44
应收利息	-	-	-	-	-	584.94	584.94
应收申购款	-	-	-	-	-	4,096.72	4,096.72
资产总计	2,503,355.40	-	-	-	-	35,221,128.10	37,724,483.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	183,425.72	183,425.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	953.22	953.22
应付托管费	-	-	-	-	-	190.63	190.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	767.42	767.42
应交税费	-	-	-	-	-	217,403.52	217,403.52
其他负债	-	-	-	-	-	92,942.16	92,942.16
负债总计	-	-	-	-	-	495,682.67	495,682.67
利率敏感度缺口	2,503,355.40	-	-	-	-	34,725,445.43	37,228,800.83

注：上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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末本基金均未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金的其他市场价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06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	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	45,583,521.30	93.87	35,216,446.44	94.59
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	45,583,521.30	93.87	35,216,446.44	94.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1、中证浙江凤凰行动50指数上涨5%	2,271,228.48	1,737,065.62
	2、中证浙江凤凰行动50指数下跌5%	-2,271,228.48	-1,737,065.62

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%		
	观察期为180天		
分析	风险价值	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	风险价值	-1,009,903.79	-626,010.31
	合计	-1,009,903.79	-626,010.31

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。

常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末

	2022年06月30日	2021年12月31日
第一层次	45,583,521.30	35,216,446.44
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	45,583,521.30	35,216,446.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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货币资金、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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	45,583,521.30	91.78
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	3,749,658.89	7.55
8	其他各项资产	332,725.28	0.67
9	合计	49,665,905.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

7.2.2 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投资组合。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	600926	杭州银行	3,797,943.00	10.20
2	600460	士兰微	2,580,496.00	6.93
3	600352	浙江龙盛	2,403,655.00	6.46
4	601916	浙商银行	2,372,955.00	6.37
5	600177	雅戈尔	1,617,679.24	4.35
6	688298	东方生物	1,441,610.24	3.87

7	600596	新安股份	1,381,401.00	3.71
8	600704	物产中大	1,374,173.00	3.69
9	600415	小商品城	1,189,675.00	3.20
10	600273	嘉化能源	870,690.00	2.34
11	601018	宁波港	806,518.00	2.17
12	603225	新凤鸣	717,664.00	1.93
13	600126	杭钢股份	609,648.00	1.64
14	603298	杭叉集团	429,945.00	1.15
15	603897	长城科技	241,336.00	0.65
16	601339	百隆东方	240,995.00	0.65
17	603889	新澳股份	161,040.00	0.43
18	605377	华旺科技	137,459.00	0.37
19	603908	牧高笛	132,106.00	0.35
20	603277	银都股份	108,708.00	0.29

注：1、表中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、表中"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	600926	杭州银行	2,398,087.00	6.44
2	601916	浙商银行	1,589,065.00	4.27
3	600460	士兰微	1,444,202.00	3.88
4	600352	浙江龙盛	1,239,992.75	3.33
5	600177	雅戈尔	1,122,580.00	3.02
6	600596	新安股份	1,012,111.00	2.72
7	600704	物产中大	902,864.00	2.43
8	688298	东方生物	755,477.75	2.03
9	600415	小商品城	653,858.00	1.76

10	600273	嘉化能源	610,719.00	1.64
11	601018	宁波港	537,665.00	1.44
12	600126	杭钢股份	390,031.00	1.05
13	603225	新凤鸣	365,201.00	0.98
14	603298	杭叉集团	225,552.00	0.61
15	600160	巨化股份	206,769.00	0.56
16	601339	百隆东方	151,177.00	0.41
17	603908	牧高笛	132,031.00	0.35
18	603897	长城科技	114,533.00	0.31
19	603889	新澳股份	112,005.00	0.30
20	605377	华旺科技	99,388.00	0.27

注：1、表中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、表中"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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,142,461.48
卖出股票收入（成交）总额	14,841,374.08

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、表中"买入股票成本"或"卖出股票收入"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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期未进行贵金属投资。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	之江凤凰	ETF基金	交易型开放式	浙江浙商证券资产管理有限公司	45,583,521.30	93.87

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12.2 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期收到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.13.2 本基金及目标基金投资的前十名证券中，没有超出基金合同规定的备选证券库之外的证券。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,961.00
2	应收清算款	56,690.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	264,073.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	332,725.28

7.13.4 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可转债。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
2,085	14,079.93	94,609.93	0.32%	29,262,049.47	99.68%

8.2 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	507,777.55	1.7297%

8.3 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

注：

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金；

2、本基金的基金经理本报告期末未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年07月31日)基金份额总额	398,448,294.23
本报告期期初基金份额总额	22,552,392.91
本报告期基金总申购份额	30,772,573.29
减：本报告期基金总赎回份额	23,968,306.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,356,659.40

注:总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期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

报告期内，本基金及目标基金均无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金及目标基金基金投资策略均无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

报告期内基金管理人、托管人的业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

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	
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	37,983,835.56	100.00%	35,374.88	100.00%	-

注：a)截至报告期末，本公司已在上海交易所、深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，本基金交易单元无变更。

b)本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分

析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c)基金交易单元的选择程序如下：

1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	2,098,580.00	100.00%

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	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-07
2	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金2021年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-12
4	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与	中国证监会规定媒介	2022-02-12

	南京苏宁基金销售有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告		
5	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金减聘基金经理公告	中国证监会规定媒介	2022-02-17
6	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-02-18
7	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数型证券投资基金联接基金招募说明书（更新）(2022年第1次重大事项临时更新）	中国证监会规定媒介	2022-02-18
8	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数型证券投资基金联接基金招募说明书（更新）(2022年第2次重大事项临时更新）	中国证监会规定媒介	2022-03-04
9	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金增聘基金经理公告	中国证监会规定媒介	2022-03-04
10	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-03-04
11	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-22

12	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-25
13	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳众禄基金销售股份有限公司费率优惠活动和开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-29
14	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
15	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与上海利得基金销售有限公司费率优惠活动、定期定额投资业务和转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-07
16	浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金2022年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
17	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台费率优惠活动和开通定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2022-05-07
18	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券股份有限公司费率优惠活动和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
19	浙江浙商证券资产管理有限	中国证监会规定媒介	2022-06-10

	公司关于旗下部分基金参与众惠基金销售有限公司开通定期定额投资业务公告		
20	浙江浙商证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京肯特瑞基金销售有限公司申购起点金额及最低持有数量限制的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
21	浙江浙商证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司申购起点金额及最低持有数量限制的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21

§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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022年8月，浙江浙商证券资产管理有限公司的合规总监和首席风险官由方斌先生变更为杨锴先生，上述人事变动已按照相关法律法规的规定进行备案和公告。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准设立浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；

《浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

《浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

报告期内在规定媒介上披露的各项公告；

基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人住所及托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.stocke.com.cn。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇二二年八月三十日