

汇泉臻心致远混合型证券投资基金
2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2022 年 07 月 21 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 12 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇泉臻心致远混合	
基金主代码	013051	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 02 日	
报告期末基金份额总额	591,450,214.49 份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、参与融资业务的投资策略	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会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	汇泉基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
下属分级基金的交易代码	013051	013052
报告期末下属分级基金的份额总额	349,129,012.04 份	242,321,202.45 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
1. 本期已实现收益	-35,833,221.68	-25,423,343.94
2. 本期利润	12,128,412.55	7,961,527.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0345	0.0321
4. 期末基金资产净值	289,938,278.99	200,707,996.45
5. 期末基金份额净值	0.8305	0.8283

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。

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

汇泉臻心致远混合 A

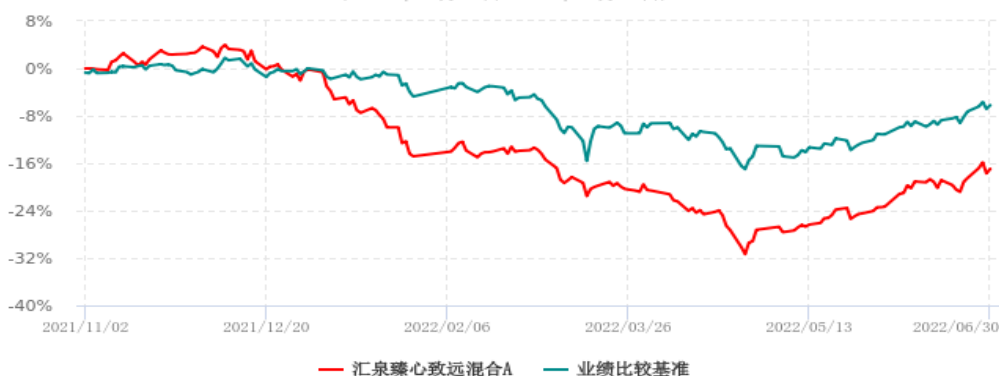
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.49%	1.33%	4.17%	1.04%	0.32%	0.29%
过去六个月	-16.83%	1.23%	-6.21%	1.12%	-10.62%	0.11%
自基金合同 生效起至今	-16.95%	1.14%	-6.20%	1.00%	-10.75%	0.14%

汇泉臻心致远混合 C

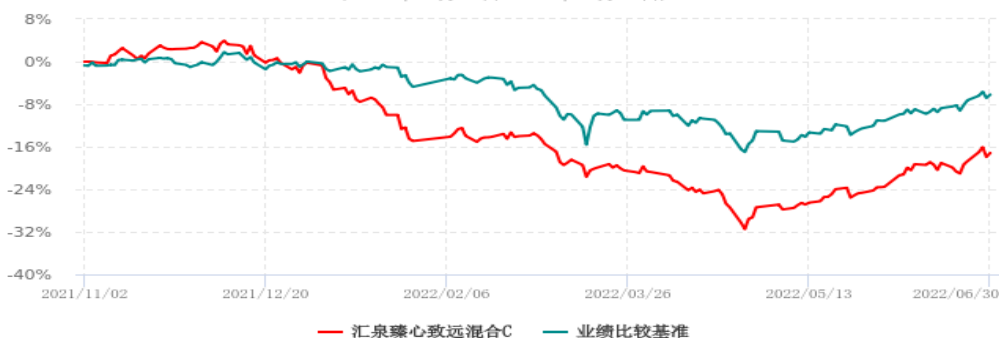
阶段	净值增 长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.39%	1.33%	4.17%	1.04%	0.22%	0.29%
过去六个月	-16.99%	1.23%	-6.21%	1.12%	-10.78%	0.11%
自基金合同 生效起至今	-17.17%	1.14%	-6.20%	1.00%	-10.97%	0.14%

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

汇泉臻心致远混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年11月02日-2022年06月30日)



汇泉臻心致远混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年11月02日-2022年06月30日)



注：1、本基金合同于 2021 年 11 月 2 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合约定。

§ 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		
梁永强	本基金的基金 经理、公司 总经理	2021- 11-02	-	20 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理、公司总经理。现任汇泉基金管理有限公司总经理、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《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》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

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度初，国内需求持续偏弱，叠加国内部分地区疫情变化和海外俄乌战争的影响，市场风险偏好快速下降，整体市场也大幅下跌到 4 月底。在国内疫情及相关政策有了好转和政府大量的刺激政策支持下，市场从 4 月底开始恢复性上涨，目前为止还在这个恢复性上涨的过程中。有鉴于市场发生的剧烈变化，本基金整体上对组合的仓位操作偏保守一些，组合的集中度也保持适度均衡，希望能够在控制总体风险的情况下提高组合的有效度和灵活度。

虽然短期经济比较疲软，市场也经历了较大的波动，但中国经济发展的长期确定性依然存在，上一轮全球信息产业革命中国和美国都是最大的受益者，而新一轮能源产业变革中国在产业格局中也占据了非常好的位置，这也根本上决定了未来中国资产在全球格局中持续扩大的趋势，另外目前 A 股的估值也处于合理区间，可以判断 A 股依然处于长期底部区间，短期可能会经历调整，但未来上升空间还比较大。从中国发展的内外部环境来看，中美之间长期竞争，中国自身经济发展进入中低速阶段，因此存量资源的优化配置和效率提升将成为长期重点，这个过程中社会资源将主要向科技和创新方向倾斜，因此本基金将长期在新科技、大数据、新能源、新消费和大金融等五大方向上进行布局，阶段性根据市场情况加入其他板块进行组合的平衡，报告期组合的配置方向主要包括新能源设备、军工、农化及基础化工品、

新材料、消费、资源品等方向。

展望三季度,美国加息和俄乌战争的边际影响逐步递减,国内疫情及相关政策也在优化,政府稳增长政策的落地也逐步展开,因此市场的大环境持续改善,市场情绪和定价也回到正常状态,市场经历过上半年的剧烈波动以后,三季度区间震荡的概率比较大,因此本基金将保持中等仓位,重点放在配置行业和个股的持续优化上。

疫情的反复虽然对很多产业造成了影响,但基于微观企业来看,过程中应对得当的企业在疫情后都获得了更大的发展空间,这也是后续投资过程中需要重点去研究的目标。从国家政策方向、行业景气以及估值水平这几个角度出发,下阶段本基金重点配置的方向主要包括以下几个:(1)新能源方向,包括新能源车电池和上游材料,光伏上游材料、组件、逆变器等;(2)化工、新能源金属、煤炭等资源品,由于长期行业低迷、环保要求,煤炭、新能源金属、磷化工等品种的资本开支长期偏低,加之俄乌冲突激化供给短缺,资源品供给不足的问题很难在 2、3 年内得到缓解,这些方向可能长期保持高景气;(3)军工,军工板块相对周期性比较小,行业中优质公司在未来几年的订单比较确定,目前投资的性价比是比较好的;(4)消费医药,主要包括景气度持续的白酒、创新药和医疗设备、眼科口腔等医疗服务公司;(5)券商,打造强大的资本市场是中共中央和国务院的战略决策,券商的战略地位是很重要的,长期空间也比较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 类基金份额净值为 0.8305 元,本报告期份额净值增长率为 4.49%,同期业绩比较基准收益率为 4.17%。C 类基金份额净值为 0.8283 元,本报告期份额净值增长率为 4.39%,同期业绩比较基准收益率为 4.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	388,089,649.80	78.73
	其中:股票	388,089,649.80	78.73
2	基金投资	-	-
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	54,000,540.00	10.95
	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	20,728,366.46	4.21
8	其他资产	30,117,281.73	6.11
9	合计	492,935,837.99	100.00

注：根据财政部发布的《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》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 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》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则及相关新规定，各金融资产已包含对应的应计利息。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则的执行对本基金的财务状况和经营成果未产生重大影响。

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 13,265,707.28 元，占净值比例 2.70%。

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	41,297,320.00	8.42
C	制造业	288,555,790.52	58.81
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	35,201,332.00	7.17
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	5,722,500.00	1.17
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	4,047,000.00	0.82
	合计	374,823,942.52	76.39

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（人民币元）	占基金资产净值比（%）
非日常生活消费品	9,964,673.88	2.03
金融	3,301,033.40	0.67
合计	13,265,707.28	2.70

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 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	002466	天齐锂业	175,000	21,840,000.00	4.45
2	002460	赣锋锂业	110,000	16,357,000.00	3.33
3	601066	中信建投	500,000	14,455,000.00	2.95
4	600862	中航高科	499,915	14,047,611.50	2.86
5	601101	昊华能源	1,340,000	13,802,000.00	2.81
6	600096	云天化	400,000	12,592,000.00	2.57
7	300769	德方纳米	28,000	11,443,040.00	2.33
8	000858	五粮液	50,000	10,096,500.00	2.06
9	03690	美团-W	60,000	9,964,673.88	2.03
10	600309	万华化学	100,000	9,699,000.00	1.98

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

除北京昊华能源股份有限公司、美团外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

本基金投资北京昊华能源股份有限公司、美团的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,914,278.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	203,003.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,117,281.73

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
报告期期初基金份额总额	356,985,395.06	255,867,894.56
报告期期间基金总申购份额	1,282,818.40	5,221,228.95
减：报告期期间基金总赎回份额	9,139,201.42	18,767,921.06
报告期期末基金份额总额	349,129,012.04	242,321,202.45

§ 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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇泉臻心致远混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司
二〇二二年七月二十一日