
汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业证券股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月18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2024年4月1日起至2024年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上证券商
场内简称	上证券商
基金主代码	510200
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月09日
报告期末基金份额总额	76,885,548.00份
投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，力求实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金投资策略主要包括： 1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、资产支持证券的投资策略 4、衍生品投资策略 5、融资及转融通证券出借 6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	本基金的标的指数为上证证券行业指数，业绩比较基准为上证证券行业指数收益率。

风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业证券股份有限公司

§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（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	-1,678,159.60
2.本期利润	-5,151,547.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0714
4.期末基金资产净值	71,775,911.80
5.期末基金份额净值	0.9335

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

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	-7.06%	1.35%	-7.51%	1.39%	0.45%	-0.04%
过去六个月	-11.10%	1.42%	-11.63%	1.46%	0.53%	-0.04%
过去一年	-7.08%	1.43%	-8.50%	1.47%	1.42%	-0.04%
过去三年	-21.42%	1.42%	-29.34%	1.48%	7.92%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-6.65%	1.55%	-26.80%	1.62%	20.15%	-0.07%

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



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
陈思余	策略量化组基金经理、本基金的基金经理	2023-10-25	-	6年	陈思余先生，南开大学信息安全与法学双学位学士，6年证券、基金行业从业经验。历任天源迪科信息技术股份有限公司计费产品一部JAVA开发工程师。2017年4月加入汇安基金管理有限责任公司，担任策略量化组基金经理。2023年10月25日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023年1

				0月25日至今，任富时中国A 50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023年10月25日至今，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

本报告期末本基金的基金经理无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、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

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，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在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成交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

2024年二季度以来国民经济总体稳定，但仍然存在一定的结构性矛盾，经济形势依然处在恢复期。

虽然广义财政收支均下滑，国有土地使用权出让收入下降明显，二季度经济略显压力，但是随着全国地产优化政策持续起效，地产行业逐步复苏。伴随暑期旅游临近，相关产业与消费预期将有所回升，后期累积效应将不断显现，也将加快经济的复苏。

物价方面，CPI在猪肉价格的带动下缓步上行；PPI跌幅或相对收窄，国际油价振荡调整。财新PMI指数2024年6月数据为51.8，连续8个月高于枯荣线，显示制造业生产经营活动扩张在加速。但是其中新出口订单指数增速跌至6个月新低，体现海外市场持续承压。汇率方面人民币走弱，如下半年美联储降息，出口缺口补齐等利好因素下，汇率有望相对提升，利好进口相关企业。

市场风险方面，强监管的趋势下，防范风险的意识不断加强，风险逐步出清，为市场的价值修复提供了更多的助力。在资本市场新“国九条”的指引下，中小金融机构合并重组开始加速，为市场提供服务的金融机构逐步朝着高质量的方向发展，有望吸引更多的外部资金流入。

随着佣金改革而来券商利润下降预期逐步落地，强监管之下券商营收面临更多的结构调整，券商行业风险逐步出清，市场关于“加快建设一流投资银行”的期待持续发酵，科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融为券商指引了未来的发力方向。

2024年二季度沪深300指数跌幅2.14%，上证券商指数跌幅7.51%

本基金管理人将继续坚持基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，力求让投资者分享证券行业的长期增长红利。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上证券商基金份额净值为0.9335元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.06%，同期业绩比较基准收益率为-7.51%。

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，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	69,489,514.11	96.62
	其中：股票	69,489,514.11	96.62
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	-	-
	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	2,153,978.85	2.99
8	其他资产	277,906.82	0.39
9	合计	71,921,399.78	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（指数投资）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	-	-
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	69,463,690.87	96.78
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	69,463,690.87	96.78

5.2.2 报告期末（积极投资）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	18,667.67	0.03
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	5,767.05	0.01
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	1,388.52	0.00
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	25,823.24	0.04

5.2.3 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股票。

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 报告期末指数投资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	600030	中信证券	588,297	10,724,654.31	14.94
2	600837	海通证券	715,000	6,120,400.00	8.53
3	601688	华泰证券	380,200	4,710,678.00	6.56
4	601211	国泰君安	336,325	4,557,203.75	6.35
5	600999	招商证券	274,890	3,823,719.90	5.33
6	600958	东方证券	379,472	2,883,987.20	4.02
7	601901	方正证券	364,000	2,813,720.00	3.92
8	601377	兴业证券	501,480	2,537,488.80	3.54
9	601788	光大证券	148,800	2,175,456.00	3.03
10	601995	中金公司	66,251	1,961,692.11	2.73

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603285	键邦股份	354	6,602.10	0.01
2	688691	灿芯股份	80	3,400.80	0.00
3	688530	欧莱新材	181	2,914.10	0.00
4	688709	成都华微	129	2,423.91	0.00
5	688695	中创股份	75	2,366.25	0.00

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 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调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的中信证券、海通证券、华泰证券、国泰君安、招商证券、方正证券、光大证券、中金公司在编制日前一年内受到过监管部门处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的其余前十大持有证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 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	6,111.68
2	应收证券清算款	271,795.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	277,906.82

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	6,602.10	0.01	新股未上市
2	688691	灿芯股份	3,400.80	0.00	科创板打新限售
3	688530	欧莱新材	2,914.10	0.00	科创板打新限售
4	688709	成都华微	2,423.91	0.00	科创板打新限售
5	688695	中创股份	2,366.25	0.00	科创板打新限售

5.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	66,885,548.00
报告期期间基金总申购份额	24,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	14,500,000.00
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	76,885,548.00

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2024年07月19日