

# 汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
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.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	59
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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的情况.....	61
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	65
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</b>
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.....	66

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>67</b>
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安沪深 300 增强	
基金主代码	003884	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 3 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	300,917,144.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码:	003884	003885
报告期末下属分级基金的份额总额	99,065,570.32 份	201,851,573.98 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在严格控制对沪深 300 指数跟踪误差的基础上,通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越沪深 300 指数的投资收益和基金财产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金,在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、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、权证投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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,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	汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青
	联系电话	01056711600
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn
客户服务电话	01056711690	95528
传真	01056711640	021-63602540
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址	北京市东城区东直门南大	上海市北京东路 689 号

	街 5 号中青旅大厦 13 层； 上海市虹口区东大名路 501 号白玉兰大厦 36 层	
邮政编码	100007	200001
法定代表人	刘强	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路 501 号上海 白玉兰广场 36 层 02 单元

### § 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

基金级别	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,233,122.37	22,563,659.19
本期利润	12,134,615.41	20,578,410.65
加权平均基金份额本期利润	0.1269	0.1090
本期加权平均净值利润率	6.49%	6.03%
本期基金份额净值增长率	6.53%	6.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	62,232,704.69	101,190,928.45
期末可供分配基金份额利润	0.6282	0.5013
期末基金资产净值	199,332,601.65	375,295,639.80
期末基金份额净值	2.0121	1.8593
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	95.56%	92.47%

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、对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

#### 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

汇安沪深 300 增强 A

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	-0.50%	0.80%	-1.91%	0.76%	1.41%	0.04%
过去三个月	7.69%	0.98%	3.32%	0.93%	4.37%	0.05%
过去六个月	6.53%	1.41%	0.29%	1.25%	6.24%	0.16%
过去一年	34.63%	1.36%	24.19%	1.27%	10.44%	0.09%
自基金合同生效起至今	95.56%	1.25%	50.62%	1.29%	44.94%	-0.04%

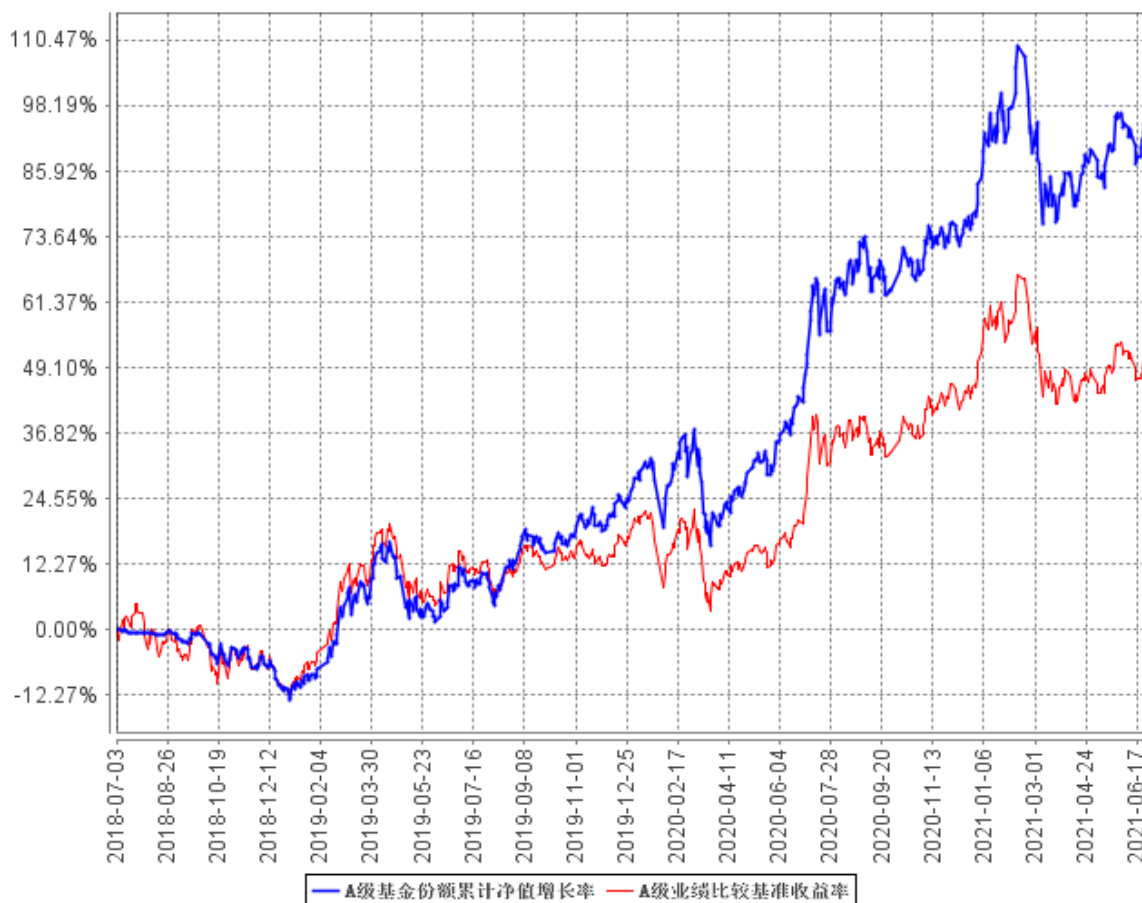


汇安沪深 300 增强 C

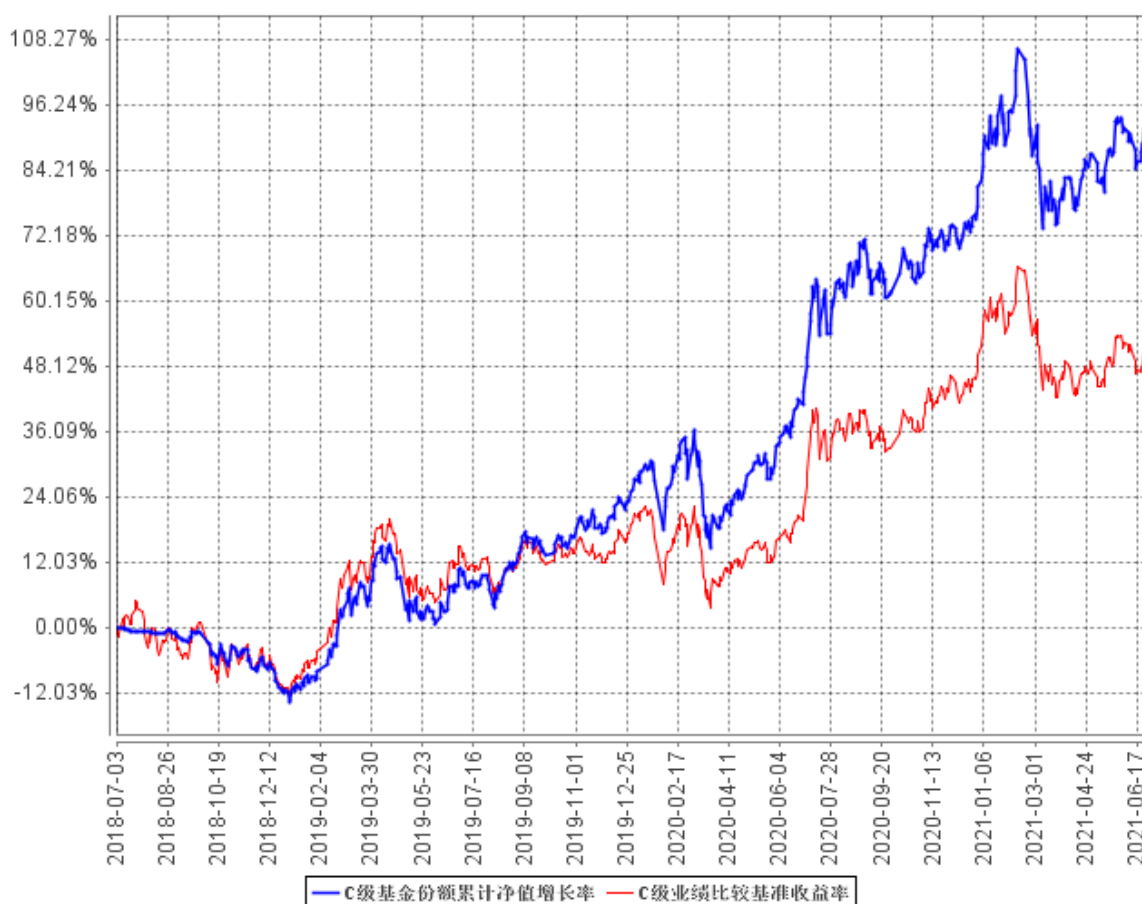
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.53%	0.80%	-1.91%	0.76%	1.38%	0.04%
过去三个月	7.59%	0.98%	3.32%	0.93%	4.27%	0.05%
过去六个月	6.32%	1.41%	0.29%	1.25%	6.03%	0.16%
过去一年	34.11%	1.36%	24.19%	1.27%	9.92%	0.09%
自基金合同生效起至今	92.47%	1.25%	50.62%	1.29%	41.85%	-0.04%

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

A级基金份额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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金实施转型日为 2018 年 7 月 3 日，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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于 2016 年 4 月 19 日获中国证监会批复，2016 年 4 月 25 日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本 1 亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理 50 只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安嘉诚债券型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利混合型证券投资基金、汇安核心资产混合型证券投资基金、汇安裕鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安价值蓝筹混合型证券投资基金、汇安消费龙头混合型证券投资基金、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安中证 500 指数增强型证券投资基金、汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金、汇安均衡优选混合型证券投资基金、汇安核心价值混合型证券投资基金、汇安鑫利优选混合型证券投资基金、汇安泓利一年持有期混合型证券投资基

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		
朱晨歌	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2018 年 8 月 22 日	-	6 年	朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，6 年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资事业部数量分析师、投资经理，从事量化投资研究工作。2017 年 12 月 29 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2018 年 2 月 8 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 7 月 27 日，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 26 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 24 日至 2021 年 2 月 2 日，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 9 日至今，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 22 日至今，任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金；2019 年 3 月 13 日至今，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 14 日至今，任富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 30 日至今，任汇安量化

					先锋混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 9 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；2020 年 4 月 9 日至今，任汇安核心资产混合型证券投资基金基金经理；2020 年 11 月 16 日至今，任汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

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 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

今年上半年，国内宏观经济稳步复苏，企业盈利较显著改善，尤其是新能源、半导体、医疗服务等高景气以及顺周期等疫情受损板块。年初受利率波动影响而大幅调整的一线核心资产，在二季度走势出现分化，核心影响因素还是业绩。过去几年，A 股优质核心资产经历了一波显著的估值提升过程，其背后既有经济转型中龙头公司的竞争格局变化，也有流动性支持下的新增资金对于盈利确定性的青睐。今年，在流动性边际收紧的大背景下，靠盈利增长消化短期偏高估值是市场主线，因此，在投资中，需要对短期业绩增速更加重视。本着长期价值投资的理念，以及对短期市场估值偏高的考虑，基金上半年的整体配置均衡偏价值，以估值合理甚至低估的一二线龙头公司为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安沪深 300 增强 A 基金份额净值为 2.0121 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；截至本报告期末汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.8593 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，估值和盈利的匹配程度仍将是选择投资标的的首要考量因素，对于增速显著领先行业且可持续性较强的优质标的，我们也将提升对短期估值的容忍度；而中长期来看，盈利确定性较高的优质核心资产，在短期承压之后，仍具有较高的配置价值。从量化因子维度，高景气、低拥挤的行业和板块有望在下半年获得超额收益。本基金作为指数增强产品，基于沪深 300 行业和个股分布情况，将在严格控制跟踪误差的前提下，通过量化模型，优选基本面更佳的赛道和公司作为配置方向，力争为投资者获得长期稳定的超额收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，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。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

#### **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，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 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由汇安基金管理有限责任公司编制本托管人复核的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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	28,332,842.21	37,199,083.97
结算备付金		939,003.74	1,133,796.04
存出保证金		176,747.53	143,496.66
交易性金融资产	6.4.7.2	539,191,315.00	507,949,476.38
其中：股票投资		539,191,315.00	507,949,476.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,164,212.47	244,139.59
应收利息	6.4.7.5	7,980.57	8,166.29
应收股利		-	-
应收申购款		5,705,290.09	586,756.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		578,517,391.61	547,264,915.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	3,764,528.57
应付赎回款		2,831,148.85	4,215,251.45
应付管理人报酬		468,084.40	440,386.46
应付托管费		46,808.45	44,038.63
应付销售服务费		123,033.42	109,734.25
应付交易费用	6.4.7.7	270,033.22	589,658.88
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,041.82	331,919.08
负债合计		3,889,150.16	9,495,517.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	300,917,144.30	299,317,598.88
未分配利润	6.4.7.10	273,711,097.15	238,451,799.00
所有者权益合计		574,628,241.45	537,769,397.88
负债和所有者权益总计		578,517,391.61	547,264,915.20

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，汇安沪深 300 增强 A 基金份额净值 2.0121 元，基金份额总额 99,065,570.32 份；汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值 1.8593 元，基金份额总额 201,851,573.98 份。汇安沪深 300 增强份额总额合计为 300,917,144.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		37,580,997.70	41,936,873.22
1.利息收入		130,134.75	124,329.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	130,134.75	124,329.72
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）		40,175,000.26	22,002,301.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,762,356.83	19,275,126.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	179,294.41
股利收益	6.4.7.16	3,412,643.43	2,547,880.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,083,755.50	19,274,616.97
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	359,618.19	535,625.35
<b>减：二、费用</b>		4,867,971.64	2,339,436.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,630,040.30	1,225,495.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	263,004.02	122,549.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	679,634.31	210,578.47
4. 交易费用	6.4.7.19	1,092,270.24	592,642.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	1,515.66
7. 其他费用	6.4.7.20	203,022.77	186,654.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		32,713,026.06	39,597,436.27
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		32,713,026.06	39,597,436.27

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	299,317,598.88	238,451,799.00	537,769,397.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,713,026.06	32,713,026.06
三、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）	1,599,545.42	2,546,272.09	4,145,817.51
其中：1.基金申购款	248,187,471.94	210,063,668.13	458,251,140.07
2.基金赎回款	-246,587,926.52	-207,517,396.04	-454,105,322.56
四、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)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	300,917,144.30	273,711,097.15	574,628,241.45
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	158,907,135.50	44,098,136.13	203,005,271.63
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	39,597,436.27	39,597,436.27
三、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)	64,990,574.56	14,820,710.25	79,811,284.81
其中：1.基金申购款	264,321,311.42	72,312,820.85	336,634,132.27
2.基金赎回款	-199,330,736.86	-57,492,110.60	-256,822,847.46
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	223,897,710.06	98,516,282.65	322,413,992.71

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：

\_\_\_\_\_  
刘强

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王嘉浩

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
江士

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇安丰泰混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于 2018 年 7 月 3 日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2018 年 7 月 2 日表决通过了《关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金转型的有关事项的议案》，同时根据《关于准予汇

安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]737 号)准予注册的批复, 汇安丰泰混合基金于 2018 年 7 月 3 日实施转型。同日起,《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效, 原《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。原汇安丰泰混合基金 A 类基金份额转为本基金 A 类基金份额, 原汇安丰泰混合基金 C 类基金份额转为本基金 C 类基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》, 本基金根据申购费与销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 在投资人申购时不收取申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额的, 称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、权证、资产支持证券、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相关规定)。本基金的投资组合比例为: 股票资产投资比例不低于基金资产的 80%, 其中投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

## 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(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

## 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

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	28,332,842.21
定期存款	-
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	-
合计：	28,332,842.21

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	461,754,607.03	539,191,315.00	77,436,707.97
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	461,754,607.03	539,191,315.00	77,436,707.97

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 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

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,666.37
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	234.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-



应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	79.50
合计	7,980.57

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	270,033.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	270,033.22

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	862.87
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
其他应付款_指数使用费	50,000.00
合计	150,041.82

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,386,918.92	102,386,918.92
本期申购	44,933,664.65	44,933,664.65

本期赎回(以“-”号填列)	-48,255,013.25	-48,255,013.25
本期末	99,065,570.32	99,065,570.32

金额单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	196,930,679.96	196,930,679.96
本期申购	203,253,807.29	203,253,807.29
本期赎回(以“-”号填列)	-198,332,913.27	-198,332,913.27
本期末	201,851,573.98	201,851,573.98

注：本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,152,521.60	40,849,857.87	91,002,379.47
本期利润	13,233,122.37	-1,098,506.96	12,134,615.41
本期基金份额交易产生的变动数	-1,152,939.28	-1,717,024.27	-2,869,963.55
其中：基金申购款	25,054,209.65	18,454,104.97	43,508,314.62
基金赎回款	-26,207,148.93	-20,171,129.24	-46,378,278.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,232,704.69	38,034,326.64	100,267,031.33

单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	74,219,554.85	73,229,864.68	147,449,419.53
本期利润	22,563,659.19	-1,985,248.54	20,578,410.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,407,714.41	1,008,521.23	5,416,235.64
其中：基金申购款	90,058,811.52	76,496,541.99	166,555,353.51
基金赎回款	-85,651,097.11	-75,488,020.76	-161,139,117.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,190,928.45	72,253,137.37	173,444,065.82

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	124,562.64
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	4,106.76
其他	1,465.35
合计	130,134.75

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	36,762,356.83
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	36,762,356.83

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	415,006,413.94
减：卖出股票成本总额	378,244,057.11
买卖股票差价收入	36,762,356.83

**6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

无。

### **6.4.7.13 债券投资收益**

#### **6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

无。

#### **6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

#### **6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

#### **6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

#### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

### **6.4.7.14 贵金属投资收益**

#### **6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

#### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

#### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

#### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

### **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**

无。

#### **6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,412,643.43
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	3,412,643.43

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,083,755.50
——股票投资	-3,083,755.50
——债券投资	-
——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	-3,083,755.50

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	359,486.75
转换费收入	131.44
合计	359,618.19

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,092,270.24
银行间市场交易费用	-
合计	1,092,270.24

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,843.82
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	203,022.77

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

无。

##### 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
汇安基金管理有限责任公司（“汇安基金”）	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
戴新华	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东

郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述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

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,630,040.30	1,225,495.98
其中：支付销售机构的客户维护费	658,798.89	315,704.99

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	263,004.02	122,549.58

注：支付基金托管人浦发银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C	合计
汇安基金	-	303,825.82	303,825.82
浦发银行	-	3,091.70	3,091.70
合计	-	306,917.52	306,917.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C	合计
汇安基金	-	93,333.76	93,333.76
浦发银行	-	1,258.15	1,258.15
合计	-	94,591.91	94,591.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金，再由汇安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 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**

无。



#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

##### 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

无。

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
浦发银行	28,332,842.21	124,562.64	47,364,831.81	119,742.15

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，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

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 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	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注	

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额		
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股流通受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月28日	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688315	诺禾致源	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
301006	迈拓股份	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	399	18,884.67	100,532.04	-
688682	霍莱沃	2021年4月13日	2021年10月20日	新股流通受限	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688628	优利德	2021年1月22日	2021年8月2日	新股流通受限	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	新股流通受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月	新股流通	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-

		日	月 12 日	受限						
688663	新风光	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 13 日	新股 流通 受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688676	金盘 科技	2021 年 3 月 2 日	2021 年 9 月 9 日	新股 流通 受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688239	航宇 科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股 流通 受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300979	华利 集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	33.22	87.50	625	20,762.50	54,687.50	-
688087	英科 再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 9 日	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景 科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
301017	漱玉 平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉 平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股 未上 市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 未上 市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10	新股 流通	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

		日	月 15 日	受限							
688597	煜邦 电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 流通 受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-	
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	48.59	90.39	391	18,998.69	35,342.49	-	
688067	爱威 科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-	
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-	
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-	
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股 流通 受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-	
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
688226	威腾 电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-	
300932	三友 联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-	
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	

		日	月 15 日	受限							
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 流通 受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-	
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股 流通 受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股 流通 受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-	
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-	
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-	

		日	月 3 日	受限							
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-	
301016	雷尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-	
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股 流通 受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-	
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-	
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股 流通 受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	
605162	新中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-	
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-	
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月	新股 流通	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	

		日	月 1 日	受限							
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-	
300930	屹通 新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-	
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	
300991	创益 通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-	
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 流通 受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
300943	春晖 智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月	新股 流通	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	

		日	月 10 日	受限							
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股 流通 受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股 流通 受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
300992	泰福 泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	

注：



- 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。
- 2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。
- 3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。
- 4、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

#### **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**

无。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设

的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浦发银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资或资产支持证券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.28%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6

月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 561,499,466.71 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	28,332,842.21	-	-	-	28,332,842.21
结算备付金	939,003.74	-	-	-	939,003.74
存出保证金	176,747.53	-	-	-	176,747.53
交易性金融	-	-	-	539,191,315.00	539,191,315.00

资产					
应收证券清算款		-	-	4,164,212.47	4,164,212.47
应收利息		-	-	7,980.57	7,980.57
应收申购款		-	-	5,705,290.09	5,705,290.09
资产总计	29,448,593.48			549,068,798.13	578,517,391.61
负债					
应付赎回款		-	-	2,831,148.85	2,831,148.85
应付管理人报酬		-	-	468,084.40	468,084.40
应付托管费		-	-	46,808.45	46,808.45
应付销售服务费		-	-	123,033.42	123,033.42
应付交易费用		-	-	270,033.22	270,033.22
其他负债		-	-	150,041.82	150,041.82
负债总计		-	-	3,889,150.16	3,889,150.16
利率敏感度缺口	29,448,593.48			545,179,647.97	574,628,241.45
上年度末 2020 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	37,199,083.97				37,199,083.97
结算备付金	716,487.22			417,308.82	1,133,796.04
存出保证金	143,496.66				143,496.66
交易性金融资产				507,949,476.38	507,949,476.38
应收证券清算款				244,139.59	244,139.59
应收利息				8,166.29	8,166.29
应收申购款				586,756.27	586,756.27
资产总计	38,059,067.85			509,205,847.35	547,264,915.20
负债					
应付证券清算款				3,764,528.57	3,764,528.57
应付赎回款				4,215,251.45	4,215,251.45
应付管理人报酬				440,386.46	440,386.46
应付托管费				44,038.63	44,038.63
应付销售服务费				109,734.25	109,734.25
应付交易费				589,658.88	589,658.88

用					
其他负债	-	-	-	331,919.08	331,919.08
负债总计	-	-	-	9,495,517.32	9,495,517.32
利率敏感度缺口	38,059,067.85	-	-	-499,710,330.03	537,769,397.88

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 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，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深 300 指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制。

##### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	539,191,315.00	93.83	507,949,476.38	94.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	539,191,315.00	93.83	507,949,476.38	94.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外其他变量保持不变		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	27,928,370.08	26,197,893.28
	沪深 300 指数下降 5%	-27,928,370.08	-26,197,893.28

## § 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	539,191,315.00	93.20
	其中：股票	539,191,315.00	93.20
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	29,271,845.95	5.06
8	其他各项资产	10,054,230.66	1.74
9	合计	578,517,391.61	100.00

### 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	4,257,400.00	0.74
B	采矿业	9,033,492.00	1.57
C	制造业	263,926,108.28	45.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,109,440.00	1.06
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	10,502,271.87	1.83
J	金融业	113,673,654.00	19.78
K	房地产业	15,434,049.00	2.69
L	租赁和商务服务业	12,004,000.00	2.09



M	科学研究和技术服务业	5,637,240.00	0.98
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	10,400,562.42	1.81
R	文化、体育和娱乐业	6,860,000.00	1.19
S	综合	-	-
	合计	457,838,217.57	79.68

### 7.2.2 期末积极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	141,319.10	0.02
B	采矿业	87,243.59	0.02
C	制造业	59,484,217.25	10.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,191,166.93	0.90
E	建筑业	61,656.03	0.01
F	批发和零售业	419,933.99	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	7,054,014.76	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	384,316.40	0.07
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.01
M	科学研究和技术服务业	8,316,875.64	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	85,810.35	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,353,097.43	14.16

### 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 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	13,588	27,946,439.60	4.86
2	600036	招商银行	390,600	21,166,614.00	3.68
3	601318	中国平安	300,100	19,290,428.00	3.36
4	300059	东方财富	481,800	15,798,222.00	2.75
5	600276	恒瑞医药	213,360	14,502,079.20	2.52
6	603501	韦尔股份	45,000	14,490,000.00	2.52
7	002415	海康威视	221,800	14,306,100.00	2.49
8	002475	立讯精密	300,000	13,800,000.00	2.40
9	002129	中环股份	350,000	13,510,000.00	2.35
10	688169	石头科技	10,000	12,610,000.00	2.19
11	601888	中国中免	40,000	12,004,000.00	2.09
12	000858	五粮液	40,000	11,915,600.00	2.07
13	601398	工商银行	2,019,900	10,442,883.00	1.82
14	600690	海尔智家	397,300	10,294,043.00	1.79
15	000001	平安银行	452,100	10,226,502.00	1.78
16	002142	宁波银行	250,700	9,769,779.00	1.70
17	300433	蓝思科技	321,700	9,461,197.00	1.65
18	603986	兆易创新	50,000	9,395,000.00	1.63
19	600309	万华化学	80,000	8,705,600.00	1.51
20	000002	万科 A	361,300	8,602,553.00	1.50
21	603799	华友钴业	70,000	7,994,000.00	1.39
22	002271	东方雨虹	143,469	7,936,705.08	1.38
23	600030	中信证券	307,400	7,666,556.00	1.33
24	601012	隆基股份	84,000	7,462,560.00	1.30
25	600031	三一重工	250,000	7,267,500.00	1.26
26	300413	芒果超媒	100,000	6,860,000.00	1.19
27	600048	保利地产	567,400	6,831,496.00	1.19
28	000725	京东方 A	1,000,000	6,240,000.00	1.09
29	600085	同仁堂	150,000	6,127,500.00	1.07
30	600019	宝钢股份	800,000	6,112,000.00	1.06
31	600900	长江电力	296,000	6,109,440.00	1.06
32	600570	恒生电子	65,278	6,087,173.50	1.06
33	601166	兴业银行	292,900	6,019,095.00	1.05

34	600436	片仔癀	13,300	5,962,390.00	1.04
35	300347	泰格医药	30,000	5,799,000.00	1.01
36	600919	江苏银行	800,000	5,680,000.00	0.99
37	603259	药明康德	36,000	5,637,240.00	0.98
38	600887	伊利股份	150,000	5,524,500.00	0.96
39	601899	紫金矿业	559,600	5,422,524.00	0.94
40	002594	比亚迪	20,000	5,020,000.00	0.87
41	600926	杭州银行	319,700	4,715,575.00	0.82
42	603288	海天味业	36,452	4,700,485.40	0.82
43	300015	爱尔眼科	64,829	4,601,562.42	0.80
44	002410	广联达	64,700	4,412,540.00	0.77
45	603833	欧派家居	30,000	4,258,800.00	0.74
46	002714	牧原股份	70,000	4,257,400.00	0.74
47	002236	大华股份	200,000	4,220,000.00	0.73
48	300014	亿纬锂能	35,000	3,637,550.00	0.63
49	603993	洛阳钼业	699,800	3,610,968.00	0.63
50	002001	新和成	113,400	3,252,312.00	0.57
51	600104	上汽集团	143,500	3,152,695.00	0.55
52	600346	恒力石化	118,000	3,096,320.00	0.54
53	600585	海螺水泥	74,700	3,066,435.00	0.53
54	601377	兴业证券	300,000	2,898,000.00	0.50
55	002050	三花智控	120,000	2,877,600.00	0.50
56	002241	歌尔股份	60,000	2,564,400.00	0.45
57	002008	大族激光	62,300	2,516,297.00	0.44
58	002624	完美世界	107	2,558.37	0.00

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	25,000	13,370,000.00	2.33
2	300887	谱尼测试	90,000	8,045,100.00	1.40
3	603128	华贸物流	500,000	7,045,000.00	1.23
4	600882	妙可蓝多	100,000	6,980,000.00	1.21
5	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.90
6	002832	比音勒芬	200,000	5,118,000.00	0.89
7	603345	安井食品	20,000	5,080,400.00	0.88
8	300573	兴齐眼药	30,000	4,230,900.00	0.74

9	601636	旗滨集团	218,700	4,059,072.00	0.71
10	300604	长川科技	50,000	3,410,500.00	0.59
11	000488	晨鸣纸业	399,550	3,252,337.00	0.57
12	603298	杭叉集团	170,000	3,083,800.00	0.54
13	601567	三星医疗	100,000	2,130,000.00	0.37
14	300957	贝泰妮	3,990	1,076,170.83	0.19
15	688696	极米科技	1,252	1,041,664.00	0.18
16	688606	奥泰生物	2,230	332,270.00	0.06
17	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.06
18	688518	联赢激光	14,111	264,863.47	0.05
19	300896	爱美客	324	255,597.12	0.04
20	688660	电气风电	28,932	254,601.60	0.04
21	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
22	300999	金龙鱼	2,680	227,692.80	0.04
23	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.03
24	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.03
25	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.03
26	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
27	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.03
28	688378	奥来德	2,411	155,750.60	0.03
29	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.03
30	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.02
31	688589	力合微	3,562	141,090.82	0.02
32	688335	复洁环保	4,076	140,295.92	0.02
33	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.02
34	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.02
35	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
36	688551	科威尔	2,211	110,726.88	0.02
37	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.02
38	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.02
39	605111	新洁能	609	109,784.43	0.02
40	688080	映翰通	2,233	106,335.46	0.02
41	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.02
42	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.02
43	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.02
44	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.02
45	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.02
46	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
47	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01

48	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
49	688228	开普云	2,120	81,662.40	0.01
50	605358	立昂微	693	80,096.94	0.01
51	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
52	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
53	001203	大中矿业	3,808	76,731.20	0.01
54	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
55	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
56	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
57	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
58	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
59	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.01
60	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
61	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
62	300979	华利集团	625	54,687.50	0.01
63	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
64	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
65	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.01
66	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
67	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
68	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
69	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
70	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.01
71	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
72	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
73	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.01
74	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01
75	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.01
76	605339	南侨食品	863	37,264.34	0.01
77	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
78	300981	中红医疗	391	35,342.49	0.01
79	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
80	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
81	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.01
82	300900	广联航空	879	32,857.02	0.01
83	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
84	601702	华峰铝业	4,166	29,370.30	0.01
85	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
86	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00

87	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
88	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
89	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
90	605136	丽人丽妆	867	26,382.81	0.00
91	300857	协创数据	934	26,077.28	0.00
92	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
93	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.00
94	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
95	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
96	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
97	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
98	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
99	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
100	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
101	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
102	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
103	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
104	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
105	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
106	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
107	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
108	003013	地铁设计	724	16,507.20	0.00
109	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
110	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
111	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
112	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
113	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
114	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
115	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
116	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
117	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
118	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
119	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
120	003001	中岩大地	560	14,112.00	0.00
121	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
122	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
123	605169	洪通燃气	951	13,913.13	0.00
124	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
125	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00

126	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
127	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
128	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
129	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
130	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.00
131	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
132	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
133	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
134	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
135	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
136	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
137	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
138	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
139	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
140	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
141	605018	长华股份	840	11,096.40	0.00
142	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
143	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
144	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
145	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
146	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
147	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
148	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
149	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
150	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
151	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
152	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
153	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
154	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
155	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
156	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
157	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
158	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
159	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
160	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
161	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
162	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
163	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
164	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

165	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
166	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
167	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
168	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
169	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
170	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
171	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
172	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
173	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
174	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
175	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
176	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
177	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
178	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
179	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
180	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
181	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
182	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
183	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
184	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
185	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
186	300137	先河环保	140	1,143.80	0.00
187	002726	龙大肉食	75	759.00	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	002475	立讯精密	16,886,040.00	3.14
2	600882	妙可蓝多	14,432,545.00	2.68
3	688169	石头科技	14,048,947.29	2.61
4	300750	宁德时代	12,862,356.25	2.39
5	600276	恒瑞医药	10,799,585.00	2.01
6	000725	京东方 A	10,574,100.00	1.97
7	002129	中环股份	10,322,612.00	1.92
8	600690	海尔智家	9,363,452.00	1.74



9	002304	洋河股份	9,025,220.00	1.68
10	300887	谱尼测试	8,127,855.80	1.51
11	601888	中国中免	8,030,760.00	1.49
12	603501	韦尔股份	7,953,813.00	1.48
13	603128	华贸物流	7,493,000.50	1.39
14	603986	兆易创新	7,347,890.56	1.37
15	605336	帅丰电器	7,270,823.00	1.35
16	601899	紫金矿业	7,156,030.00	1.33
17	300413	芒果超媒	7,028,939.00	1.31
18	601166	兴业银行	6,926,931.00	1.29
19	000723	美锦能源	6,856,244.00	1.27
20	600019	宝钢股份	6,794,964.00	1.26

注：买入股票成本、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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000333	美的集团	12,495,879.00	2.32
2	000651	格力电器	11,226,305.81	2.09
3	002960	青鸟消防	10,444,449.22	1.94
4	300633	开立医疗	9,871,178.00	1.84
5	601888	中国中免	9,387,992.84	1.75
6	600882	妙可蓝多	9,237,499.00	1.72
7	002304	洋河股份	9,083,362.00	1.69
8	603733	仙鹤股份	7,839,335.00	1.46
9	002541	鸿路钢构	7,740,373.93	1.44
10	002918	蒙娜丽莎	7,369,982.33	1.37
11	300122	智飞生物	7,013,027.00	1.30
12	600438	通威股份	6,963,712.00	1.29
13	605336	帅丰电器	6,668,415.55	1.24
14	000723	美锦能源	6,552,251.00	1.22
15	300573	兴齐眼药	6,269,198.00	1.17
16	000568	泸州老窖	6,268,832.00	1.17
17	688677	海泰新光	6,113,975.78	1.14
18	002027	分众传媒	5,869,060.00	1.09

19	600519	贵州茅台	5,660,447.00	1.05
20	603195	公牛集团	5,475,459.89	1.02

注：买入股票成本、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。

### 7.4.3 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	412,569,651.23
卖出股票收入（成交）总额	415,006,413.94

注：买入股票成本、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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

本基金投资的招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日, 因为同业投资提供第三方信用担保等事由受到中国银行保险监督管理委员会处罚 (银保监罚决字 (2021) 16 号)。该主体作为股票发行人, 经营稳健, 业绩良好, 所受处罚不影响发行人的实际经营, 经过本基金管理人内部严格的投资决策流程, 该主体发行的债券被纳入本基金的实际投资组合。本基金投资的其余前十大持有证券的发行主体本报告期内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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	176,747.53
2	应收证券清算款	4,164,212.47
3	应收股利	-
4	应收利息	7,980.57
5	应收申购款	5,705,290.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,054,230.66

### 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。

#### 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

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.90	新股锁定

### 7.12.6 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。

## § 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

份额级别	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
汇安沪深 300 增强 A	17,392	5,696.04	4,821,043.48	4.870000%	94,244,526.84	95.130000%
汇安沪深 300 增强 C	37,070	5,445.15	116,350,480.45	57.640000%	85,501,093.53	42.360000%
合计	54,462	5,525.27	121,171,523.93	40.270000%	179,745,620.37	59.730000%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇安沪深 300 增强 A	79,471.37	0.08022098%
	汇安沪深 300 增强 C	17.68	0.00000876%
	合计	79,489.05	0.02641559%

### 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的情况

项目	份额级别	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	汇安沪深 300 增强 A	0~10
	汇安沪深 300 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安沪深 300 增强 A	0
	汇安沪深 300 增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2018 年 7 月 3 日）基金份额总额	453,804.07	2,522,567.55
本报告期期初基金份额总额	102,386,918.92	196,930,679.96
本报告期基金总申购份额	44,933,664.65	203,253,807.29
减：本报告期基金总赎回份额	48,255,013.25	198,332,913.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	99,065,570.32	201,851,573.98

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

本基金管理人 2021 年 1 月 5 日发布公告，邹唯先生任公司副总经理。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日(2017 年 1 月 25 日)起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无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	
万联证券	2	815,711,410.06	100.00%	580,214.19	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- 1、综合实力较强、市场信誉良好；
- 2、财务状况良好，经营状况稳健；
- 3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；
- 5、具有佣金费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- 6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存合规风控部备案。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

**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
万联证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-



湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	汇安基金管理有限责任公司关于变更高级管理人员的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 1 月 5 日
2	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 1 月 22 日
3	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 3 月 31 日
4	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 4 月 17 日
5	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金（2021 年第 1 号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 4 月 17 日
6	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 4 月 22 日

## § 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

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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- (3) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (4) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (5) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (7) 报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告

### 12.2 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

### 12.3 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

2021 年 8 月 31 日