

# 汇安中证 500 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>51</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
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>67</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.....	67

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安中证 500 增强	
基金主代码	010157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 16 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	272,046,191.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安中证 500 增强 A	汇安中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码:	010157	010158
报告期末下属分级基金的份额总额	182,564,253.82 份	89,481,937.80 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在严格控制对中证 500 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，力求实现超越中证 500 指数的投资收益，谋求基金财产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型股票指数基金，在标的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。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、股票投资策略</li> <li>3、债券投资策略</li> <li>4、资产支持证券投资策略</li> <li>5、股指期货投资策略</li> <li>6、国债期货投资策略</li> <li>7、参与融资及转融通证券出借业务的策略</li> <li>8、存托凭证投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中证 500 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青
	联系电话	01056711600
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn
		张燕
		0755-83199084
		yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	01056711690	95555
传真	01056711640	0755-83195201
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	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 号白玉兰大厦 36 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100007	518040
法定代表人	刘强	缪建民

## 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	汇安中证 500 增强 A	汇安中证 500 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	12,260,932.65	4,321,262.60
本期利润	26,677,019.21	10,215,123.53
加权平均基金份额本期利润	0.0897	0.0822
本期加权平均净值利润率	8.81%	8.09%
本期基金份额净值增长率	8.76%	8.54%
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	9,134,894.92	4,238,752.32
期末可供分配基金份额利润	0.0500	0.0474
期末基金资产净值	198,597,887.04	97,096,612.54
期末基金份额净值	1.0878	1.0851
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	8.78%	8.51%

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

汇安中证 500 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	2.28%	0.82%	1.12%	0.69%	1.16%	0.13%
过去三个月	10.20%	0.73%	8.41%	0.65%	1.79%	0.08%
过去六个月	8.76%	1.05%	6.61%	0.94%	2.15%	0.11%
自基金合同生效起至今	8.78%	0.94%	7.59%	0.96%	1.19%	-0.02%

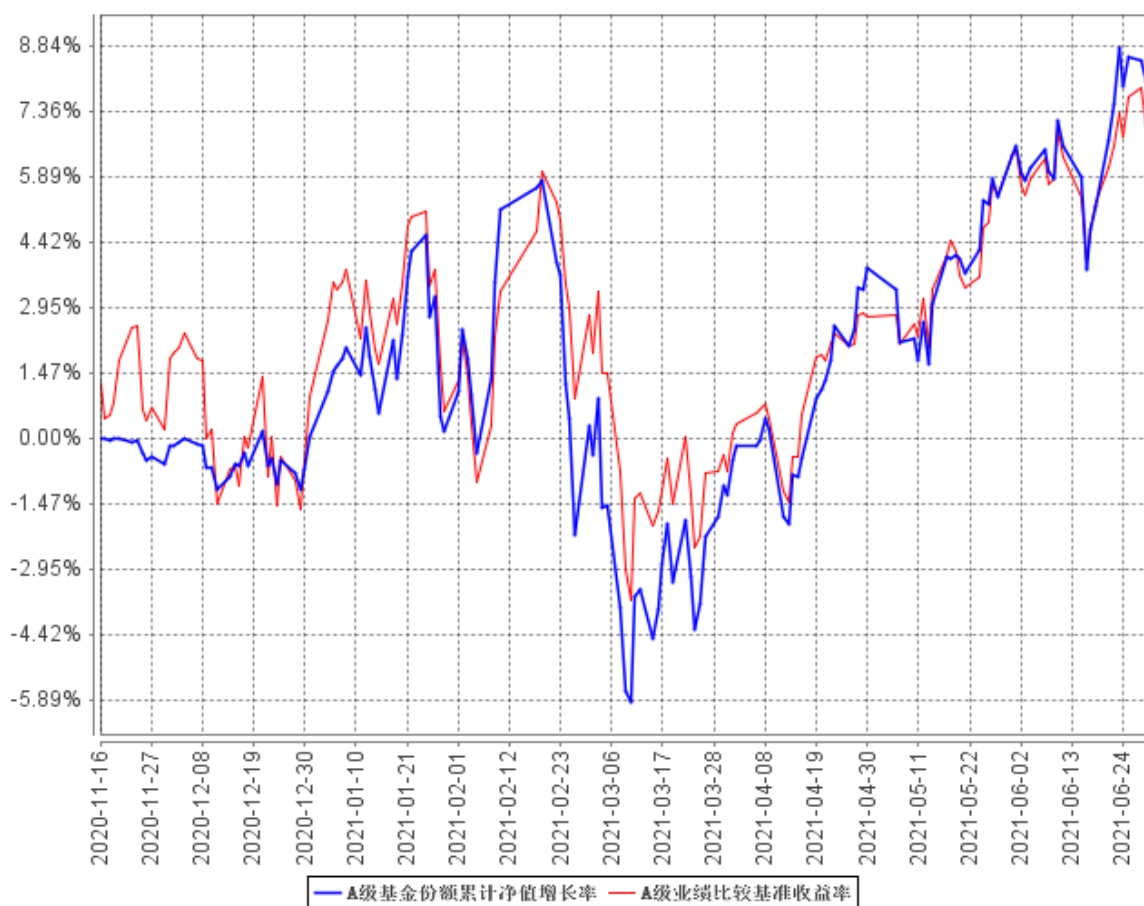


汇安中证 500 增强 C

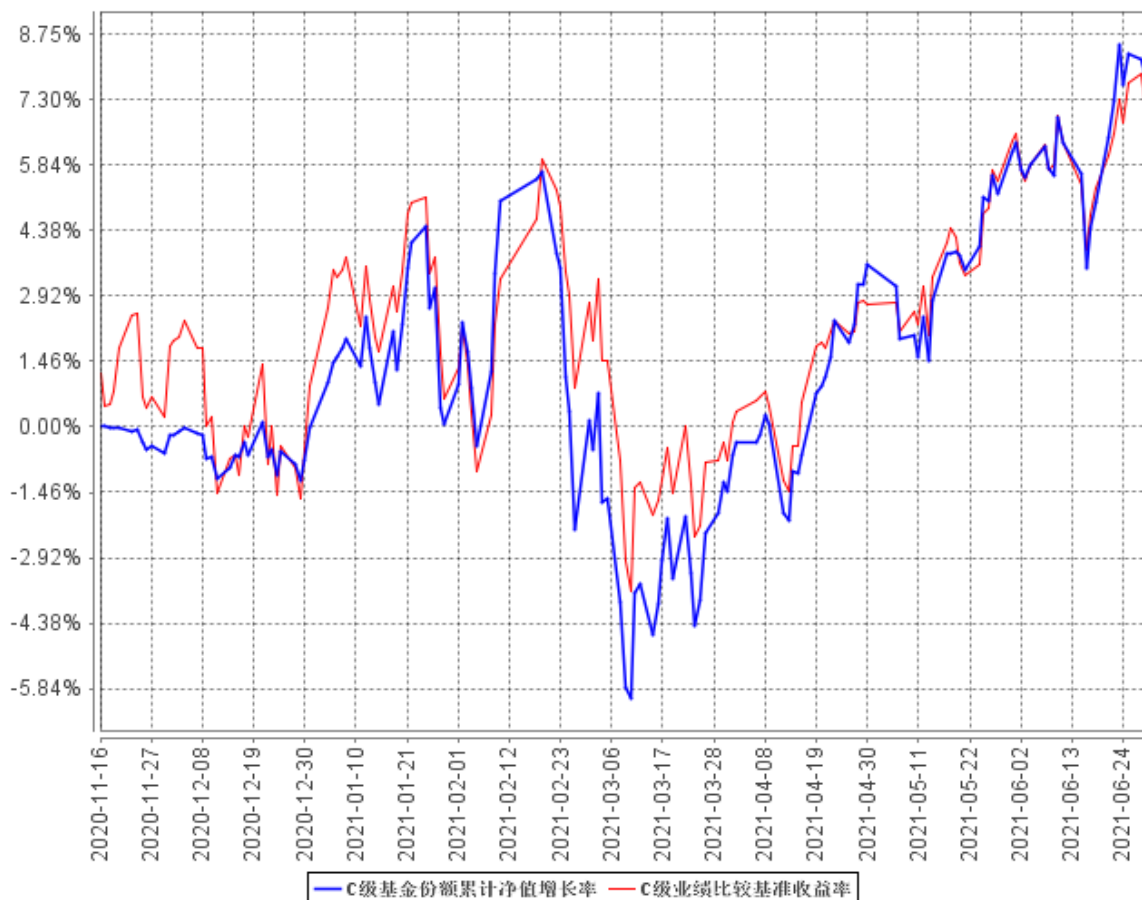
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.24%	0.82%	1.12%	0.69%	1.12%	0.13%
过去三个月	10.10%	0.73%	8.41%	0.65%	1.69%	0.08%
过去六个月	8.54%	1.05%	6.61%	0.94%	1.93%	0.11%
自基金合同生效起至今	8.51%	0.94%	7.59%	0.96%	0.92%	-0.02%

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：①基金合同生效日为 2020 年 11 月 16 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、可转换债券、可交换债券）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、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）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 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。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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，

本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为 2020 年 11 月 16 日至 2021 年 5 月 15 日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

## § 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	2020年11月16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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

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。中证 500 作为 A 股中盘成长股的代表指数，目前估值仍处于历史较低分位数水平，且成分股中涵盖了很多各个行业的优质成长股代表，与今年的市场风格相符合。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安中证 500 增强 A 基金份额净值为 1.0878 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.76%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%；截至本报告期末汇安中证 500 增强 C 基金份额净值为 1.0851 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.54%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

## 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，基于中证 500 指数的行业和个股的分布情况，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：汇安中证 500 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	42,168,009.84	51,815,934.53
结算备付金		424,714.00	48,368,110.57
存出保证金		-	7,701,724.80
交易性金融资产	6.4.7.2	280,767,666.47	199,889,950.55
其中：股票投资		280,767,666.47	199,889,950.55
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	-	250,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,477.57	23,318.96
应收股利		-	-
应收申购款		2,202,435.16	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		325,565,303.04	557,799,039.41
<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		-	-
应付赎回款		29,315,830.93	-
应付管理人报酬		286,858.38	469,199.31
应付托管费		57,371.66	93,839.86
应付销售服务费		30,265.29	63,243.47
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	180,477.20	175,000.00
负债合计		29,870,803.46	801,282.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	272,046,191.62	556,977,271.25
未分配利润	6.4.7.10	23,648,307.96	20,485.52
所有者权益合计		295,694,499.58	556,997,756.77
负债和所有者权益总计		325,565,303.04	557,799,039.41

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，汇安中证 500 增强 A 基金份额净值 1.0878 元，基金份额总额 182,564,253.82 份；汇安中证 500 增强 C 基金份额净值 1.0851 元，基金份额总额 89,481,937.80 份。汇安中证 500 增强份额总额合计为 272,046,191.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安中证 500 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
<b>一、收入</b>		41,630,283.23
1.利息收入		184,224.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	148,109.43
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		36,115.52
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,414,770.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,726,885.56
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	296,491.55
股利收益	6.4.7.16	3,391,393.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,309,947.49
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	721,340.05
<b>减：二、费用</b>		4,738,140.49

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,146,289.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	429,257.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	252,561.66
4. 交易费用	6.4.7.19	1,698,609.49
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,503.81
7. 其他费用	6.4.7.20	207,918.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>36,892,142.74</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>36,892,142.74</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安中证 500 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）	556,977,271.25	20,485.52	556,997,756.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,892,142.74	36,892,142.74
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）	-284,931,079.63	-13,264,320.30	-298,195,399.93
其中：1.基金申购款	132,402,447.48	3,985,466.45	136,387,913.93
2.基金赎回款	-417,333,527.11	-17,249,786.75	-434,583,313.86
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）	272,046,191.62	23,648,307.96	295,694,499.58

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：

<u>刘强</u>	<u>王嘉浩</u>	<u>江士</u>
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

汇安中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1934 号《关于准予汇安中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由汇安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 556,920,351.09 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0999 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 556,977,271.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 56,920.16 份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/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;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,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 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安中证 500 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(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、可转换债券、可交换债券)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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%;其中投资于中证 500 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,本基金持有的现金或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。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:中证 500 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》、《汇安中证 500 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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。



#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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	4,615,259.39
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	37,552,750.45
合计：	42,168,009.84

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 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	260,211,558.23	280,767,666.47	20,556,108.24
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	260,211,558.23	280,767,666.47	20,556,108.24

##### 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	294.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,079.97
应收结算备付金利息	103.18
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	-
合计	2,477.57

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 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	27,330.73
应付证券出借违约金	-
预提费用	103,146.47

其他应付款_指数使用费	50,000.00
合计	180,477.20

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安中证 500 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	369,250,181.79	369,250,181.79
本期申购	89,555,716.48	89,555,716.48
本期赎回(以“-”号填列)	-276,241,644.45	-276,241,644.45
本期末	182,564,253.82	182,564,253.82

金额单位：人民币元

汇安中证 500 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	187,727,089.46	187,727,089.46
本期申购	42,846,731.00	42,846,731.00
本期赎回(以“-”号填列)	-141,091,882.66	-141,091,882.66
本期末	89,481,937.80	89,481,937.80

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

汇安中证 500 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	-88,671.79	163,457.50	74,785.71
本期利润	12,260,932.65	14,416,086.56	26,677,019.21
本期基金份额交易产生的变动数	-3,037,365.94	-7,680,805.76	-10,718,171.70
其中：基金申购款	281,562.41	2,249,846.05	2,531,408.46
基金赎回款	-3,318,928.35	-9,930,651.81	-13,249,580.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,134,894.92	6,898,738.30	16,033,633.22

单位：人民币元

汇安中证 500 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	-137,003.44	82,703.25	-54,300.19
本期利润	4,321,262.60	5,893,860.93	10,215,123.53
本期基金份额交易产生的变动数	54,493.16	-2,600,641.76	-2,546,148.60
其中：基金申购款	400,122.13	1,053,935.86	1,454,057.99
基金赎回款	-345,628.97	-3,654,577.62	-4,000,206.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,238,752.32	3,375,922.42	7,614,674.74

#### 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	10,999.39
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	75,800.17
其他	61,309.87
合计	148,109.43

#### 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	16,726,885.56
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	16,726,885.56

##### 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	631,002,283.03
减：卖出股票成本总额	614,275,397.47
买卖股票差价收入	16,726,885.56

#### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	296,491.55

### 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	3,391,393.63
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	3,391,393.63

### 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	21,361,147.49
——股票投资	21,361,147.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,051,200.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-1,051,200.00
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	20,309,947.49

#### 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	720,951.59
转换费收入	388.46
合计	721,340.05

#### 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	1,698,609.49
银行间市场交易费用	-
合计	1,698,609.49

#### 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	43,639.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,771.76
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	207,918.23

### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
当期发生的基金应支付的管理费	2,146,289.43
其中：支付销售机构的客户维护费	783,062.43

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 1.00% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	429,257.87

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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		
	汇安中证 500 增强 A	汇安中证 500 增强 C	合计
汇安基金	-	8,454.10	8,454.10
招商银行	-	113,264.66	113,264.66
合计	-	121,718.76	121,718.76

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固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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,615,259.39	10,999.39

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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	-
688680	海优新材	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	69.94	243.61	2,795	195,482.30	680,889.95	-
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新股流通受限	43.22	63.82	4,920	212,642.40	313,994.40	-
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	-
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	-
688607	康众医疗	2021 年 1 月 25 日	2021 年 8 月 2 日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
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	-
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	291	13,773.03	73,320.36	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	新股流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月	新股流通	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-

		日	月 5 日	受限							
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	-	
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 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	
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	-	
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	-	
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	318	15,451.62	28,744.02	-	
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	新股未上	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-	

		日	月 6 日	市							
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 受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	
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	2021 年 8	新股 流通	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	



		日	月 9 日	受限							
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 3 日	新股 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-	
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	新股 流通	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-	

		日	月 25 日	受限							
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 1 日	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
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	新股 流通	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	

		日	月 15 日	受限							
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 10 日	新股 流通 受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
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 15 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	

		日	月 26 日	受限						
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招商银行，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约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、流通受限制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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2.61%。

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 248,341,208.50 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、结算备付金和买入返售金融资产等。

#### 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	42,168,009.84	-	-	-	42,168,009.84
结算备付金	424,714.00	-	-	-	424,714.00
交易性金融资产	-	-	-	-280,767,666.47	280,767,666.47
应收利息	-	-	-	2,477.57	2,477.57
应收申购款	-	-	-	2,202,435.16	2,202,435.16
资产总计	42,592,723.84	-	-	-282,972,579.20	325,565,303.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,315,830.93	29,315,830.93
应付管理人报酬	-	-	-	286,858.38	286,858.38
应付托管费	-	-	-	57,371.66	57,371.66
应付销售服务费	-	-	-	30,265.29	30,265.29
其他负债	-	-	-	180,477.20	180,477.20
负债总计	-	-	-	29,870,803.46	29,870,803.46
利率敏感度缺口	42,592,723.84	-	-	-253,101,775.74	295,694,499.58
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	51,815,934.53	-	-	-	51,815,934.53
结算备付金	48,368,110.57	-	-	-	48,368,110.57
存出保证金	-	-	-	7,701,724.80	7,701,724.80
交易性金融资产	-	-	-	-199,889,950.55	199,889,950.55
买入返售金融资产	250,000,000.00	-	-	-	250,000,000.00
应收利息	-	-	-	23,318.96	23,318.96
资产总计	350,184,045.10	-	-	-207,614,994.31	557,799,039.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,051,200.00	1,051,200.00
应付管理人报酬	-	-	-	469,199.31	469,199.31
应付托管费	-	-	-	93,839.86	93,839.86
应付销售服务费	-	-	-	63,243.47	63,243.47
其他负债	-	-	-	-876,200.00	-876,200.00
负债总计	-	-	-	801,282.64	801,282.64
利率敏感度缺口	350,184,045.10	-	-	-206,813,711.67	556,997,756.77

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，在严格控制对中证 500 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	280,767,666.47	94.95	199,889,950.55	35.89
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	280,767,666.47	94.95	199,889,950.55	35.89

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## § 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	280,767,666.47	86.24
	其中：股票	280,767,666.47	86.24
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	42,592,723.84	13.08
8	其他各项资产	2,204,912.73	0.68
9	合计	325,565,303.04	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	1,748,360.00	0.59
B	采矿业	6,136,990.00	2.08
C	制造业	177,126,317.89	59.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,886,744.00	1.99
E	建筑业	2,074,738.00	0.70
F	批发和零售业	9,296,304.00	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,849,056.00	0.63
H	住宿和餐饮业	9,812,251.00	3.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,513,437.09	5.92
J	金融业	2,639,294.00	0.89
K	房地产业	2,930,815.00	0.99
L	租赁和商务服务业	2,139,600.00	0.72

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	2,171,610.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	3,543,884.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	244,869,400.98	82.81

### 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,766,179.27	9.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	1.75
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	328,753.90	0.11
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	128,719.74	0.04
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	3,433,476.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.02
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	35,898,265.49	12.14

### 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	603444	吉比特	12,500	6,625,000.00	2.24
2	300285	国瓷材料	134,600	6,561,750.00	2.22
3	000739	普洛药业	211,700	6,223,980.00	2.10
4	002340	格林美	628,500	5,876,475.00	1.99
5	002444	巨星科技	161,600	5,507,328.00	1.86
6	600060	海信视像	301,700	5,098,730.00	1.72
7	600258	首旅酒店	208,600	4,977,196.00	1.68
8	000513	丽珠集团	98,700	4,936,974.00	1.67
9	002985	北摩高科	50,147	4,889,332.50	1.65
10	600754	锦江酒店	84,900	4,835,055.00	1.64
11	002242	九阳股份	143,400	4,659,066.00	1.58
12	603707	健友股份	109,800	4,584,150.00	1.55
13	300308	中际旭创	100,000	3,852,000.00	1.30
14	000488	晨鸣纸业	448,900	3,654,046.00	1.24
15	002074	国轩高科	82,982	3,614,695.92	1.22
16	600884	杉杉股份	154,490	3,602,706.80	1.22
17	300223	北京君正	34,300	3,461,556.00	1.17
18	601636	旗滨集团	179,505	3,331,612.80	1.13
19	003022	联泓新科	100,000	3,070,000.00	1.04
20	002648	卫星石化	75,400	2,954,926.00	1.00
21	300699	光威复材	38,513	2,925,062.35	0.99
22	000636	风华高科	95,600	2,889,032.00	0.98
23	000799	酒鬼酒	10,700	2,734,920.00	0.92
24	000830	鲁西化工	143,700	2,691,501.00	0.91
25	600089	特变电工	207,700	2,668,945.00	0.90
26	600803	新奥股份	161,600	2,668,016.00	0.90
27	002048	宁波华翔	136,409	2,659,975.50	0.90
28	300146	汤臣倍健	77,900	2,562,910.00	0.87
29	300271	华宇软件	129,500	2,492,875.00	0.84
30	603927	中科软	56,711	2,435,737.45	0.82
31	002203	海亮股份	228,200	2,428,048.00	0.82
32	002092	中泰化学	236,400	2,427,828.00	0.82
33	002831	裕同科技	78,700	2,336,603.00	0.79

34	600188	兖州煤业	152,000	2,334,720.00	0.79
35	002557	洽洽食品	53,800	2,318,780.00	0.78
36	601615	明阳智能	142,935	2,314,117.65	0.78
37	601168	西部矿业	191,600	2,285,788.00	0.77
38	603486	科沃斯	10,000	2,280,800.00	0.77
39	000050	深天马 A	158,200	2,243,276.00	0.76
40	601717	郑煤机	192,100	2,234,123.00	0.76
41	002745	木林森	166,500	2,231,100.00	0.75
42	603786	科博达	29,535	2,229,892.50	0.75
43	300166	东方国信	178,799	2,209,955.64	0.75
44	600062	华润双鹤	182,400	2,172,384.00	0.73
45	300244	迪安诊断	56,700	2,171,610.00	0.73
46	600409	三友化工	213,000	2,153,430.00	0.73
47	601828	美凯龙	178,300	2,139,600.00	0.72
48	603077	和邦生物	1,028,200	2,138,656.00	0.72
49	000807	云铝股份	178,800	2,127,720.00	0.72
50	603712	七一二	58,900	2,126,290.00	0.72
51	603379	三美股份	113,626	2,125,942.46	0.72
52	600704	物产中大	269,300	2,119,391.00	0.72
53	600582	天地科技	543,300	2,118,870.00	0.72
54	000581	威孚高科	101,300	2,110,079.00	0.71
55	603225	新风鸣	103,788	2,106,896.40	0.71
56	600201	生物股份	120,700	2,106,215.00	0.71
57	002399	海普瑞	132,000	2,102,760.00	0.71
58	600739	辽宁成大	100,900	2,099,729.00	0.71
59	600820	隧道股份	392,200	2,074,738.00	0.70
60	002926	华西证券	214,200	2,062,746.00	0.70
61	600312	平高电气	351,200	2,051,008.00	0.69
62	000717	韶钢松山	444,700	2,041,173.00	0.69
63	603228	景旺电子	77,612	2,033,434.40	0.69
64	300463	迈克生物	47,454	1,997,338.86	0.68
65	603883	老百姓	37,500	1,975,500.00	0.67
66	600782	新钢股份	353,400	1,971,972.00	0.67
67	600376	首开股份	349,400	1,956,640.00	0.66
68	600835	上海机电	119,363	1,939,648.75	0.66
69	601233	桐昆股份	80,000	1,927,200.00	0.65
70	600967	内蒙一机	190,300	1,925,836.00	0.65
71	300315	掌趣科技	452,100	1,921,425.00	0.65
72	600260	凯乐科技	213,300	1,894,104.00	0.64

73	000690	宝新能源	364,800	1,864,128.00	0.63
74	002317	众生药业	215,700	1,857,177.00	0.63
75	601298	青岛港	299,200	1,849,056.00	0.63
76	600597	光明乳业	126,900	1,828,629.00	0.62
77	600131	国网信通	138,100	1,828,444.00	0.62
78	300180	华峰超纤	368,200	1,822,590.00	0.62
79	000028	国药一致	47,600	1,801,184.00	0.61
80	603156	养元饮品	62,500	1,786,250.00	0.60
81	600373	中文传媒	179,800	1,772,828.00	0.60
82	601098	中南传媒	200,800	1,771,056.00	0.60
83	000998	隆平高科	109,000	1,748,360.00	0.59
84	600801	华新水泥	98,600	1,732,402.00	0.59
85	601003	柳钢股份	285,500	1,684,450.00	0.57
86	600256	广汇能源	455,400	1,516,482.00	0.51
87	002690	美亚光电	26,400	1,472,064.00	0.50
88	000598	兴蓉环境	260,000	1,354,600.00	0.46
89	603719	良品铺子	28,900	1,300,500.00	0.44
90	000999	华润三九	44,800	1,198,400.00	0.41
91	002465	海格通信	122,100	1,155,066.00	0.39
92	600219	南山铝业	294,400	1,059,840.00	0.36
93	002244	滨江集团	232,500	974,175.00	0.33
94	688208	道通科技	10,000	869,900.00	0.29
95	002563	森马服饰	70,600	843,670.00	0.29
96	300482	万孚生物	9,100	588,679.00	0.20
97	600643	爱建集团	82,600	576,548.00	0.19

### 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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.74
2	002541	鸿路钢构	71,800	4,189,530.00	1.42
3	002129	中环股份	107,700	4,157,220.00	1.41
4	601966	玲珑轮胎	89,700	3,923,478.00	1.33
5	300012	华测检测	107,700	3,433,476.00	1.16
6	600559	老白干酒	100,000	2,630,000.00	0.89
7	603658	安图生物	30,000	2,273,100.00	0.77
8	002614	奥佳华	100,000	2,263,000.00	0.77

9	600085	同仁堂	53,800	2,197,730.00	0.74
10	688696	极米科技	1,252	1,041,664.00	0.35
11	300957	贝泰妮	2,605	702,011.02	0.24
12	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.23
13	600882	妙可蓝多	8,400	586,320.00	0.20
14	688317	之江生物	4,920	313,994.40	0.11
15	300782	卓胜微	540	290,250.00	0.10
16	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.08
17	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.07
18	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.05
19	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.05
20	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.04
21	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.03
22	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.03
23	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
24	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.02
25	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
26	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
27	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
28	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
29	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
30	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
31	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01
32	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
33	300981	中红医疗	318	28,744.02	0.01
34	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
35	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
36	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
37	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
38	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
39	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
40	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
41	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
42	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
43	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
44	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
45	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
46	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
47	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00



48	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
49	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
50	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
51	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
52	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
53	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
54	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
55	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
56	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
57	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
58	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
59	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
60	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
61	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
62	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
63	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
64	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
65	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
66	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
67	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
68	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
69	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
70	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
71	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
72	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
73	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
74	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
75	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
76	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
77	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
78	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
79	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
80	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
81	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
82	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
83	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	300012	华测检测	11,834,688.55	2.12
2	300274	阳光电源	10,661,516.00	1.91
3	601233	桐昆股份	10,210,748.00	1.83
4	300308	中际旭创	8,326,455.00	1.49
5	603345	安井食品	7,254,572.69	1.30
6	000998	隆平高科	7,208,864.00	1.29
7	002444	巨星科技	7,040,088.29	1.26
8	002074	国轩高科	6,980,121.50	1.25
9	688002	睿创微纳	6,905,850.60	1.24
10	002541	鸿路钢构	6,820,950.00	1.22
11	600409	三友化工	6,585,503.77	1.18
12	600258	首旅酒店	6,567,642.00	1.18
13	603298	杭叉集团	6,536,417.60	1.17
14	002422	科伦药业	6,265,569.00	1.12
15	300496	中科创达	5,739,189.00	1.03
16	000739	普洛药业	5,615,813.00	1.01
17	603613	国联股份	5,532,337.00	0.99
18	600732	爱旭股份	5,371,868.00	0.96
19	000858	五粮液	5,225,655.00	0.94
20	600426	华鲁恒升	5,112,576.00	0.92

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	300274	阳光电源	9,744,382.00	1.75
2	300012	华测检测	9,515,928.75	1.71
3	600426	华鲁恒升	9,077,223.60	1.63
4	002340	格林美	7,830,012.00	1.41

5	603345	安井食品	7,829,657.20	1.41
6	601233	桐昆股份	7,043,979.00	1.26
7	603501	韦尔股份	6,943,187.00	1.25
8	300633	开立医疗	6,814,573.12	1.22
9	002739	万达电影	6,798,579.80	1.22
10	688002	睿创微纳	6,738,498.50	1.21
11	300496	中科创达	6,620,824.00	1.19
12	002422	科伦药业	6,217,957.00	1.12
13	300059	东方财富	6,154,950.00	1.11
14	603298	杭叉集团	6,117,666.18	1.10
15	002064	华峰化学	5,662,146.00	1.02
16	000858	五粮液	5,468,397.00	0.98
17	300750	宁德时代	5,357,657.46	0.96
18	600409	三友化工	5,286,349.00	0.95
19	000998	隆平高科	5,138,625.00	0.92
20	603613	国联股份	5,111,038.00	0.92

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	673,791,965.90
卖出股票收入（成交）总额	631,002,283.03

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					0.00
股指期货投资本期收益 (元)					296,491.55
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-1,051,200.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,基于股指期货贴水情况和现金头寸安排,本基金曾投资中证 500 股指期货多头。相关合约以及投资比例等均符合基金合同要求。

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,477.57
5	应收申购款	2,202,435.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,204,912.73

#### 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	1.74	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
汇安中证 500 增强 A	4,021	45,402.70	995,274.88	0.550000%	181,568,978.94	99.450000%
汇安中证 500 增强 C	9,546	9,373.76	10,232,127.69	11.430000%	79,249,810.11	88.570000%
合计	13,567	20,052.05	11,227,402.57	4.130000%	260,818,789.05	95.870000%

### 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	汇安中证 500 增强 A	495.05	0.00027116%
	汇安中证 500 增强 C	5,117.58	0.00571912%
	合计	5,612.63	0.00206312%

### 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	汇安中证 500 增强 A	0
	汇安中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安中证 500 增强 A	0
	汇安中证 500 增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安中证 500 增强 A	汇安中证 500 增强 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 16 日）基金份额总额	369,250,181.79	187,727,089.46
本报告期期初基金份额总额	369,250,181.79	187,727,089.46
本报告期基金总申购份额	89,555,716.48	42,846,731.00
减：本报告期基金总赎回份额	276,241,644.45	141,091,882.66
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	182,564,253.82	89,481,937.80

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（2020 年 11 月 16 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	1,293,722,298.49	100.00%	923,629.46	100.00%	-

注：（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和



券商协作表现评价等四个方面。

(2) 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测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

(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	-	-	100,000,000.00	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	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	汇安基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日
3	汇安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日
4	汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日
5	汇安中证 500 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1月20日
6	汇安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021年1月20日
7	汇安中证 500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	规定报刊和/或公司网站	2021年2月3日
8	汇安中证 500 指数增强型证	规定报刊和/或公司	2021年4月22日

---

	券投资基金 2021 年第 1 季度 报告	网站	
--	--------------------------	----	--

## § 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中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安中证 500 指数增强型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) 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