

汇安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 汇安中证 500 增强 |
| 基金主代码 | 010157 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 177,010,587.95 份 |
| 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"> 1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、参与融资及转融通证券出借业务的策略 8、存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率 (税后) \times 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 109,964,567.24 份 | 67,046,020.71 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年10月1日—2021年12月31日） | |
|-----------------|-----------------------------|---------------|
| | 汇安中证 500 增强 A | 汇安中证 500 增强 C |
| 1. 本期已实现收益 | 6,571,965.51 | 3,868,799.35 |
| 2. 本期利润 | 2,070,043.93 | 751,301.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0180 | 0.0106 |
| 4. 期末基金资产净值 | 125,808,981.98 | 76,358,089.81 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1441 | 1.1389 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇安中证 500 增强 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个 | 1.55% | 0.89% | 3.43% | 0.72% | -1.88% | 0.17% |

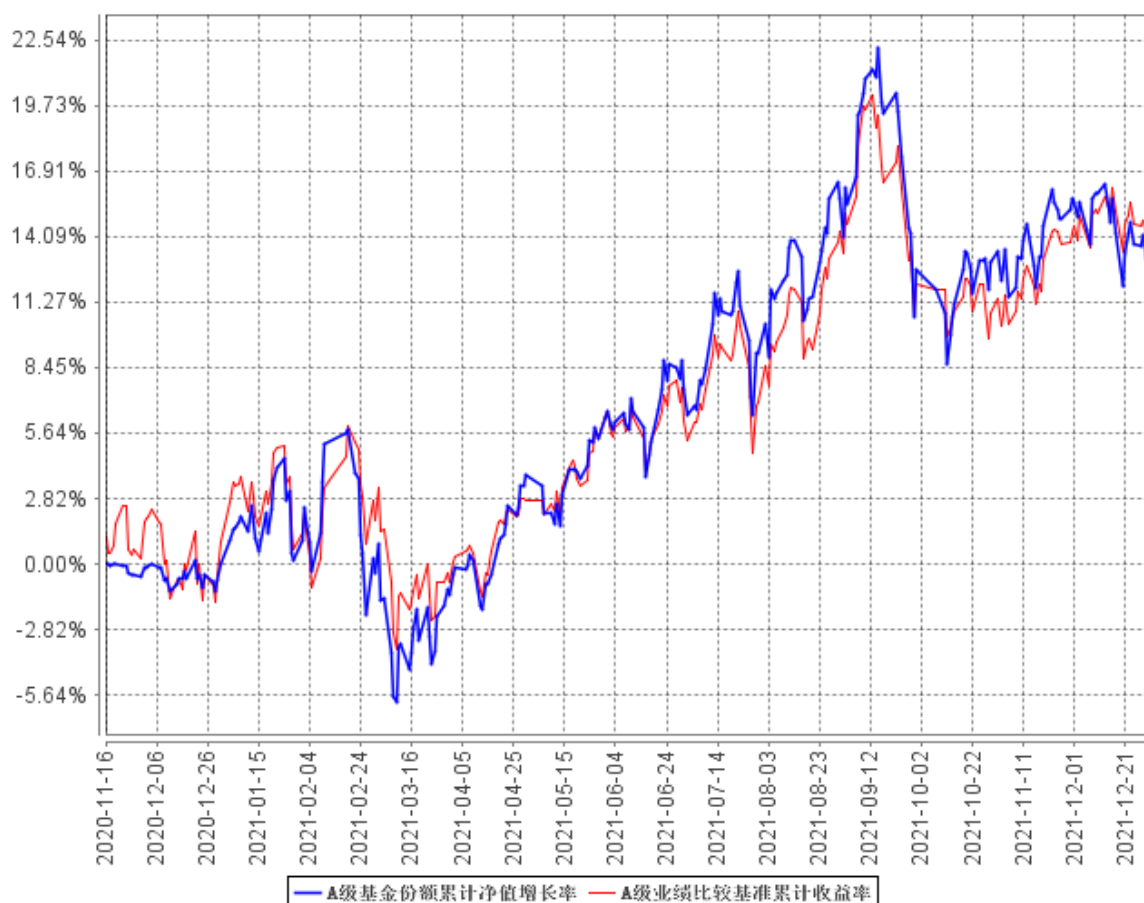
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 月 | | | | | | |
| 过去六个月 | 5.18% | 1.06% | 7.72% | 0.91% | -2.54% | 0.15% |
| 过去一年 | 14.39% | 1.05% | 14.83% | 0.92% | -0.44% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.41% | 0.99% | 15.89% | 0.93% | -1.48% | 0.06% |

汇安中证 500 增强 C

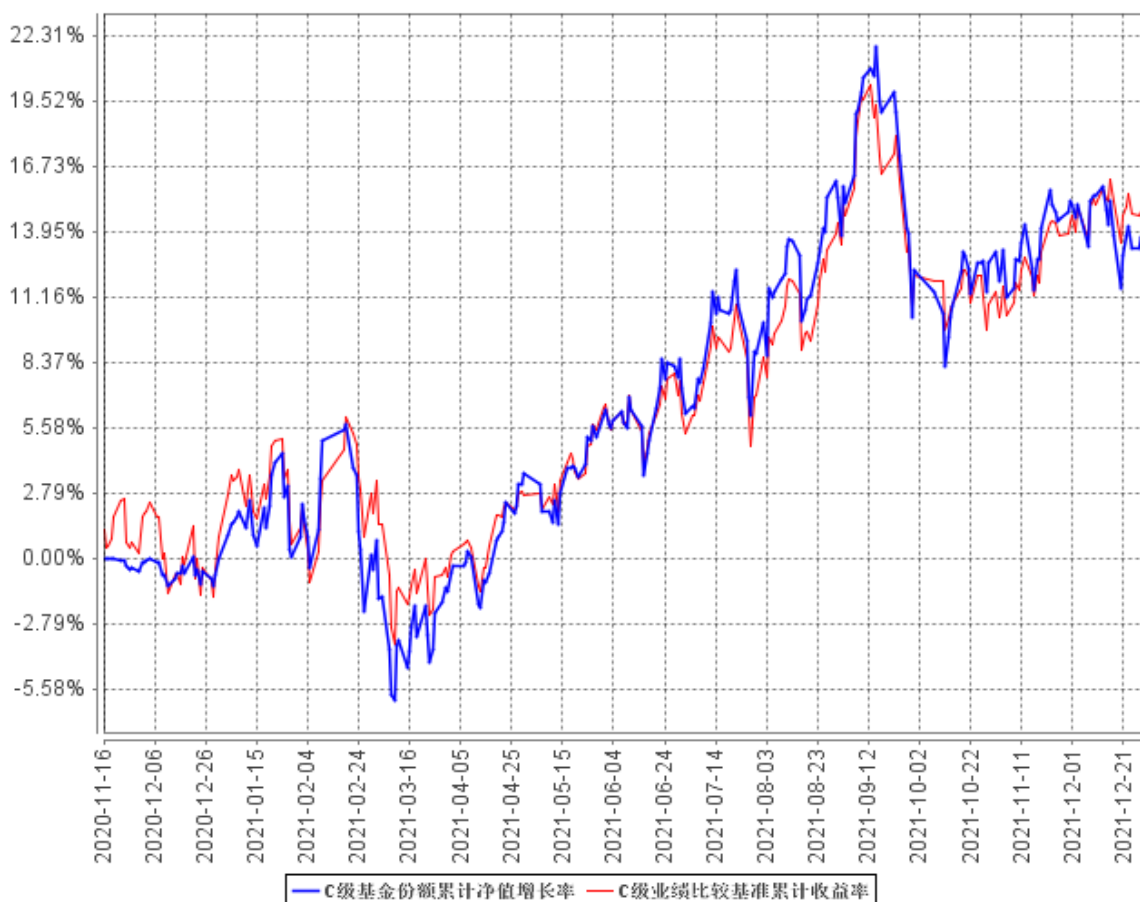
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.45% | 0.89% | 3.43% | 0.72% | -1.98% | 0.17% |
| 过去六个月 | 4.96% | 1.06% | 7.72% | 0.91% | -2.76% | 0.15% |
| 过去一年 | 13.92% | 1.05% | 14.83% | 0.92% | -0.91% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.89% | 0.99% | 15.89% | 0.93% | -2.00% | 0.06% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，本基金合同生效已满一年。

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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | - | 7年 | 朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，7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 6 月 16 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：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与

的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年四季度，国内宏观经济下行压力加大，面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”的三重压力：需求端，国内消费数据持续疲弱，海外疫情缓解导致出口亦或动能不足；供给端，受疫情、碳中和以及长期资本开支不足等因素影响，上游周期品短缺涨价，对中下游企业带来较大冲击；供需两端承压，再叠加外部环境的复杂严峻和不确定性已成共识，致预期转弱。根据当前经济形势，结合年底中央经济工作会议的相关分析表述，稳增长将是接下来国内经济工作的重点，一些政策工具如降准、放松地产融资和实质性促进消费等已经开始实施，且市场对政策托底的预期持续加强；企业自身也开始寻求积极应对，如部分消费品公司开始通过涨价等方式将成本压力向下游传导，带来盈利预期改善；资金层面，股市对增量资金吸引力仍在，市场活跃度长期维持高位，A 股机构化进程加速，公募基金规模不断增加，北上资金年内净流入超 4000 亿元创下历史新高，仅 12 月就净买入逾 800 亿元，其偏好对市场阶段性表现也造成一定影响。在此背景下，四季度的市场风格较前三季度更为均衡，且年底价值风格相对更优，消费股强势反弹，公用事业、地产和基建产业链等板块超额收益也较为明显；而新能源、半导体等高成长景气赛道股整体表现乏力，市场对景气赛道公司竞争格局的判断和筛选也更为严苛。根据宏观环境和市场风格的变化，本基金在四季度的投资管理中适当降低了高景气赛道的配置，增加了部分消费和地产产业链中确定性和成长性较好的标的。

回顾 2021，我们比较深刻地感觉到在目前经济转型期，政策方向的指引对于行业发展、企业经营的重要影响。尤其是双碳和国产化，在目前的政策鼓励之下，考虑到国内外大环境，不仅是在 2021 年，乃至在未来较长一段时间或都将是 A 股市场重要的投资主线。2021 年二季度之后，我们对经济形势的加速下行、对双碳等政策的执行程度预期不足，未能及时调整组合配置，尤其是对中证 500 中占比较高的周期股配置不足，导致全年超额收益表现不佳，值得反思。展望 2022 年，上述长期赛道的阶段性的回调并不改变其中优质公司的长期投资价值，但随着过去两年的市场热捧，后续选股难度将不可避免的加大，需要对细分领域的竞争格局变化进行动态跟踪，边际的变化将尤为重要。我们判断板块的估值扩张在 2022 年比较难看到，更多的需要找个股业绩增长的逻辑。除了上述两大主线，稳增长带来的投资加码和消费回暖也将有不错的机会，其中一些盈利能力佳、竞争壁垒高的核心资产在经过过去一年较为平淡的股价表现之后，2022 年有望受益于经济回暖。整体来看，市场或仍然是结构性行情为主，但鉴于高景气赛道和核心资产可能出现的此消彼长，类似 2021 年较为极端的分化情况或较难出现，中证 500 指数作为中盘成长股的代表指

数，兼具成长和价值属性，在目前市场环境下，有望延续 2021 年的相对收益表现。我们也将继续沿着基本面量化的配置思路，优选标的，力争获得中长期超越基准的投资回报。

4.5 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 1.1441 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 3.43%；截至本报告期末汇安中证 500 增强 C 基金份额净值为 1.1389 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准收益率为 3.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 188,928,115.85 | 91.22 |
| | 其中：股票 | 188,928,115.85 | 91.22 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 121,000.00 | 0.06 |
| | 其中：债券 | 121,000.00 | 0.06 |
| | 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 | 17,519,279.49 | 8.46 |
| 8 | 其他资产 | 552,714.98 | 0.27 |
| 9 | 合计 | 207,121,110.32 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,773,290.00 | 1.37 |
| B | 采矿业 | 2,710,751.00 | 1.34 |
| C | 制造业 | 115,646,191.68 | 57.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,406,952.00 | 1.69 |
| E | 建筑业 | 2,444,918.21 | 1.21 |
| F | 批发和零售业 | 3,804,423.00 | 1.88 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,143,924.00 | 1.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | 687,219.00 | 0.34 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,629,370.00 | 5.26 |
| J | 金融业 | 2,807,873.00 | 1.39 |
| K | 房地产业 | 2,097,044.35 | 1.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,205,857.00 | 1.09 |
| 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 | 2,598,333.00 | 1.29 |
| S | 综合 | 388,167.00 | 0.19 |
| | 合计 | 154,344,313.24 | 76.34 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 31,785,127.67 | 15.72 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 4,713.80 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 51,891.51 | 0.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 25,722.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术 | 2,201,878.79 | 1.09 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| | 术服务业 | | |
| J | 金融业 | 69,749.68 | 0.03 |
| 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 | 360,100.99 | 0.18 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 23,941.95 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,161.78 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 37,906.44 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 34,583,802.61 | 17.11 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000999 | 华润三九 | 152,300 | 5,214,752.00 | 2.58 |
| 2 | 601636 | 旗滨集团 | 246,900 | 4,221,990.00 | 2.09 |
| 3 | 603707 | 健友股份 | 100,388 | 4,216,296.00 | 2.09 |
| 4 | 000739 | 普洛药业 | 120,000 | 4,210,800.00 | 2.08 |
| 5 | 002557 | 洽洽食品 | 62,900 | 3,859,544.00 | 1.91 |
| 6 | 300253 | 卫宁健康 | 220,000 | 3,687,200.00 | 1.82 |
| 7 | 002340 | 格林美 | 350,500 | 3,627,675.00 | 1.79 |
| 8 | 603589 | 口子窖 | 50,000 | 3,543,500.00 | 1.75 |
| 9 | 002191 | 劲嘉股份 | 200,000 | 3,026,000.00 | 1.50 |
| 10 | 000012 | 南玻 A | 300,000 | 2,979,000.00 | 1.47 |

5.3.2 报告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前五名股票投资 明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002129 | 中环股份 | 70,000 | 2,922,500.00 | 1.45 |
| 2 | 603055 | 台华新材 | 174,800 | 2,809,036.00 | 1.39 |
| 3 | 600577 | 精达股份 | 359,500 | 2,674,680.00 | 1.32 |
| 4 | 002074 | 国轩高科 | 50,000 | 2,562,500.00 | 1.27 |
| 5 | 600460 | 士兰微 | 44,900 | 2,433,580.00 | 1.20 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 121,000.00 | 0.06 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 121,000.00 | 0.06 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|------------|--------------|
| 1 | 113638 | 台 21 转债 | 1,210 | 121,000.00 | 0.06 |

注：本基金本报告期末仅持有以上 1 只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明 细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 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） | | | | | 57,800.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 0.00 |

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的健友股份在编制日前一年内受到过监管部门处罚。经过审慎研究分析，上述公司业绩良好，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，上述主体发行的证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。

5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,678.04 |
| 5 | 应收申购款 | 551,036.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 552,714.98 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇安中证 500 增强 A | 汇安中证 500 增强 C |
|----------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 121,732,774.19 | 78,726,068.08 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 16,459,766.36 | 27,834,499.85 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 28,227,973.31 | 39,514,547.22 |

| | | |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 109,964,567.24 | 67,046,020.71 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇安中证 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托管协议
- 4、汇安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36 层 02-03 室

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，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。

公司网站：<http://www.huianfund.cn/>

汇安基金管理有限责任公司

2022 年 1 月 24 日