
汇安沪深300指数增强型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至2022年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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07月03日
报告期末基金份额总额	222,513,954.62份
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。	
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	
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	94,802,712.94份	127,711,241.68份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日)	
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
1. 本期已实现收益	-4,835,744.90	-5,833,020.86
2. 本期利润	16,460,643.47	19,224,240.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1727	0.1573
4. 期末基金资产净值	162,870,387.33	201,926,633.11
5. 期末基金份额净值	1.7180	1.5811

- 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

汇安沪深300增强A净值表现

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	11.05%	1.48%	5.93%	1.36%	5.12%	0.12%

月						
过去六个月	-8.00%	1.54%	-8.72%	1.38%	0.72%	0.16%
过去一年	-14.62%	1.34%	-13.40%	1.18%	-1.22%	0.16%
过去三年	54.03%	1.32%	16.70%	1.20%	37.33%	0.12%
自基金合同生效起至今	66.97%	1.27%	30.44%	1.27%	36.53%	0.00%

汇安沪深300增强C净值表现

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	10.94%	1.48%	5.93%	1.36%	5.01%	0.12%
过去六个月	-8.18%	1.54%	-8.72%	1.38%	0.54%	0.16%
过去一年	-14.96%	1.34%	-13.40%	1.18%	-1.56%	0.16%
过去三年	52.15%	1.32%	16.70%	1.20%	35.45%	0.12%
自基金合同生效起至今	63.67%	1.27%	30.44%	1.27%	33.23%	0.00%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇安沪深300增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年07月03日-2022年06月30日)



汇安沪深300增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年07月03日-2022年06月30日)



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券 从 业 年 限	
		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- 08-22	-	7 年	朱晨歌先生，复旦大学理论物理硕士，7年证券、基金行业从业经验。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基金经理一职。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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A股市场反弹较为强势。尤其是4月底之后，随着疫情边际改善，市场持续上涨，且呈现出板块轮动的趋势，新能源等景气赛道热度不减，稳增长概念的地产、消费等板块也开始回暖。市场反弹的背后是宏观经济基本面发生的积极变化，上海等地疫情的好转与复工复产是最直观的边际改善，稳增长政策的持续推出对经济的托底作用也开始逐渐显现：具体来看，5月社融数据超市场预期，6月亦有望延续，流动性水平维持高位，经济活动整体回暖；地产销售数据同样边际改善，5月竣工和销售面积年内首次环比转正，同比降幅也持续收窄；汽车、家电等行业纷纷出台强刺激政策，尤其是新能源车相关的刺激补贴持续超预期，下半年需求有望维持高位；消费方面，随着疫情得到较好控制，国内防疫政策也有进一步的放松，餐饮、旅游等消费场景的恢复也将带动整个居民消费的复苏。海外方面，虽然联储加息节奏加快，全球流动性收紧，美股走弱，但国内当前政策经济环境对资本市场较为友好，流动性充裕，叠加基本面改善，使得A股也走出了独立行情，外资也呈现出持续流入之势，进一步推升了市场的积极情绪。

展望后市，三季度将是年内经济复苏的关键一季，有望是全年GDP增速高点。目前市场动能仍在，高景气赛道在政策加持下业绩增速保持在高位，仍具有较强进攻性；而消费、地产链等景气度出现拐点的优质公司，我们在偏左侧布局的过程中积累了较高的安全边际，随着经济回暖，也有望迎来业绩和估值的双重修复，值得继续重视。一个潜在风险在于本轮疫情毒株变异较快，传播力强，短期或有所反复，但随着防疫政策的优化和防疫经验的积累，或将尽可能降低疫情对经济活动的影响。作为本基金的管理人，我们将继续坚持汇安基本面量化的投资理念，力争战胜基准指数，为投资者创造更好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安沪深300增强A基金份额净值为1.7180元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.05%，同期业绩比较基准收益率为5.93%；截至报告期末汇安沪深300增强C基金份额净值为1.5811元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.94%，同期业绩比较基准收益率为5.93%。

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	339,148,513.54	91.46
	其中：股票	339,148,513.54	91.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	139,577.82	0.04
	其中：债券	139,577.82	0.04
	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	30,778,826.79	8.30
8	其他资产	731,207.46	0.20
9	合计	370,798,125.61	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	12,404,752.00	3.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	166,647,255.43	45.68
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	6,936,000.00	1.90
E	建筑业	2,491,402.00	0.68
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,510,000.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	6,972,523.36	1.91

J	金融业	57,339,000.60	15.72
K	房地产业	15,204,148.00	4.17
L	租赁和商务服务业	6,894,728.00	1.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,336,000.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	280,735,809.39	76.96

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	1,349,628.66	0.37
C	制造业	42,110,861.34	11.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,898,000.00	0.79
F	批发和零售业	79,573.94	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	15,222.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,354,726.01	1.74
J	金融业	4,762,176.00	1.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,850.41	0.00
M	科学研究和技术服务业	457,690.35	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	190,303.09	0.05
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	164,099.41	0.04
R	文化、体育和娱乐业	19,572.94	0.01
S	综合	-	-
	合计	58,412,704.15	16.01

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,500	23,517,500.00	6.45
2	000858	五粮液	73,000	14,740,890.00	4.04
3	600036	招商银行	325,000	13,715,000.00	3.76
4	300750	宁德时代	25,400	13,563,600.00	3.72
5	300059	东方财富	500,000	12,700,000.00	3.48
6	002129	TCL中环	186,500	10,982,985.00	3.01
7	002142	宁波银行	296,540	10,619,097.40	2.91
8	002714	牧原股份	188,500	10,418,395.00	2.86
9	600809	山西汾酒	26,500	8,607,200.00	2.36
10	002466	天齐锂业	66,000	8,236,800.00	2.26

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300911	亿田智能	100,000	7,685,000.00	2.11
2	603613	国联股份	61,470	5,446,242.00	1.49
3	600563	法拉电子	25,000	5,129,000.00	1.41
4	603055	台华新材	395,900	4,972,504.00	1.36
5	603323	苏农银行	933,760	4,762,176.00	1.31

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）	139,577.82	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	139,577.82	0.04

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	127045	牧原转债	1,082	139,577.82	0.04

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

本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 本基金投资的招商银行、宁波银行、东方财富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	50,843.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	680,364.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	731,207.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	---------	--------------

1	127045	牧原转债	139,577.82	0.04
---	--------	------	------------	------

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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

	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
报告期期初基金份额总额	94,001,082.91	121,700,181.84
报告期期间基金总申购份额	5,629,370.26	18,708,562.32
减：报告期期间基金总赎回份额	4,827,740.23	12,697,502.48
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	94,802,712.94	127,711,241.68

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安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托管协议
- (5) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (7) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (8) 中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

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

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2022年07月21日