

汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 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
交易代码	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
报告期末基金份额总额	308,756,868.89 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	112,259,298.62 份	196,497,570.27 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（2020年7月1日—2020年9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	8,150,294.01	11,390,519.18
2. 本期利润	20,608,170.52	22,204,693.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1938	0.1297
4. 期末基金资产净值	188,739,347.70	306,173,319.16
5. 期末基金份额净值	1.6813	1.5582

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

汇安沪深 300 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
过去三个月	12.50%	1.57%	9.69%	1.53%	2.81%	0.04%
过去六个月	36.31%	1.33%	23.17%	1.26%	13.14%	0.07%
过去一年	42.86%	1.40%	19.31%	1.32%	23.55%	0.08%
自基金合同生效起	63.41%	1.24%	33.02%	1.34%	30.39%	-0.10%

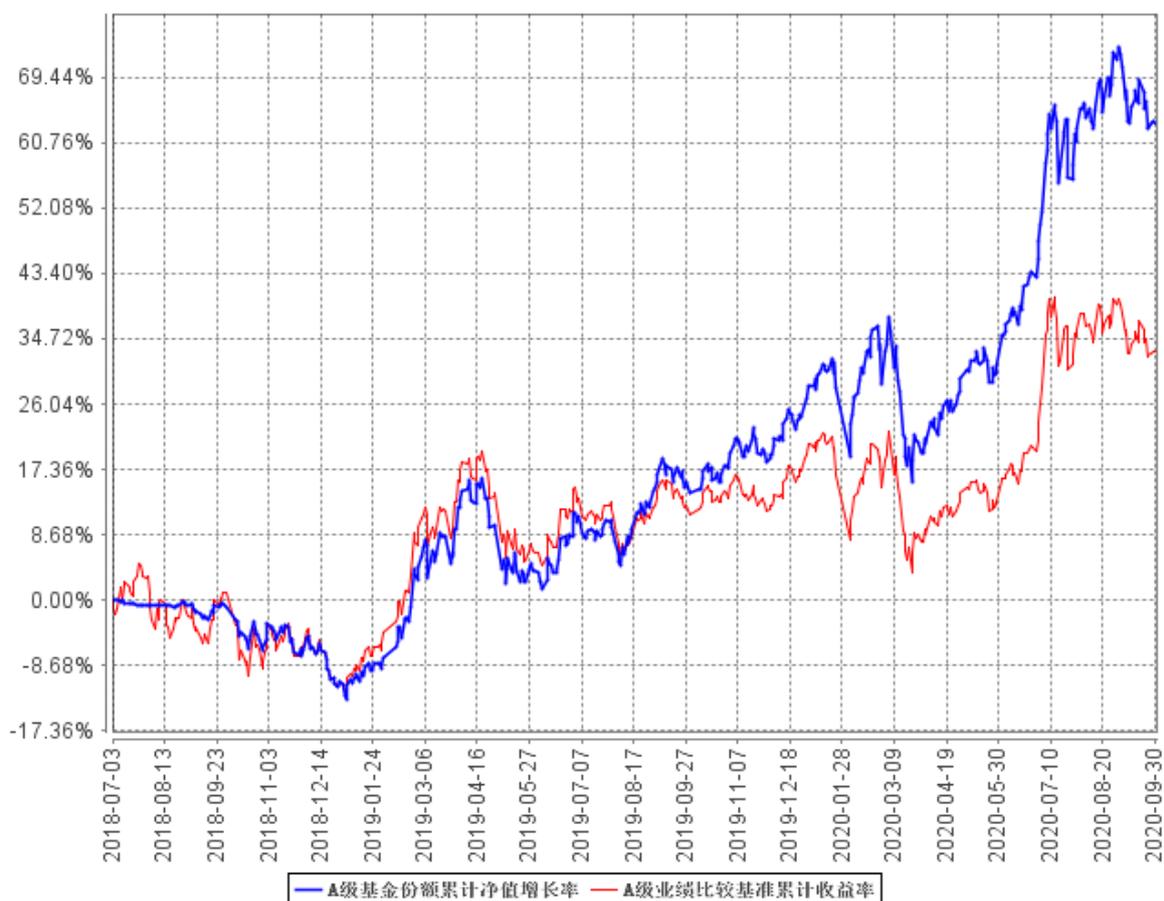
至今						
----	--	--	--	--	--	--

汇安沪深 300 增强 C

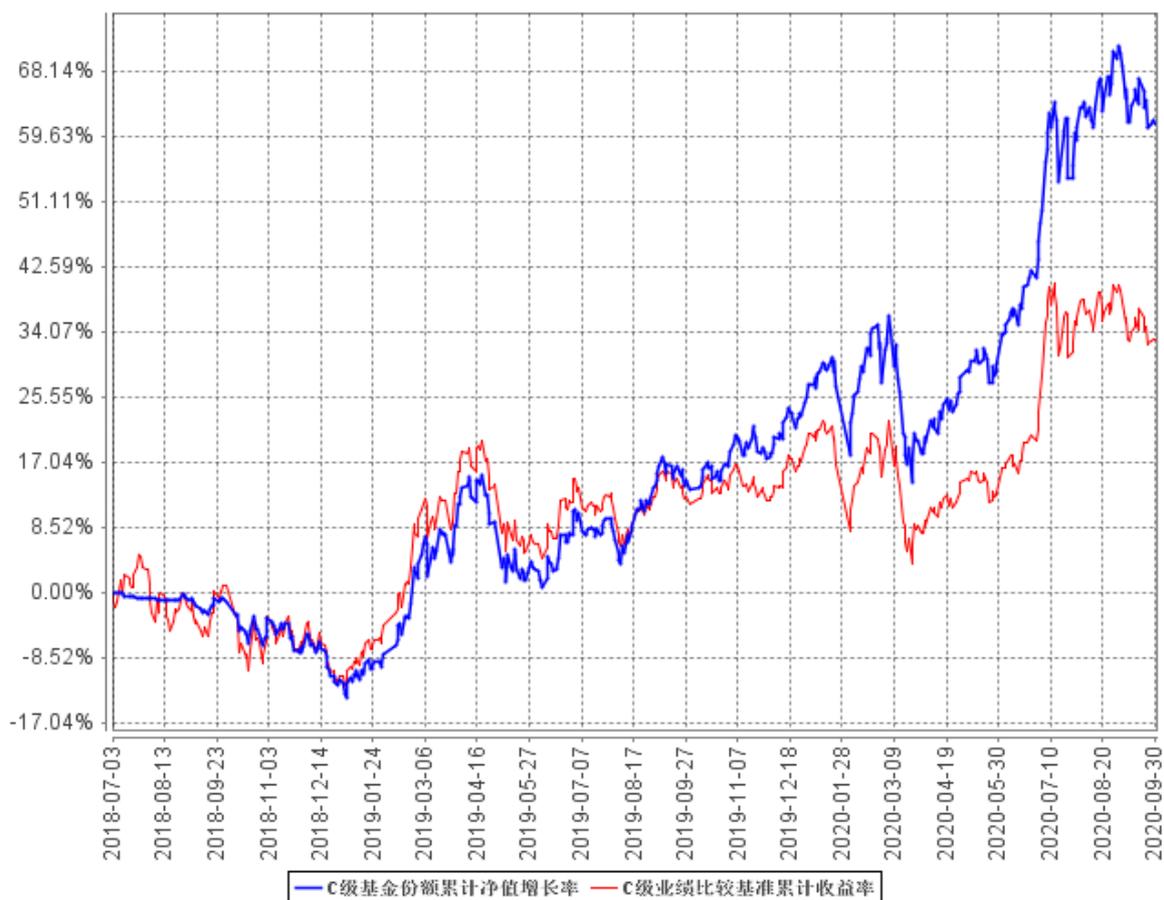
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个 月	12.39%	1.57%	9.69%	1.53%	2.70%	0.04%
过去六个 月	36.06%	1.33%	23.17%	1.26%	12.89%	0.07%
过去一年	42.30%	1.40%	19.31%	1.32%	22.99%	0.08%
自基金合 同生效起 至今	61.30%	1.24%	33.02%	1.34%	28.28%	-0.10%

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：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	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；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；2019 年 12 月 24 日至今，任汇安宜创量化精

					选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。
--	--	--	--	--	--

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

三季度，受益于整体疫情防控得当和经济逐步回暖，A 股权益市场呈现震荡上行格局。尤其

是 7 月初，在流动性宽松预期下，市场表现火热，交投活跃，呈现出普涨态势。上证综指突破 3400 点，其余主流指数均录得较大涨幅，投资者情绪也较为高涨。随后，市场进入窄幅震荡节奏，更多的是结构性机会。现阶段，市场走势主要受以下因素影响：首先，疫情国内控制较好，国内经济数据印证复苏逻辑，企业基本面改善仍将是投资机会的最主要来源。海外疫情仍有部分地区较为严重，且随着天气转冷有反复趋势，疫苗研制进度将较大程度影响全球经济复苏节奏；其次，从资金面来看，流动性仍将保持适度宽松，新发公募和北上资金等增量资金仍将对市场流动性提供一定支撑；美国大选对全球市场表现都将产生一定影响，但不是主要矛盾。

展望四季度，受益于经济复苏，金融地产等顺周期板块有望获得超额收益；而中长期来看，A 股大类资产配置需求提升的逻辑仍将长期成立，在经济转型背景下，代表新的经济方向的消费/科技/医药等相关板块的优质龙头公司仍将是我们的长期关注的方向。作为汇安沪深 300 增强基金的管理人，我们将继续勤勉尽责，通过量化选股模型优选标的，力争为投资者获得超越基准的收益回报。

4.5 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 1.6813 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.50%；截至本报告期末汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.5582 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.39%；同期业绩比较基准收益率为 9.69%。

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，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	466,233,341.88	93.78
	其中：股票	466,233,341.88	93.78
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	30,020,432.37	6.04
8	其他资产	912,058.79	0.18
9	合计	497,165,833.04	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	2,960,000.00	0.60
B	采矿业	4,305,000.00	0.87
C	制造业	187,048,979.41	37.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,827,913.00	0.77
E	建筑业	4,902,708.00	0.99
F	批发和零售业	3,705,000.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	12,541,400.00	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,598,395.02	2.14
J	金融业	98,805,558.40	19.96
K	房地产业	19,341,000.00	3.91
L	租赁和商务服务业	12,261,700.00	2.48
M	科学研究和技术服务业	1,421,000.00	0.29
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	6,040,448.00	1.22
R	文化、体育和娱乐业	5,392,000.00	1.09
S	综合	-	-
	合计	373,151,101.83	75.40

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	75,641,818.17	15.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,947,029.12	0.39
F	批发和零售业	28,264.03	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	20,921.08	0.00
H	住宿和餐饮业	1,775,000.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,254,752.69	0.66
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	1,103,813.40	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	4,375,031.56	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,269,610.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	1,666,000.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	93,082,240.05	18.81

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前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	320,000	24,403,200.00	4.93
2	600519	贵州茅台	12,000	20,022,000.00	4.05
3	600036	招商银行	430,000	15,480,000.00	3.13

4	601888	中国中免	55,000	12,261,700.00	2.48
5	000002	万科 A	350,000	9,807,000.00	1.98
6	600048	保利地产	600,000	9,534,000.00	1.93
7	000333	美的集团	130,000	9,438,000.00	1.91
8	600030	中信证券	308,400	9,261,252.00	1.87
9	600309	万华化学	131,218	9,093,407.40	1.84
10	600009	上海机场	130,000	8,941,400.00	1.81

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	300573	兴齐眼药	35,000	4,720,100.00	0.95
2	603700	宁水集团	139,910	4,407,165.00	0.89
3	603195	公牛集团	29,059	4,387,909.00	0.89
4	300070	碧水源	500,000	4,350,000.00	0.88
5	002541	鸿路钢构	100,000	4,230,000.00	0.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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。

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	103,772.37
2	应收证券清算款	146,737.65
3	应收股利	-
4	应收利息	6,788.96
5	应收申购款	654,759.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	912,058.79

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	110,959,322.77	112,938,387.29
报告期期间基金总申购份额	53,809,966.49	168,371,315.30
减：报告期期间基金总赎回份额	52,509,990.64	84,812,132.32
报告期期末基金份额总额	112,259,298.62	196,497,570.27

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产投资本基金。

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产投资本基金。

§ 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、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36 层 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

2020 年 10 月 28 日