

# 汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 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：2019 年 10 月 22 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 2019 年 10 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 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 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	190,990,790.96 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	144,085,189.82 份	46,905,601.14 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（2019年7月1日—2019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	6,190,786.58	1,849,368.45
2. 本期利润	7,041,089.01	2,869,343.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0603	0.0915
4. 期末基金资产净值	169,575,420.48	51,359,495.03
5. 期末基金份额净值	1.1769	1.0950

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 本报告期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

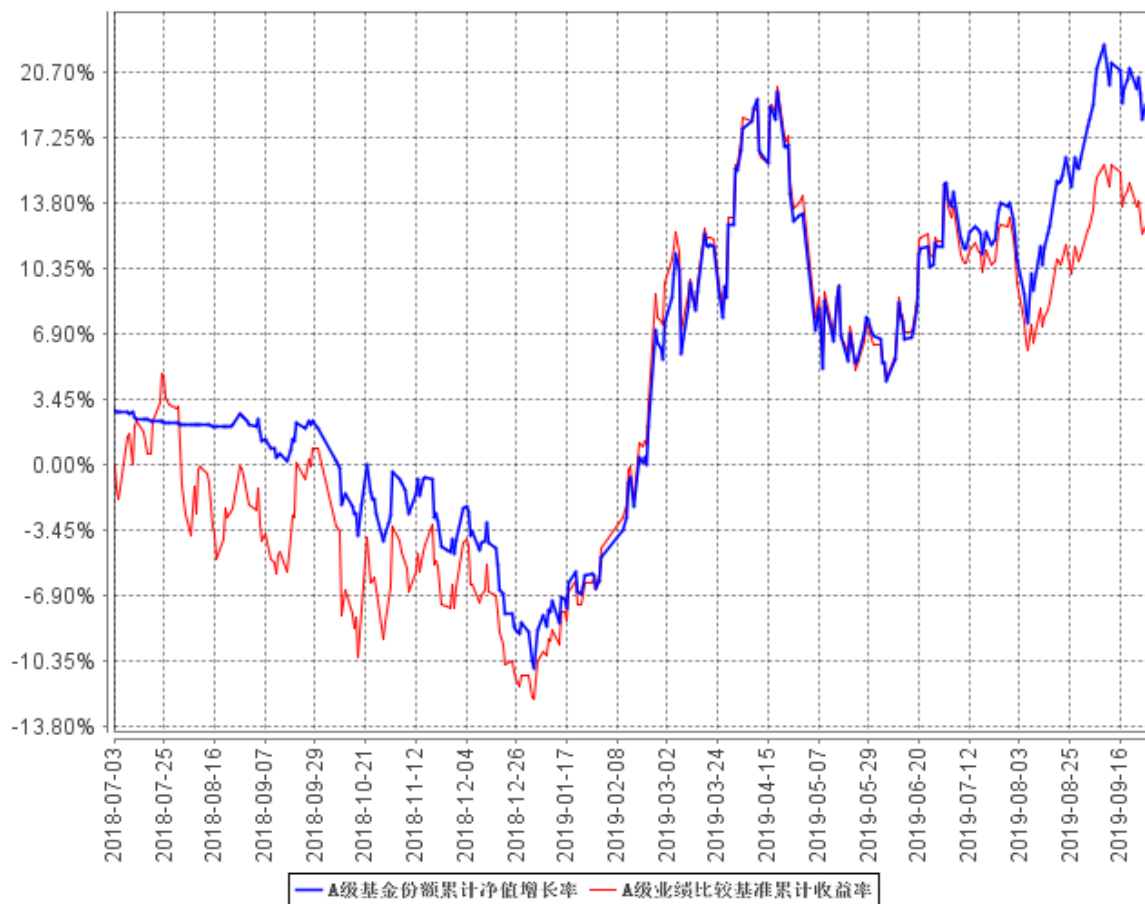
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.51%	0.97%	-0.26%	0.91%	5.77%	0.06%

###### 汇安沪深 300 增强 C

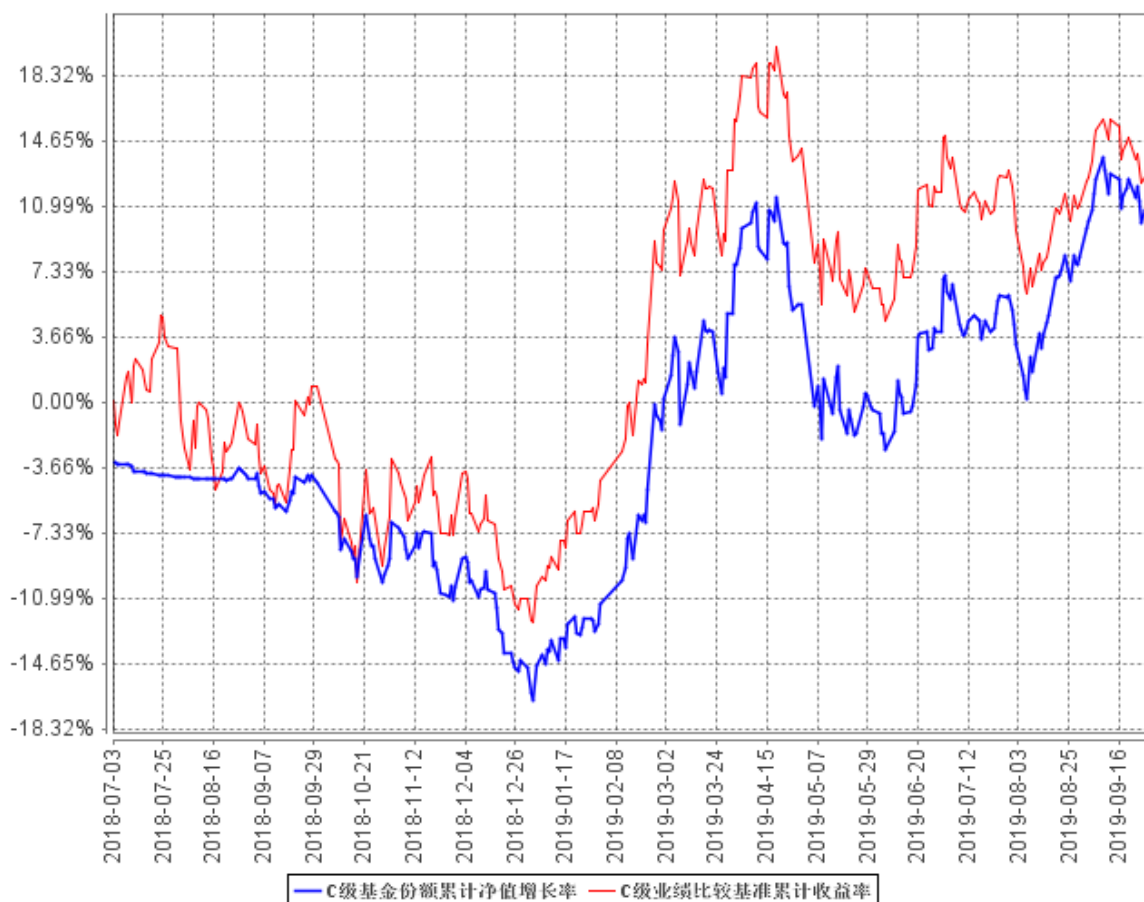
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.37%	0.97%	-0.26%	0.91%	5.63%	0.06%

### 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本基金实施转型日为 2018 年 7 月 3 日，至本报告期末，本基金实施转型未满一年。

②根据《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于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）、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：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。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 2018 年 7 月 3 日至 2019 年 1 月 2 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		
计伟	指数与量化投资部副总经理、本基金的基金经理	2018 年 1 月 11 日	2019 年 7 月 19 日	12 年	计伟, ACCA, 工商管理硕士, 12 年证券、基金行业从业经历, 曾任中国国际金融有限公司运作分析师; 华安基金管理有限公司指数与量化投资事业总部专户投资经理、公募基金经理与事业部产品负责人, 同时担任华安基金风险管理委员会委员。2016 年 7 月 1 日加入汇安基金管理有限责任公司, 任指数与量化投资部副总经理一职。2018 年 1 月 11 日至 2018 年 7 月 2 日, 任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 3 月 7 日至 2019 年 4 月 4 日, 任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 4 月 2 日至 2019 年 4 月 4 日, 任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理; 2017 年 9 月 6 日至 2019 年 7 月 19 日, 任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 7 月 3 日至 2019 年 7 月 19 日, 任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理; 2018 年 12 月 21 日至 2019 年 7 月 19 日, 任富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
朱晨歌	指数与量化投资部高	2018 年 8 月 22 日	-	4 年	朱晨歌, 复旦大学理论物理硕士, 4 年证券、基金行业从业经历, 曾任华安基金管

	<p>级经理、 本基金的 基金经理</p>			<p>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 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 2 月 8 日至今，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 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。</p>
--	-------------------------------	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，市场呈现震荡走势。宏观经济仍在筑底过程中，二季度以来主要经济数据下行，供给侧改革带来的产能收缩仍在继续，减税降费等政策对提高企业盈利和居民收入有正向贡献，但仍不足以对冲经济下行周期。另外，中美贸易谈判有所反复，受此影响，人民币汇率持续承压，外资一度呈流出态势。作为目前对 A 股影响最大的外部因素，贸易摩擦的不确定性，对投资者的风险偏好有明显影响。

展望后市，近期的中央政治局会议确立了逆周期调控政策的延续，符合市场预期，LPR 改革引导实体经济利率下行，将有助于提升权益市场估值水平；在最新一轮中美贸易谈判中，双方取得实质性进展，外部环境得到改善。但中长期来看，决定市场能否转暖的核心因素仍然是经济和企业盈利的复苏，作为市场领先指标，在当前时点，社融、基建投资增速和 PMI 已经企稳，企业盈利有望见底回升。从结构上来看，在金融供给侧改革的大背景下，各个行业的龙头股马太效应将愈发明显。传统意义上的优质白马蓝筹的核心资产仍然享受估值溢价，在不确定性较大的市场环境中仍然值得配置；另外，5G 引领下的新一轮科技周期的开启有望成为影响宏观经济和资本市场新的重要力量，科创板的推出也将对科技股的估值修复有提振作用，需要自下而上精选质地优良、估值合理的标的。作为汇安沪深 300 增强基金的管理人，我们将勤勉尽责，力争为投资者获得持续稳定的超额收益。

## 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 1.1769 元，净值增长率 5.51%；汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.0950，净值增长率 5.37%；业绩比较基准收益率-0.26%。

## 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	204,330,947.61	92.15
	其中：股票	204,330,947.61	92.15
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	15,613,577.43	7.04
8	其他资产	1,790,491.86	0.81
9	合计	221,735,016.90	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	2,728,040.00	1.23
B	采矿业	2,491,634.00	1.13
C	制造业	83,614,829.58	37.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,264,378.00	1.02
E	建筑业	2,596,770.00	1.18
F	批发和零售业	2,342,242.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,525,540.00	2.50

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,142,700.00	2.33
J	金融业	55,644,346.00	25.19
K	房地产业	6,984,924.00	3.16
L	租赁和商务服务业	3,780,900.00	1.71
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	1,276,704.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	174,393,007.58	78.93

### 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	19,447,304.63	8.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,855,944.00	0.84
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	7,567,241.40	3.43
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	757,200.00	0.34
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	310,250.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,937,940.03	13.55

### 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	171,500	14,927,360.00	6.76
2	600519	贵州茅台	8,700	10,005,000.00	4.53
3	600036	招商银行	188,400	6,546,900.00	2.96
4	000661	长春高新	12,000	4,732,320.00	2.14
5	000651	格力电器	80,100	4,589,730.00	2.08
6	600009	上海机场	55,000	4,387,900.00	1.99
7	000333	美的集团	84,800	4,333,280.00	1.96
8	601398	工商银行	768,800	4,251,464.00	1.92
9	600276	恒瑞医药	50,120	4,043,681.60	1.83
10	600887	伊利股份	138,800	3,958,576.00	1.79

#### 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	000860	顺鑫农业	66,000	3,442,560.00	1.56
2	300573	兴齐眼药	40,000	3,029,200.00	1.37
3	600584	长电科技	120,000	2,065,200.00	0.93
4	000977	浪潮信息	80,000	2,056,000.00	0.93
5	603368	柳药股份	51,900	1,855,944.00	0.84

### 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

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
IF1910	IF1910	2	2,293,320.00	-51,120.00	-
IF1912	IF1912	2	2,290,800.00	-53,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-105,000.00
股指期货投资本期收益(元)					542,539.81
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-201,456.00

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

因股指期货合约有较大贴水，本基金本报告期内择机做多了沪深 300 股指期货，用以获取基差收敛的确定性收益，同时代替部分股票仓位，留出更多灵活现金。相关投资对本基金总体风险影响可控，符合产品既定投资政策和投资目标。

## 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	688,218.40
2	应收证券清算款	1,029,873.35
3	应收股利	-
4	应收利息	6,811.77
5	应收申购款	65,588.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,790,491.86

### 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。

#### 5.11.5.3 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	60,156,669.07	5,361,938.18
报告期期间基金总申购份额	109,233,462.59	45,566,370.89

减: 报告期期间基金总赎回份额	25,304,941.84	4,022,707.93
报告期期末基金份额总额	144,085,189.82	46,905,601.14

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

报告期内, 基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内, 基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190703-20190806	-	30,460,400.35	-	30,460,400.35	15.9486%
个人	1	20190701-20190801	23,663,649.29	-	-	23,663,649.29	12.3899%

#### 产品特有风险

本基金本报告期内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, 投资人在投资本基金时, 可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险, 具体包括: 巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理, 保护中小投资者利益。

## § 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

2019 年 10 月 22 日