
富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

2022年第4季度报告

2022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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月19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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1月18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10月1日起至2022年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	A50ETF
场内简称	A50ETF
基金主代码	512150
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018年12月21日
报告期末基金份额总额	44,073,350.00份
投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，力求实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债的投资策略、资产支持证券的投资策略、衍生品投资策略、融资及转融通证券出借、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的标的指数为富时中国A50指数，业绩比较基准为富时中国A50指数收益率。
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，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指

	数所代表的股票市场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	中国工商银行股份有限公司

§ 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10月01日 - 2022年12月31日）
1. 本期已实现收益	-2,905,107.25
2. 本期利润	1,411,567.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0273
4. 期末基金资产净值	66,346,250.28
5. 期末基金份额净值	1.5054

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

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	2.03%	1.51%	0.74%	1.50%	1.29%	0.01%
过去六个月	-10.79%	1.22%	-13.15%	1.23%	2.36%	-0.01%
过去一年	-14.71%	1.32%	-17.16%	1.35%	2.45%	-0.03%
过去三年	12.76%	1.31%	-9.59%	1.36%	22.35%	-0.05%
自基金合同生效起至今	50.54%	1.26%	22.74%	1.33%	27.80%	-0.07%

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

富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金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12月21日-2022年12月31日)



注：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	2019-06-14	—	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20

					19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；2019年3月13日至2022年12月22日，任汇安丰裕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。
--	--	--	--	--	----

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

无

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年四季度，长期影响A股表现的国内外环境出现了一系列积极变化。二十大的胜利召开，中国式现代化的宏伟目标振奋人心；大会后针对国内疫情防控和地产等相关政策的优化调整，在力度和节奏上一定程度上超出市场预期，对后续基本面的改善以及明年经济复苏的信心也有很大提振作用；海外方面，随着美国通胀水平下行，经济热度减退，美联储加息节奏继续放缓是大概率事件，有助于全球非美元资产的估值重构。上述背景下，四季度消费、地产等板块表现抢眼，而景气赛道由于资金切换以及短期政策、业绩真空的因素，持续表现低迷。整体来看，市场情绪回暖较为明显，资金交易量、活跃度都明显提升。不过，即使经过了这一波反弹，市场整体估值仍处于低位，大部分行

业经历了回调之后动态估值处于历史较低分位数水平。在明年经济复苏较为确定的预期下，市场有望迎来业绩和估值的双重修复。

展望2023年，我们将继续结合行业景气度和个股竞争格局两个维度寻找投资机会。从景气度边际改善的角度来看，经历了疫情三年的影响，中国经济在稳增长政策逐步推出和落地的过程中有望进一步复苏，顺周期将是今年确定性较强的方向，如消费、医药、地产链等；另一方面，在当今国际地缘政治的深刻变革之下，未来我国的高质量发展与安全并重将是长期逻辑，因此拥有技术优势、成本优势、市场优势的科技龙头企业仍然是我们长期关注的对象。新能源、半导体、计算机、军工等板块作为传统的高景气赛道代表，在新的一年里需要甄别行业高景气与个股高增之间的关系，尽量找出同时受益于行业增长与竞争格局优化后市场份额提升的优质龙头公司。整体来看，A股目前的底部特征较为明显，对于2023年的权益投资，我们认为可以比过去的一年更加乐观一些，积极布局估值具有安全边际且业绩增长有保障的优质标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末A50ETF基金份额净值为1.5054元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.03%，同期业绩比较基准收益率为0.74%。

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	64,468,312.81	95.70
	其中：股票	64,468,312.81	95.70
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,931.22	0.00
	其中：债券	1,931.22	0.00
	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	2,424,165.39	3.60
8	其他资产	470,003.71	0.70
9	合计	67,364,413.13	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	545,415.00	0.82
B	采矿业	3,361,468.00	5.07
C	制造业	30,471,239.38	45.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	443,100.00	0.67
E	建筑业	759,657.00	1.14
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	530,450.00	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	22,762,850.25	34.31
K	房地产业	1,394,120.00	2.10
L	租赁和商务服务业	1,771,446.00	2.67
M	科学研究和技术服务业	243,000.00	0.37
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	62,282,745.63	93.88

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	1,817,660.77	2.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,312.23	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,379.04	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	220,440.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,450.72	0.01
J	金融业	18,956.45	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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,671.25	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	42,696.72	0.06
S	综合	-	-
	合计	2,185,567.18	3.29

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,900	8,462,300.00	12.75
2	600036	招商银行	136,800	5,097,168.00	7.68
3	000858	五 粮 液	18,000	3,252,420.00	4.90
4	601318	中国平安	63,400	2,979,800.00	4.49
5	601166	兴业银行	158,300	2,784,497.00	4.20
6	002594	比亚迪	7,700	1,978,669.00	2.98
7	300750	宁德时代	4,887	1,922,643.54	2.90
8	000568	泸州老窖	8,300	1,861,524.00	2.81
9	600887	伊利股份	58,400	1,810,400.00	2.73
10	601012	隆基绿能	42,196	1,783,202.96	2.69

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	600436	片仔癀	2,600	749,996.00	1.13
2	600585	海螺水泥	17,200	470,936.00	0.71
3	601816	京沪高铁	39,800	195,816.00	0.30
4	688320	禾川科技	1,782	83,397.60	0.13
5	001270	铖昌科技	568	69,296.00	0.10

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）	1,931.22	0.00
8	同业存单	—	—

9	其他	-	-
10	合计	1,931.22	0.00

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	16	1,931.22	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金投资的招商银行、比亚迪、兴业银行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	4,874.25
2	应收证券清算款	465,129.46
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	470,003.71

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	1,931.22	0.00

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未存在流通受限情况。

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未存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	53,073,350.00
报告期期间基金总申购份额	8,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	17,000,000.00
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	44,073,350.00

§ 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) 中国证监会批准富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (2) 《富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (4) 《富时中国A50交易型开放式指数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) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (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

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

2023年01月19日