汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:**2019** 年 **08** 月 **29** 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 半年度财务会计报告(未经审计) 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 20
6.4 报表附注 22
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
7.6 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 45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 46
7.8 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贵金属投资明细 46
7.9 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 46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 49

§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
10.8 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 53
11.1 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 53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 53
§12 备查文件目录 53
12.1 备查文件目录 53
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信平稳增利债券	
基金主代码	540005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年12月03日	
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	84,218,711.88份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信平稳增利债券A	汇丰晋信平稳增利债券C
下属分级基金的交易代码	540005	541005
报告期末下属分级基金的份额总额	72,120,801.34份	12,097,910.54份

注：本基金自2011年6月7日起增加C类份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势，自上而下进行宏观分析，自下而上精选个券，在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下，获取债券的利息收入及价差收益。通过参与股票一级市场投资，获取新股发行收益，为投资者谋取稳定的当期收益与较高的长期投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在对企业债券进行信用评级的基础上，综合考量企业债券（含公司债、企业短期融资券）的信用评级以及包括其它券种在内的债券流动性、供求关系、收

	益率水平等因素，自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套利操作、新股认购等策略，提高投资组合收益。
业绩比较基准	中债新综合指数收益率（全价）。
风险收益特征	本基金属于债券型基金产品，在开放式基金中，风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币基金和中短债基金，属于中低风险的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	陆志俊
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨小勇	彭纯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼；交通银行股份

	有限公司：中国（上海）长宁区仙霞路18号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	汇丰晋信平稳增利债券A	汇丰晋信平稳增利债券C
本期已实现收益	1,152,638.68	187,634.12
本期利润	1,122,032.71	205,293.09
加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.54%	1.53%
本期基金份额净值增长率	1.65%	1.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	-777,953.90	-242,896.53
期末可供分配基金份额利润	-0.0108	-0.0201
期末基金资产净值	79,979,200.44	13,311,596.40
期末基金份额净值	1.1090	1.1003
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	31.59%	31.60%

注：①本期已实现收益是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期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
③上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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
④本基金自2011年6月7日起分级为A、C类。

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

汇丰晋信平稳增利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.63%	0.05%	0.28%	0.03%	0.35%	0.02%
过去三个月	0.15%	0.06%	-0.24%	0.06%	0.39%	0.00%
过去六个月	1.65%	0.06%	0.24%	0.06%	1.41%	0.00%
过去一年	4.76%	0.07%	2.82%	0.06%	1.94%	0.01%
过去三年	6.03%	0.09%	0.03%	0.08%	6.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	31.59%	0.15%	25.95%	0.07%	5.64%	0.08%

注：
过去一个月指　2019 年 6 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去三个月指　2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去六个月指　2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去一年指　　2018 年 7 月 1 日－2019 年 6 月 30 日
过去三年指　　2016 年 7 月 1 日－2019 年 6 月 30 日
自基金合同生效至今指　2008 年 12 月 3 日－2019 年 6 月 30 日

汇丰晋信平稳增利债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.59%	0.05%	0.28%	0.03%	0.31%	0.02%
过去三个月	0.06%	0.06%	-0.24%	0.06%	0.30%	0.00%
过去六个月	1.48%	0.06%	0.24%	0.06%	1.24%	0.00%
过去一年	4.40%	0.07%	2.82%	0.06%	1.58%	0.01%
过去三年	4.93%	0.09%	0.03%	0.08%	4.90%	0.01%
成立至今	31.60%	0.17%	19.32%	0.07%	12.28%	0.10%

注：
过去一个月指　2019 年 6 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去三个月指　2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去六个月指　2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日
过去一年指　　2018 年 7 月 1 日－2019 年 6 月 30 日
过去三年指　　2016 年 7 月 1 日－2019 年 6 月 30 日
成立至今指　　2011 年 6 月 7 日－2019 年 6 月 30 日

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

注：1. 按照基金合同的约定，本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种，包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等，投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过 6 个月内完成建仓，截止 2009 年 6 月 3 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 基金合同生效日（2008 年 12 月 3 日）至 2014 年 5 月 31 日，本基金业绩比较基准为"中信标普全债指数"。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准调整为"中债新综合指数收益率（全价）"。

注：1. 按照基金合同的约定，本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种，包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等，投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2.本基金份额成立之日起至 2014 年 5 月 31 日，本基金业绩比较基准为"中信标普全债指数"。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准调整为"中债新综合指数收益率（全价）"。

3. 本基金自 2011 年 6 月 7 日起增加 C 类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2019年6月30日，公司共管理20只开放式基金：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金（2006年5月23日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006年9月27日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007年4月9日成立）、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金（2008年7月23日成立）、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金（2008年12月3日成立）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金(2009年6月24日成立)、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(2009

年12月11日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010年6月8日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010年12月8日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011年7月27日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011年11月2日成立）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（2012年8月1日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014年11月26日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015年2月11日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015年9月30日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016年3月11日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016年11月10日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017年6月2日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018年11月14日成立）和汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019年3月20日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李媛媛	投资部固定收益副总监、本基金、汇丰晋信货币市场基金基金经理	2016-06-04	-	14	李媛媛女士，曾任广东发展银行上海分行国际部交易员、法国巴黎银行（中国）有限公司资金部交易员、比利时富通银行上海分行环球市场部交易员和汇丰晋信基金管理有限公司投资经理。现任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金和汇丰晋信货币市场基金基金经理、投资部固定收益副总监。

注：1.任职日期为本基金管理人公告李媛媛女士担任本基金基金经理的日期；
2.2019年7月27日，基金管理人发布公告，聘任蔡若林先生、范力先生担任本基金基金经理，李媛媛女士不再担任本基金基金经理；
3.证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

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《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

本报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各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交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年上半年，一季度GDP增长6.4%， 二季度增长6.2%，上半年GDP累计同比增长6.3%，仍在6.0%-6.5%的预期范围内。2019年第一季度，领先指标1-2月PMI低于50的荣枯分界线以下。3月PMI环比大幅回升至50.5%，中小型企业和大型企业PMI走势分化，说明前期出台的一系列扶持民企的政策初见成效。虽然3月PMI大幅回升至50.5%，但从绝对数来说仍然偏低。第二季度，领先指标中采制造业PMI逐月走低，并且5月和6月PMI均为49.4% 在50的荣枯分界线下。受到前期一系列政府扶持政策的影响，中小型企业和大型企业的PMI分化，但中小型企业的PMI回升幅度有限，仍然在50以下。工业企业利润逐月走低，制造业投资存在压力。基建投资可能成为支撑经济的重要支柱。

CPI方面，受到猪肉、蔬菜、水果价格大幅上升的影响，对通胀造成一定的压力。外汇方面，人民币汇率受到中美贸易摩擦的影响，人民币汇率波动加大。2019年上半年，CFETS人民币汇率指数下跌0.66%。

海外方面，美国经济复苏动能减弱，国债利率持续走低，领先指标PMI连续创下今年来的新低，降息预期升温。欧洲方面，德国制造业PMI连续低于50以下，全球宽松预期升温。

货币市场方面， 2019年1月2日，央行官网公告，自2019年起，将普惠金融定向降准小型和微型企业贷款考核标准由单户授信小于500万元调整为单户授信小于1000万元。这有利于扩大普惠金融定向降准优惠政策的覆盖面，引导金融机构更好的满足小微企业的贷款需求，使更多的小微企业受益。2019年第一季度，银行间总体流动性维持充裕，资金价格维持低位，春节长假前资金价格也没有出现大幅飙升的情况，平稳度过。

2019年第二季度，4月整体流动性偏平稳，5月包商银行事件的爆发，资金面一度收紧。但随着央行连续通过公开市场和MLF的大额净投放，以及提高了SLF的额度，加上定向降准的实施，逐步稳定了市场情绪，整个6月的流动性整体宽松，银行间隔夜回购利率甚至破1%，没有出现以往季末流动性紧张的局面。

回顾2019年上半年的债券市场，尽管国内和国际的大环境都对债券偏友好，但受到股票市场上涨的压制，债券维持震荡整理，没有明显的方向，走势相较2018年略显平淡。截至二季度季末，中债新综合全价（总值）指数单季微涨0.24%。

回顾2019年上半年平稳增利基金的操作，由于一季度权益市场涨势良好，适当增加了转债的仓位，同时，逐步用3年左右的信用债代替利率债，以求获取较高收益。第二季度，转债经过前期的涨幅，积累了一定的收益，适当减少仓位兑现收益。同时，继续用2-3年的高等级信用债代替利率债，以求获取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值变化幅度为1.65%，同期业绩比较基准为0.24%，本基金A类领先同期比较基准为1.41%；本基金C类本报告期内净值变化幅度为1.48%，同期业绩比较基准为0.24%，本基金C类领先同期比较基准为1.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，世界各主要经济体增长均有放缓的压力。美国由于经济放缓，就业数据反复，可能会开启降息周期，而欧元区经济疲弱，欧央行坚持宽松，誓言达成通胀目标。全球经济景气周期下行，叠加中美贸易摩擦，使得外需疲弱，进出口贸易承压。虽然经济下行的速度有所放缓，但是制造业PMI显示经济需求面压力仍存。固定资产投资中的房地产投资，上半年建安/土建投资贡献明显，下半年持续性有待验证，制造业投资，民间投资融资环境虽有改善，但受制于上半年的违约事件，市场信心依然不足。而地方政府投融资的矛盾也在一定程度上制约基建投资增速的回升。我们预计2019年下半年宏观经济仍面临下行趋势，但下行速度放缓，货币政策总体维持稳定偏宽松，央行预计将更多的采用定向的方式替代全面降准向市场提供流动性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）的相关规定，结合本基金基金合同

关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门-基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下展开工作，其中：

一、基金运营部

1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。

2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。

3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。

二、基金投资部

基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。

三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

四、风险控制部

根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

五、督察长

监督和检查公司关于估值各项工作的贯彻和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下，应及时修订本估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经过本公司管理委员会的批准后方可实施。

2. 如果基金准备采用新投资策略或投资新品种或者有其他重大或突发性相关估值事项发生时，应召开临时会议，或者投资品种估值小组成员列席参加公司风控委员会会议，通过公司风控委员会会议讨论并通过上述估值事项。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2019年上半年度，基金托管人在汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2019年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019年上半年度，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	811,558.98	390,974.90
结算备付金		621,515.97	567,501.41
存出保证金		7,282.77	2,866.22
交易性金融资产	6.4.7.2	83,370,391.36	55,200,893.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		83,370,391.36	55,200,893.21
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,500,000.00	6,500,000.00
应收证券清算款		104,899.72	8,609.60
应收利息	6.4.7.5	1,131,348.84	1,343,360.46
应收股利		-	-
应收申购款		1,755.71	404,035.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		93,548,753.35	64,418,241.49
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		100,641.12	23,963.61
应付管理人报酬		45,621.32	33,093.88
应付托管费		15,207.12	11,031.29
应付销售服务费		3,248.09	3,500.72
应付交易费用	6.4.7.7	-	350.00
应交税费		15,894.98	11,959.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	77,343.88	159,015.55
负债合计		257,956.51	242,914.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	84,218,711.88	58,900,726.28

未分配利润	6.4.7.10	9,072,084.96	5,274,600.97
所有者权益合计		93,290,796.84	64,175,327.25
负债和所有者权益总计		93,548,753.35	64,418,241.49

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额为84,218,711.88份，基金份额净值A类1.1090元，基金份额72,120,801.34份;C 类份额净值1.1003元，基金份额12,097,910.54份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		1,778,372.11	3,852,333.07
1.利息收入		1,453,510.29	2,098,269.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,763.42	19,463.70
债券利息收入		1,331,617.09	1,874,993.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		110,129.78	203,811.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		326,356.28	-3,506,257.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	326,356.28	-3,506,257.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,947.00	5,217,592.04
4.汇兑收益（损失以“—”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,452.54	42,729.30
减：二、费用		451,046.31	566,043.84
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	256,507.19	327,476.18
2．托管费	6.4.10.2.2	85,502.43	109,158.70
3．销售服务费	6.4.10.2.3	19,946.79	32,266.77
4．交易费用	6.4.7.19	294.45	1,601.88
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		1,756.73	2,888.97
7．其他费用	6.4.7.20	87,038.72	92,651.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,327,325.80	3,286,289.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,327,325.80	3,286,289.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期

	2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	58,900,726.28	5,274,600.97	64,175,327.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,327,325.80	1,327,325.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	25,317,985.60	2,470,158.19	27,788,143.79
其中：1.基金申购款	41,202,061.49	4,072,694.63	45,274,756.12
2.基金赎回款	-15,884,075.89	-1,602,536.44	-17,486,612.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	84,218,711.88	9,072,084.96	93,290,796.84
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	151,561,022.64	3,967,353.44	155,528,376.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,286,289.23	3,286,289.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-72,832,109.50	-2,714,560.29	-75,546,669.79

其中：1.基金申购款	1,536,925.68	62,910.35	1,599,836.03
2.基金赎回款	-74,369,035.18	-2,777,470.64	-77,146,505.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	78,728,913.14	4,539,082.38	83,267,995.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王栋	赵琳	杨洋
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2008]第1156号《关于核准汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金募集的批复》核准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,944,380,339.34元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原"毕马威华振会计师事务所有限公司")KPMG-B(2008)CR No.0079验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》于2008年12月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,944,833,772.60份基金份额，其中认购资金利息折合453,433.26份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据经批准的《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费、赎回费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，即A类基金份额和C类基金份额。在投资人申购时收取申购费用的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和

C类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，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债券、股票、权证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。本基金的投资组合比例为：具有较高息票率的债券品种(包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等)投资比例不低于基金资产的80%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票，权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证。本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数收益率(全价)。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年06月30日的财务状况以及2019年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末

	2019年06月30日
活期存款	811,558.98
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	811,558.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	83,215,333.97	83,370,391.36	155,057.39
	银行间市场	-	-	-
	合计	83,215,333.97	83,370,391.36	155,057.39
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		83,215,333.97	83,370,391.36	155,057.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	147.71
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	251.73
应收债券利息	1,130,946.52
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.88
合计	1,131,348.84

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末未产生应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	75.16
预提费用	77,268.72
合计	77,343.88

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 汇丰晋信平稳增利债券A

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信平稳增利债券A)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,416,800.55	46,416,800.55
本期申购	39,706,929.82	39,706,929.82
本期赎回（以“-”号填列）	-14,002,929.03	-14,002,929.03
本期末	72,120,801.34	72,120,801.34

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.9.2 汇丰晋信平稳增利债券C

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信平稳增利债券C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,483,925.73	12,483,925.73
本期申购	1,495,131.67	1,495,131.67
本期赎回（以“-”号填列）	-1,881,146.86	-1,881,146.86
本期末	12,097,910.54	12,097,910.54

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 汇丰晋信平稳增利债券A

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信平稳增利债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,301,879.09	5,525,108.14	4,223,229.05
本期利润	1,152,638.68	-30,605.97	1,122,032.71
本期基金份额交易产生的变动数	-628,713.49	3,141,850.83	2,513,137.34
其中：基金申购款	-922,489.74	4,864,591.35	3,942,101.61
基金赎回款	293,776.25	-1,722,740.52	-1,428,964.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-777,953.90	8,636,353.00	7,858,399.10

6.4.7.10.2 汇丰晋信平稳增利债券C

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信平稳增利债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-442,774.38	1,494,146.30	1,051,371.92
本期利润	187,634.12	17,658.97	205,293.09
本期基金份额交易产生的变动数	12,243.73	-55,222.88	-42,979.15
其中：基金申购款	-47,741.62	178,334.64	130,593.02
基金赎回款	59,985.35	-233,557.52	-173,572.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-242,896.53	1,456,582.39	1,213,685.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	5,068.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	6,649.02
其他	46.29
合计	11,763.42

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	326,356.28
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	326,356.28

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,052,381.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,302,622.22
减：应收利息总额	1,423,402.54
买卖债券差价收入	326,356.28

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日

1.交易性金融资产	-12,947.00
——股票投资	-
——债券投资	-12,947.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-12,947.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	8,170.84
转换费收入	3,281.70
合计	11,452.54

注：

1. A类基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持续持有期少于7日的A类基金份额持有人，按其赎回金额的1.50%收取赎回费，并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于7日的A类基金份额持有人，按其赎回金额的0.10%收取赎回费，其中不低于赎回费总额25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费；C类基金份额(持有期少于30日)的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对于持续持有期少于7日的C类基金份额持有人，按其赎回金额的1.50%收取赎回费，并全额计入基金财产；对于持有期大于等于7日且少于30日的C类基金份额持有人，赎回费率为0.75%，不低于赎回费总额25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费；持有期不少于30日(含30日)的C类基金份额持有人，不收取赎回费用。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分组成，其中赎回费部分按照上述规则归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	294.45
银行间市场交易费用	-
合计	294.45

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	38,515.94
汇划手续费	170.00
银行间债券账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	87,038.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司("汇丰晋信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
汇丰银行（中国）有限公司（"汇丰银行"）	见注释1
恒生银行（中国）有限公司（"恒生银行"）	见注释2

注：

1、汇丰银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

2、恒生银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

3、相关关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	256,507.19	327,476.18
其中：支付销售机构的客户维护费	111,736.23	143,358.42

注：支付基金管理人汇丰晋信的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值　X　0.60%　/　当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,502.43	109,158.70

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值　X　0.20%　/　当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信平稳增利债券A	汇丰晋信平稳增利债券C	合计
恒生银行	0.00	469.16	469.16
汇丰晋信	0.00	4.40	4.40
汇丰银行	0.00	19,313.34	19,313.34
交通银行	0.00	35.76	35.76
山西证券	-	-	-
合计	0.00	19,822.66	19,822.66
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信平稳增利债券A	汇丰晋信平稳增利债券C	合计
汇丰晋信	0.00	5.52	5.52
交通银行	0.00	45.42	45.42
山西证券	0.00	14.45	14.45
汇丰银行	0.00	31,652.51	31,652.51
恒生银行	0.00	527.25	527.25
合计	0.00	32,245.15	32,245.15

注：A类基金份额不计提销售服务费，C类基金份额按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇丰晋信，再由汇丰晋信计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C类基金份额日销售服务费＝前一日C类基金资产净值 X 0.30%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	9,910,400.00	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	811,558.98	5,068.11	1,477,991.40	11,030.84

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

2019年上半年度，本基金未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日

A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	4,997,400.00	-
合计	4,997,400.00	-

注：未评级为国债、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	24,598,072.34	8,367,151.00
AAA以下	20,828,424.02	6,432,047.81
未评级	32,946,495.00	40,401,694.40
合计	78,372,991.36	55,200,893.21

注：未评级为国债和政策性金融债等免评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2019年6月30日，本基金未持有流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2019年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	811,558.98	-	-	-	811,558.98
结算备付金	621,515.97	-	-	-	621,515.97
存出保证金	7,282.77	-	-	-	7,282.77
交易性金融资产	16,211,303.56	60,801,346.10	6,357,741.70	-	83,370,391.36
买入返售金融资产	7,500,000.00	-	-	-	7,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	104,899.72	104,899.72
应收利息	-	-	-	1,131,348.84	1,131,348.84
应收申购款	-	-	-	1,755.71	1,755.71
资产总计	25,151,661.28	60,801,346.10	6,357,741.70	1,238,004.27	93,548,753.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	100,641.12	100,641.12
应付管理人报酬	-	-	-	45,621.32	45,621.32
应付托管费	-	-	-	15,207.12	15,207.12
应付销	-	-	-	3,248.09	3,248.09

售服务费					
应交税费	-	-	-	15,894.98	15,894.98
其他负债	-	-	-	77,343.88	77,343.88
负债总计	-	-	-	257,956.51	257,956.51
利率敏感度缺口	25,151,661.28	60,801,346.10	6,357,741.70	980,047.76	93,290,796.84
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	390,974.90	-	-	-	390,974.90
结算备付金	567,501.41	-	-	-	567,501.41
存出保证金	2,866.22	-	-	-	2,866.22
交易性金融资产	11,022,186.50	38,747,932.31	5,430,774.40	-	55,200,893.21
买入返售金融资产	6,500,000.00	-	-	-	6,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	8,609.60	8,609.60
应收利息	-	-	-	1,343,360.46	1,343,360.46
应收申购款	-	-	-	404,035.69	404,035.69
资产总计	18,483,529.03	38,747,932.31	5,430,774.40	1,756,005.75	64,418,241.49
负债					
应付赎	-	-	-	23,963.61	23,963.61

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	33,093.88	33,093.88
应付托管费	-	-	-	11,031.29	11,031.29
应付销售服务费	-	-	-	3,500.72	3,500.72
应付交易费用	-	-	-	350.00	350.00
应交税费	-	-	-	11,959.19	11,959.19
其他负债	-	-	-	159,015.55	159,015.55
负债总计	-	-	-	242,914.24	242,914.24
利率敏感度缺口	18,483,529.03	38,747,932.31	5,430,774.40	1,513,091.51	64,175,327.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	市场利率上升25个基点	-523,935.22	-346,877.65
	市场利率下降25个基点	532,243.97	351,261.59

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等，投资比例不低于基金资产的80%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2019年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2018年12月31日:同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日:同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为5,393,197.76 元，属于第二层次的余额为77,977,193.60元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次1,107,227.41元，第二层次54,093,665.80元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	83,370,391.36	89.12
	其中：债券	83,370,391.36	89.12
	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	7,500,000.00	8.02
	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	1,433,074.95	1.53
8	其他各项资产	1,245,287.04	1.33
9	合计	93,548,753.35	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,547,000.00	9.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,396,895.00	31.51
	其中：政策性金融债	29,396,895.00	31.51
4	企业债券	37,668,578.60	40.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	7,757,917.76	8.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,370,391.36	89.37

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018006	国开1702	187,000	19,092,700.00	20.47
2	018003	国开1401	45,590	5,408,341.70	5.80
3	019611	19国债01	40,000	3,996,800.00	4.28

4	018008	国开1802	36,290	3,693,233.30	3.96
5	124918	PR沪南汇	58,950	3,608,919.00	3.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,282.77
2	应收证券清算款	104,899.72
3	应收股利	-
4	应收利息	1,131,348.84
5	应收申购款	1,755.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,245,287.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132004	15国盛EB	2,364,720.00	2.53
2	128016	雨虹转债	593,508.78	0.64
3	110048	福能转债	556,900.00	0.60
4	110049	海尔转债	481,280.00	0.52
5	128029	太阳转债	426,932.00	0.46
6	113009	广汽转债	319,200.00	0.34
7	110045	海澜转债	296,280.00	0.32
8	113013	国君转债	226,480.00	0.24
9	113011	光大转债	216,800.00	0.23
10	110046	圆通转债	168,965.80	0.18
11	113015	隆基转债	89,418.00	0.10
12	128035	大族转债	85,685.44	0.09
13	110038	济川转债	47,637.00	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇丰晋信平稳增利债券A	838	86,063.01	9,004,379.87	12.49%	63,116,421.47	87.51%
汇丰晋信平稳增利债券C	103	117,455.44	0.00	0.00%	12,097,910.54	100.00%
合计	941	89,499.16	9,004,379.87	10.69%	75,214,332.01	89.31%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇丰晋信平稳增利债券A	177,850.87	0.2466%
	汇丰晋信平稳增	0.00	0.0000%

	利债券C		
	合计	177,850.87	0.2112%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇丰晋信平稳增利债券A	0
	汇丰晋信平稳增利债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信平稳增利债券A	0
	汇丰晋信平稳增利债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信平稳增利债券A	汇丰晋信平稳增利债券C
基金合同生效日(2008年12月03日)基金份额总额	1,944,833,772.60	-
本报告期期初基金份额总额	46,416,800.55	12,483,925.73
本报告期基金总申购份额	39,706,929.82	1,495,131.67
减：本报告期基金总赎回份额	14,002,929.03	1,881,146.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	72,120,801.34	12,097,910.54

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本公司高级管理人员无重大人事变动，未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于2015年4月18日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），并报中国证券监督管理委员会备案。本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

1、报告期内无增加的交易单元

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

a.实力雄厚，信誉良好；

b.公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好,过去三年未有任何违规经营记录；

c.公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

d.公司内部管理规范，研究流程严谨清晰,能满足基金操作的高度保密要求；

e.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：

a.研究报告的数量和质量；

b.提供研究服务的主动性；

c.资讯提供的及时性及便利性；

d.其他可评价的考核标准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	64,569,177.30	90.69%	928,900,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	6,627,827.96	9.31%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-01-02

2	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过农业银行进行公募基金申购、基金组合购买和定期定额投资费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-01-04
3	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第1次）	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-01-17
4	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1次）	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-01-17
5	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金2018年第4季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-01-21
6	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金2018年年度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-03-27
7	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金2018年年度报告摘要	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-03-27
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-04-01
9	关于旗下基金继续通过中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-04-02
10	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金2019年第1季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-04-20
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加中国民生银行股份有限公司费率优惠	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-05-21

	活动的公告		
12	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中国银行定期定额投资费率优惠标准的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2019-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1）中国证监会批准汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金设立的文件
2）汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同
3）汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金招募说明书
4）汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金托管协议
5）汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
6）基金管理人业务资格批件和营业执照
7）基金托管人业务资格批件和营业执照
8）报告期内汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
9）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

地点为管理人地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：http://www.hsbcjt.cn

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十九日