

---

# 汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 29 日

## § 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。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信珠三角混合
基金主代码	004351
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月02日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	183,902,627.32份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金是一个“纯粹”的区域投资主题基金，将股票资产聚焦于本基金主题所指的珠三角区域的上市公司或有确切证据能证明受益于该区域经济的上市公司，通过筛选优质上市公司，争取中长期投资收益超越比较基准。</p>
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金借鉴汇丰集团的投资理念和流程，基于多因素分析，对权益类资产、固定收益类及现金类资产比例进行动态调整。具体而言，本基金将通过对宏观经济面、资金流动性、上市公司整体盈利水平、市场估值水平、基于技术指标及成交量的趋势分析、市场情绪、政策面、海外市场情况等因素进行跟踪，全面评估上述因素中的关键指标及其变动趋势，以最终确定大类资产的配置权重，实现资产合理配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 公司发展是个动态的过程，随着公司所处的阶段不同，以及区域经济环境和政策的变化，都会对公司的业绩、发展战略及投资行为产生影响，本基金将会从受益于区域经济的视角出发，密切关注各行业动态并挖掘潜在的机会，从而筛选出优质的上市公司。</p> <p>(2) 本基金主题包含了数个行业，这些行业的发</p>

	<p>展趋势和估值水平区别较大，这为主动型资产管理提供了空间。在个股选择时，本基金将着重选择那些需求空间大、技术确定性较高、公司治理结构优良，发展趋势向好的上市公司。具体而言，本基金对区域主题内的上市公司采用“盈利-估值指标”二维估值模型，并从公司治理结构等方面进行综合评价，以筛选出优质的上市公司。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。</p>
业绩比较基准	<p>业绩比较基准=中证珠三角沿海区域发展主题指数*70%+同业存款利率（税后）*30%</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高风险收益特征的基金品种。</p>

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵
	联系电话	021-20376868
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn
		田青
		010-67595096
		tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	021-20376888	010-67595096
传真	021-20376999	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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；中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

## § 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）
本期已实现收益	13,225,822.86
本期利润	29,314,064.61
加权平均基金份额本期利润	0.1434
本期基金份额净值增长率	14.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.0350
期末基金资产净值	177,465,604.08
期末基金份额净值	0.9650

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。

### 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	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	2.88%	0.83%	2.17%	0.93%	0.71%	-0.10%
过去三个月	-5.99%	1.19%	-6.80%	1.22%	0.81%	-0.03%
过去六个月	14.88%	1.21%	15.25%	1.23%	-0.37%	-0.02%
过去一年	-1.16%	1.27%	-1.63%	1.19%	0.47%	0.08%
自基金合同生效起至今	-3.50%	1.13%	-6.85%	0.99%	3.35%	0.14%

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

自基金合同生效至今指2017年6月2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

汇丰晋信珠三角区域发展混合型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



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的50%-95%，其中投资于“珠三角区域发展”主题的股票比例不低于非现金资产的80%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，现金或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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
2. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止2017年12月2日，本基金已完成建仓。
3. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证珠三角沿海区域发展主题指数\*70%+同业存款利率（税后）\*30%
4. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证珠三角沿海区域发展主题指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## § 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		
吴培文	本基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金经理。	2017-06-02	-	10	吴培文先生，清华大学工学硕士。历任宝钢股份研究员、东海证券研究员、平安证券高级研究员，2011年8月加入汇丰晋信基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。现任本基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金经理。



注：1. 吴培文先生任职日期为本基金基金合同生效日期；  
2. 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合规守信情况的说明

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

一季度国家发布了《粤港澳大湾区发展规划》。A股市场上，每次区域规划发布期间，本地港口、地产、公用事业等会出现较为明显的涨幅。由于本基金是一个区域主题基金，所以我们在第一季度的投资中阶段性地兼顾了上述主题属性。从第一季度的业绩来看，由于前期市场整体表现较好，虽然本基金实现了正收益，但并未表现出超额收益。另一方面，我们认为，受区域政策催化剂影响的行情往往“一而再，再而衰”，并不是股票增值的核心动力，所以我们在粤港澳大湾区规划出台后对上述主题性股票进行了减持。

当前及未来，管理人的投资策略将集中到汇丰晋信一贯坚持的PBROE价值策略，即在主动管理的基础上，基于PBROE的价值评分，对价值低估的股票和行业进行动态筛选。我们认为，价值是决定回报率的最大因素，坚持以价值为核心的投资策略，会更好的实现长期回报。虽然管理人的投资策略是稳定的，但由于市场和个股基本面数据的变化，具体的投资重点会随市场变动而做出适时调整。

在运作中，管理人参考比较基准，控制在主动管理过程中承担的风险。

本产品是一个混合型基金。本基金力争通过个股选择、行业配置，以及仓位控制，获取相对比较基准的超额收益（中证珠三角沿海区域发展主题指数\*70%+同业存款利率（税后）\*30%）。本产品的比较基准中的主要成分是中证珠三角沿海区域发展主题指数，该指数包含了珠三角区域具有代表性的100家大公司，具有良好的区域经济代表性。由于珠三角区域市场经济体系发育较早，制度相对完善，使得该地区的企业具有优于全国平均水平的成长性。我们聚焦于投资珠三角区域的优质企业，将有利于投资者分享中国经济的成长红利。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金业绩表现为14.88%，同期业绩比较基准增长率为15.25%，本基金落后同期比较基准为0.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然2019年一季度股票市场出现了明显的上涨，但二季度回调。如我们在一季报中指出的，2019年，我们认为风险与机遇共存。好的方面，多数股票估值处于相对底部区间。由于估值具有吸引力，市场对利好的响应度较高。当一季度出现资金面、政策面和基本面的三重利好时，市场的响应度较高。但仍需警惕，当前全球经济处于下行周期，国内多数行业的盈利也仍面临下行压力。并且全球主要国家的经贸关系处于不确定的状态。所以一季度的上涨更多地可以视作对此前悲观预期的修复，而不宜视作牛市的开端。上述基本判断，当前都未改变。展望下半年，我们预计后续利好和利空可能交相主导市

场走势，全年可能会有若干次波段式的机会。

珠三角区域有较多公司属于电子和计算机行业，或者出口占比较高的外向型企业。这两类企业具有良好的国际竞争力和创新能力，但短期比较容易受到国际贸易摩擦的影响，下一阶段需要平衡相关企业的长期机遇和短期风险。

此外，全市场而言，我们认为部分基本面优秀的行业和公司，估值已经逼近历史高位。而部分基本面下行的行业和公司，估值已经逼近历史低位。所以下一阶段，需要平衡基本面和估值的匹配度，在组合中兼顾基本面上行的股票和估值处于底部的股票。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配

## 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

本托管人复核审查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。

## § 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：汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	35,541,463.94	45,217,060.38
结算备付金		799,637.60	944,539.09
存出保证金		143,722.08	78,146.55
交易性金融资产	6.4.7.2	141,519,825.76	145,427,281.75
其中：股票投资		131,516,825.76	145,427,281.75
基金投资		-	-
债券投资		10,003,000.00	-
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	-	35,000,000.00
应收证券清算款		356,331.63	1,750,983.92

应收利息	6.4.7.5	330,335.41	8,557.40
应收股利		-	-
应收申购款		2,522.28	15,118.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		178,693,838.70	228,441,688.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		471,521.83	33,836,055.48
应付赎回款		18,096.63	1,677,928.90
应付管理人报酬		214,315.53	253,581.99
应付托管费		35,719.28	42,263.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	393,933.44	469,540.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,647.91	376,788.06
负债合计		1,228,234.62	36,656,159.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	183,902,627.32	228,325,109.62
未分配利润	6.4.7.10	-6,437,023.24	-36,539,580.68
所有者权益合计		177,465,604.08	191,785,528.94
负债和所有者权益总计		178,693,838.70	228,441,688.05

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额为183,902,627.32份，基金份额净值0.9650元。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		32,602,225.68	-10,134,929.03
1. 利息收入		323,312.83	94,918.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	109,591.99	94,918.26
债券利息收入		207,851.66	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,869.18	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,102,693.90	39,112,418.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,536,339.39	35,085,092.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,965.72	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.	-	-
收益	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	1,580,320.23	4,027,326.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,088,241.75	-49,656,849.67

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	87,977.20	314,583.80
<b>减：二、费用</b>		3,288,161.07	4,641,225.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,434,190.57	2,248,106.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	239,031.74	374,684.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,507,467.21	1,825,500.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	107,471.55	192,934.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		29,314,064.61	-14,776,154.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		29,314,064.61	-14,776,154.76

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金

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)	228,325,109.6 2	-36,539,580.6 8	191,785,528.94



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,314,064.61	29,314,064.61
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)	-44,422,482.30	788,492.83	-43,633,989.47
其中：1. 基金申购款	6,729,720.16	-308,794.13	6,420,926.03
2. 基金赎回款	-51,152,202.46	1,097,286.96	-50,054,915.50
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)	183,902,627.32	-6,437,023.24	177,465,604.08
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)	436,740,430.56	23,517,339.80	460,257,770.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,776,154.76	-14,776,154.76
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)	-190,226,132.04	-14,578,355.25	-204,804,487.29
其中：1. 基金申购款	11,802,962.05	629,322.96	12,432,285.01
2. 基金赎回款	-202,029,094.09	-15,207,678.21	-217,236,772.30
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)	246,514,298.52	-5,837,170.21	240,677,128.31

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

汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金(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”)证监许可[2017]第167号《关于准予汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金注册的批复》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《汇丰晋信珠三角区域发展混合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基金,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798,562,754.79元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第593号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金基金合同》于2017年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为798,874,928.83份基金份额,其中认购资金利息折合312,174.04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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信珠三角区域发展混合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国内依法发行上市的股票(含中小板,创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券、同业存单等以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资业务。本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的50%-95%,其中,投资于“珠三角区域发展”主题的股票比例不低于非现金资产的80%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或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%。本基金的业绩比较基准为:中证珠三角沿海区域发展主题指数×70%+同业存款利率(税后)×30%。

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》、《汇丰晋信珠三角区域发展混合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年上半年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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
山西证券	-	-	7,978,730.06	0.70%

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期内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。

##### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内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。

##### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
山西证券	-	-	-	-

  

关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

山西证券	7,430.57	0.70%	7,430.57	2.70%
------	----------	-------	----------	-------

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 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	1,434,190.57	2,248,106.89
其中：支付销售机构的客户维护费	676,997.68	1,033,834.23

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1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 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	239,031.74	374,684.48

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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
建设银行	35,541,463.94	100,813.80	18,875,785.69	85,777.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 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。

#### 6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

##### 6.4.9.2 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。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.10 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6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131,493,719.16元，属于第二层次的余额为10,026,106.60元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次的余额为143,943,038.48元，属于第二层次的余额为1,484,243.27元，无属于第三层次的余额。)

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (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	131,516,825.76	73.60
	其中：股票	131,516,825.76	73.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,003,000.00	5.60
	其中：债券	10,003,000.00	5.60
	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	36,341,101.54	20.34
8	其他各项资产	832,911.40	0.47
9	合计	178,693,838.70	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,078,556.88	1.17
B	采矿业	5,949,066.76	3.35
C	制造业	78,888,426.44	44.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,976,484.00	1.11
E	建筑业	3,511,525.00	1.98
F	批发和零售业	3,875,766.00	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	27,159,972.34	15.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	847,376.00	0.48
J	金融业	4,531,829.61	2.55
K	房地产业	2,674,716.13	1.51
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	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	131,516,825.76	74.11

### 7.3 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

金额单位：人民币元

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	000089	深圳机场	997,482	8,867,614.98	5.00
2	600548	深高速	832,020	7,812,667.80	4.40
3	000333	美的集团	130,100	6,746,986.00	3.80
4	002271	东方雨虹	243,907	5,526,932.62	3.11

5	600332	白云山	126,331	5,175,781.07	2.92
6	300285	国瓷材料	262,700	4,468,527.00	2.52
7	002311	海大集团	123,800	3,825,420.00	2.16
8	002032	苏泊尔	50,411	3,822,666.13	2.15
9	002511	中顺洁柔	310,560	3,813,676.80	2.15
10	000999	华润三九	129,900	3,811,266.00	2.15

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于 [www.hsbcjt.cn](http://www.hsbcjt.cn) 网站的半年度报告正文。

## 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	10,609,587.00	5.53
2	601668	中国建筑	10,448,453.60	5.45
3	300136	信维通信	10,064,360.64	5.25
4	002299	圣农发展	8,849,747.83	4.61
5	600873	梅花生物	8,499,464.00	4.43
6	002301	齐心集团	7,163,794.00	3.74
7	002563	森马服饰	7,106,676.00	3.71
8	000333	美的集团	6,658,674.47	3.47
9	600030	中信证券	6,298,016.54	3.28
10	002511	中顺洁柔	6,084,212.40	3.17
11	002271	东方雨虹	6,025,580.20	3.14
12	002311	海大集团	5,902,057.36	3.08
13	600339	中油工程	5,757,480.80	3.00
14	002242	九阳股份	5,688,879.00	2.97
15	600332	白云山	5,683,336.88	2.96
16	601899	紫金矿业	5,535,765.00	2.89

17	002032	苏泊尔	5,519,950.00	2.88
18	600026	中远海能	5,320,944.00	2.77
19	002701	奥瑞金	5,247,587.18	2.74
20	002174	游族网络	5,165,215.00	2.69
21	002745	木林森	5,127,183.00	2.67
22	600060	海信电器	5,114,996.00	2.67
23	601857	中国石油	4,846,154.00	2.53
24	002081	金螳螂	4,821,122.00	2.51
25	002583	海能达	4,586,609.00	2.39
26	002594	比亚迪	4,569,092.20	2.38
27	600483	福能股份	4,556,934.00	2.38
28	002353	杰瑞股份	4,537,439.00	2.37
29	600660	福耀玻璃	4,274,063.59	2.23
30	601098	中南传媒	4,273,799.12	2.23
31	002035	华帝股份	4,199,766.00	2.19
32	300285	国瓷材料	4,174,428.00	2.18
33	002042	华孚时尚	4,161,467.00	2.17
34	300458	全志科技	4,150,982.00	2.16
35	600183	生益科技	4,088,822.00	2.13
36	601877	正泰电器	4,065,801.86	2.12
37	600029	南方航空	4,064,549.00	2.12
38	000703	恒逸石化	4,052,756.36	2.11
39	601872	招商轮船	4,016,454.00	2.09
40	002791	坚朗五金	3,990,860.00	2.08
41	603515	欧普照明	3,984,138.70	2.08
42	601398	工商银行	3,965,713.00	2.07
43	600872	中炬高新	3,954,558.39	2.06
44	002187	广百股份	3,918,378.00	2.04
45	600062	华润双鹤	3,914,369.40	2.04
46	000088	盐田港	3,904,385.50	2.04
47	601021	春秋航空	3,874,978.00	2.02

48	601928	凤凰传媒	3,864,093.11	2.01
49	002475	立讯精密	3,854,076.40	2.01
50	002372	伟星新材	3,848,591.60	2.01

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600873	梅花生物	11,269,208.50	5.88
2	601857	中国石油	11,078,571.18	5.78
3	300136	信维通信	10,154,659.89	5.29
4	601318	中国平安	9,632,946.53	5.02
5	601139	深圳燃气	9,343,716.79	4.87
6	601333	广深铁路	9,010,392.14	4.70
7	601877	正泰电器	8,920,736.60	4.65
8	600026	中远海能	7,601,365.70	3.96
9	000895	双汇发展	7,562,246.44	3.94
10	002299	圣农发展	7,502,626.32	3.91
11	001872	招商港口	7,269,877.54	3.79
12	000671	阳光城	7,109,509.05	3.71
13	002242	九阳股份	6,986,265.85	3.64
14	601668	中国建筑	6,815,930.17	3.55
15	600030	中信证券	6,590,888.38	3.44
16	002152	广电运通	6,418,804.55	3.35
17	300458	全志科技	5,703,040.50	2.97
18	000089	深圳机场	5,475,498.96	2.86
19	601899	紫金矿业	5,406,315.70	2.82
20	002400	省广集团	5,274,500.51	2.75
21	000539	粤电力A	5,118,685.62	2.67

22	000027	深圳能源	4,960,262.00	2.59
23	002024	苏宁易购	4,949,327.30	2.58
24	601186	中国铁建	4,940,313.40	2.58
25	002035	华帝股份	4,897,817.92	2.55
26	002174	游族网络	4,897,556.84	2.55
27	300133	华策影视	4,849,687.23	2.53
28	002081	金螳螂	4,806,968.28	2.51
29	600060	海信电器	4,743,685.44	2.47
30	000088	盐田港	4,700,595.63	2.45
31	002303	美盈森	4,599,171.80	2.40
32	002042	华孚时尚	4,525,144.00	2.36
33	002745	木林森	4,465,978.74	2.33
34	601872	招商轮船	4,449,727.44	2.32
35	600483	福能股份	4,441,464.70	2.32
36	002791	坚朗五金	4,425,109.78	2.31
37	600062	华润双鹤	4,348,321.86	2.27
38	002301	齐心集团	4,312,873.00	2.25
39	002543	万和电气	4,224,986.30	2.20
40	002594	比亚迪	4,216,316.01	2.20
41	001979	招商蛇口	4,213,931.44	2.20
42	002583	海能达	4,212,253.02	2.20
43	600548	深高速	4,173,321.28	2.18
44	000997	新大陆	4,166,408.82	2.17
45	002187	广百股份	4,144,697.19	2.16
46	000703	恒逸石化	4,068,614.39	2.12
47	603515	欧普照明	4,046,270.35	2.11
48	601098	中南传媒	3,979,534.65	2.07
49	601928	凤凰传媒	3,948,847.00	2.06

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	466,671,680.61
卖出股票收入（成交）总额	511,236,367.74

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,003,000.00	5.64
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	5.64
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,003,000.00	5.64

### 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	180209	18国开09	100,000	10,003,000.00	5.64

### 7.7 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。

### 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 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

##### 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	143,722.08
2	应收证券清算款	356,331.63
3	应收股利	-
4	应收利息	330,335.41
5	应收申购款	2,522.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	832,911.40

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 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

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
2,298	80,027.25	0.00	0.00%	183,902,627.32	100.00%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%
------------------	------	---------

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年06月02日)基金份额总额	798,874,928.83
本报告期期初基金份额总额	228,325,109.62
本报告期基金总申购份额	6,729,720.16
减：本报告期基金总赎回份额	51,152,202.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	183,902,627.32

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。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚荣为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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

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。自本基金募集以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）一直为本基金提供审计服务。

#### 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	
方正证券	1	69,386,568.69	7.11%	64,620.05	7.11%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	3,491,413.30	0.36%	3,251.63	0.36%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	29,760,100.03	3.05%	27,715.77	3.05%	-
海通证券	1	105,122,938.21	10.77%	97,900.72	10.77%	-
东北证券	1	9,511,519.38	0.97%	8,858.04	0.97%	-
中信建投	1	52,677,059.86	5.40%	49,057.76	5.40%	-
申万宏源	1	159,082,346.21	16.29%	148,152.66	16.29%	-
国泰君安	1	76,243,495.07	7.81%	71,005.20	7.81%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	47,635,195.13	4.88%	44,362.71	4.88%	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	242,391,148.86	24.83%	225,739.62	24.83%	-
安信证券	2	29,035,345.18	2.97%	27,040.86	2.97%	-
中信证券	2	151,996,892.67	15.57%	141,555.22	15.57%	-

1、报告期内无新增加的交易单元

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
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

光大证券	39,96 3.70	0.46%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	4,80 5,32 8.00	55.35%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	3,83 5,91 5.00	44.19%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	10,00 0,000. 00	100.00%	-	-	-	-

## § 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。

汇丰晋信基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十九日