
汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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

报告送出日期:2021 年 01 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1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2020年10月01日起至2020年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信2016周期混合	
基金主代码	540001	
交易代码	540001	541001
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年05月23日	
报告期末基金份额总额	144,597,684.98份	
投资目标	通过基于内在价值判断的股票投资方法、基于宏观经济/现金流/信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程，本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求高于业绩比较基准的收益。	
投资策略	<p>1. 动态调整的资产配置策略</p> <p>本基金投资的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，相应的从“进取”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，股票类资产比例逐步下降，而固定收益类资产比例逐步上升。</p> <p>2. 以风险控制为前提的股票筛选策略</p> <p>根据投研团队的研究成果，本基金首先筛选出股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票；同时，再通过严格的基本面分析（CFROI为核心的财</p>	

	<p>务分析、公司治理结构分析) 和公司实地调研, 最终挑选出质地优良的具有高收益风险比的优选股票。</p> <p>3. 动态投资的固定收益类资产投资策略</p> <p>在投资初始阶段, 本基金债券投资将奉行较为“积极”的策略; 随着目标期限的临近和达到, 本基金债券投资将逐步转向“稳健”和“保守”, 在组合久期配置和个券选择上作相应变动。</p>																																												
<p>业绩比较基准</p>	<p>1. 2016年6月1日前业绩比较基准</p> <p>基金合同生效后至2016年5月31日, 本基金业绩比较基准如下:</p> <p>业绩比较基准 = X * MSCI中国A股在岸指数+ (1-X) *中债新综合指数 (全价), 其中X值见下表:</p> <table border="1" data-bbox="715 891 1401 1568"> <thead> <tr> <th>时间段</th> <th>股票类资产比例%</th> <th>X值 (%)</th> <th>(1-X) 值 (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>基金合同生效之日至2007/5/31</td> <td>0-65</td> <td>45.5</td> <td>54.5</td> </tr> <tr> <td>2007/6/1-2008/5/31</td> <td>0-60</td> <td>42.0</td> <td>58.0</td> </tr> <tr> <td>2008/6/1-2009/5/31</td> <td>0-55</td> <td>38.5</td> <td>61.5</td> </tr> <tr> <td>2009/6/1-2010/5/31</td> <td>0-45</td> <td>31.5</td> <td>68.5</td> </tr> <tr> <td>2010/6/1-2011/5/31</td> <td>0-40</td> <td>28.0</td> <td>72.0</td> </tr> <tr> <td>2011/6/1-2012/5/31</td> <td>0-35</td> <td>24.5</td> <td>75.5</td> </tr> <tr> <td>2012/6/1-2013/5/31</td> <td>0-25</td> <td>17.5</td> <td>82.5</td> </tr> <tr> <td>2013/6/1-2014/5/31</td> <td>0-20</td> <td>14.0</td> <td>86.0</td> </tr> <tr> <td>2014/6/1-2015/5/31</td> <td>0-15</td> <td>10.5</td> <td>89.5</td> </tr> <tr> <td>2015/6/1-2016/5/31</td> <td>0-10</td> <td>7.0</td> <td>93.0</td> </tr> </tbody> </table> <p>注:</p> <p>1. 2008年11月11日, 新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。</p> <p>2. 2010年12月16日, 新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。</p> <p>3. 2013年2月1日起, 本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先“X *富时中国A全指 + (1-X) *新华巴克莱资本中国全债指数”, 变更为“X *富时中国A全指 + (1-X) *中债新综合指数 (全价)”。</p>	时间段	股票类资产比例%	X值 (%)	(1-X) 值 (%)	基金合同生效之日至2007/5/31	0-65	45.5	54.5	2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0	2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5	2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5	2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0	2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5	2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5	2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0	2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5	2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0
时间段	股票类资产比例%	X值 (%)	(1-X) 值 (%)																																										
基金合同生效之日至2007/5/31	0-65	45.5	54.5																																										
2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0																																										
2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5																																										
2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5																																										
2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0																																										
2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5																																										
2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5																																										
2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0																																										
2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5																																										
2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0																																										

	<p>4. 2015年4月1日起,本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先“X *富时中国A全指 + (1-X) * 中债新综合指数(全价)”,变更为“X * MSCI 中国A股在岸指数+(1-X)*中债新综合指数(全价)”。</p> <p>5. 2018年3月1日, MSCI中国A股指数更名为MSCI中国A股在岸指数。</p> <p>6. 2016年6月1日后业绩比较基准 2016年6月1日起, 本基金业绩比较基准 = 银行活期存款利率(税后)</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只生命周期基金,风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。</p> <p>本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于中等水平;随着目标投资期限的逐步接近,本基金逐步降低预期风险与收益水平,转变成为中低风险的证券投资基金;在临近目标期限和目标期限达到以后,本基金转变成为低风险的证券投资基金。</p>
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

§ 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10月01日 - 2020年12月31日)
1. 本期已实现收益	1,847,735.69
2. 本期利润	2,843,343.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0168
4. 期末基金资产净值	156,858,911.20
5. 期末基金份额净值	1.0848

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。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。

2、本基金基金合同生效之日(含基金合同生效之日)至2011/05/31(含2011/05/31)

年管理费率为1.5% ，年托管费率为0.25% 。2011/06/01(含2011/06/01)至2016/05/31(含2016/05/31)年管理费率为0.75% ，年托管费率为0.20% 。2016/06/01起(含2016/06/01)年管理费率为0.38% ，年托管费率为0.10% 。

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	1.58%	0.07%	0.09%	0.00%	1.49%	0.07%
过去六个月	3.01%	0.11%	0.18%	0.00%	2.83%	0.11%
过去一年	4.32%	0.13%	0.36%	0.00%	3.96%	0.13%
过去三年	18.04%	0.13%	1.07%	0.00%	16.97%	0.13%
过去五年	15.58%	0.14%	-0.22%	0.05%	15.80%	0.09%
自基金合同生效起至今	221.91%	0.57%	123.89%	0.52%	98.02%	0.05%

注：

过去三个月指2020年10月1日-2020年12月31日

过去六个月指2020年7月1日-2020年12月31日

过去一年指2020年1月1日-2020年12月31日

过去三年指2018年1月1日-2020年12月31日

过去五年指2016年1月1日-2020年12月31日

自基金合同生效起至今指2006年5月23日-2020年12月31日

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

汇丰晋信2016生命周期开放式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，自基金合同生效日（2006年5月23日）至2007年5月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例0-65%，固定收益类资产比例35-100%。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2006年11月23日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
2. 根据基金合同的约定，自2007年6月1日起至2008年5月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例0-60%，固定收益类资产比例40-100%。
3. 根据基金合同的约定，自2008年6月1日起至2009年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-55%，固定收益类资产比例45-100%。
4. 根据基金合同的约定，自2009年6月1日起至2010年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-45%，固定收益类资产比例55-100%。
5. 根据基金合同的约定，自2010年6月1日起至2011年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-40%，固定收益类资产比例60-100%。
6. 根据基金合同的约定，自2011年6月1日起至2012年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-35%，固定收益类资产比例65-100%。
7. 根据基金合同的约定，自2012年6月1日起至2013年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-25%，固定收益类资产比例75-100%。
8. 根据基金合同的约定，自2013年6月1日起至2014年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-20%，固定收益类资产比例80-100%。
9. 根据基金合同的约定，自2014年6月1日起至2015年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-15%，固定收益类资产比例85-100%。
10. 根据基金合同的约定，自2015年6月1日起至2016年5月31日，本基金的资产配置比例

调整为：股票类资产比例0-10%，固定收益类资产比例90-100%。

11. 根据基金合同的约定，自2016年6月1日起本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-5%，固定收益类资产比例95-100%。

12. 基金合同生效日（2006年5月23日）至2007年5月31日，本基金的业绩比较基准=45.5%×富时中国A全指+54.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；根据基金合同的约定，自2007年6月1日起至2008年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：42%×富时中国A全指+58%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2008年6月1日起至2009年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：38.5%×富时中国A全指+61.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2009年6月1日起至2010年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：31.5%×富时中国A全指+68.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2010年6月1日起至2011年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：28%×富时中国A全指+72%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2011年6月1日起至2012年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：24.5%×富时中国A全指+75.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。自2012年6月1日起至2013年1月31日，本基金的业绩比较基准调整为：17.5%×富时中国A全指+82.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。2013年2月1日起至2013年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为“17.5%×富时中国A全指+82.5%×中债新综合指数（全价）”。2013年6月1日起至2014年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为“14%×富时中国A全指+86%×中债新综合指数（全价）”。2014年6月1日起至2015年3月31日，本基金的业绩比较基准调整为“10.5%×富时中国A全指+89.5%×中债新综合指数（全价）”。2015年4月1日起至2015年5月31日，本基金的业绩比较基准修改为“10.5%×MSCI中国A股在岸指数+89.5%×中债新综合指数（全价）”。2015年6月1日起至2016年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为“7%×MSCI中国A股在岸指数+93%×中债新综合指数（全价）”。2016年6月1日起，本基金的业绩比较基准调整为“银行活期存款利率（税后）”。

13. 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新华富时中国A全指成份股在报告期产生的股票红利收益。业绩比较基准中的中债新综合指数收益率（全价）为中债新综合全价（总值）指数收益率，是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中。

14. 2008年11月11日，新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。

15. 2010年12月16日，新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。

16. 2018年3月1日，MSCI中国A股指数更名为MSCI中国A股在岸指数。

§ 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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
蔡若林	本基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理	2016-01-30	-	9	蔡若林先生，硕士研究生。汇丰晋信基金管理有限公司助理策略分析师、助理研究员、固定收益信用分析师、汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理。现任本基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：

1. 任职日期为本基金管理人公告蔡若林先生担任本基金基金经理的日期；
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 公平交易专项说明

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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年四季度，国内新型冠状病毒防疫形势总体保持稳定，但进入秋冬季节，局部零星病例有所增加，所幸在各方快速应对下基本都能做到第一时间控制传播。人民日常工作生活基本恢复正常是国内经济在四季度继续稳步复苏的重要前提。四季度官方制造业PMI指数维持高位，显示经济复苏势头依然强劲。12月PMI落于51.9，生产和新订单指数分别录得54.2和53.6，虽然环比出现小幅回落，但依然处于历史同期的相对高位。分企业类型看，大型和中型企业制造业PMI均为52.7，小型企业录得48.8，疫情以来小型企业复苏一直呈现偏弱的状态，反映国内经济内生动力依然不足，下阶段随着前期各项刺激政策逐步退出或回归正常化，经济修复速度仍然面临放缓的压力。

通胀方面，四季度食品价格加速回落带动CPI同比增速下行，11月CPI同比增速降至-0.5%，核心CPI同比增速也维持0.5%的低位。目前来看低通胀主要是食品价格阶段性快速回落导致的，整体通缩风险相对有限，但也在一定程度上反映了内需相对疲弱的问题。

在此背景下，我们认为央行货币政策进一步收缩的可能性相对较小，相反，为了进一步刺激内需，同时应对后疫情时代经济面临的下行压力，未来我们仍可能看到相对积极的货币政策再次出现。经过二、三季度的调整之后，国内债券整体收益率重新回到具有较高吸引力的水平，四季度以震荡为主，期间中债新综合全价指数上涨0.64%，中债信用债指数持平于三季度，中债金融债指数上涨1.55%，中债国债指数上涨0.47%。

权益方面，我国经济领先复苏继续推动风险偏好和市场情绪的提升，A股在四季度震荡上行，期间沪深300指数上涨13.60%，中小板指上涨10.07%，创业板指上涨15.21%。

基金操作上，四季度基本维持债券和股票仓位比例不变，维持债券组合久期不变，通过配置中长期利率债维持组合久期标配，信用债配置依然以短期高评级品种为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为1.58%，同期业绩比较基准收益率为0.09%。

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 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	2,184,860.40	1.37
	其中：股票	2,184,860.40	1.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,704,004.60	94.07
	其中：债券	149,704,004.60	94.07
	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	2,263,013.73	1.42
8	其他资产	4,995,052.63	3.14
9	合计	159,146,931.36	100.00

5.2 报告期末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	175,260.40	0.11
C	制造业	961,000.00	0.61
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,048,600.00	0.67
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,184,860.40	1.39

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

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	600660	福耀玻璃	20,000	961,000.00	0.61
2	000002	万科A	20,000	574,000.00	0.37
3	600048	保利地产	30,000	474,600.00	0.30
4	600547	山东黄金	7,420	175,260.40	0.11

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	3,799,620.00	2.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,740,500.00	35.54

	其中：政策性金融债	55,740,500.00	35.54
4	企业债券	18,808,900.00	11.99
5	企业短期融资券	14,994,000.00	9.56
6	中期票据	40,617,500.00	25.89
7	可转债（可交换债）	15,743,484.60	10.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,704,004.60	95.44

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	190205	19国开05	200,000	19,828,000.00	12.64
2	180214	18国开14	100,000	10,389,000.00	6.62
3	101556016	15桂铁投MTN001	100,000	10,358,000.00	6.60
4	180210	18国开10	100,000	10,333,000.00	6.59
5	160409	16农发09	100,000	10,190,000.00	6.50

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持有股指期货。

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持有国债期货。

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持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,340.79
2	应收证券清算款	2,000,899.73
3	应收股利	-
4	应收利息	2,951,898.55
5	应收申购款	36,913.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,995,052.63

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	110059	浦发转债	2,145,944.00	1.37

2	113011	光大转债	1,982,080.00	1.26
3	113021	中信转债	1,367,730.00	0.87
4	113026	核能转债	1,354,671.00	0.86
5	128021	兄弟转债	1,236,301.00	0.79
6	127012	招路转债	1,044,130.00	0.67
7	132015	18中油EB	821,902.00	0.52
8	110053	苏银转债	757,820.00	0.48
9	128101	联创转债	744,863.00	0.47
10	113583	益丰转债	679,402.10	0.43
11	113025	明泰转债	638,350.00	0.41
12	113009	广汽转债	625,565.60	0.40
13	128019	久立转2	566,988.00	0.36
14	128035	大族转债	436,275.66	0.28
15	110062	烽火转债	339,960.00	0.22
16	128029	太阳转债	261,372.00	0.17
17	113014	林洋转债	220,500.00	0.14

5.11.5 报告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

投资组合报告中，由于四舍五入原因，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差；由于小数点后保留位数限制原因，市值占净值比例可能显示为零。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	174,745,325.03
报告期期间基金总申购份额	18,992,405.99
减：报告期期间基金总赎回份额	49,140,046.04
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	144,597,684.98

§ 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

本报告期内，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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

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	20201102 - 20201105; 20201110 - 20201224	34,399,661.89	0.00	34,399,661.89	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，可能引起巨额赎回导致的流动性风险，本基金管理人会根据份额持有人的结构和特点，保持关注申赎动向，根据可能产生的流动性风险，对本基金的投资组合及时作出相应调整，目前单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况对本基金流动性影响有限。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信2016生命周期开放式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2016生命周期开放式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

9.2 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。

9.3 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

2021年01月22日