

汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金

2021年第2季度报告

2021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

报告送出日期:2021年07月21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7月20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2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 汇丰晋信沪港深股票 |
| 基金主代码 | 002332 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年11月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 849,495,304.47份 |
| 投资目标 | 本基金把握沪港通及后续资本市场开放政策带来的机会，挖掘A股及港股市场的优质公司，在控制风险的前提下精选个股，以追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 两地股票资产配置策略：</p> <p>通过有效的资产配置(考虑国内与海外宏观经济、流动性、企业盈利、估值与A/H股价差、国际资本流动、动量指标、市场情绪、政府政策等因素)，动态调整</p> |

| | |
|---------------|--|
| | <p>两地股票资产的配置比例。</p> <p>(2) 个股精选策略</p> <p>本基金对沪港深三市涵盖的上市公司采用“成长性-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。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益。</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> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深300指数收益率×45% + 恒生指数收益率×45% + 同业存款利率（税后）×10%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金除了投资于 A 股上市公司外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易</p> |

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| | 日不连贯可能带来的风险等。同时，本基金名为“沪港深”基金，基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇丰晋信沪港深股票A | 汇丰晋信沪港深股票C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002332 | 002333 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 796,106,305.68份 | 53,388,998.79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(2021年04月01日 - 2021年06月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
| | 汇丰晋信沪港深股票A | 汇丰晋信沪港深股票C |
| 1. 本期已实现收益 | 75,298,559.38 | 4,124,317.22 |
| 2. 本期利润 | 153,205,337.27 | 8,350,411.32 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1615 | 0.1479 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,604,810,785.11 | 104,715,230.74 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.0158 | 1.9614 |

注：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

汇丰晋信沪港深股票A净值表现

| 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 | 8.15% | 1.40% | 2.30% | 0.75% | 5.85% | 0.65% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 三个月 | | | | | | |
| 过去六个月 | 4.95% | 1.99% | 2.79% | 1.02% | 2.16% | 0.97% |
| 过去一年 | 39.72% | 1.86% | 19.64% | 1.00% | 20.08% | 0.86% |
| 过去三年 | 87.12% | 1.66% | 21.98% | 1.08% | 65.14% | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | 111.82% | 1.45% | 38.32% | 0.97% | 73.50% | 0.48% |

注：

过去三个月指 2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去六个月指 2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去一年指 2020 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去三年指 2018 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2016 年 11 月 10 日-2021 年 6 月 30 日

汇丰晋信沪港深股票C净值表现

| 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 | 8.02% | 1.40% | 2.30% | 0.75% | 5.72% | 0.65% |
| 过去六个月 | 4.70% | 1.99% | 2.79% | 1.02% | 1.91% | 0.97% |
| 过去一年 | 39.05% | 1.86% | 19.64% | 1.00% | 19.41% | 0.86% |
| 过去三年 | 84.22% | 1.66% | 21.98% | 1.08% | 62.24% | 0.58% |
| 自基金合 | 106.23% | 1.45% | 38.32% | 0.97% | 67.91% | 0.48% |

| | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|
| 同生 效起 至今 | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|

注：

过去三个月指 2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去六个月指 2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去一年指 2020 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

过去三年指 2018 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2016 年 11 月 10 日-2021 年 6 月 30 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

汇丰晋信沪港深股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月10日-2021年06月30日)



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%（投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于权证的比例为基金资产净值的 0-3%，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 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金依据法律法规的规定，本着谨慎和风险可控的原则，可参与创业板上市证券的投资。

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 5 月 10 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

3. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 45% + 恒生指数收益率 × 45% + 同业存款利率（税后）× 10%。

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沪深 300 指数、恒生指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信沪港深股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月10日-2021年06月30日)



- 注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%（投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于权证的比例为基金资产净值的 0-3%，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 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金依据法律法规的规定，本着谨慎和风险可控的原则，可参与创业板上市证券的投资。
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 5 月 10 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
3. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 45% + 恒生指数收益率 × 45% + 同业存款利率（税后）× 10%。
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沪深 300 指数、恒生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 | | |
| 程彧 | 海外投资部总监、汇丰晋信沪港深股票型证券投资 | 2016-11-10 | - | 14 | 加拿大英属哥伦比亚大学国际工商管理硕士。曾任 |

| | | | | |
|--|-----------------------------|--|---|---|
| | 基金、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金经理 | | 5 | 毕马威会计师事务所担任助理审计经理、摩根士丹利房地产基金投资经理、汇丰晋信基金管理有限公司国际业务部副总监、国际业务部总监、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金基金经理，现为海外投资部总监、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|-----------------------------|--|---|---|

注：1. 任职日期为本基金基金合同生效日的日期；
2. 证券从业年限是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 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，或者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

在经历了2021年一季度的大幅波动后，A股和港股市场在二季度小幅波动，最终均小幅收高。从风格来看，成长跑赢价值。从行业表现来看，新能源、医药、电子等行业在两地市场中总体表现领先，而金融、地产等行业表现落后。

在基金的投资运作方面，我们在二季度中前期维持了较高仓位，但在二季度中后期开始进行逐步减仓，并且在二季度末时将仓位降低到中性仓位以下水平。此外，伴随着仓位调整，我们亦将组合的风格向价值进行调整。从风险溢价的角度，出于对两地市场吸引力的考虑，我们二季度总体对港股维持了超配。二季度我们围绕中国核心资产进行了重点配置，即那些在中国经济转型过程中，具有可持续的、较高盈利能力并且在行业中有一定代表性的公司

我们认为，中国的经济正在稳健的复苏增长的过程中，企业的盈利能力也有明显的恢复增长，这是支持市场最有利的积极因素。但是，相对于上半年，下半年的两地市场预计将面临更多压力，挑战主要来自于：中国宏观经济增长的边际放缓、国内央行与美联储货币政策的收紧、大宗商品价格高企以及新冠病毒变异等因素带来的不确定性。因此，在风险事件落地和不确定性消除前，下半年我们将会维持中性或以下仓位并且保持总体均衡或偏向价值的组合风格，以等待更好的机会。从风险溢价的角度考虑以及港股市场的高股息价值类资产选择，下半年我们仍将在权益资产中更多配置港股市场。我们的组合仍将继续重点配置中国核心资产(核心资产不以行业或风格划分)。在行业配置和选股方面，在当前市场环境下，我们相对看好银行、电信运营商、建筑等行业中的龙头高股息资产，看好消费者服务(主要包括游戏、外卖、电商、物管、旅游、文娱等)、消费(主要包括运动品、乳制品、汽车等)、TMT(主要包括半导体国产替代、平台型电子龙头公司和SAAS云计算龙头)等行业。此外，我们亦看好新能源与创新药行业的中长期投资机会，等待估值回归后更佳的配置机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类份额净值增长率为8.15%，同期业绩比较基准收益率为2.30%；本基金C类份额净值增长率为8.02%，同期业绩比较基准收益率为2.30%。

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 | 1,440,053,360.14 | 82.05 |
| | 其中：股票 | 1,440,053,360.14 | 82.05 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 100,049,000.00 | 5.70 |
| | 其中：债券 | 100,049,000.00 | 5.70 |
| | 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 | 205,794,663.22 | 11.73 |
| 8 | 其他资产 | 9,149,839.10 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 1,755,046,862.46 | 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 | 219,812,588.43 | 12.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生 | 13,020.39 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| | 产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | 33,126,454.44 | 1.94 |
| F | 批发和零售业 | 13,105.24 | 0.00 |
| 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 | 28,004.40 | 0.00 |
| J | 金融业 | 134,919.69 | 0.01 |
| K | 房地产业 | 6,429,823.90 | 0.38 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,790.80 | 0.00 |
| 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 | 259,576,707.29 | 15.18 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%) |
|----------|----------------|----------------------------|
| 基础材料 | 160,608.08 | 0.01 |
| 非日常生活消费品 | 218,697,799.93 | 12.79 |
| 日常消费品 | 133,250,825.81 | 7.79 |
| 金融 | 371,992,003.82 | 21.76 |
| 医疗保健 | 2,839,805.83 | 0.17 |
| 工业 | 53,068,843.77 | 3.10 |
| 信息技术 | 142,392,409.08 | 8.33 |
| 电信服务 | 210,933,252.37 | 12.34 |
| 公用事业 | 209,035.14 | 0.01 |

| | | |
|-----|------------------|-------|
| 地产业 | 46,932,069.02 | 2.75 |
| 合计 | 1,180,476,652.85 | 69.05 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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 | H00285 | 比亚迪电子 | 3,334,500 | 141,503,108.76 | 8.28 |
| 2 | H00941 | 中国移动 | 2,909,000 | 117,516,280.96 | 6.87 |
| 3 | H00939 | 建设银行 | 20,619,000 | 104,827,177.45 | 6.13 |
| 4 | H00780 | 同程艺龙 | 6,267,200 | 101,375,940.93 | 5.93 |
| 5 | H01288 | 农业银行 | 43,146,000 | 96,932,493.94 | 5.67 |
| 6 | H01398 | 工商银行 | 23,738,560 | 90,070,857.38 | 5.27 |
| 7 | H03988 | 中国银行 | 33,212,000 | 77,101,764.28 | 4.51 |
| 8 | H06969 | 思摩尔国际 | 1,978,846 | 70,884,329.64 | 4.15 |
| 9 | 603589 | 口子窖 | 964,700 | 65,300,543.00 | 3.82 |
| 10 | 600741 | 华域汽车 | 2,445,800 | 64,251,166.00 | 3.76 |

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 | 100,049,000.00 | 5.85 |
| | 其中：政策性金融债 | 100,049,000.00 | 5.85 |
| 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 | 100,049,000.00 | 5.85 |

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 | 210304 | 21进出04 | 600,000 | 59,958,000.00 | 3.51 |
| 2 | 210404 | 21农发04 | 300,000 | 29,952,000.00 | 1.75 |
| 3 | 200215 | 20国开15 | 100,000 | 10,139,000.00 | 0.59 |

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 | 2,573,500.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 5,909,484.60 |
| 4 | 应收利息 | 481,061.58 |
| 5 | 应收申购款 | 185,792.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,149,839.10 |

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

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

| | 汇丰晋信沪港深股票A | 汇丰晋信沪港深股票C |
|----------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,098,545,908.43 | 58,505,458.32 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 57,557,928.39 | 8,102,970.30 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 359,997,531.14 | 13,219,429.83 |
| 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 | 796,106,305.68 | 53,388,998.79 |

§ 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 | 20210402 - 20210509; 20210528 - 20210603 | 230,262,867.08 | - | 86,762,867.08 | 143,500,000.00 | 16.89% |
| 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

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 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07月21日