

# 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

## 2021年第3季度报告

### 2021年09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

报告送出日期:2021年10月27日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月26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07月01日起至2021年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信中小盘股票
基金主代码	540007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	35,656,145.75份
投资目标	本基金通过精选具有持续成长潜力的中小型优势企业，充分把握其在成长为行业龙头过程中所体现出的高成长性、可持续性以及市值高速扩张所带来的投资机会，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>根据本基金所奉行的“关注成长、较高仓位、精选研究”的投资理念和“研究创造价值”的股票精选策略，在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>行业研究员通过分析行业特征，定期提出行业投资评级和配置建议。行业比较分析师综合内、</p>

	外部研究资源，结合宏观基本面分析等状况，提出重点行业配置比重的建议。 (3) 股票投资策略 本基金主要采用“自下而上”的方式挑选具有持续潜力、目前股价尚未充分反映公司未来高成长性的中小型上市公司股票作为主要投资对象。
业绩比较基准	中证700（中小盘）指数*90%+同业存款利率*10%。
风险收益特征	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计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。
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

### § 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07月01日 - 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	121,236.21
2. 本期利润	-6,734,110.21
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1856
4. 期末基金资产净值	74,548,796.00
5. 期末基金份额净值	2.0908

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、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	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		②	率③	率标准差 ④		
过去 三个 月	-8.16%	1.57%	0.55%	1.06%	-8.71%	0.51%
过去 六个 月	-3.69%	1.40%	9.78%	0.93%	-13.47%	0.47%
过去 一年	8.77%	1.59%	12.89%	1.05%	-4.12%	0.54%
过去 三年	113.85%	1.63%	52.20%	1.32%	61.65%	0.31%
过去 五年	82.05%	1.41%	22.64%	1.18%	59.41%	0.23%
自基 金合 同生 效起 至今	112.89%	1.59%	43.13%	1.45%	69.76%	0.14%

注：

过去三个月指2021年7月1日-2021年9月30日

过去六个月指2021年4月1日-2021年9月30日

过去一年指2020年10月1日-2021年9月30日

过去三年指2018年10月1日-2021年9月30日

过去五年指2016年10月1日-2021年9月30日

自基金合同生效起至今指2009年12月11日-2021年9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

汇丰晋信中小盘股票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  
(2009年12月11日-2021年09月30日)



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，其中，将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小上市公司股票。本基金权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（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%。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2010年6月11日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证700（中小盘）指数\*90% + 同业存款利率\*10%。

3. 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700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		

刘哲华	本基金基金经理	2020-01-20	-	4	刘哲华先生，澳大利亚国立大学应用金融硕士，2016年10月加入汇丰晋信基金管理有限公司，先后担任投资部助理研究员、专户理财部助理研究员，投资部研究员。现任本基金基金经理。
-----	---------	------------	---	---	---

注：1. 任职日期为本基金管理人公告刘哲华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

2021年三季度A股市场呈小幅震荡态势，沪深300指数下跌6.85%，中证500指数上涨4.34%。从行业板块看，煤炭、有色、钢铁表现居前，而消费者服务、医药、食品饮料等行业表现落后。

受益于国家“碳中和”政策，国内顺周期行业供给端受到较大限制的同时叠加需求端相对稳健，导致上游原材料价格整体上涨；同时由于涨价行为尚未明显传导至消费者终端，导致国内产业链整体出现超额利润向最上游转移的现象。A股市场的行业指数表现也充分体现出这一现象。

本报告期内，我们的持仓以中游制造业中各细分领域的龙头为主，持仓公司普遍具有较高的价格传导能力，对于原材料涨价的抵抗力强于行业平均水平，且具备长期成长性。然而受制于市场短期情绪，持仓公司短期内的表现弱于市场。

具体操作上，我们将风险控制放在首位，积极平衡短期风格偏好与长期价值，以期构建具有较高风险收益比与竞争力的投资组合。

#### 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-8.16%，同期业绩比较基准收益率为0.55%。

#### 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	70,245,110.05	92.48
	其中：股票	70,245,110.05	92.48

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,963,056.74	6.53
8	其他资产	746,574.70	0.98
9	合计	75,954,741.49	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	5,116,350.00	6.86
C	制造业	39,833,257.05	53.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,955,444.00	14.70
E	建筑业	3,128,673.00	4.20
F	批发和零售业	637,560.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	3,315,964.00	4.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,230,548.00	4.33
J	金融业	4,027,314.00	5.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	70,245,110.05	94.23

### 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	603187	海容冷链	116,220	4,718,532.00	6.33
2	603639	海利尔	213,960	3,757,137.60	5.04
3	002884	凌霄泵业	164,940	3,572,600.40	4.79
4	002484	江海股份	168,200	3,007,416.00	4.03
5	002158	汉钟精机	102,100	2,376,888.00	3.19
6	603566	普莱柯	120,400	2,323,720.00	3.12
7	601666	平煤股份	150,000	1,914,000.00	2.57
8	601179	中国西电	260,000	1,664,000.00	2.23
9	601555	东吴证券	154,700	1,542,359.00	2.07
10	600406	国电南瑞	37,200	1,335,852.00	1.79

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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	39,750.46
2	应收证券清算款	507,320.76
3	应收股利	-
4	应收利息	524.07
5	应收申购款	198,979.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	746,574.70

#### 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

报告期期初基金份额总额	37,354,564.65
报告期期间基金总申购份额	2,774,123.85
减：报告期期间基金总赎回份额	4,472,542.75
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	35,656,145.75

### § 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

无。

#### 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中小盘股票型证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信中小盘股票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) 报告期内汇丰晋信中小盘股票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

## 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10月27日