

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

2023年第1季度报告

2023年03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:2023年04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2023年4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2023年01月01日起至2023年03月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 汇丰晋信动态策略混合 |
| 基金主代码 | 540003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年04月09日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,898,254,899.14份 |
| 投资目标 | 本基金将致力于捕捉股票、债券等市场不同阶段中的不同投资机会，无论其处于牛市或者熊市，均通过基金资产在不同市场的合理配置，追求基金资产的长期较高回报。 |
| 投资策略 | <p>1. 积极主动的资产配置策略</p> <p>本基金奉行“恰当时机、恰当比重、恰当选股”的投资理念和“自上而下”与“自下而上”的双重选股策略。在投资决策中，本基金结合全球经济增长、通货膨胀和利息的预期，预测中国股票、债券市场的未来走势，在长期投资的基础上，将战略资产配置与择时相结合，灵活、主动的调整基金资产在股票、固定收益和现金上的配置比例。同时，在各类资产中，本基金根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产品种具体投资品种的种类和数量。</p> <p>2. 综合相对、绝对估值方法的股票筛选策略</p> |

| | | | |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------------|
| | 本基金不拘泥于单一的价值标准或成长标准，对股票给予全面的成长、价值分析，优选出价值低估，成长低估的上市公司进行投资。成长指标包括：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率（P/E）、净资产收益率（ROE）等；价值指标包括：市净率（P/B）、每股收益、年现金流/市值、股息率等。同时，再通过严格的基本面分析（CFROI（投资现金回报率）指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析）和公司实地调研，最大程度地筛选出有投资价值的投资品种。 | | |
| 业绩比较基准 | 业绩比较基准 = 50% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 50% × 中债新综合指数收益率（全价）。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益中等的基金产品。 | | |
| 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 | 汇丰晋信动态策略混合 A | 汇丰晋信动态策略混合 H | 汇丰晋信动态策略混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 540003 | 960003 | 016335 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,630,443,461.00 份 | 203,014,956.28 份 | 64,796,481.86 份 |

注：本基金自2016年6月28日起增加H类份额，自2022年8月1日起增加C类份额。

§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(2023年01月01日 - 2023年03月31日) | | |
|-----------------|--------------------------------|----------------|----------------|
| | 汇丰晋信动态策略混合 A | 汇丰晋信动态策略混合 H | 汇丰晋信动态策略混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -33,775,368.35 | -2,297,534.67 | -1,439,861.80 |
| 2. 本期利润 | 558,390,745.07 | 40,358,970.29 | 11,324,872.29 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3373 | 0.2160 | 0.1904 |
| 4. 期末基金资产净值 | 7,286,238,633.76 | 578,337,816.00 | 288,535,843.73 |

| | | | |
|------------|--------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 4.4689 | 2.8487 | 4.4530 |
|------------|--------|--------|--------|

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；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

汇丰晋信动态策略混合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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 8.51% | 1.08% | 2.57% | 0.40% | 5.94% | 0.68% |
| 过去六个月 | 11.30% | 1.26% | 3.16% | 0.50% | 8.14% | 0.76% |
| 过去一年 | 0.72% | 1.45% | -0.54% | 0.57% | 1.26% | 0.88% |
| 过去三年 | 125.83% | 1.46% | 11.15% | 0.60% | 114.68% | 0.86% |
| 过去五年 | 133.80% | 1.41% | 12.13% | 0.64% | 121.67% | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 567.02% | 1.51% | 52.42% | 0.83% | 514.60% | 0.68% |

注：

过去三个月指 2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日

过去六个月指 2022 年 10 月 1 日-2023 年 3 月 31 日

过去一年指 2022 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日

过去三年指 2020 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日

过去五年指 2018 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日

自基金合同生效起至今指 2007 年 4 月 9 日-2023 年 3 月 31 日

汇丰晋信动态策略混合H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 | 8.51% | 1.08% | 2.57% | 0.40% | 5.94% | 0.68% |
| 过去六个月 | 11.32% | 1.26% | 3.16% | 0.50% | 8.16% | 0.76% |

| | | | | | | |
|------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去一年 | 0.65% | 1.45% | -0.54% | 0.57% | 1.19% | 0.88% |
| 过去三年 | 125.35% | 1.46% | 11.15% | 0.60% | 114.20% | 0.86% |
| 过去五年 | 134.67% | 1.41% | 12.13% | 0.64% | 122.54% | 0.77% |
| 成立至今 | 184.87% | 1.27% | 17.82% | 0.59% | 167.05% | 0.68% |

注：

过去三个月指 2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 过去六个月指 2022 年 10 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 过去一年指 2022 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 过去三年指 2020 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 过去五年指 2018 年 4 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 成立至今指 2016 年 6 月 28 日-2023 年 3 月 31 日

汇丰晋信动态策略混合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 | 8.38% | 1.08% | 2.57% | 0.40% | 5.81% | 0.68% |
| 过去六个月 | 10.96% | 1.26% | 3.16% | 0.50% | 7.80% | 0.76% |
| 成立至今 | -3.13% | 1.29% | -1.62% | 0.51% | -1.51% | 0.78% |

注：

过去三个月指 2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 过去六个月指 2022 年 10 月 1 日-2023 年 3 月 31 日
 成立至今指 2022 年 8 月 1 日-2023 年 3 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

汇丰晋信动态策略混合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



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2007 年 10 月 9 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（2007 年 4 月 9 日）至 2014 年 5 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股在岸指数收益率+50%×中信标普全债指数收益率”。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“50%×MSCI 中国 A 股在岸指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。MSCI 中国 A 股在岸指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中。本基金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。

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

汇丰晋信动态策略混合H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：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

2. 本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股在岸指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。MSCI 中国 A 股在岸指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中。本基金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。

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

4. 本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额。

汇丰晋信动态策略混合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



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

2. 本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股在岸指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。MSCI 中国 A 股在岸指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中。本基金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。

3. 本基金自 2022 年 8 月 1 日起增加 C 类份额。

§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 | | |
| 陆彬 | 副总经理，投资总监，汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资 | 2020-05-09 | - | 8.5 | 陆彬先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理研究员、研究员、助理研究总监、总经理助理，现任副总经理、投资总 |

| | | | | | |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 资基金、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金基金经理 | | | | 监、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金、汇丰晋信时代先锋混合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陆彬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

2023年一季度，市场主要指数均普遍上涨，上证综指上涨5.94%，创业板指上涨2.25%，科创50指数上涨12.67%。在中信30个一级行业中，传媒、计算机、通信、电子行业涨幅较大，房地产、消费者服务、银行、电力设备及新能源行业表现相对落后。

站在当前，市场各主要指数的风险溢价水平依然处于历史较高位置，而波动率呈现低点回升的趋势，权益资产依然具备较高的吸引力，适合保持较高的仓位配置。国内各项支持政策陆续出台，经济进入复苏通道并向潜在增长水平回归，地产、消费、出口有望陆续迎来需求端的改善，各方面的经济数据也呈现了积极的因素，大部分的行业基本面相较去年都更为乐观，经济发展呈现稳中向好的趋势。基于当前的投资环境，我们将继续保持在不同行业间相对均衡的配置、偏左侧的投资风格，进行逆向投资布局。我们将通过自下而上的研究，寻找具备较高长期盈利水平，且市场估值已经充分反映了较多悲观预期，最终可能迎来盈利增长和估值提升的投资机会。

汇丰晋信动态策略基金将坚持基本面和估值相结合的投资体系，希望能持续挖掘基本面足够扎实、业绩中性预期、估值弱假设下，未来市值还有较大提升空间的优质企业。本基金当前重点配置新能源产业链、计算机、电子、保险、消费医药等行业。

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8.51%，同期业绩比较基准收益率为2.57%；本基金H类份额净值增长率为8.51%，同期业绩比较基准收益率为2.57%；本基金C类份额净值增长率为8.38%，同期业绩比较基准收益率为2.57%。

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 | 7,644,244,949.97 | 93.39 |
| | 其中：股票 | 7,644,244,949.97 | 93.39 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 379,053,754.58 | 4.63 |
| | 其中：债券 | 379,053,754.58 | 4.63 |
| | 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 | -9,024.66 | 0.00 |
| | 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 | 97,719,911.22 | 1.19 |
| 8 | 其他资产 | 64,146,254.46 | 0.78 |
| 9 | 合计 | 8,185,155,845.57 | 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 | 250,570,817.25 | 3.07 |
| C | 制造业 | 4,192,471,590.25 | 51.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,619.60 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 216,147,357.30 | 2.65 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,043,864,735.01 | 25.07 |
| J | 金融业 | 766,757,014.56 | 9.40 |
| 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 | 174,426,816.00 | 2.14 |
| 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 | 7,644,244,949.97 | 93.76 |

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 | 300454 | 深信服 | 4,552,587 | 673,600,772.52 | 8.26 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 7,086,895 | 535,202,310.40 | 6.56 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 1,296,100 | 526,281,405.00 | 6.45 |
| 4 | 002460 | 赣锋锂业 | 7,658,731 | 509,075,849.57 | 6.24 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 9,391,917 | 428,271,415.20 | 5.25 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 13,058,858 | 338,485,599.36 | 4.15 |
| 7 | 002405 | 四维图新 | 23,250,656 | 314,581,375.68 | 3.86 |
| 8 | 688798 | 艾为电子 | 2,677,857 | 312,773,697.60 | 3.84 |
| 9 | 688023 | 安恒信息 | 1,540,633 | 309,482,357.04 | 3.80 |
| 10 | 300379 | 东方通 | 11,457,548 | 282,084,831.76 | 3.46 |

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 | 379,053,754.58 | 4.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 379,053,754.58 | 4.65 |

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 | 239911 | 23贴现国债11 | 2,000,000 | 199,384,197.80 | 2.45 |
| 2 | 239915 | 23贴现国债15 | 1,500,000 | 149,695,452.38 | 1.84 |
| 3 | 239904 | 23贴现国债04 | 300,000 | 29,974,104.40 | 0.37 |

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
无。

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
无。

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
无。

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
无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。

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
无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期末，本基金投资的前十名证券的发行主体除江西赣锋锂业股份有限公司（002460）外，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。

本基金持有的“赣锋锂业”的发行主体江西赣锋锂业股份有限公司，因涉嫌A股某上市公司股票二级市场内幕交易，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会于2022年1月24日决定对公司立案（《立案告知书》编号：证监立案字0252022001号）。2022年12月6日，公司收到中国证监会江西监管局出具的《行政处罚事先告知书》（赣处罚字（2022）4号）。

本基金管理人会紧密跟踪并及时采取相应投资决策，截至目前，本基金对赣锋锂业的投资决策流程符合本公司规定。

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 | 1,428,656.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 57,620,231.75 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,097,366.64 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 64,146,254.46 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

| | 汇丰晋信动态策略 混合A | 汇丰晋信动态策略 混合H | 汇丰晋信动态策略 混合C |
|---------------------------|------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,635,898,329.78 | 175,827,152.54 | 41,902,015.41 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 194,033,793.13 | 39,699,991.72 | 68,448,944.66 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 199,488,661.91 | 12,512,187.98 | 45,554,478.21 |
| 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 | 1,630,443,461.00 | 203,014,956.28 | 64,796,481.86 |

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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净值比例达到或超过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动态策略混合型证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信动态策略混合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) 报告期内汇丰晋信动态策略混合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

2023年04月21日