

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本中期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2024年8月30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。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
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.....	54
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信大盘波动股票	
基金主代码	002334	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年03月11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	9,448,708.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信大盘波动股票A	汇丰晋信大盘波动股票C
下属分级基金的交易代码	002334	002335
报告期末下属分级基金的份额总额	7,892,403.59份	1,556,304.51份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于汇丰集团低波动率策略构建投资组合，力求为投资者提供相对业绩比较基准更高的相对收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、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>本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的低波动率策略。该策略包括了“估值-盈利”个股优选策略和波动率优化策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上</p>

	<p>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 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 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	沪深300指数*90%+同业存款利率（税后）*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、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。

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	周慧	王小飞
	联系电话	021-20376868	021-6063 7103
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	021-60637228
传真		021-20376999	021-60635778
注册地址		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	北京市西城区金融大街25号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	杨小勇	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金中期报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	汇丰晋信大盘波动股票A	汇丰晋信大盘波动股票C
本期已实现收益	-589,938.45	-126,050.06
本期利润	-418,684.47	-133,525.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0480	-0.0775
本期加权平均净值利润率	-3.41%	-5.74%
本期基金份额净值增长率	-3.62%	-3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末	

	(2024年06月30日)	
期末可供分配利润	3,131,867.46	531,084.04
期末可供分配基金份额利润	0.3968	0.3412
期末基金资产净值	11,024,271.05	2,087,388.55
期末基金份额净值	1.3968	1.3412
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	39.68%	34.12%

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

汇丰晋信大盘波动股票A

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	-2.82%	0.64%	-2.97%	0.43%	0.15%	0.21%
过去三个月	-1.40%	0.73%	-1.92%	0.68%	0.52%	0.05%
过去六个月	-3.62%	0.96%	0.82%	0.81%	-4.44%	0.15%
过去一年	-10.10%	0.85%	-8.88%	0.79%	-1.22%	0.06%
过去三年	-10.73%	0.91%	-30.26%	0.94%	19.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	39.68%	0.84%	13.84%	1.02%	25.84%	-0.18%

注：

过去一个月指2024年6月1日－2024年6月30日

过去三个月指2024年4月1日－2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日－2024年6月30日

过去一年指2023年7月1日－2024年6月30日

过去三年指2021年7月1日－2024年6月30日

自基金合同生效起至今指2016年3月11日－2024年6月30日

汇丰晋信大盘波动股票C

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	-2.86%	0.64%	-2.97%	0.43%	0.11%	0.21%
过去三个月	-1.53%	0.73%	-1.92%	0.68%	0.39%	0.05%
过去六个月	-3.86%	0.96%	0.82%	0.81%	-4.68%	0.15%
过去一年	-10.54%	0.85%	-8.88%	0.79%	-1.66%	0.06%
过去三年	-12.08%	0.91%	-30.26%	0.94%	18.18%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	34.12%	0.84%	13.84%	1.02%	20.28%	-0.18%

注：

过去一个月指2024年6月1日－2024年6月30日

过去三个月指2024年4月1日－2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日－2024年6月30日

过去一年指2023年7月1日－2024年6月30日

过去三年指2021年7月1日－2024年6月30日

自基金合同生效起至今指2016年3月11日－2024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



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80%-95%，除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%，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%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合，本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非现金基金资产的80%。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2016年9月12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 = 沪深300指数*90%+同业存款利率（税后）*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沪深300指数成份股在报告期产生的股票红利收益。



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80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,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%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合,本基金投资于前述"个股优选策略及波动率优化策略"精选的股票不低于非现金基金资产的80%。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2016年9月12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=沪深300指数*90%+同业存款利率(税后)*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沪深300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2024年6月30日,公司共管理38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）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自2020年11月19日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、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）、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）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019年8月2日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020年7月30日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020年8月13日成立）、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金（2020年10月29日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021年3月16日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021年5月24日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021年7月12日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022年1月21日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022年3月3日成立）、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金（2022年6月8日成立）、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金（2022年8月16日成立）、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金（2022年9月14日成立）、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金（2022年9月27日成立）、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金（2022年12月20日成立）、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金（2023年1月17日成立）、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（2023年12月12日成立）、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金（2024年4月16日成立）和汇丰晋信养老目标日期2036一年持有期混合型基金中基金(FOF)（2024年6月12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）	证券从业	说明

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘禹良	汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理	2023-11-18	-	4	刘禹良先生，硕士研究生，曾任北京时代富投投资咨询有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理。
方磊	权益投资部运营总监、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理	2016-03-11	-	24	方磊女士，新加坡南洋理工大学数学硕士，具备基金从业资格。曾任上海市长宁卫生局、上海电器有限公司统计师、PhillipSecuritieLtd.Pte金融工程师、上海德锦投资有限公司金融分析师、德隆友联战略投资管理咨询有限公司数据分析师、易评咨询有限公司顾问统计、汇丰晋信基金管理有限公司风险管理部副总监、规则化投资部总监。现任权益投资部运营总监、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理。

闫滢	汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理	2021-12-25	-	11	闫滢女士，硕士研究生。曾任易方达基金管理有限公司信用研究员、富国基金管理有限公司基金经理助理、万家基金管理有限公司基金经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理，协助基金经理开展固定收益资产和新股相关投资管理工作。
----	--------------------	------------	---	----	---

- 注：1.方磊女士任职日期为本基金基金合同生效日期；
 2.刘禹良先生任职日期为本基金管理人公告刘禹良先生担任本基金基金经理的日期；
 3.闫滢女士任职日期为本基金管理人公告闫滢女士担任本基金基金经理助理的日期；
 4.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 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

本基金从估值和盈利两个维度优选公司，通过波动率优化的方式来控制基金的波动率，同时采用多方案的模式来构建投资组合，力求将多个相关性低的投资方案组合配置起来，进一步降低基金的波动率，提升夏普比率，并促使组合表现更加稳健。本基金在投资流程上会更加注重规则化和纪律化。

2024年上半年，市场整体呈现下跌的态势。年初小微盘股出现流动性风险，跌幅居前，经历了春节后一波反弹，小微盘股继续走弱。大盘价值和红利风格则长时间占优。从行业看，银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业涨幅居前，而消费者服务、计算机、商贸零售、传媒、医药、房地产等板块跌幅居前。

本基金采用多方案模式进行规则化投资，主要仓位立足于大盘股，同时有小部分仓位进行全市场选股。年初整体配置较为均衡，但是市场上下跌的公司较多，少数超市值的、股息率高的公司表现优异，春节后，本基金开始在均衡的基础上更多偏重大市值股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值变化幅度为-3.62%，同期业绩比较基准为0.82%，本基金A类落后同期比较基准为4.44%；本基金C类本报告期内净值变化幅度为-3.86%，同期业绩比较基准为0.82%，本基金C类落后同期比较基准为4.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，全球经济体金融紧缩政策有望逐渐减轻，步入降息周期。国内经济上半年经济较为平稳，但消费意愿边际承压，随着政策持续加码，居民消费意愿有望回暖。

当前市场整体的估值水平依然处于一个较低位置，投资者风险偏好也持续处在低位。美联储下半年降息仍然是大概率事件，届时海外流动性会有所改善，如果国内相关的刺激政策加码，后续市场情绪有望逐步回升，A股市场有望回暖。

从行业角度来看，有很多方向值得关注。国家政策多次指出以科技创新推动产业创新，发展高水平现代化生产力，电子、通信等相关行业具备一定的配置价值。政府工作报告将“低空经济”列入新质生产力篇章，上游的核心零部件以及下游应用端的相关行业同样具有较大的潜力。此外，业绩稳定、能够持续分红的稳定型行业中的优质公司同样是我们关注的重点。

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，根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引，结合本基金基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司特设估值委员会作为公司基金估值的主要决策机关。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规以及基金估值运作等方面的专业胜任能力，估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的证券品种的估值数据。

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

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提交解决方案。

§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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,015,075.09	1,002,886.20
结算备付金		70,194.91	-
存出保证金		1,474.75	1,090.93
交易性金融资产	6.4.7.2	12,077,840.56	14,925,041.25
其中：股票投资		12,077,840.56	14,925,041.25
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		385.89	103,698.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,164,971.20	16,032,716.38
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,335.63	24,224.38
应付管理人报酬		13,268.39	16,784.45
应付托管费		2,211.37	2,797.43
应付销售服务费		873.38	1,181.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	32,622.83	38,912.47
负债合计		53,311.60	83,899.83

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	9,448,708.10	11,081,269.39
未分配利润	6.4.7.8	3,662,951.50	4,867,547.16
净资产合计		13,111,659.60	15,948,816.55
负债和净资产总计		13,164,971.20	16,032,716.38

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额为9,448,708.10份，其中A类基金份额总额为7,892,403.59份，基金份额净值1.3968元；C类基金份额总额为1,556,304.51份，基金份额净值1.3412元。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-426,745.94	2,138,239.66
1.利息收入		2,325.81	3,834.95
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,325.81	3,834.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-598,988.97	610,860.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-768,927.04	476,152.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	629.32
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	169,938.07	134,079.08
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	163,778.77	1,474,208.17
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	6,138.45	49,335.78
减：二、营业总支出		125,463.80	205,019.40
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	87,104.45	137,478.02
2.托管费	6.4.10.2.2	14,517.40	22,913.01
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,774.55	5,745.59
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	18,067.40	38,882.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-552,209.74	1,933,220.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-552,209.74	1,933,220.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-552,209.74	1,933,220.26

6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,081,269.39	4,867,547.16	15,948,816.55
二、本期期初净资产	11,081,269.39	4,867,547.16	15,948,816.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,632,561.29	-1,204,595.66	-2,837,156.95
（一）、综合收益总额	-	-552,209.74	-552,209.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,632,561.29	-652,385.92	-2,284,947.21
其中：1.基金申购款	1,180,730.62	447,470.80	1,628,201.42
2.基金赎回款	-2,813,291.91	-1,099,856.72	-3,913,148.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	9,448,708.10	3,662,951.50	13,111,659.60
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	12,375,383.01	4,918,483.71	17,293,866.72
二、本期期初净资产	12,375,383.01	4,918,483.71	17,293,866.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-344,873.81	1,640,005.18	1,295,131.37
（一）、综合收益总额	-	1,933,220.26	1,933,220.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-344,873.81	-293,215.08	-638,088.89
其中：1.基金申购款	6,375,882.05	3,132,544.76	9,508,426.81
2.基金赎回款	-6,720,755.86	-3,425,759.84	-10,146,515.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	12,030,509.20	6,558,488.89	18,588,998.09

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：

李选进

苑忠磊

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

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(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[2015]第2564号《关于准予汇丰晋信大盘波动精选股票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《汇丰晋信大盘波动精选股票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,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291,092,480.36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(2016)第255号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》于2016年3月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为291,130,104.74份基金份额,其中认购资金利息折合37,624.38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。

根据经批准的《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即A类基金份额和C类基金份额。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信大盘波动精选股票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、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。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80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,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比例不低于基金资产净值的5%。本基金使用"个股优选策略及波动率优化策略"精选的股票不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数 \times 90%+同业存款利率(税后) \times 10%。

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2024年8月30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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

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<年度报告和中期报告>》、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》、《汇丰晋信大盘波动精选股票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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2024年6月30日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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2024年上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2024年06月30日的财务状况以及2024年上半年度的经营成果和净资产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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款		1,015,075.09
等于：本金		1,014,987.12
加：应计利息		87.97
减：坏账准备		-
定期存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
其中：存款期限1个月以内		-
存款期限1-3个月		-
存款期限3个月以上		-
其他存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计		1,015,075.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,545,112.24	-	12,077,840.56	-467,271.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,545,112.24	-	12,077,840.56	-467,271.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.56
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,689.87
其中：交易所市场	23,689.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	8,927.40
合计	32,622.83

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇丰晋信大盘波动股票A

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信大盘波动股票A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,038,399.27	9,038,399.27
本期申购	793,592.42	793,592.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,939,588.10	-1,939,588.10
本期末	7,892,403.59	7,892,403.59

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7.2 汇丰晋信大盘波动股票C

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信大盘波动股票C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,042,870.12	2,042,870.12
本期申购	387,138.20	387,138.20
本期赎回（以“-”号填列）	-873,703.81	-873,703.81
本期末	1,556,304.51	1,556,304.51

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 汇丰晋信大盘波动股票A

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信大盘波动股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,175,717.55	-1,115,227.75	4,060,489.80
本期期初	5,175,717.55	-1,115,227.75	4,060,489.80
本期利润	-589,938.45	171,253.98	-418,684.47
本期基金份额交易产生的变动数	-559,455.54	49,517.67	-509,937.87

其中：基金申购款	360,048.59	-45,682.46	314,366.13
基金赎回款	-919,504.13	95,200.13	-824,304.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,026,323.56	-894,456.10	3,131,867.46

6.4.7.8.2 汇丰晋信大盘波动股票C

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信大盘波动股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,054,930.64	-247,873.28	807,057.36
本期期初	1,054,930.64	-247,873.28	807,057.36
本期利润	-126,050.06	-7,475.21	-133,525.27
本期基金份额交易产生的变动数	-224,179.83	81,731.78	-142,448.05
其中：基金申购款	160,778.91	-27,674.24	133,104.67
基金赎回款	-384,958.74	109,406.02	-275,552.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	704,700.75	-173,616.71	531,084.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,029.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	287.38
其他	9.40
合计	2,325.81

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	24,585,174.32
减：卖出股票成本总额	25,294,468.91
减：交易费用	59,632.45
买卖股票差价收入	-768,927.04

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	169,938.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	169,938.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	163,778.77
——股票投资	163,778.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	163,778.77

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	2,398.21
基金转换费收入	3,740.24
合计	6,138.45

注： 1.本基金对于持有A类基金份额少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有A类基金份额不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其中不低于75%计入基金财产；对于持有A类基金份额不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其中不低于50%计入基金财产；对于持有A类基金份额长于6个月的基金份额所收取的赎回费，其中不低于25%计入基金财产。对于持续持有C类基金份额少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有C类基金份额长于30日但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。本基金的赎回费率按持有期间递减。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分组成，其中赎回费部分按照上述规则归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	8,927.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	140.00

银行间市场债券账户维护费	9,000.00
合计	18,067.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

无。

6.4.9.2 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	87,104.45	137,478.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,902.25	55,946.54
应支付基金管理人的净管理费	51,202.20	81,531.48

注：自2023年1月1日至2023年11月30日，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。根据基金管理人汇丰晋信于2023年11月25日发布的《汇丰晋信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年12月1日起，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1.20%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×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,517.40	22,913.01

注：自2023年1月1日至2023年11月30日，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。根据基金管理人汇丰晋信于2023年11月25日发布的《汇丰晋信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年12月1日起，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0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信大盘波动股票A	汇丰晋信大盘波动股票C	合计
汇丰晋信	0.00	0.72	0.72
建设银行	0.00	1,075.90	1,075.90
合计	0.00	1,076.62	1,076.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信大盘波动股票A	汇丰晋信大盘波动股票C	合计
汇丰晋信	0.00	0.82	0.82
建设银行	0.00	1,020.11	1,020.11
合计	0.00	1,020.93	1,020.93

注：A类基金份额不收取基金销售服务费，C类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇丰晋信，再由汇丰晋信计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 X 0.50%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	1,015,075.09	2,029.03	2,699,803.12	3,488.22

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制限定在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2024年6月30日，本基金无债券投资(2023年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方

面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年06月30日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2024年06月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理

人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,015,075.09	-	-	-	1,015,075.09
结算备付金	70,194.91	-	-	-	70,194.91
存出保证金	1,474.75	-	-	-	1,474.75
交易性金融资产	-	-	-	12,077,840.56	12,077,840.56

应收申购款	-	-	-	385.89	385.89
资产总计	1,086,744.75	-	-	12,078,226.45	13,164,971.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,335.63	4,335.63
应付管理人报酬	-	-	-	13,268.39	13,268.39
应付托管费	-	-	-	2,211.37	2,211.37
应付销售服务费	-	-	-	873.38	873.38
其他负债	-	-	-	32,622.83	32,622.83
负债总计	-	-	-	53,311.60	53,311.60
利率敏感度缺口	1,086,744.75	-	-	12,024,914.85	13,111,659.60
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,002,886.20	-	-	-	1,002,886.20
存出保证金	1,090.93	-	-	-	1,090.93
交易性金融资产	-	-	-	14,925,041.25	14,925,041.25
应收申购款	-	-	-	103,698.00	103,698.00

资产总计	1,003,977.13	-	-	15,028,739.25	16,032,716.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,224.38	24,224.38
应付管理人报酬	-	-	-	16,784.45	16,784.45
应付托管费	-	-	-	2,797.43	2,797.43
应付销售服务费	-	-	-	1,181.10	1,181.10
其他负债	-	-	-	38,912.47	38,912.47
负债总计	-	-	-	83,899.83	83,899.83
利率敏感度缺口	1,003,977.13	-	-	14,944,839.42	15,948,816.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2023年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产的80%-95%，其中投资于个股优选策略及波动率优化策略精选的股票不低于非现金基金资产的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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	12,077,840.56	92.12	14,925,041.25	93.58
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,077,840.56	92.12	14,925,041.25	93.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	647,154.11	669,380.01
	2.业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-647,154.11	-669,380.01

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	12,077,840.56	14,925,041.25
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	12,077,840.56	14,925,041.25

6.4.14.2.2 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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	12,077,840.56	91.74
	其中：股票	12,077,840.56	91.74
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	1,085,270.00	8.24
8	其他各项资产	1,860.64	0.01

9	合计	13,164,971.20	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 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	237,576.00	1.81
B	采矿业	1,213,945.00	9.26
C	制造业	7,623,668.80	58.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	620,228.00	4.73
E	建筑业	51,088.00	0.39
F	批发和零售业	300,450.36	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	612,519.00	4.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,365.40	1.06
J	金融业	1,023,338.00	7.80
K	房地产业	46,809.00	0.36
L	租赁和商务服务业	56,925.00	0.43
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	80,080.00	0.61
Q	卫生和社会工作	13,416.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	58,432.00	0.45
	合计	12,077,840.56	92.12

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	200	293,478.00	2.24
2	600919	江苏银行	37,600	279,368.00	2.13
3	300750	宁德时代	1,300	234,039.00	1.78
4	300308	中际旭创	1,260	173,728.80	1.32
5	600938	中国海油	5,000	165,000.00	1.26
6	000333	美的集团	2,500	161,250.00	1.23
7	603993	洛阳钼业	18,800	159,800.00	1.22
8	601058	赛轮轮胎	10,400	145,600.00	1.11
9	002252	上海莱士	17,900	139,978.00	1.07
10	600023	浙能电力	19,500	138,645.00	1.06
11	000651	格力电器	3,500	137,270.00	1.05
12	300679	电连技术	3,400	136,782.00	1.04
13	300498	温氏股份	6,800	134,776.00	1.03
14	600066	宇通客车	5,200	134,160.00	1.02
15	000858	五粮液	1,000	128,040.00	0.98
16	000975	山金国际	7,800	127,062.00	0.97
17	000725	京东方 A	28,300	115,747.00	0.88
18	002468	申通快递	13,400	112,560.00	0.86
19	603605	珀莱雅	1,000	110,990.00	0.85
20	002594	比亚迪	400	100,100.00	0.76
21	000807	云铝股份	7,400	99,974.00	0.76
22	600886	国投电力	5,300	96,672.00	0.74
23	603986	兆易创新	1,000	95,620.00	0.73
24	601318	中国平安	2,300	95,128.00	0.73
25	688076	诺泰生物	1,200	93,936.00	0.72
26	600150	中国船舶	2,300	93,633.00	0.71
27	601138	工业富联	3,400	93,160.00	0.71
28	600036	招商银行	2,700	92,313.00	0.70
29	688008	澜起科技	1,600	91,456.00	0.70
30	301004	嘉益股份	1,000	91,000.00	0.69
31	000400	许继电气	2,600	89,466.00	0.68

32	688578	艾力斯	1,400	89,236.00	0.68
33	601601	中国太保	3,200	89,152.00	0.68
34	300760	迈瑞医疗	300	87,273.00	0.67
35	300115	长盈精密	7,100	85,129.00	0.65
36	601021	春秋航空	1,500	84,495.00	0.64
37	600015	华夏银行	13,200	84,480.00	0.64
38	300502	新易盛	800	84,440.00	0.64
39	002142	宁波银行	3,800	83,828.00	0.64
40	601298	青岛港	8,700	83,172.00	0.63
41	603160	汇顶科技	1,200	82,500.00	0.63
42	600795	国电电力	13,700	82,063.00	0.63
43	688766	普冉股份	840	81,622.80	0.62
44	601567	三星医疗	2,300	80,500.00	0.61
45	002595	豪迈科技	2,100	80,157.00	0.61
46	000526	学大教育	1,300	80,080.00	0.61
47	600483	福能股份	6,800	79,288.00	0.60
48	688169	石头科技	200	78,520.00	0.60
49	603195	公牛集团	1,015	78,276.80	0.60
50	000543	皖能电力	8,800	77,880.00	0.59
51	600958	东方证券	10,200	77,520.00	0.59
51	600887	伊利股份	3,000	77,520.00	0.59
53	600489	中金黄金	5,200	76,960.00	0.59
54	002463	沪电股份	2,100	76,650.00	0.58
55	002683	广东宏大	3,800	76,494.00	0.58
56	002493	荣盛石化	7,800	75,348.00	0.57
57	603556	海兴电力	1,600	74,928.00	0.57
58	300673	佩蒂股份	5,700	74,784.00	0.57
59	600863	内蒙华电	16,000	74,240.00	0.57
60	002444	巨星科技	3,000	74,100.00	0.57
61	688408	中信博	800	73,664.00	0.56
62	000800	一汽解放	9,400	73,602.00	0.56

63	002001	新和成	3,800	72,960.00	0.56
64	601127	赛力斯	800	72,896.00	0.56
65	600132	重庆啤酒	1,200	72,840.00	0.56
66	002304	洋河股份	900	72,666.00	0.55
67	688065	凯赛生物	1,600	72,624.00	0.55
68	601333	广深铁路	22,400	72,576.00	0.55
69	002155	湖南黄金	4,000	72,400.00	0.55
70	600660	福耀玻璃	1,500	71,850.00	0.55
71	600497	驰宏锌锗	13,400	71,556.00	0.55
72	000598	兴蓉环境	9,500	71,440.00	0.54
73	003006	百亚股份	3,000	71,100.00	0.54
74	601088	中国神华	1,600	70,992.00	0.54
75	600737	中粮糖业	7,400	70,966.00	0.54
76	002311	海大集团	1,500	70,575.00	0.54
77	002129	TCL中环	8,100	70,065.00	0.53
78	601168	西部矿业	3,900	70,005.00	0.53
79	603055	台华新材	6,900	69,897.00	0.53
80	002078	太阳纸业	5,000	69,750.00	0.53
81	603296	华勤技术	1,260	69,589.80	0.53
82	688233	神工股份	3,600	69,372.00	0.53
83	603369	今世缘	1,500	69,300.00	0.53
84	300896	爱美客	400	68,840.00	0.53
85	603298	杭叉集团	3,500	68,740.00	0.52
86	600529	山东药玻	2,700	68,418.00	0.52
87	601633	长城汽车	2,700	68,310.00	0.52
88	601918	新集能源	7,000	68,250.00	0.52
89	300761	立华股份	3,000	67,920.00	0.52
90	002318	久立特材	2,900	67,657.00	0.52
91	601598	中国外运	12,000	67,560.00	0.52
92	300832	新产业	1,000	67,440.00	0.51
93	002221	东华能源	8,200	67,322.00	0.51

94	603158	腾龙股份	9,500	66,880.00	0.51
95	601018	宁波港	19,500	66,300.00	0.51
96	601500	通用股份	12,400	66,216.00	0.51
97	301345	涛涛车业	1,200	66,120.00	0.50
98	300842	帝科股份	1,700	65,960.00	0.50
99	603979	金诚信	1,300	65,689.00	0.50
100	688234	天岳先进	1,400	65,688.00	0.50
101	601899	紫金矿业	3,700	65,009.00	0.50
102	600582	天地科技	9,400	64,766.00	0.49
103	601001	晋控煤业	3,900	64,428.00	0.49
104	601228	广州港	21,100	64,355.00	0.49
105	600933	爱柯迪	4,300	63,597.00	0.49
106	600967	内蒙一机	8,800	63,360.00	0.48
107	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.48
108	002053	云南能投	5,200	62,868.00	0.48
109	600739	辽宁成大	7,300	61,101.00	0.47
110	600959	江苏有线	23,100	60,984.00	0.47
111	002035	华帝股份	9,700	60,431.00	0.46
112	600535	天士力	4,800	60,384.00	0.46
113	000937	冀中能源	9,000	60,300.00	0.46
114	002984	森麒麟	2,500	60,225.00	0.46
115	300059	东方财富	5,700	60,192.00	0.46
116	603156	养元饮品	2,800	59,556.00	0.45
117	002906	华阳集团	2,200	58,872.00	0.45
118	600998	九州通	11,997	58,545.36	0.45
119	600673	东阳光	8,300	58,432.00	0.45
120	300433	蓝思科技	3,200	58,400.00	0.45
121	601166	兴业银行	3,300	58,146.00	0.44
122	603786	科博达	900	57,735.00	0.44
123	300783	三只松鼠	2,500	54,675.00	0.42
124	605007	五洲特纸	4,300	54,309.00	0.41

125	605305	中际联合	2,100	54,159.00	0.41
126	002697	红旗连锁	11,500	53,245.00	0.41
127	300791	仙乐健康	2,080	52,416.00	0.40
128	002475	立讯精密	1,300	51,103.00	0.39
129	601117	中国化学	6,200	51,088.00	0.39
130	600566	济川药业	1,600	50,736.00	0.39
131	300124	汇川技术	900	46,170.00	0.35
132	601698	中国卫通	3,200	45,088.00	0.34
133	601398	工商银行	7,900	45,030.00	0.34
134	002050	三花智控	2,300	43,884.00	0.33
135	000977	浪潮信息	1,200	43,644.00	0.33
136	002920	德赛西威	500	43,545.00	0.33
137	600276	恒瑞医药	1,000	38,460.00	0.29
138	002027	分众传媒	6,300	38,178.00	0.29
139	002415	海康威视	1,200	37,092.00	0.28
140	600029	南方航空	6,200	36,518.00	0.28
141	000786	北新建材	1,200	35,592.00	0.27
142	002714	牧原股份	800	34,880.00	0.27
143	600030	中信证券	1,900	34,637.00	0.26
144	002371	北方华创	100	31,989.00	0.24
145	000568	泸州老窖	200	28,698.00	0.22
146	000063	中兴通讯	1,000	27,970.00	0.21
147	601155	新城控股	3,000	26,610.00	0.20
148	300274	阳光电源	420	26,052.60	0.20
149	000338	潍柴动力	1,600	25,984.00	0.20
150	002230	科大讯飞	600	25,770.00	0.20
151	002352	顺丰控股	700	24,983.00	0.19
152	601288	农业银行	5,400	23,544.00	0.18
153	000100	TCL科技	5,400	23,328.00	0.18
154	000792	盐湖股份	1,200	20,940.00	0.16
155	601888	中国中免	300	18,747.00	0.14

156	000625	长安汽车	1,300	17,459.00	0.13
157	600426	华鲁恒升	600	15,984.00	0.12
158	000538	云南白药	300	15,345.00	0.12
159	000708	中信特钢	1,000	13,570.00	0.10
160	300015	爱尔眼科	1,300	13,416.00	0.10
161	000938	紫光股份	600	13,410.00	0.10
162	000002	万科A	1,900	13,167.00	0.10
163	300408	三环集团	400	11,676.00	0.09
164	000661	长春高新	100	9,177.00	0.07
165	002466	天齐锂业	300	8,973.00	0.07
166	002460	赣锋锂业	300	8,595.00	0.07
167	300122	智飞生物	300	8,409.00	0.06
168	002180	纳思达	300	7,926.00	0.06
169	002179	中航光电	200	7,610.00	0.06
170	002271	东方雨虹	600	7,404.00	0.06
171	001979	招商蛇口	800	7,032.00	0.05
172	002555	三七互娱	500	6,525.00	0.05
173	300003	乐普医疗	400	5,936.00	0.05
174	000963	华东医药	200	5,562.00	0.04
175	600031	三一重工	300	4,950.00	0.04
176	300573	兴齐眼药	20	3,280.00	0.03
177	600406	国电南瑞	40	998.40	0.01

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	600919	江苏银行	298,966.00	1.87
2	002947	恒铭达	182,062.00	1.14

3	600497	驰宏锌锗	179,771.00	1.13
4	000651	格力电器	178,579.00	1.12
5	603993	洛阳钼业	167,312.00	1.05
6	300750	宁德时代	165,489.00	1.04
7	300308	中际旭创	157,129.00	0.99
8	601058	赛轮轮胎	153,499.00	0.96
9	002984	森麒麟	152,081.00	0.95
10	300783	三只松鼠	151,089.00	0.95
11	688408	中信博	150,468.15	0.94
12	600938	中国海油	150,141.00	0.94
13	603605	珀莱雅	149,463.00	0.94
14	600023	浙能电力	149,243.00	0.94
15	300679	电连技术	148,441.00	0.93
16	600066	宇通客车	144,711.00	0.91
17	000975	山金国际	144,624.00	0.91
18	601998	中信银行	144,128.00	0.90
19	600737	中粮糖业	142,423.00	0.89
20	002714	牧原股份	141,309.00	0.89

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	601138	工业富联	306,783.00	1.92
2	300308	中际旭创	301,358.00	1.89
3	600219	南山铝业	290,300.00	1.82
4	601229	上海银行	275,934.00	1.73
5	600000	浦发银行	267,478.00	1.68

6	002938	鹏鼎控股	254,359.00	1.59
7	600104	上汽集团	251,645.00	1.58
8	000651	格力电器	247,656.00	1.55
9	601717	郑煤机	244,491.00	1.53
10	002202	金风科技	227,059.00	1.42
11	000895	双汇发展	226,562.00	1.42
12	601009	南京银行	222,540.00	1.40
13	601166	兴业银行	215,142.00	1.35
14	002241	歌尔股份	207,784.00	1.30
15	601877	正泰电器	203,767.00	1.28
16	600089	特变电工	201,308.00	1.26
17	601088	中国神华	200,546.00	1.26
18	000157	中联重科	192,758.00	1.21
19	002947	恒铭达	187,451.00	1.18
20	600196	复星医药	185,644.00	1.16

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	22,283,489.45
卖出股票收入（成交）总额	24,585,174.32

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

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期末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	1,474.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	385.89
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,860.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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。

§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

份额级别	持有人户数(户)	人均持有的基金份额	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
汇丰晋信大盘波动股票A	490	16,106.95	866,310.55	10.98%	7,026,093.04	89.02%
汇丰晋信大盘波动股票C	421	3,696.69	0.00	0.00%	1,556,304.51	100.00%

合计	911	10,371.80	866,310.55	9.17%	8,582,397.55	90.83%
----	-----	-----------	------------	-------	--------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇丰晋信大盘波动股票A	22,422.30	0.2841%
	汇丰晋信大盘波动股票C	13.68	0.0009%
	合计	22,435.98	0.2375%

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	份额级别	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	汇丰晋信大盘波动股票A	0
	汇丰晋信大盘波动股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	汇丰晋信大盘波动股票A	0~10
	汇丰晋信大盘波动股票C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信大盘波动股票 A	汇丰晋信大盘波动股票 C
基金合同生效日(2016年03月11 日)基金份额总额	220,794,046.57	70,336,058.17

本报告期期初基金份额总额	9,038,399.27	2,042,870.12
本报告期基金总申购份额	793,592.42	387,138.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,939,588.10	873,703.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,892,403.59	1,556,304.51

注：此处申购含红利再投、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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年02月01日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局

受到的具体措施类型	基金管理人被采取责令改正的行政监管措施，相关高级管理人员被采取出具警示函的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	公司内部控制管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，按要求及时完成整改，监管机构已验收通过整改结果，公司所有业务均正常开展
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的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	
东北证券	1	101,469.00	0.22%	95.99	0.22%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	4,083,693.00	8.71%	3,862.78	8.71%	-
华泰	1	-	-	-	-	-

证券						
山西 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	15,312,208.53	32.67%	14,483.75	32.67%	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
中投 证券	1	-	-	-	-	-
中信 建投	1	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	20,353,646.54	43.43%	19,252.80	43.43%	-
国投 证券	2	79,814.00	0.17%	75.51	0.17%	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	1,017,367.17	2.17%	962.42	2.17%	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	5,920,465.53	12.63%	5,600.19	12.63%	-

注：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

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-01-22
2	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-03-29
3	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增光大银行为汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-04-12
4	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-04-22
5	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金更新招募说明书（2024年第1号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28
6	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28
7	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28

§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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信大盘波动精选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大盘波动精选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

12.2 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。

12.3 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

二〇二四年八月三十一日