

汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	7
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.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信港股通双核混合
基金主代码	007291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年08月02日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	537,455,026.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金致力于捕捉股票、债券市场不同阶段的投资机会，对于股票投资部分，主要投资于优质的港股通标的股票,基于汇丰"profitability-valuation"选股模型，筛选出低估值、高盈利的股票，严格遵守投资纪律，在债券投资上，遵循稳健投资的原则，以追求超越业绩基准的长期投资收益。</p>
投资策略	<p>本基金的双核策略指的是以下两个核心策略：</p> <p>1) 在资产配置上借鉴汇丰经验，采用基于多因素分析的大类资产配置策略，实现资产合理配置。</p> <p>2) 在个股选择上采用汇丰集团在海外市场成功运作的"估值-盈利个股精选策略"，筛选低估值、高盈利的股票。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将上市公司作为一个整体考虑，如果整体上市公司的业绩预期改善、投资者的风险偏好增强、无风险利率下降，则预期股市看涨，应采取加仓的策略；反之亦然。</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</p>

	<p>据港股通投资的具体特征，将运用"Profitability-Valuation"（盈利-估值）投资策略作为本基金股票资产的主要投资策略。</p> <p>该策略的目标是就特定盈利能力水平的股票中，选取估值低于市场平均值的股票。我们相信，如果盈利能力是可持续的，那么这些股票应该会均值回归，从而增加我们产生超额收益的机会。</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>中证港股通综合指数收益率*70%+中债新综合指数*30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益风险水平的投资品种。</p> <p>本基金投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票，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。</p>

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周慧	张姗
	联系电话	021-20376868	400-61-95555
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-20376888	400-61-95555
传真		021-20376999	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		杨小勇	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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；招商银行股份有限公司：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

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)
本期已实现收益	23,113,222.23
本期利润	74,775,674.30
加权平均基金份额本期利润	0.1440
本期加权平均净值利润率	14.90%
本期基金份额净值增长率	16.86%
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	-150,158,364.41
期末可供分配基金份额利润	-0.2794
期末基金资产净值	573,808,867.51
期末基金份额净值	1.0676
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	6.76%

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	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.53%	1.17%	-1.06%	0.70%	1.59%	0.47%
过去三个月	11.74%	1.21%	5.91%	0.87%	5.83%	0.34%
过去六个月	16.86%	1.36%	5.34%	0.91%	11.52%	0.45%
过去一年	5.89%	1.35%	-3.03%	0.87%	8.92%	0.48%
过去三年	-40.03%	2.02%	-21.70%	1.00%	-18.33%	1.02%
自基金合同生效起至今	6.76%	1.91%	-11.19%	0.97%	17.95%	0.94%

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2019年8月2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

汇丰晋信港股通双核策略混合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
(2019年08月02日-2024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：股票投资比例范围为基金资产的50%-95%（其中，港股通标的股票投资比例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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。
- 2.本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至2020年2月2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 = 中证港股通综合指数收益率*70%+中债新综合指数*30%。
- 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中证港股通综合指数成份股在报告期产生的股票红利收益。本基金业绩比较基准中的中债新综合指数为中债新综合全价（总值）指数，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。

§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）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付倍佳	汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金和汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金经理	2023-02-04	-	6	付倍佳女士，硕士研究生。曾任上海申银万国证券研究所有限公司分析师，汇丰晋信基金管理有限公司港股研究员、高级港股研究员、基金经理助理，现任汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金和汇丰晋信港股通双核策略混合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.付倍佳女士任职日期为本基金管理人公告付倍佳女士担任本基金基金经理的日期；
- 2.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；
- 3.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 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

2024年上半年，国内经济呈现结构性复苏，盈利预测波动逐步收敛；海外通胀回落，美债长端利率有望进入下行通道；全球风险偏好短期或受衰退预期抑制，整体风险资产波动率加大。港股先抑后扬，上半年收涨，价值因子、市值因子表现显著领先。我们认为二季度港股上涨是由利率端、盈利端、交易端共同驱动：1) 利率端：压制港股估值的要素之一是长端美债利率过去三年随加息上行，随着美国经济数据走弱，降息预期再起，美债利率进入下行趋势，港股资产估值修复弹性大。2) 盈利端：随超长国债发行、地产政策发力，盈利预期转暖，同时港股多个行业头部公司加大分红回购，ROE确定性有望抬升，是支持港股市场上行持续性的主要驱动力。3) 交易端：全球投资者对港股的配置比例处于历史低位，本轮全球资产再平衡，被动资金或直接配置MSCI指数（其中港股占比超70%），导致港股权重股二季度涨幅领先。我们认为美债利率下行趋势已确立，港股流动性有望实质改善，盈利侧有韧性亦有弹性，市场机会大于风险。

从行业表现来看，2024年上半年港股市场中石油石化、有色金属、家电等行业涨幅居前，反映市场偏好供给有约束、全球定价的资产。医药、商贸零售、计算机等行业表现落后，主要反映市场风险偏好下移，对现金流因子敏感。风格上，价值持续跑赢成长。

在基金的投资运作方面，本基金产品在上半年整体维持了高仓位运行，加大了“杠铃型”策略的两极化配置。高确定性资产板块里，我们阶段性超配公用事业、石油石化等红利资产；高成长性资产板块里，我们逐步超配消费电子、创新药等产品周期驱动类资产；作为杠铃杆，我们将有色金属作为中长期底仓，此类资产供给受限，全球定价，价格中枢有望持续抬升。

4.4.2 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16.86%，同期业绩比较基准收益率为5.34%，本基金领先同期比较基准11.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们在耐心等待港股从盈利下行与利率上行的最差情形转向盈利企稳上行与利率见顶回落的正向组合。但今年在海外地缘摩擦加剧、美联储政策转向、国内行业复苏分化的背景下，或呈现高波动率特征。因此，我们在组合上基于宏观及中观视角，会动态调整组合 β ；基于资产属性及行业景气驱动视角，配置风险回报比高且行业间相关性较弱的板块；基于公司基本面研究视角，优选个股。

我们选择“确定性+创新性”两极化配置，关注三条投资主线：

1. 受益于盈利增长高弹性及估值对利率下行较为敏感，我们看好港股互联网、电子、创新药的投资机会。

1) 盈利高弹性，估值未充分反映。受益于经营杠杆弹性大、前期降本增效优、竞争格局边际改善的互联网，盈利增长或持续优于预期。然而，市场的反馈仍不积极，钝化的低位估值水平提供了良好的布局时机。

2) 远期成长性突出。电子及创新药公司有立足长期的前沿技术/产品迭代以迎接下一轮的收入扩张机会，有望开启二次增长曲线。

2. 受益于供给有约束，需求紧平衡，我们看好有色金属的投资机会。

1) 国内铜矿企业或迎来向上双击。铜中长期供给约束明显，海外头部矿企品位下滑明显，边际成本抬升，有利于铜价中枢中长期上行。同时，未来五年铜矿产量增长来源大部分都在国内上市的头部矿企，当前估值在全球来看尚有折价，有望迎来估值扩张。

2) 有色金属与其他权益资产弱相关，作为组合板块配置，或有效降低组合波动率。

3. 受益于经营壁垒高、资本开支下移、现金流改善，我们看好公用事业等高股息资产的投资机会。关注行业集中度提升、基本面夯实、整体ROE水平稳中有升、以及分红意愿提升的红利资产的投资机会。

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

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 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

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	51,239,259.04	33,336,154.23
结算备付金		1,203,928.19	12,786,300.43
存出保证金		36,551.93	12,411.86
交易性金融资产	6.4.7.2	516,668,809.92	485,415,673.32
其中：股票投资		516,668,809.92	485,415,673.32
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		918,704.06	-
应收股利		5,787,623.77	26,395.58
应收申购款		316,556.40	69,347.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		576,171,433.31	531,646,283.03
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		0.01	13,473,214.89
应付赎回款		967,589.94	646,273.79
应付管理人报酬		702,304.69	650,538.28
应付托管费		117,050.77	108,423.04
应付销售服务费		-	-
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	575,620.39	657,092.03
负债合计		2,362,565.80	15,535,542.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	537,455,026.57	564,898,256.93
未分配利润	6.4.7.8	36,353,840.94	-48,787,515.93
净资产合计		573,808,867.51	516,110,741.00
负债和净资产总计		576,171,433.31	531,646,283.03

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额537,455,026.57份，基金份额净值1.0676元。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

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		79,262,244.09	-38,831,359.53
1.利息收入		113,384.65	127,414.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	113,384.65	127,414.22

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）		27,422,257.65	13,320,397.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,369,336.60	8,046,337.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	6,052,921.05	5,274,060.70
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	51,662,452.07	-52,653,230.37
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	64,149.72	374,058.67
减：二、营业总支出		4,486,569.79	5,980,713.45
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,732,954.31	5,004,048.20
2.托管费	6.4.10.2.2	622,159.05	834,008.04
3.销售服务费		-	-
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	131,456.43	142,657.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,775,674.30	-44,812,072.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,775,674.30	-44,812,072.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		74,775,674.30	-44,812,072.98

6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

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	564,898,256.93	-48,787,515.93	516,110,741.00
二、本期期初净资产	564,898,256.93	-48,787,515.93	516,110,741.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,443,230.36	85,141,356.87	57,698,126.51
（一）、综合收益总额	-	74,775,674.30	74,775,674.30
（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）	-27,443,230.36	10,365,682.57	-17,077,547.79

列)			
其中：1.基金申购款	142,796,922.05	2,336,872.05	145,133,794.10
2.基金赎回款	-170,240,152.41	8,028,810.52	-162,211,341.89
(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	537,455,026.57	36,353,840.94	573,808,867.51
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	711,821,908.46	62,434,349.66	774,256,258.12
二、本期期初净资产	711,821,908.46	62,434,349.66	774,256,258.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-94,634,341.55	-57,373,930.84	-152,008,272.39
(一)、综合收益总额	-	-44,812,072.98	-44,812,072.98
(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)	-94,634,341.55	-12,561,857.86	-107,196,199.41
其中：1.基金申购款	75,516,856.25	7,539,570.16	83,056,426.41
2.基金赎回款	-170,151,197.80	-20,101,428.02	-190,252,625.82
(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	617,187,566.91	5,060,418.82	622,247,985.73

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

汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金(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[2019]427号《关于准予汇丰晋信港股通双核策略混合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《汇丰晋信港股通双核策略混合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基金，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280,534,560.23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(2019)第0437号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》于2019年8月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为280,630,289.61份基金份额，其中认购资金利息折合95,729.38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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小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、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，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50%-95%(其中，港股通标的股票投资比例不低于非现金资产的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%。本基金的业绩比较基准为：中证港股通综合指数收益率×70%+中债新综合指数×30%。

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》、《汇丰晋信港股通双核策略混合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。

本财务报表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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	51,239,259.04	
等于：本金	51,234,548.39	
加：应计利息	4,710.65	
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	51,239,259.04	

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	498,354,596.43	-	516,668,809.92	18,314,213.49
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		498,354,596.43	-	516,668,809.92	18,314,213.49

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	98.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	474,261.40
其中：交易所市场	474,261.40
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	101,260.33
合计	575,620.39

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	564,898,256.93	564,898,256.93
本期申购	142,796,922.05	142,796,922.05
本期赎回（以“-”号填列）	-170,240,152.41	-170,240,152.41
本期末	537,455,026.57	537,455,026.57

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-188,157,970.85	139,370,454.92	-48,787,515.93
本期期初	-188,157,970.85	139,370,454.92	-48,787,515.93
本期利润	23,113,222.23	51,662,452.07	74,775,674.30
本期基金份额交易产生的变动数	14,886,384.21	-4,520,701.64	10,365,682.57
其中：基金申购款	-46,408,858.73	48,745,730.78	2,336,872.05
基金赎回款	61,295,242.94	-53,266,432.42	8,028,810.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-150,158,364.41	186,512,205.35	36,353,840.94

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

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	34,433.12
其他	2,559.24
合计	113,384.65

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	845,581,748.44
减：卖出股票成本总额	821,471,153.47
减：交易费用	2,741,258.37
买卖股票差价收入	21,369,336.60

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	6,052,921.05
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	6,052,921.05

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	51,662,452.07
——股票投资	51,662,452.07

——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	51,662,452.07

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	64,149.72
合计	64,149.72

注：对于持有基金份额少于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75%计入基金财产；对于持有基金份额不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有基金份额不少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减。

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	41,587.99
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
汇划手续费	2,714.98
账户维护费	9,000.00
证券组合费	18,481.12
合计	131,456.43

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
招商银行股份有限公司("招商银行")	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	3,732,954.31	5,004,048.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,324,992.40	1,751,381.76
应支付基金管理人的净管理费	2,407,961.91	3,252,666.44

注：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 X 1.50% / 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	622,159.05	834,008.04

注：支付基金托管人招商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 X 0.25% / 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
招商银行	51,239,259.04	76,392.29	37,175,500.66	86,124.35

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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招商银行，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时间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票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票，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，本基金未持有流动性受限资产。

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、结算备付金和存出保证金等。

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	51,239,259.04	-	-	-	51,239,259.04

结算备付金	1,203,928.19	-	-	-	1,203,928.19
存出保证金	36,551.93	-	-	-	36,551.93
交易性金融资产	-	-	-	516,668,809.92	516,668,809.92
应收清算款	-	-	-	918,704.06	918,704.06
应收股利	-	-	-	5,787,623.77	5,787,623.77
应收申购款	-	-	-	316,556.40	316,556.40
资产总计	52,479,739.16	-	-	523,691,694.15	576,171,433.31
负债					
应付清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	967,589.94	967,589.94
应付管理人报酬	-	-	-	702,304.69	702,304.69
应付托管费	-	-	-	117,050.77	117,050.77
其他负债	-	-	-	575,620.39	575,620.39
负债总计	-	-	-	2,362,565.80	2,362,565.80
利率敏感度缺口	52,479,739.16	-	-	521,329,128.35	573,808,867.51
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	33,336,154.23	-	-	-	33,336,154.23
结算备付金	12,786,300.43	-	-	-	12,786,300.43
存出保证金	12,411.86	-	-	-	12,411.86
交易性金融资产	-	-	-	485,415,673.32	485,415,673.32
应收股利	-	-	-	26,395.58	26,395.58
应收申购款	-	-	-	69,347.61	69,347.61
资产总计	46,134,866.52	-	-	485,511,416.51	531,646,283.03
负债					
应付清算款	-	-	-	13,473,214.89	13,473,214.89
应付赎回款	-	-	-	646,273.79	646,273.79
应付管理人报酬	-	-	-	650,538.28	650,538.28
应付托管费	-	-	-	108,423.04	108,423.04
其他负债	-	-	-	657,092.03	657,092.03
负债总计	-	-	-	15,535,542.03	15,535,542.03
利率敏感度缺口	46,134,866.52	-	-	469,975,874.48	516,110,741.00

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	516,668,809.92	-	516,668,809.92
应收股利	-	5,787,623.77	-	5,787,623.77
资产合计	-	522,456,433.69	-	522,456,433.69
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	522,456,433.69	-	522,456,433.69
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	485,415,673.32	-	485,415,673.32
应收股利	-	26,395.58	-	26,395.58

资产合计	-	485,442,068.9 0	-	485,442,068.9 0
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	485,442,068.9 0	-	485,442,068.9 0

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇汇率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. 港币升值50个基点	2,612,282.17	2,427,210.35
	2. 港币贬值50个基点	-2,612,282.17	-2,427,210.35

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50%-95%(其中，港股通标的股票投资比例不低于非现金资产的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	上年度末
----	-----	------

	2024年06月30日		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	516,668,809.92	90.04	485,415,673.32	94.05
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	516,668,809.92	90.04	485,415,673.32	94.05

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%	39,107,656.37	37,087,711.99
	2.业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-39,107,656.37	-37,087,711.99

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	516,668,809.92	485,415,673.32
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	516,668,809.92	485,415,673.32

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	516,668,809.92	89.67
	其中：股票	516,668,809.92	89.67
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	52,443,187.23	9.10
8	其他各项资产	7,059,436.16	1.23
9	合计	576,171,433.31	100.00

注：权益投资中通过沪港通机制投资香港股票金额26,495.27元，占基金资产净值的比例为0.00%；通过深港通机制投资香港股票金额516,642,314.65元，占基金资产净值的比例为90.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 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)	占基金资产净值比例(%)
原材料	85,793,299.99	14.95

非日常生活消费品	52,730,775.66	9.19
能源	31,554,774.70	5.50
金融	16,970,552.37	2.96
医疗保健	67,818,520.56	11.82
工业	72,958,813.48	12.71
信息技术	83,604,732.40	14.57
通讯业务	21,538,729.92	3.75
公用事业	83,698,610.84	14.59
合计	516,668,809.92	90.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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	H03311	中国建筑国际	3,697,008	35,968,814.89	6.27
2	H00285	比亚迪电子	957,033	34,065,130.26	5.94
3	H00175	吉利汽车	3,563,000	28,584,015.00	4.98
4	H03993	洛阳钼业	3,909,294	25,475,051.96	4.44
5	H01818	招金矿业	1,973,508	23,595,474.79	4.11
6	H01530	三生制药	4,003,000	23,528,269.78	4.10
7	H00135	昆仑能源	2,846,000	21,039,646.97	3.67
8	H00257	光大环境	5,443,000	19,473,451.58	3.39
9	H00390	中国中铁	4,453,000	17,516,547.01	3.05
10	H00386	中国石油化工股份	3,756,000	17,345,811.96	3.02
11	H02899	紫金矿业	1,078,000	16,214,161.78	2.83
12	H00700	腾讯控股	46,739	15,885,746.29	2.77
13	H01193	华润燃气	580,500	14,490,323.74	2.53

14	H01810	小米集团—W	962,878	14,482,615.65	2.52
15	H00358	江西铜业股份	996,000	14,162,676.18	2.47
16	H00371	北控水务集团	6,412,000	14,045,049.98	2.45
17	H02382	舜宇光学科技	315,800	13,906,824.60	2.42
18	H01415	高伟电子	580,000	12,995,650.52	2.26
19	H02380	中国电力	3,199,000	11,824,636.45	2.06
20	H00836	华润电力	522,000	11,410,234.09	1.99
21	H01801	信达生物	331,500	11,133,965.86	1.94
22	H00939	建设银行	2,108,000	11,101,072.87	1.93
23	H02688	新奥能源	185,400	10,888,719.61	1.90
24	H03690	美团—W	102,604	10,403,917.13	1.81
25	H06185	康希诺生物	572,200	10,204,481.59	1.78
26	H03668	兖煤澳大利亚	309,300	9,640,269.20	1.68
27	H01316	耐世特	2,889,000	9,281,298.47	1.62
28	H00013	和黄医药	326,500	8,194,725.55	1.43
29	H02018	瑞声科技	291,000	8,153,609.32	1.42
30	H01177	中国生物制药	3,223,000	7,853,985.60	1.37
31	H02096	先声药业	1,319,383	6,899,919.75	1.20
32	H01258	中国有色矿业	1,021,000	6,345,873.17	1.11
33	H01398	工商银行	1,383,573	5,859,203.64	1.02
34	H09626	哔哩哔哩—W	48,780	5,649,655.31	0.98
35	H00934	中石化冠德	1,236,000	4,568,693.54	0.80
36	H00667	中国东方教育	2,163,000	4,461,526.66	0.78

37	H00388	香港交易所	45	10,275.86	0.00
38	H00772	阅文集团	145	3,328.32	0.00
39	H02359	药明康德	96	2,558.42	0.00
40	H01951	锦欣生殖	242	614.01	0.00
41	H03800	协鑫科技	461	488.06	0.00
42	H01888	建滔积层板	54	413.99	0.00
43	H01772	赣锋锂业	3	41.67	0.00
44	H09696	天齐锂业	1	20.44	0.00
45	H09869	海伦司	9	18.40	0.00

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	H00285	比亚迪电子	32,105,205.35	6.22
2	H00175	吉利汽车	31,987,137.36	6.20
3	H03993	洛阳钼业	21,679,481.99	4.20
4	H00135	昆仑能源	21,608,044.46	4.19
5	H02899	紫金矿业	19,844,470.29	3.85
6	H01810	小米集团－W	18,612,834.69	3.61
7	H01024	快手－W	18,199,746.00	3.53
8	H00992	联想集团	17,660,623.17	3.42
9	H00386	中国石油化工股份	16,878,878.42	3.27
10	H00390	中国中铁	16,604,908.68	3.22
11	H00257	光大环境	16,555,260.89	3.21
12	H00700	腾讯控股	15,596,829.51	3.02
13	H00762	中国联通	14,653,447.76	2.84
14	H00598	中国外运	14,378,187.40	2.79

15	H03800	协鑫科技	14,347,380.34	2.78
16	H01208	五矿资源	14,225,173.48	2.76
17	H00013	和黄医药	14,004,124.29	2.71
18	H00939	建设银行	13,722,064.28	2.66
19	H01818	招金矿业	13,628,091.00	2.64
20	H01193	华润燃气	13,557,867.51	2.63
21	H02057	中通快递-W	13,540,400.05	2.62
22	H00371	北控水务集团	13,430,560.35	2.60
23	H01347	华虹半导体	13,183,472.71	2.55
24	H02382	舜宇光学科技	12,941,200.67	2.51
25	H01398	工商银行	12,260,475.20	2.38
26	H01801	信达生物	11,954,238.14	2.32
27	H09896	名创优品	11,871,212.41	2.30
28	H00358	江西铜业股份	11,707,617.09	2.27
29	H01316	耐世特	11,674,060.14	2.26
30	H02688	新奥能源	11,491,954.70	2.23
31	H06049	保利物业	11,383,577.03	2.21
32	H06185	康希诺生物	11,294,026.90	2.19
33	H02380	中国电力	11,105,695.22	2.15
34	H00836	华润电力	11,011,860.50	2.13
35	H01415	高伟电子	10,966,322.31	2.12
36	H03690	美团-W	10,894,153.92	2.11
37	H00941	中国移动	10,774,243.04	2.09
38	H01258	中国有色矿业	10,707,661.08	2.07
39	H00425	敏实集团	10,571,408.06	2.05
40	H01177	中国生物制药	10,445,101.05	2.02

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	H00883	中国海洋石油	40,891,176.87	7.92
2	H00728	中国电信	35,190,184.73	6.82
3	H01787	山东黄金	33,594,400.90	6.51
4	H01208	五矿资源	32,455,756.76	6.29
5	H01818	招金矿业	29,179,152.38	5.65
6	H00425	敏实集团	28,274,523.86	5.48
7	H00857	中国石油股份	24,945,601.55	4.83
8	H00941	中国移动	24,025,784.96	4.66
9	H01171	兖矿能源	23,479,413.63	4.55
10	H01398	工商银行	22,711,907.64	4.40
11	H00992	联想集团	22,344,721.36	4.33
12	H02099	中国黄金国际	21,017,835.00	4.07
13	H01024	快手-W	19,036,794.00	3.69
14	H00762	中国联通	15,603,565.28	3.02
15	H03800	协鑫科技	15,359,733.16	2.98
16	H01378	中国宏桥	14,829,890.79	2.87
17	H00780	同程旅行	14,778,885.57	2.86
18	H00598	中国外运	14,734,316.21	2.85
19	H00772	阅文集团	14,527,007.62	2.81
20	H06049	保利物业	14,362,451.16	2.78
21	H03993	洛阳钼业	13,689,710.38	2.65
22	H02269	药明生物	13,318,237.52	2.58
23	H01093	石药集团	13,250,016.46	2.57
24	H00826	天工国际	12,915,438.03	2.50
25	H01896	猫眼娱乐	12,858,908.93	2.49
26	H09896	名创优品	12,837,844.13	2.49
27	H00268	金蝶国际	12,782,978.72	2.48
28	H01816	中广核电力	12,406,330.54	2.40

29	H02057	中通快递－W	12,365,014.19	2.40
30	H01347	华虹半导体	11,252,593.71	2.18
31	H00285	比亚迪电子	11,219,684.24	2.17
32	H06862	海底捞	10,410,118.75	2.02

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	801,061,838.00
卖出股票收入（成交）总额	845,581,748.44

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	36,551.93
2	应收清算款	918,704.06
3	应收股利	5,787,623.77
4	应收利息	-
5	应收申购款	316,556.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,059,436.16

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
13,154	40,858.68	173,745,624.48	32.33%	363,709,402.09	67.67%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	934,509.94	0.1739%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年08月02日)基金份额总额	280,630,289.61
本报告期期初基金份额总额	564,898,256.93
本报告期基金总申购份额	142,796,922.05
减：本报告期基金总赎回份额	170,240,152.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	537,455,026.57

注：此处申购含红利再投份额。

§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	
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	891,499,249.74	54.14%	465,688.72	55.22%	-
民生证券	2	696,274,765.68	42.28%	348,135.80	41.28%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	58,869,571.02	3.58%	29,435.14	3.49%	-

注：

- 1、报告期内无增加的交易单元
- 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
4	汇丰晋信港股通双核策略混合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
5	汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	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

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

投资者类别	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	20240101-20240311	118,691,976.72	0.00	118,691,976.72	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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港股通双核策略混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信港股通双核策略混合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