

汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年01月01日起至2021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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信慧盈混合
基金主代码	009475
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年07月30日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	385,883,410.39份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基于目标资产配置进行适度调整，并通过汇丰“profitability-valuation”选股模型精选低估值、高盈利的股票，在控制组合风险的前提下，追求资产的稳健增值。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>1) 本基金借鉴汇丰集团的投资理念和流程，基于多因素分析，对权益类资产、固定收益类及现金类资产比例进行动态调整。</p> <p>2) 通过对组合波动率的控制，可以间接控制组合的回撤可能。</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“profitability-valuation”(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，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率</p>

	<p>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、可转换债券及可交换债券投资策略</p> <p>权益价值方面，本基金将对可转换债券对应的基础股票的价值进行分析，判断其债券投资价值，同时，采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。通过对目标公司股票的投资价值、可交换债券的债券价值、以及期权价值等综合分析，进行可交换债券的投资决策。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将综合运用久期管理、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。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率*35%+中债新综合指数收益率*65%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵
	联系电话	021-20376868
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn
客户服务电话	021-20376888	95559
传真	021-20376999	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号

邮政编码	200120	200336
法定代表人	杨小勇	任德奇

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；交通银行股份有限公司：中国（上海）长宁区仙霞路18号

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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	-350,759.10
本期利润	-1,597,464.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0033
本期加权平均净值利润率	-0.32%
本期基金份额净值增长率	-1.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)

期末可供分配利润	3,528,250.20
期末可供分配基金份额利润	0.0091
期末基金资产净值	398,458,064.43
期末基金份额净值	1.0326
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	3.26%

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。

④本基金的基金合同于2020年7月30日生效。

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	0.91%	0.64%	-0.33%	0.27%	1.24%	0.37%
过去三个月	5.55%	0.66%	2.44%	0.31%	3.11%	0.35%
过去六个月	-1.14%	0.92%	1.99%	0.43%	-3.13%	0.49%
自基金合同生效起至今	3.26%	0.72%	5.42%	0.40%	-2.16%	0.32%

注：

过去一个月指 2021年6月1日-2021年6月30日

过去三个月指 2021年4月1日-2021年6月30日

过去六个月指 2021年1月1日-2021年6月30日

自基金合同生效起至今指2020年7月30日—2021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. 本基金的基金合同于2020年7月30日生效，截至2021年6月30日基金合同生效未满1年。
2. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例不高于基金资产的50%，同业存单投资比例不超过基金资产净值的20%，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%。
3. 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2021年1月30日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
4. 本基金业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 35\% + \text{中债新综合指数收益率} \times 65\%$ 。
5. 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800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收益率为中债新综合财富（总值）指数收益率，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。

§ 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2021年6月30日，公司共管理26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）和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）。

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		
严瑾	本基金、汇丰晋信龙腾混	2020-	-	15	严瑾女士，法国瓦尔省土

	合型证券投资基金、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理	07-30			<p>伦大学经济管理学院硕士、法国图卢兹一大经济管理学院硕士。曾任上海日月明集团投资有限公司投资项目经理、富邦证券有限公司上海代表处行业研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员、投资经理、QFII（合格境外机构投资者）投资咨询副总监、QFII（合格境外机构投资者）投资咨询总监、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信2026生命周期证券投资基金、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。</p>
蔡若林	本基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理	2020-08-22	-	10	<p>蔡若林先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理策略分析师、助理研究员、固定收益信用分析师、汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理。现任本基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>

傅煜清	基金经理助理、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金基金经理	2020-11-14	-	4.5	傅煜清女士，加拿大麦克马斯特大学工商管理硕士。曾任上海国际货币经纪有限责任公司债券经纪人、加拿大皇家银行信用分析员、汇丰晋信基金管理有限公司信用分析员，现任汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金基金经理，同时担任汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理，协助基金经理开展债券和新股相关投资管理工作。
-----	--	------------	---	-----	---

- 注：1. 严瑾女士任职日期为本基金基金合同生效日的日期；
 2. 蔡若林先生任职日期为本基金管理人公告蔡若林先生担任本基金基金经理的日期；傅煜清女士任职日期为本基金管理人公告傅煜清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根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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。

本报告期内，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

本报告期内，从国债收益率的表现来看，国债收益率尤其短端在部分阶段出现下行，长端国债收益率则相对平稳，下降幅度较小，显示阶段性的流动性宽松是债券收益率下行的主要原因。其中，由于信用债集中到期，流动性宽松以维护市场稳定，1年期国债收益率在4月降幅达到19bp；同期十年期国债收益率基本持平。5月以后，随着地方债供给增加，资金面边际收敛，再加上资金获利了结等因素，短端国债收益率开始回升，长端利率则小幅下行。

回顾本基金2021年上半年的操作，慧盈基金在大类资产上维持超配权益，上半年股票资产仅小幅上涨，因而大类资产配置上超额收益不明显。上半年行业分化加剧，我们在新能源、原材料等行业的超配获得的收益较大，但消费、医药行业的超配拖累明显，个别重仓个股受政策及市场风格影响出现较大幅度的回调，从而拖累业绩。上半年本基金债券部分投资仓位基本不变，信用债部分依然以高评级短期限品种为主，严控组合的信用风险暴露；利率债部分在三月份通过增加长期限政金债配置，小幅拉长了组合整体久期，二季度，利率债部分投资继续以长期限金融债为主，债券组合整体久期基本不变。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金单位净值增长率为-1.14%，同期业绩比较基准为1.99%，净值表现落后业绩比较基准3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外复苏差异预计将进一步拉大，海外的货币政策宽松可能接近尾声，同时国内经济的基本面特征与疫情前更加相似。但A股市场或将伴随国内货币政策防范化解金融风险、保供稳价和碳中和等政策的方向不断小幅微调，创造出更多结构性机会。

我们认为A股的估值较历史中长期均值偏低。沪深300指数 E/P 较十年期国债到期收益率高出3.75个百分点，处于过去一年的平均水平。若中国经济和货币政策回归疫情前的常态化，我们认为这一差值将有望向此前的均值水平回归，沪深300指数的E/P与十年债收益率的差距扩大可能预示着沪深300估值的回归或国债到期收益率的走低。

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，根据中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门-基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下展开工作，其中：

一、基金运营部

1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。

2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。

3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。

二、基金投资部

基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。

三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

四、风险控制部

根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

五、督察长

监督和检查公司关于估值各项工作的贯彻和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。

1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下，应及时修订本估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经过本公司管理委员会的批准后方可实施。

2. 如果基金准备采用新投资策略或投资新品种或者有其他重大或突发性相关估值事项发生时，应召开临时会议，或者投资品种估值小组成员列席参加公司风控委员会会议，通过公司风控委员会会议讨论并通过上述估值事项。

报告期内，本基金与中债金融估值中心有限公司根据《中债信息产品服务协议》而取得中债估值服务。

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

本报告期内，基金托管人在汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,693,069.35	15,746,360.13
结算备付金		1,721,125.81	18,356,517.91
存出保证金		317,181.70	227,265.50
交易性金融资产	6.4.7.2	382,914,524.99	802,362,714.87
其中：股票投资		196,859,874.99	408,734,734.87
基金投资		-	-
债券投资		186,054,650.00	393,627,980.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,500,000.00	-
应收证券清算款		2,856,687.32	8,012,732.99
应收利息	6.4.7.5	3,746,482.91	7,886,972.41
应收股利		-	-
应收申购款		4,794.24	45,272.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		408,753,866.32	852,637,836.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	3,597,383.05
应付赎回款		9,296,122.90	19,259,824.51
应付管理人报酬		272,928.89	598,666.30
应付托管费		68,232.24	149,666.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	523,462.71	973,492.31
应交税费		14,024.91	10,743.55
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,030.24	189,591.81
负债合计		10,295,801.89	24,779,368.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	385,883,410.39	792,555,979.66

未分配利润	6.4.7.10	12,574,654.04	35,302,488.80
所有者权益合计		398,458,064.43	827,858,468.46
负债和所有者权益总计		408,753,866.32	852,637,836.54

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额385,883,410.39份，基金份额净值1.0326元。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
一、收入		3,621,760.97
1. 利息收入		5,959,472.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,429.02
债券利息收入		5,706,063.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		198,979.87
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,817,422.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,093,444.89
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-704,942.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	980,964.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,246,705.71

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	726,416.84
减：二、费用		5,219,225.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,993,951.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	498,488.05
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,571,471.40
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		15,503.67
7. 其他费用	6.4.7.20	139,810.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,597,464.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,597,464.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	792,555,979.66	35,302,488.80	827,858,468.46
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	-1,597,464.81	-1,597,464.81
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-406,672,569.27	-21,130,369.95	-427,802,939.22

其中：1. 基金申购款	13,055,328.08	442,088.27	13,497,416.35
2. 基金赎回款	-419,727,897.35	-21,572,458.22	-441,300,355.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	385,883,410.39	12,574,654.04	398,458,064.43

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：

王栋

赵琳

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

汇丰晋信慧盈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[2020]679号《关于准予汇丰晋信慧盈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《汇丰晋信慧盈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1,077,609,653.67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(2020)第0641号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金合同》于2020年7月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,077,875,891.59份基金份额,其中认购资金利息折合266,237.92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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括: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允许投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、次级债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证

监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资不高于基金资产的50%,同业存单投资比例不超过基金资产净值的20%,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800指数收益率×35%+中债新综合指数收益率×65%。

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2021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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《汇丰晋信慧盈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2021年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2021年06月30日的财务状况以及2021年上半年度的经营成果和基金净值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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021年06月30日
活期存款	1,693,069.35
定期存款	-
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	-
合计	1,693,069.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	176,726,809.28	196,859,874.99	20,133,065.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,016,500.00	-10,000.00
	银行间市场	180,137,182.27	900,967.73
	合计	185,163,682.27	890,967.73
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	361,890,491.55	382,914,524.99	21,024,033.44

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	663.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	697.05
应收债券利息	3,744,994.31
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	128.43
合计	3,746,482.91

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	521,098.96
银行间市场应付交易费用	2,363.75
合计	523,462.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,883.77
应付证券出借违约金	-
预提费用	103,146.47
合计	121,030.24

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	792,555,979.66	792,555,979.66
本期申购	13,055,328.08	13,055,328.08
本期赎回（以“-”号填列）	-419,727,897.35	-419,727,897.35
本期末	385,883,410.39	385,883,410.39

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	9,291,334.99	26,011,153.81	35,302,488.80
本期利润	-350,759.10	-1,246,705.71	-1,597,464.81
本期基金份额交易产生的变动数	-5,412,325.69	-15,718,044.26	-21,130,369.95
其中：基金申购款	167,092.44	274,995.83	442,088.27
基金赎回款	-5,579,418.13	-15,993,040.09	-21,572,458.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,528,250.20	9,046,403.84	12,574,654.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	17,904.75
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	33,869.27
其他	2,655.00
合计	54,429.02

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	911,300,110.21
减：卖出股票成本总额	913,393,555.10
买卖股票差价收入	-2,093,444.89

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-704,942.91
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-704,942.91

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	495,467,179.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	483,340,032.17
减：应收利息总额	12,832,089.78
买卖债券差价收入	-704,942.91

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	980,964.93
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	980,964.93

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,246,705.71
——股票投资	-815,066.82
——债券投资	-431,638.89
——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	-1,246,705.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	697,018.01
转换费收入	29,398.83
合计	726,416.84

注：1. 对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。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。

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,564,530.15

银行间市场交易费用	6,941.25
合计	2,571,471.40

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	43,639.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	18,714.27
账户维护费	16,950.00
其他费用-其他	1,000.00
合计	139,810.74

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
山西证券股份有限公司(“山西证券”)	见注释①

注：①山西证券与本基金管理人的股东-山西信托共同受山西金融投资控股集团有限公司控制。

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,993,951.92
其中：支付销售机构的客户维护费	1,050,188.29

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0.80%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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	498,488.05

注：支付基金托管人交通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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2021年01月01日至2021年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
山西证券	46,207,645.61	29,861,551.78	-	-	-	-
交通银行	5,071,148.36	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

本报告期，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本报告期末，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金(2020年12月31日：同)。

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	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,693,069.35	17,904.75

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

本报告期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	首次公开发行限售	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行限售	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
3009	药易	2021	2021	首次	12.2	53.7	244	2,98	13,1	-

37	购	-01- 20	-07- 27	公开发 行限 售	5	1		9.00	05.2 4	
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	首次 公开发 行限 售	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 56	英力 股份	2021 -03- 16	2021 -09- 27	首次 公开发 行限 售	12.8 5	25.8 0	371	4,76 7.35	9,57 1.80	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	首次 公开发 行限 售	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	首次 公开发 行限 售	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 12	首次 公开发 行限 售	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	首次 公开发 行限 售	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3009	创益	2021	2021	首次	13.0	26.5	254	3,31	6,73	-

91	通	-05-12	-11-22	公开发 行限售	6	1		7.24	3.54	
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	首次 公开发 行限售	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	首次 公开发 行限售	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 10	晶雪 节能	2021 -06- 09	2021 -12- 20	首次 公开发 行限售	7.83	17.6 1	218	1,70 6.94	3,83 8.98	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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交通银行，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，违约风险可能性很小；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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	20,154,000.00
A-1以下	-	-
未评级	45,567,550.00	119,982,000.00
合计	45,567,550.00	140,136,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	19,868,000.00
合计	-	19,868,000.00

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	80,093,100.00	102,062,300.00
AAA以下	15,154,500.00	20,140,000.00
未评级	45,239,500.00	111,421,680.00
合计	140,487,100.00	233,623,980.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资券。

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2021年06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(所有者权益)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该比例限制)。

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2021年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.09%。

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2021年6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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,693,069.35	-	-	-	1,693,069.35
结算备付金	1,721,125.81	-	-	-	1,721,125.81
存出保证金	317,181.70	-	-	-	317,181.70
交易性	120,264,150.00	35,598,500.00	30,192,000.00	196,859,874.99	382,914,524.99

金融资产					
买入返售金融资产	15,500,000.00	-	-	-	15,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,856,687.32	2,856,687.32
应收利息	-	-	-	3,746,482.91	3,746,482.91
应收申购款	-	-	-	4,794.24	4,794.24
资产总计	139,495,526.86	35,598,500.00	30,192,000.00	203,467,839.46	408,753,866.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,296,122.90	9,296,122.90
应付管理人报酬	-	-	-	272,928.89	272,928.89
应付托管费	-	-	-	68,232.24	68,232.24
应付交易费用	-	-	-	523,462.71	523,462.71
应交税费	-	-	-	14,024.91	14,024.91
其他负债	-	-	-	121,030.24	121,030.24
负债总计	-	-	-	10,295,801.89	10,295,801.89
利率敏感度缺口	139,495,526.86	35,598,500.00	30,192,000.00	193,172,037.57	398,458,064.43
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,746,360.13	-	-	-	15,746,360.13
结算备付金	18,356,517.91	-	-	-	18,356,517.91
存出保证金	227,265.50	-	-	-	227,265.50
交易性	284,509,980.00	20,138,000.00	88,980,000.00	408,734,734.87	802,362,714.87

金融资产					
应收证券清算款	-	-	-	8,012,732.99	8,012,732.99
应收利息	-	-	-	7,886,972.41	7,886,972.41
应收申购款	-	-	-	45,272.73	45,272.73
资产总计	318,840,123.54	20,138,000.00	88,980,000.00	424,679,713.00	852,637,836.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,597,383.05	3,597,383.05
应付赎回款	-	-	-	19,259,824.51	19,259,824.51
应付管理人报酬	-	-	-	598,666.30	598,666.30
应付托管费	-	-	-	149,666.55	149,666.55
应付交易费用	-	-	-	973,492.31	973,492.31
应交税费	-	-	-	10,743.55	10,743.55
其他负债	-	-	-	189,591.81	189,591.81
负债总计	-	-	-	24,779,368.08	24,779,368.08
利率敏感度缺口	318,840,123.54	20,138,000.00	88,980,000.00	399,900,344.92	827,858,468.46

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

假设	除市场利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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

	市场利率上升25个基点	-835,983.74	-1,842,144.92
	市场利率下降25个基点	850,400.73	1,880,088.25

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不高于基金资产的50%，同业存单投资比例不超过基金资产净值的20%，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 2021年06月30日		上年度末 2020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	196,859,874.99	49.41	408,734,734.87	49.37
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	196,859,874.99	49.41	408,734,734.87	49.37

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	30,205,144.51	40,623,603.81
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-30,205,144.51	-40,623,603.81

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 196,519,981.53 元，属于第二层次的余额为 186,394,543.46 元，无属于第三层次的余额。(2020年12月31日：第一层次 405,941,289.70 元，第二层次396,421,425.17 元，无第三层次)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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。(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，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	196,859,874.99	48.16
	其中：股票	196,859,874.99	48.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,054,650.00	45.52
	其中：债券	186,054,650.00	45.52
	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	15,500,000.00	3.79
	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	3,414,195.16	0.84
8	其他各项资产	6,925,146.17	1.69
9	合计	408,753,866.32	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	137,749,873.43	34.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,506,364.39	1.63
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	13,105.24	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,273,586.40	2.08
J	金融业	19,819,827.29	4.97
K	房地产业	2,391,400.00	0.60
L	租赁和商务服务业	17,162,118.80	4.31
M	科学研究和技术服务业	4,932,585.00	1.24
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	196,859,874.99	49.41

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	300750	宁德时代	40,500	21,659,400.00	5.44
2	600519	贵州茅台	8,400	17,276,280.00	4.34
3	601888	中国中免	57,188	17,162,118.80	4.31
4	600036	招商银行	270,101	14,636,773.19	3.67
5	300760	迈瑞医疗	25,020	12,010,851.00	3.01
6	600436	片仔癀	20,600	9,234,980.00	2.32
7	002415	海康威视	139,100	8,971,950.00	2.25
8	000301	东方盛虹	410,500	8,579,450.00	2.15
9	002271	东方雨虹	150,300	8,314,596.00	2.09
10	300496	中科创达	52,600	8,261,356.00	2.07
11	000661	长春高新	21,292	8,240,004.00	2.07
12	000830	鲁西化工	377,600	7,072,448.00	1.77
13	600900	长江电力	314,600	6,493,344.00	1.63
14	300014	亿纬锂能	60,500	6,287,765.00	1.58
15	603267	鸿远电子	47,740	6,106,900.80	1.53
16	002371	北方华创	21,300	5,908,194.00	1.48
17	603259	药明康德	31,500	4,932,585.00	1.24
18	603501	韦尔股份	14,000	4,508,000.00	1.13
19	300896	爱美客	5,200	4,102,176.00	1.03
20	603799	华友钴业	32,800	3,745,760.00	0.94
21	002648	卫星石化	78,020	3,057,603.80	0.77
22	600958	东方证券	297,300	2,970,027.00	0.75
23	000615	奥园美谷	108,700	2,391,400.00	0.60
24	603986	兆易创新	12,400	2,329,960.00	0.58
25	000001	平安银行	96,300	2,178,306.00	0.55
26	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
27	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.02
28	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01

29	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
30	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
31	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
32	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
33	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
34	603171	N税友	637	12,230.40	0.00
35	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
36	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
37	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
38	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
39	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
42	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
43	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
44	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
45	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
46	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
47	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	300750	宁德时代	48,911,448.78	5.91
2	000568	泸州老窖	29,695,052.47	3.59
3	601899	紫金矿业	26,781,705.10	3.24
4	600036	招商银行	25,416,676.92	3.07
5	600436	片仔癀	24,139,116.06	2.92
6	600309	万华化学	21,456,809.88	2.59

7	300760	迈瑞医疗	21,441,305.96	2.59
8	300496	中科创达	18,268,692.75	2.21
9	603259	药明康德	18,077,829.85	2.18
10	000661	长春高新	17,772,888.00	2.15
11	600031	三一重工	16,528,314.57	2.00
12	601318	中国平安	13,954,982.00	1.69
13	300014	亿纬锂能	13,232,453.00	1.60
14	600519	贵州茅台	13,143,151.00	1.59
15	300059	东方财富	12,803,677.13	1.55
16	000830	鲁西化工	12,636,596.32	1.53
17	600900	长江电力	12,159,701.00	1.47
18	000001	平安银行	11,743,794.00	1.42
19	000157	中联重科	11,653,904.66	1.41
20	300122	智飞生物	11,586,117.00	1.40

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	000568	泸州老窖	69,979,620.33	8.45
2	300750	宁德时代	54,276,596.00	6.56
3	601899	紫金矿业	41,481,106.50	5.01
4	600436	片仔癀	34,844,940.91	4.21
5	601318	中国平安	33,537,108.38	4.05
6	600519	贵州茅台	33,172,665.00	4.01
7	002475	立讯精密	31,723,827.86	3.83
8	300760	迈瑞医疗	30,621,946.51	3.70
9	300122	智飞生物	30,364,221.00	3.67
10	600031	三一重工	29,704,086.49	3.59

11	601888	中国中免	22,096,633.30	2.67
12	002241	歌尔股份	18,930,426.14	2.29
13	300601	康泰生物	17,561,282.56	2.12
14	600309	万华化学	17,146,489.44	2.07
15	002025	航天电器	16,890,077.60	2.04
16	000001	平安银行	16,395,206.12	1.98
17	600036	招商银行	15,477,370.32	1.87
18	603259	药明康德	14,613,184.93	1.77
19	601168	西部矿业	14,039,638.94	1.70
20	300034	钢研高纳	13,482,751.22	1.63

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	702,333,762.04
卖出股票收入（成交）总额	911,300,110.21

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	65,239,500.00	16.37
	其中：政策性金融债	65,239,500.00	16.37
4	企业债券	10,098,500.00	2.53
5	企业短期融资券	25,567,550.00	6.42
6	中期票据	85,149,100.00	21.37
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	186,054,650.00	46.69

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101800960	18贵州高速MTN001	200,000	20,216,000.00	5.07
2	101801147	18中化工MTN003	200,000	20,204,000.00	5.07
3	200406	20农发06	200,000	20,000,000.00	5.02
4	101664051	16北电MTN001	140,000	14,103,600.00	3.54
5	101801032	18陕煤化MTN003	100,000	10,318,000.00	2.59

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券除18贵州高速MTN001（101800960）外，没有出现发行主体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“18贵州高速MTN001”的发行主体贵州高速公路集团有限公司（以下简称“公司”），由于存在：根据贵州高速公路集团有限公司2020年9月27日发布的《贵州高速公路集团有限公司受到重大行政处罚公告》，公司于2020年8月26日收到贵州省都匀市公安局送达的《行政处罚决定书》（匀公林罚决字[2020]第20号），经查，2018年至2019年期间，都匀至安顺高速公路建设项目非法占用林地共计90.419公顷

（1,356.285亩），滥伐林木共计3,943.7立方米，属非法占用林地及滥伐林木行为，被处以罚款共计14,045,060.70元。根据贵州高速公路集团有限公司2020年10月27日发布的《贵州高速公路集团有限公司缴纳未批占用土地款的公告》，公司收到贵州省黔南布依族苗族自治州长顺县自然资源局送达的《行政处罚决定书》，经查，都匀至安顺高速公路建设项目（长顺境）未批先占用土地，被处以罚款5,902,267.00元。根据贵州高速公路集团有限公司2020年10月27日发布的《贵州高速公路集团有限公司缴纳未批占用土地款的公告》，公司分别收到贵州省遵义市综合行政执法局（新蒲新区）、遵义市汇川区综合行政执法局、桐梓县综合行政执法局及绥阳县综合行政执法局送达的《行政处罚决定书》，经查，兰州至海口国家高速公路重庆至遵义段（贵州境）扩容项目在建设期间未批先占用土地，被处以罚款共计人民币13,680,462.30元。根据贵州高速公路集团有限公司2020年11月5日发布的《贵州高速公路集团有限公司缴纳未批占用土地款的公告》，公司分别收到贵州省黔南布依族苗族自治州都匀市、贵定县、惠水县自然资源局送达的《行政处罚决定书》，经查，都匀至安顺高速公路项目（都匀段、贵定段、惠水段）未批先占用土地，被处以罚款19,965,276.94元。根据贵州高速公路集团有限公司2020年11月30日发布的《贵州高速公路集团有限公司缴纳未批占用土地款的公告》，公司分别收到贵州省安顺市西秀区、镇宁县自然资源局、麻江县自然资源局送达的《行

政处罚决定书》，经查，都匀至安顺高速公路建设项目（西秀段、镇宁段、麻江段）未批先占用土地，被处以罚款898.4097万元。本基金管理人认为，上述事宜对贵州高速公路集团有限公司整体业务影响较小，且上述罚没款占贵州高速公路集团有限公司总收入和总利润比重较小，对偿债能力不会产生影响，不会对本基金投资决策产生重大影响。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18贵州高速MTN001的投资决策流程符合本公司规定。

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	317,181.70
2	应收证券清算款	2,856,687.32
3	应收股利	-
4	应收利息	3,746,482.91
5	应收申购款	4,794.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,925,146.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
3,306	116,722.14	0.00	0.00%	385,883,410.39	100.00%

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	11,922.66	0.0031%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年07月30日)基金份额总额	1,077,875,891.59
本报告期期初基金份额总额	792,555,979.66
本报告期基金总申购份额	13,055,328.08
减：本报告期基金总赎回份额	419,727,897.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	385,883,410.39

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，本基金托管人交通银行股份有限公司托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人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	
川财	1	-	-	-	-	-

证券						
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	16,624,966.20	1.03%	15,482.87	1.03%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	146,061,598.73	9.07%	136,027.64	9.07%	-
西南证券	1	7,152,330.90	0.44%	6,661.32	0.44%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	240,658,711.04	14.95%	224,126.34	14.95%	-
东方财富	2	50,783,471.91	3.15%	47,294.51	3.15%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	46,297,570.54	2.88%	43,117.11	2.88%	-
国泰君安	2	352,036,145.77	21.86%	327,851.42	21.86%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
汇丰 前海	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	44,043,950.30	2.74%	41,018.28	2.74%	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	167,197,907.09	10.38%	155,709.76	10.38%	-
信达 证券	2	8,745,361.50	0.54%	8,144.49	0.54%	-
野村 东方	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	31,794,512.95	1.97%	29,610.26	1.97%	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	59,053,620.16	3.67%	54,998.76	3.67%	-
中信 建投	2	68,700,540.07	4.27%	63,981.11	4.27%	-
中信 证券	2	129,675,089.14	8.05%	120,766.63	8.05%	-
东兴 证券	3	-	-	-	-	-
银河 证券	3	110,111,007.41	6.84%	102,546.69	6.84%	-
广发 证券	4	131,206,993.82	8.15%	122,193.33	8.15%	-

注：

1、报告期内增加的交易单元：开源证券、东兴证券

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	587,500,00 0.00	24.0 4%	-	-	-	-
西南证 券	-	-	43,000,00 0.00	1.76%	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富	1,300,79 3.00	9.49%	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	3,004,50 0.00	21.9 3%	551,000,00 0.00	22.5 5%	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	191,200,00 0.00	7.82%	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
西部证 券	-	-	353,700,00 0.00	14.4 7%	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东 方	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	278,000,00 0.00	11.3 8%	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	4,143,60 2.74	30.2 4%	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	5,026,50 0.00	36.6 8%	353,000,00 0.00	14.4 4%	-	-	-	-
广发证 券	227,446. 55	1.66%	86,500,00 0.00	3.54%	-	-	-	-

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	旗下基金2020年第4季度报 告	本基金指定的信息披露报 纸、指定的互联网网站	2021-01-22
2	汇丰晋信基金管理有限公司 关于调整旗下部分开放式基 金最低保留份额的公告	本基金指定的信息披露报 纸、指定的互联网网站	2021-01-29
3	汇丰晋信基金管理有限公司 关于新增东吴证券股份有限	本基金指定的信息披露报 纸、指定的互联网网站	2021-02-08

	公司为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告		
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加东吴证券费率优惠的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-02-08
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于在国信证券股份有限公司开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-01
6	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在盈米基金的交易限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-10
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金最低赎回份额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-15
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过东方财富证券开办旗下开放式基金定期定额投资业务并参加定期定额投资费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-19
9	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-30
10	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加基煜基金费率优惠的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-30
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-30

12	旗下基金2020年年度报告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-03-31
13	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-04-06
14	旗下基金2021年第1季度报告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-04-22
15	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增天风证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-10
16	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加天风证券费率优惠的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-10
17	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加东方财富证券定期定额投资费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
18	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加好买基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
19	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加汇成基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
20	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加盈米基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
21	汇丰晋信基金管理有限公司	本基金指定的信息披露报	2021-06-15

	关于调整旗下开放式基金在东方财富证券的定期定额投资单笔最低限额的公告	纸、指定的互联网网站	
22	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在交通银行的申（认）购交易限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
23	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在平安银行的定期定额投资和转换交易限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
24	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在天风证券的定期定额投资单笔最低限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
25	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在展恒基金的交易限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
26	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在中金财富的定期定额投资单笔最低限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
27	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在中信建投证券的定期定额投资单笔最低限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-15
28	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在天风证券的交易限额的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-22
29	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加基煜基金费率优惠的公告	本基金指定的信息披露报纸、指定的互联网网站	2021-06-24

§ 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慧盈混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信慧盈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慧盈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

二〇二一年八月三十一日