

汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月01日起至2022年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信惠安纯债63个月定开债券
基金主代码	009748
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年10月29日
报告期末基金份额总额	4,000,059,804.75份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	<p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略 在封闭期内，本基金采用买入并持有策略构建投资组合，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下，本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运</p>

	<p>作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于基金份额持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>（二）开放期投资策略 开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+ 1%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年04月01日 - 2022年06月30日）
1. 本期已实现收益	38,997,779.05
2. 本期利润	38,997,779.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0097
4. 期末基金资产净值	4,043,554,239.40
5. 期末基金份额净值	1.0109

注：

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	0.01%	0.93%	0.01%	0.04%	0.00%
过去六个月	1.86%	0.01%	1.86%	0.01%	0.00%	0.00%
过去一年	3.70%	0.01%	3.75%	0.01%	-0.05%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.09%	0.01%	6.27%	0.01%	-0.18%	0.00%

注：

过去三个月指2022年4月1日-2022年6月30日

过去六个月指2022年1月1日-2022年6月30日

过去一年是指2021年7月1日-2022年6月30日

自基金合同生效起至今指2020年10月29日—2022年6月30日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券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



注：

- 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。本基金在开放期内持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制。
- 按照基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月或每个封闭期开始后3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止2021年4月29日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
- 报告期内本基金的业绩比较基准 = 封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

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、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金基金经理	2020-10-29	-	11	蔡若林先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限责任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责任公司基金经理助理。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、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金基金经理。
-----	--	------------	---	----	--

注：1. 蔡若林先生任职日期为本基金基金合同生效日的日期；
2. 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度，全球金融市场依然处在相对高波动、高不确定性的宏观环境中。俄乌冲突仍未结束，一季度首轮冲击之后，其对大宗商品价格乃至全球地缘政治格局的影响仍在持续发酵。海外主要经济体取消疫情管制之后经济复苏力度不及预期，叠加不断走高的通胀增速，海外央行货币政策收紧，加剧了经济衰退的担忧。国内方面，二季度疫情一度在全国范围内出现反复，我国继续坚持“动态清零”政策，最终随着6月上海基本实现全面复工复产，象征着本轮疫情被较好地控制。

受疫情反复影响，二季度国内经济下行压力短期有所加大，4月官方制造业PMI一度降至47.4，但随着疫情好转复工复产迅速推进，经济逐渐企稳。6月官方制造业PMI反弹至50.2，重新回到荣枯线之上，分项指标中，生产指数和新订单指数均回到荣枯线上方，但新出口订单和从业指数仍在收缩区间，显示疫情对经济的中长期影响仍不容忽视。

通胀方面，二季度CPI同比增速维持平稳，5月CPI同比增长2.1%。其中食品价格同比增长2.3%，复工复产后物流恢复使得主要食品价格重新企稳；非食品价格同比增长2.1%，内需相对疲弱的背景下大宗商品价格对下游的传导作用相对有限，通胀风险整体依然可控。

货币政策上，央行在二季度继续通过相对积极的操作来应对外部环境的不确定性以及对冲国内经济下行压力。4月中旬央行宣布下调金融机构存款准备金率25个基点，并且在之后还宣布已上缴利润6000亿元用于留抵退税和向地方政府转移支付，相当于投放基础货币6000亿元，效果基本相当于全面降准25个基点。5月15日，央行、银保监会发布《关于调整差别化住房信贷政策有关问题的通知》，商住房首套贷款利率下限调整为不低于相应期限LPR减20个基点（原为不低于LPR）。5月20日5年期以上LPR报价下行15个基点至4.45%。央行主要通过数量型工具向市场投放流动性，对价格型工具的使用依然相对谨慎，因此二季度国债收益率继续震荡，信用利差进一步压缩。具体看，二季度中

债新综合全价指数上涨0.29%，中债信用债指数上涨0.55%，中债金融债指数上涨0.11%，中债国债指数下跌0.10%。

基金操作上，二季度基本维持组合仓位不变。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为0.97%，同期业绩比较基准收益率为0.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,412,562,073.18	99.74
	其中：债券	6,412,562,073.18	99.74
	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	16,877,886.90	0.26
8	其他资产	601.79	0.00
9	合计	6,429,440,561.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,412,562,073.18	158.59
	其中：政策性金融债	6,412,562,073.18	158.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,412,562,073.18	158.59

注：本基金采用摊余成本法核算，公允价值部分均以摊余成本列示。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	200315	20进出15	35,300,000	3,618,833,286.80	89.50
2	160405	16农发05	6,700,000	678,582,045.73	16.78
3	018018	国开2101	6,111,220	617,302,129.18	15.27
4	108904	农发2102	4,122,020	420,256,924.23	10.39
5	200408	20农发08	2,300,000	236,240,958.22	5.84

注：本基金采用摊余成本法核算，公允价值部分均以摊余成本列示。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除国家开发银行、中国进出口银行、中国农业发展银行外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

国家开发银行，由于银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十七项违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于2022年3月21日对国家开发银行做出罚款440万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2022〕8号）。

中国进出口银行，1）由于违规投资企业股权等二十四项情况，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于2021年7月13日对中国进出口银行做出罚没7345.6万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2021〕31号）。2）由于银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十七项违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于2022年3月21日对中国进出口银行做出罚款420万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2022〕9号）。

中国农业发展银行，由于银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十七项违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于2022年3月21日对中国农业发展银行做出罚款480万元的行政处罚决定（银保监罚决字（2022）10号）。

截至目前，本基金对相关证券的投资决策流程符合本公司规定，上述处罚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。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	601.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	601.79

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

投资组合报告中，由于四舍五入原因，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差；由于小数点后保留位数限制原因，市值占净值比例可能显示为零。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,000,059,623.55
报告期期间基金总申购份额	181.20

减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,000,059,804.75

注：此处申购为分红导致的红利再投份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	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	20220401 - 20220630	999,999,000.00	0.00	0.00	999,999,000.00	25.00%
	2	20220401 - 20220630	1,699,999,000.00	0.00	0.00	1,699,999,000.00	42.50%
产品特有风险							
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金注册的文件

（二）《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合同》

（三）《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》

(四) 关于申请募集注册汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券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

9.2 存放地点

地点为管理人地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

2022年07月21日