

汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金

2022 年中期报告

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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 中期财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57
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	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信中小盘低波动股票	
基金主代码	009658	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月13日	
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,487,553.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信中小盘低波动股票A	汇丰晋信中小盘低波动股票C
下属分级基金的交易代码	009658	009775
报告期末下属分级基金的份额总额	96,195,696.99份	4,291,856.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于汇丰集团低波动率策略构建投资组合,力求为投资者提供相对业绩比较基准更高的相对收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略 本基金将通过研究和预测,根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化,适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略 1)“估值-盈利”个股优选策略 本基金运用的个股优选策略——“估值-盈利”策略是一个二维模型的概念,即以PB、PE、EVIC等指标代表的估值维度、以EBIT、ROE等指标代表的盈利维度,其分别反映公司估值高低(估值维度)和公司盈利能力(盈利维度)。基金管理人力求通过遵循严格的投资纪律,在这两个维度中选出高盈利下具有低估值属性的投资</p>

	<p>标的构成核心股票库。2) 波动率优化策略 本基金将定期运用汇丰“波动率优化”策略对核心备选库进行优化。“波动率优化”策略将对纳入核心备选库股票的过去表现、波动性及相关性进行分析,以降低组合波动率为目的,给出组合中个股权重及行业权重的建议。</p> <p>3、债券投资策略 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、资产支持证券的投资策略 通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化;通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,并估计违约率和提前偿付比率,对资产支持证券进行估值。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率*90%+同业存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇丰晋信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵
	联系电话	021-20376868
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn
客户服务电话	021-20376888	021-60637111
传真	021-20376999	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	北京市西城区金融大街25号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	杨小勇	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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；中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	汇丰晋信中小盘低波动股票A	汇丰晋信中小盘低波动股票C
本期已实现收益	-8,798,938.97	-400,706.41
本期利润	-8,380,206.39	-447,954.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0846	-0.0980

本期加权平均净值利润率	-8.89%	-10.40%
本期基金份额净值增长率	-7.86%	-8.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-7,980,541.60	-415,537.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0830	-0.0968
期末基金资产净值	93,895,765.56	4,126,397.42
期末基金份额净值	0.9761	0.9614
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.39%	-3.86%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

②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8月13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

汇丰晋信中小盘低波动股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.62%	1.04%	6.39%	0.99%	1.23%	0.05%
过去三个月	2.59%	1.52%	1.85%	1.57%	0.74%	-0.05%
过去六个月	-7.86%	1.40%	-11.05%	1.47%	3.19%	-0.07%
过去一年	-5.52%	1.23%	-4.65%	1.19%	-0.87%	0.04%
自基金合同	-2.39%	0.97%	-0.96%	1.09%	-1.43%	-0.12%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：

过去一个月指 2022 年 6 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

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 8 月 13 日-2022 年 6 月 30 日

汇丰晋信中小盘低波动股票C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	7.54%	1.04%	6.39%	0.99%	1.15%	0.05%
过去三个月	2.37%	1.52%	1.85%	1.57%	0.52%	-0.05%
过去六个月	-8.24%	1.40%	-11.05%	1.47%	2.81%	-0.07%
过去一年	-6.28%	1.23%	-4.65%	1.19%	-1.63%	0.04%
自基金合同 生效起至今	-3.86%	0.97%	-0.96%	1.09%	-2.90%	-0.12%

注：

过去一个月指 2022 年 6 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

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 8 月 13 日-2022 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

汇丰晋信中小盘低波动股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年08月13日-2022年06月30日)



注：

- 1、按照基金合同的约定，本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金通过运用汇丰“波动率优化”策略对本基金合同中定义的中小盘股票进行优化，力求构建波动率较低的投资组合，以控制投资组合的中长期回撤、降低振幅为目的，以便使投资者有更好的投资体验。本基金 80%以上的非现金基金资产投资于上述策略筛选出的股票。
- 2、本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2021 年 2 月 13 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 500 指数收益率*90%+同业存款利率（税后）*10%。
- 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 500 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信中小盘低波动策略股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年08月13日-2022年06月30日)



注：

- 1、按照基金合同的约定，本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金通过运用汇丰“波动率优化”策略对本基金合同中定义的中小盘股票进行优化，力求构建波动率较低的投资组合，以控制投资组合的中长期回撤、降低振幅为目的，以便使投资者有更好的投资体验。本基金 80%以上的非现金基金资产投资于上述策略筛选出的股票。
- 2、本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2021 年 2 月 13 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 500 指数收益率*90%+同业存款利率（税后）*10%。
- 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 500 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2022年6月30日，公司共管理30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）和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）。

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		
方磊	规则化投资部总监、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋	2020-08-13	-	22	方磊女士，新加坡南洋理工大学数学硕士，具备基金从业资格。曾任上海市

	信大盘波动精选股票型证券投资基金、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理				长宁卫生局、上海电器有限公司统计师、Phillip Securities Ltd. Pte金融工程师、上海德锦投资有限公司金融分析师、德隆友联战略投资管理有限公司数据分析师、易评咨询有限公司顾问统计、汇丰晋信基金管理有限公司风险管理部副总监。现任规则化投资部总监、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理。
何喆	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理	2021-04-24	-	17.5	何喆先生，硕士研究生，特许金融分析师，中国保险精算师。曾任华安基金管理有限公司精算顾问、汇丰晋信基金管理有限公司企业战略拓展部经理、企业战略拓展部高级经理、产品开发部副总监、产品开发部总监（负责证券投资策略研究开发和产品设计）、投资经理。现任汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理。
闫湜	基金经理助理	2021-	-	9	硕士研究生。曾任易方达

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

- 注：1. 方磊女士任职日期为本基金基金合同生效日期；
 2. 何喆先生任职日期为本基金管理人公告何喆先生担任本基金基金经理的日期；
 3. 闫滢女士任职日期为本基金管理人公告闫滢女士担任本基金基金经理助理的日期；
 4. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《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。

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

本基金的核心策略主要强调三个方面：估值、盈利与股价的历史波动率，与普通股票型基金相比，在投资流程上更注重偏规则化和纪律化的投资流程。

2022年上半年A股市场出现了“V”型反转，从一季度开始，随着A股盈利水平下降、外围市场及疫情催化的原因，整个A股市场出现了明显的下跌。从5月份后，市场呈现了一波较强的反弹，叠加疫情的缓解，市场的情绪有了明显的提升。

本报告期内，基金经理在组合上进行了调整。整个组合与业绩基准相比，行业偏移度并不大，同时增加了个股的数量以进一步分散风险。

总体而言，基金经理的操作经历了从保守逐步放宽的过程，在一季度时，整个组合以波动率的控制的核心策略为主，基金经理在一季度末期开始，在合同范围内将波动率策略上的权重逐步放松，因此，第二季度的组合风格要较一季度更偏重成长，保留了相当一部分进攻的策略，相应，组合的波动率已经接近基准的波动率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值变化幅度为-7.86%，同期业绩比较基准增长率为-11.05%，本基金A类领先同期比较基准3.19%；本基金C类本报告期内净值变化幅度为-8.24%，同期业绩比较基准增长率为-11.05%，本基金C类领先同期比较基准2.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金经理前期的逻辑认为，虽然2022年预期政策面较为宽松，但受制于整个A股市场盈利增速进入下降周期及外围美联储加息预期、俄乌关系等外围因素，基金经理对下

半年的整体行情呈现谨慎乐观。基金经理的乐观一方面是由于对于市场估值处于历史低估值的信心，另一方面也看到了市场对于二季度市场净利润增速提前出现上涨后，对于基本面拐点提前的预期；我们的谨慎主要是由于对于市场是否有后续的新增资金的考虑。

但6月份在没有明显新增公募基金发行资金的基础上，我们看到了市场对于偶尔的回调有着较强的修复惯性，显示场内资金补仓的动力。在流动性推动下，配合未来几个季度A股基本面逐步改善的预期，我们对于未来市场的乐观程度有了一定的提升，基金经理认为相较于一季度时采用的较保守策略，下半年可以随市场变化适时调整。

因此基金经理倾向于在符合基金合同关于波动率管理的前提下，更加积极地去承担合适的风险。

在进攻策略的行业配置上，基金经理倾向首选景气度较高的上游行业，包括基础化工、有色等板块，但不排除可能是适当配置一些有一定预期差、前期跌幅较大的行业。

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公司以下相关职能部门-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。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,763,913.90	9,770,682.85
结算备付金		429,028.80	803,420.88
存出保证金		11,244.72	68,227.57
交易性金融资产	6.4.7.2	88,282,753.55	107,783,487.34
其中：股票投资		88,282,753.55	107,783,487.34
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,622.90	10,881.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,356.59
资产总计		98,489,563.87	118,438,056.99
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		14,733.68	1,216,976.59
应付管理人报酬		118,498.62	149,045.01
应付托管费		19,749.80	24,840.85
应付销售服务费		2,651.81	4,163.73
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	311,766.98	591,640.95
负债合计		467,400.89	1,986,667.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	100,487,553.93	109,991,567.24
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-2,465,390.95	6,459,822.62
净资产合计		98,022,162.98	116,451,389.86
负债和净资产总计		98,489,563.87	118,438,056.99

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额为100,487,553.93份，其中A类基金份额总额为96,195,696.99份，基金份额净值0.9761元；C类基金份额总额为4,291,856.94份，基金份额净值0.9614元。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-7,846,380.32	33,802,346.51
1. 利息收入		23,577.20	269,963.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,577.20	46,911.79
债券利息收入		-	174,428.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	48,622.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-8,254,692.82	-2,392,736.89

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,183,070.92	-5,203,677.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-110,884.09
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	928,378.10	2,921,825.02
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
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	371,484.72	35,289,433.91
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	13,250.58	635,686.01
减：二、营业总支出		981,780.34	4,674,657.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	734,168.61	2,664,280.67
2. 托管费	6.4.10.2. 2	122,361.54	444,046.77
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	17,155.04	45,081.26
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	108,095.15	1,521,249.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,828,160.66	29,127,688.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,828,160.66	29,127,688.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,828,160.66	29,127,688.58

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	109,991,567.24	-	6,459,822.62	116,451,389.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	109,991,567.24	-	6,459,822.62	116,451,389.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,504,013.31	-	-8,925,213.57	-18,429,226.88
（一）、综合收益总额	-	-	-8,828,160.66	-8,828,160.66
（二）、本期基金份	-9,504,013.31	-	-97,052.91	-9,601,066.22

额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1			2
其中: 1. 基金申购款	3,621,817.52	-	-352,401.66	3,269,415.86
2. 基金赎回款	-13,125,830.83	-	255,348.75	-12,870,482.08
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	100,487,553.93	-	-2,465,390.95	98,022,162.98
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	576,670,470.91	-	-33,632,542.45	543,037,928.46
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	576,670,470.91	-	-33,632,542.45	543,037,928.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-317,005,673.12	-	42,172,062.83	-274,833,610.29
(一)、综合收益总额	-	-	29,127,688.58	29,127,688.58
(二)、本期基金份	-317,005,673.12	-	13,044,374.2	-303,961,29

额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	3.12		5	8.87
其中:1.基金申购款	28,959,422.1 8	-	-1,167,147.9 1	27,792,274.2 7
2.基金赎回 款	-345,965,09 5.30	-	14,211,522.1 6	-331,753,57 3.14
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	259,664,797. 79	-	8,539,520.38	268,204,318. 17

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

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

汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]第914号《关于准予汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金注册的批复》核准,由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币749,176,157.91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0678号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》于2020年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为749,497,428.91份基金份额,其中认

购资金利息折合321,271.00份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据经批准的《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、但不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

根据《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、次级债及其他经中国证监会允许投资的债券)、可转换债券(含可分离交易可转换债的纯债部分)、可交换债券、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：股票投资比例不低于基金资产的80%。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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 \times 90%+同业存款利率(税后) \times 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2022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》、《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2022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2022年06月30日的财务状况以及2022年上半年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

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易

费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为9,770,682.85元、803,420.88元、68,227.57元、1,356.59元和10,881.76元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为9,771,647.24元、803,782.38元、68,258.27元、0.00元和10,881.76元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为107,783,487.34元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为107,783,487.34元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,216,976.59元、149,045.01元、24,840.85元、4,163.73元、407,270.51元和1,370.44元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应

付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,216,976.59元、149,045.01元、24,840.85元、4,163.73元、407,270.51元和1,370.44元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022年06月30日
活期存款	9,763,913.90
等于：本金	9,763,037.54
加：应计利息	876.36
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	9,763,913.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	82,629,702.43	-	88,282,753.55	5,653,051.12
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	82,629,702.43	-	88,282,753.55	5,653,051.12

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	159,491.35
其中：交易所市场	159,491.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	152,260.15
合计	311,766.98

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇丰晋信中小盘低波动股票A

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信中小盘低波动股票 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	104,127,678.75	104,127,678.75
本期申购	3,172,913.70	3,172,913.70
本期赎回(以“-”号填列)	-11,104,895.46	-11,104,895.46
本期末	96,195,696.99	96,195,696.99

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7.2 汇丰晋信中小盘低波动股票C

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信中小盘低波动股票 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,863,888.49	5,863,888.49
本期申购	448,903.82	448,903.82
本期赎回（以“-”号填列）	-2,020,935.37	-2,020,935.37
本期末	4,291,856.94	4,291,856.94

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 汇丰晋信中小盘低波动股票A

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信中小盘低波 动股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	798,171.18	5,382,117.62	6,180,288.80
本期利润	-8,798,938.97	418,732.58	-8,380,206.39
本期基金份额交易产 生的变动数	20,226.19	-120,240.03	-100,013.84
其中：基金申购款	-242,012.73	-82,549.43	-324,562.16
基金赎回款	262,238.92	-37,690.60	224,548.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,980,541.60	5,680,610.17	-2,299,931.43

6.4.7.8.2 汇丰晋信中小盘低波动股票C

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信中小盘低波 动股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-21,171.90	300,705.72	279,533.82

本期利润	-400,706.41	-47,247.86	-447,954.27
本期基金份额交易产生的变动数	6,341.24	-3,380.31	2,960.93
其中：基金申购款	-19,987.92	-7,851.58	-27,839.50
基金赎回款	26,329.16	4,471.27	30,800.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-415,537.07	250,077.55	-165,459.52

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	20,057.40
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	3,275.16
其他	244.64
合计	23,577.20

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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	246,956,213.85
减：卖出股票成本总额	255,402,159.23
减：交易费用	737,125.54
买卖股票差价收入	-9,183,070.92

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.3 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。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	928,378.10
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	928,378.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	371,484.72
——股票投资	371,484.72
——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	371,484.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	6,996.70
转换费收入	6,253.88
合计	13,250.58

注：

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

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

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	235.00
银行间市场债券账户维护费	18,300.00
其他费用-其他	300.00
合计	108,095.15

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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 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	734,168.61	2,664,280.67
其中：支付销售机构的客户维护费	349,015.28	1,750,584.90

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	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年06月30日	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	122,361.54	444,046.77

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无支付给各关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	9,763,913.90	20,057.40	26,871,888.13	36,465.09

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，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

本基金本报告期及上年度可比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——固定净值型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（2022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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

于2022年06月30日，本基金无债券投资(2021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2022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2022年6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2022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 2022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	9,763,913.90	-	-	-	9,763,913.90
结算备付金	429,028.80	-	-	-	429,028.80
存出保证金	11,244.72	-	-	-	11,244.72
交易性金融资产	-	-	-	88,282,753.55	88,282,753.55
应收申购款	-	-	-	2,622.90	2,622.90
资产总计	10,204,187.42	-	-	88,285,376.45	98,489,563.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,733.68	14,733.68
应付管理人报酬	-	-	-	118,498.62	118,498.62
应付托管费	-	-	-	19,749.80	19,749.80
应付销	-	-	-	2,651.81	2,651.81

汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金 2022 年中期报告

售服务费					
其他负债	-	-	-	311,766.98	311,766.98
负债总计	-	-	-	467,400.89	467,400.89
利率敏感度缺口	10,204,187.42	-	-	87,817,975.56	98,022,162.98
上年度末 2021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	9,770,682.85	-	-	-	9,770,682.85
结算备付金	803,420.88	-	-	-	803,420.88
存出保证金	68,227.57	-	-	-	68,227.57
交易性金融资产	-	-	-	107,783,487.34	107,783,487.34
应收利息	-	-	-	1,356.59	1,356.59
应收申购款	-	-	-	10,881.76	10,881.76
资产总计	10,642,331.30	-	-	107,795,725.69	118,438,056.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,216,976.59	1,216,976.59
应付管理人报酬	-	-	-	149,045.01	149,045.01
应付托管费	-	-	-	24,840.85	24,840.85
应付销售服务费	-	-	-	4,163.73	4,163.73
应付交易费用	-	-	-	407,270.51	407,270.51
其他负债	-	-	-	184,370.44	184,370.44

负债总计	-	-	-	1,986,667.13	1,986,667.13
利率敏感度缺口	10,642,331.30	-	-	105,809,058.56	116,451,389.86

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2022年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例不低于基金资产的80%。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、存出保证金和应收申购款等。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 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	88,282,753.55	90.06	107,783,487.34	92.56
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	88,282,753.55	90.06	107,783,487.34	92.56

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	4,776,554.09	4,885,270.29
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-4,776,554.09	-4,885,270.29

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	88,282,753.55	107,765,370.44
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	12,612.41
合计	88,282,753.55	107,783,487.34

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2022年06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（2021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	88,282,753.55	89.64
	其中：股票	88,282,753.55	89.64
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	10,192,942.70	10.35
8	其他各项资产	13,867.62	0.01
9	合计	98,489,563.87	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	3,326,456.00	3.39
B	采矿业	8,069,490.00	8.23
C	制造业	59,349,178.55	60.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,121,114.00	2.16
E	建筑业	1,371,440.00	1.40
F	批发和零售业	2,829,983.00	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	3,435,864.00	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	690,952.00	0.70
J	金融业	3,845,265.00	3.92

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,036,295.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	458,216.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	889,460.00	0.91
R	文化、体育和娱乐业	859,040.00	0.88
S	综合	-	-
	合计	88,282,753.55	90.06

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	600867	通化东宝	176,200	1,821,908.00	1.86
2	603688	石英股份	10,100	1,339,361.00	1.37
3	300432	富临精工	58,000	1,276,000.00	1.30
4	300390	天华超净	14,200	1,241,080.00	1.27
5	600481	双良节能	72,100	1,214,885.00	1.24
6	601615	明阳智能	33,700	1,139,060.00	1.16
7	000729	燕京啤酒	115,500	1,115,730.00	1.14
8	600160	巨化股份	84,500	1,111,175.00	1.13
9	688385	复旦微电	16,700	1,088,673.00	1.11
10	002466	天齐锂业	8,700	1,085,760.00	1.11
11	002756	永兴材料	7,100	1,080,691.00	1.10
12	688155	先惠技术	10,300	1,073,260.00	1.09
13	600338	西藏珠峰	37,300	1,070,510.00	1.09
14	600348	华阳股份	68,000	1,051,280.00	1.07
15	002707	众信旅游	139,100	1,036,295.00	1.06

16	688186	广大特材	32,400	1,033,560.00	1.05
17	002925	盈趣科技	47,880	1,030,377.60	1.05
18	002203	海亮股份	88,700	1,024,485.00	1.05
19	600066	宇通客车	114,500	990,425.00	1.01
20	000050	深天马 A	98,500	982,045.00	1.00
21	600115	中国东航	178,100	977,769.00	1.00
22	600597	光明乳业	77,200	975,036.00	0.99
23	300363	博腾股份	12,400	967,076.00	0.99
24	000028	国药一致	32,300	962,217.00	0.98
25	300604	长川科技	21,300	961,695.00	0.98
26	688516	奥特维	3,600	961,020.00	0.98
27	600705	中航产融	276,600	957,036.00	0.98
28	688396	华润微	16,200	956,934.00	0.98
29	002221	东华能源	102,600	955,206.00	0.97
30	600390	五矿资本	195,300	955,017.00	0.97
31	600498	烽火通信	65,700	951,336.00	0.97
32	000528	柳工	145,700	948,507.00	0.97
33	300855	图南股份	22,650	946,543.50	0.97
34	601118	海南橡胶	197,800	945,484.00	0.96
35	600820	隧道股份	154,200	943,704.00	0.96
36	600377	宁沪高速	110,100	943,557.00	0.96
37	600967	内蒙一机	103,400	943,008.00	0.96
38	688123	聚辰股份	8,800	937,376.00	0.96
39	000685	中山公用	121,300	931,584.00	0.95
40	300196	长海股份	49,200	929,388.00	0.95
41	600572	康恩贝	207,500	919,225.00	0.94
42	600482	中国动力	58,500	919,035.00	0.94
43	600271	航天信息	83,700	915,678.00	0.93
44	600648	外高桥	67,100	912,560.00	0.93
45	600966	博汇纸业	117,900	912,546.00	0.93
46	300001	特锐德	52,600	910,506.00	0.93

47	601898	中煤能源	86,200	894,756.00	0.91
48	002124	天邦食品	133,100	894,432.00	0.91
49	000709	河钢股份	395,500	893,830.00	0.91
50	601997	贵阳银行	153,600	892,416.00	0.91
51	000708	中信特钢	44,200	890,630.00	0.91
52	300244	迪安诊断	28,600	889,460.00	0.91
53	603185	上机数控	5,700	889,143.00	0.91
54	600188	兖矿能源	22,200	876,456.00	0.89
55	000552	靖远煤电	202,000	870,620.00	0.89
56	002216	三全食品	44,200	865,878.00	0.88
57	300373	扬杰科技	12,100	862,125.00	0.88
58	300037	新宙邦	16,400	861,984.00	0.88
59	601098	中南传媒	91,000	859,040.00	0.88
60	600256	广汇能源	81,400	857,956.00	0.88
61	601088	中国神华	25,300	842,490.00	0.86
62	300268	佳沃食品	28,300	841,925.00	0.86
63	000983	山西焦煤	60,200	806,078.00	0.82
64	600863	内蒙华电	219,000	799,350.00	0.82
65	600985	淮北矿业	54,900	799,344.00	0.82
66	002597	金禾实业	18,200	788,606.00	0.80
67	600567	山鹰国际	278,100	770,337.00	0.79
68	688180	君实生物	10,200	768,468.00	0.78
69	600096	云天化	24,300	764,964.00	0.78
70	600596	新安股份	35,000	757,750.00	0.77
71	300398	飞凯材料	30,600	699,516.00	0.71
72	002440	闰土股份	86,200	694,772.00	0.71
73	002895	川恒股份	20,300	686,343.00	0.70
74	002539	云图控股	42,600	681,174.00	0.69
75	600063	皖维高新	89,200	676,136.00	0.69
76	688357	建龙微纳	6,000	674,640.00	0.69
77	603867	新化股份	19,400	659,018.00	0.67

78	600517	国网英大	124,100	644,079.00	0.66
79	600389	江山股份	10,600	643,738.00	0.66
80	000893	亚钾国际	18,600	640,026.00	0.65
81	601992	金隅集团	221,400	613,278.00	0.63
82	600732	爱旭股份	17,700	584,454.00	0.60
83	300724	捷佳伟创	6,100	545,035.00	0.56
84	601298	青岛港	97,800	534,966.00	0.55
85	603477	巨星农牧	21,500	515,570.00	0.53
86	601021	春秋航空	8,800	513,480.00	0.52
87	300498	温氏股份	23,800	506,702.00	0.52
88	600879	航天电子	76,100	493,889.00	0.50
89	600398	海澜之家	103,200	490,200.00	0.50
90	603517	绝味食品	8,300	479,906.00	0.49
91	002541	鸿路钢构	14,300	477,620.00	0.49
92	300118	东方日升	16,200	475,146.00	0.48
93	002046	国机精工	34,300	469,224.00	0.48
94	300393	中来股份	27,600	469,200.00	0.48
95	002928	华夏航空	39,600	466,092.00	0.48
96	002714	牧原股份	8,400	464,268.00	0.47
97	601200	上海环境	45,100	458,216.00	0.47
98	603786	科博达	7,300	449,461.00	0.46
99	002081	金螳螂	84,200	427,736.00	0.44
100	600643	爱建集团	66,900	396,717.00	0.40
101	601966	玲珑轮胎	15,400	390,698.00	0.40
102	000539	粤电力 A	92,900	390,180.00	0.40
103	002422	科伦药业	20,700	387,090.00	0.39
104	600409	三友化工	44,600	365,274.00	0.37
105	600959	江苏有线	109,200	355,992.00	0.36
106	600299	安迪苏	36,600	350,628.00	0.36
107	002065	东华软件	53,000	334,960.00	0.34
108	601058	赛轮轮胎	29,300	330,211.00	0.34

109	601163	三角轮胎	28,200	328,812.00	0.34
110	000021	深科技	28,100	327,084.00	0.33
111	000060	中金岭南	71,600	319,336.00	0.33
112	000401	冀东水泥	23,900	251,428.00	0.26
113	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.04

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	600160	巨化股份	2,495,054.00	2.14
2	601997	贵阳银行	2,438,849.40	2.09
3	600299	安迪苏	2,428,356.00	2.09
4	600648	外高桥	2,422,698.00	2.08
5	000028	国药一致	2,281,099.00	1.96
6	600482	中国动力	2,263,520.48	1.94
7	000728	国元证券	2,219,025.50	1.91
8	600705	中航产融	2,212,826.00	1.90
9	000709	河钢股份	2,071,794.00	1.78
10	600867	通化东宝	1,955,162.00	1.68
11	600820	隧道股份	1,920,971.00	1.65
12	600967	内蒙一机	1,884,255.00	1.62
13	300390	天华超净	1,866,314.00	1.60
14	688668	鼎通科技	1,848,150.71	1.59
15	002065	东华软件	1,821,689.00	1.56
16	000778	新兴铸管	1,780,347.00	1.53
17	000552	靖远煤电	1,773,875.00	1.52
18	600811	东方集团	1,746,547.00	1.50
19	000401	冀东水泥	1,738,113.00	1.49
20	600271	航天信息	1,701,536.00	1.46

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	600062	华润双鹤	4,251,631.24	3.65
2	600718	东软集团	3,508,197.00	3.01
3	000401	冀东水泥	3,292,686.00	2.83
4	000778	新兴铸管	2,844,012.00	2.44
5	600667	太极实业	2,597,261.00	2.23
6	600446	金证股份	2,562,981.00	2.20
7	600729	重庆百货	2,523,007.00	2.17
8	000021	深科技	2,487,392.99	2.14
9	600839	四川长虹	2,308,535.00	1.98
10	002085	万丰奥威	2,303,462.00	1.98
11	600959	江苏有线	2,202,556.00	1.89
12	000729	燕京啤酒	2,161,042.00	1.86
13	002465	海格通信	2,132,412.00	1.83
14	688668	鼎通科技	2,064,834.20	1.77
15	600643	爱建集团	2,016,576.00	1.73
16	002266	浙富控股	1,962,162.00	1.68
17	600811	东方集团	1,958,497.00	1.68
18	002065	东华软件	1,941,825.00	1.67
19	600835	上海机电	1,932,821.54	1.66
20	000988	华工科技	1,892,194.00	1.62

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	235,529,940.72
卖出股票收入（成交）总额	246,956,213.85

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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 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 报告期内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	11,244.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,622.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,867.62

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

份额 级别	持有 人户 数	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	持有份额	占总份	

	(户)			份额 比例		额比例
汇丰晋信中小盘低波动股票A	2,025	47,504.05	395,481.92	0.41%	95,800,215.07	99.59%
汇丰晋信中小盘低波动股票C	330	13,005.63	0.00	0.00%	4,291,856.94	100.00%
合计	2,355	42,669.87	395,481.92	0.39%	100,092,072.01	99.61%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇丰晋信中小盘低波动股票A	584,265.31	0.6074%
	汇丰晋信中小盘低波动股票C	0.00	0.0000%
	合计	584,265.31	0.5814%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	汇丰晋信中小盘低波动股票A	0
	汇丰晋信中小盘低波动股票C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信中小盘低波动股票A	50~100
	汇丰晋信中小盘低波动股票C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信中小盘低波动股票A	汇丰晋信中小盘低波动股票C
基金合同生效日(2020年08月13日)基金份额总额	715,715,029.82	33,782,399.09
本报告期期初基金份额总额	104,127,678.75	5,863,888.49
本报告期基金总申购份额	3,172,913.70	448,903.82
减：本报告期基金总赎回份额	11,104,895.46	2,020,935.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	96,195,696.99	4,291,856.94

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本公司高级管理人员无重大人事变动，未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。自本基金募集以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）一直为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	44,218,012.13	9.17%	41,181.46	9.17%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	21,748,656.70	4.51%	20,254.90	4.51%	-
海通证券	1	75,769,812.34	15.71%	70,564.63	15.71%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
山西	1	-	-	-	-	-

证券						
申万宏源	1	116,890,782.62	24.24%	108,859.58	24.24%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	62,464.96	0.01%	58.17	0.01%	-
安信证券	2	20,875.40	0.00%	19.45	0.00%	-
东吴证券	2	118,225,793.59	24.52%	110,101.85	24.52%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	38,824,404.41	8.05%	36,157.31	8.05%	-
中金公司	2	66,458,352.44	13.78%	61,892.12	13.78%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：

1、报告期内无新增加的交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

a. 实力雄厚，信誉良好；

b. 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好，过去三年未有任何违规经营记录；

c. 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

d. 公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；

e. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：

a. 研究报告的数量和质量；

b. 提供研究服务的主动性；

c. 资讯提供的及时性及便利性；

d. 其他可评价的考核标准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关准则的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-01
2	汇丰晋信基金管理有限公司	本基金指定报刊、指定互联	2022-01-20

	关于参加平安证券费率优惠的公告	网网站	
3	旗下基金2021年第4季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-24
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-25
5	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国中金财富证券有限公司的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-25
6	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加雪球基金费率优惠的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-02-17
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整汇丰晋信旗下开放式基金在东方财富证券的转换单笔最低限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-02-28
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增泰信财富为旗下开放式基金代销机构并调整交易限额、开展费率优惠的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-09
9	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国银河证券股份有限公司的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-21
10	汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金2021年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-31
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于终止与洛阳银行股份有限公司代销合作关系的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-09
12	汇丰晋信基金管理有限公司	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-13

	关于新增东方证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	网网站	
13	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加东方证券股份有限公司费率优惠的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-13
14	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增宁波银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-15
15	汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金2022年第一季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-22
16	汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-30
17	汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-30
18	汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金更新招募说明书(2022年第1号)	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-30

§ 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中小盘低波动策略股票型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日