

汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:2023 年 03 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。本年度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2023年3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。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 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	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	21
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 净资产（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	30
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合	62
8.3 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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 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	73
8.8 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	73

8.9 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	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	73
§9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 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	75
§10 开放式基金份额变动	75
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	79
§12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信价值先锋股票	
基金主代码	004350	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月14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	341,670,678.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C
下属分级基金的交易代码	004350	015364
报告期末下属分级基金的份额总额	335,647,837.64份	6,022,840.60份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金致力于捕捉中国A股股票市场的投资机会，基于汇丰"profitability-valuation（估值-盈利）"选股模型，筛选出低估值、高盈利的股票，以追求超越业绩基准的长期投资收益。</p>
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将上市公司作为一个整体考虑，如果整体上市公司的业绩预期改善、投资者的风险偏好增强、无风险利率下降，则预期股市看涨，应采取加仓的策略；反之亦然。我们认为，上市公司整体估值水平和利润变动方向，决定了公司未来股价的变动方向。上市公司整体估值水平考虑的因素有：市场整体的市盈率、国内外宏观经济形势（市场情绪）、市场利率和风险溢价（受宏观经济环境和资金面影响）等因素。本基金将综合考虑上述因素，判断估值水平和公司利润的变化方向，调整基金资产在股票、债券及现金等</p>

	<p>类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的"Profitability-Valuation（估值-盈利）"投资策略。本基金运用的"Profitability-Valuation（估值-盈利）"是一个二维的概念（PB、PE、EV为代表的估值维度与EBIT、ROE为代表的盈利维度），其分别反映公司估值高低（估值维度）和反映公司盈利能力（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标的构成核心股票库，同时，本基金将持续优化"Profitability-Valuation（估值-盈利）"投资策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证800指数收益率*90%+同业存款利率（税后）*10%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险、预期收益较高的基金产品，其预期风险和</p>

	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	王小飞
	联系电话	021-20376868	021-60637103
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	021-60637228
传真		021-20376999	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		杨小勇	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地

	(特殊普通合伙)	2号楼普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年		2021年		2020年	
	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C
本期已实现收益	-67,265,633.71	-198,053.11	27,312,345.37	-	30,742,291.33	-
本期利润	-72,314,753.33	-98,422.09	29,508,911.63	-	31,404,429.32	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2207	-0.0844	0.7324	-	0.4598	-
本期加权平均净值利润率	-11.55%	-4.84%	33.44%	-	28.15%	-
本期基金份额净值增长率	-16.54%	-1.06%	32.90%	-	38.42%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	253,833,497.61	4,510,018.64	170,626,638.23	-	46,685,715.33	-
期末可供分配基金份额利润	0.7562	0.7488	1.5254	-	0.8785	-
期末基金资产净值	589,481,335.25	10,532,859.24	288,303,818.77	-	103,069,966.28	-
期末基金份额净值	1.7562	1.7488	2.5775	-	1.9394	-
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	

基金份额累计净值增长率	115.13%	-1.06%	157.75%	-	93.94%	-
-------------	---------	--------	---------	---	--------	---

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

②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。④本基金的基金合同于2018年11月14日生效，自2022年4月1日起增加C类份额。

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

汇丰晋信价值先锋股票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
过去三个月	8.72%	1.11%	1.77%	1.07%	6.95%	0.04%
过去六个月	-4.45%	1.08%	-11.32%	0.96%	6.87%	0.12%
过去一年	-16.54%	1.27%	-19.15%	1.14%	2.61%	0.13%
过去三年	53.54%	1.30%	-1.48%	1.15%	55.02%	0.15%
自基金合同生效起至今	115.13%	1.23%	19.66%	1.14%	95.47%	0.09%

注：

过去三个月指2022年10月1日-2022年12月31日

过去六个月指2022年7月1日-2022年12月31日

过去一年指2022年1月1日—2022年12月31日

过去三年指2020年1月1日—2022年12月31日

自基金合同生效起至今指2018年11月14日—2022年12月31日

汇丰晋信价值先锋股票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	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	----------	-------------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	8.57%	1.11%	1.77%	1.07%	6.80%	0.04%
过去六个月	-4.71%	1.08%	-11.32%	0.96%	6.61%	0.12%
成立至今	-1.06%	1.21%	-7.23%	1.09%	6.17%	0.12%

注：

过去三个月指2022年10月1日-2022年12月31日

过去六个月指2022年7月1日-2022年12月31日

成立至今指2022年4月1日-2022年12月31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变动的比较

汇丰晋信价值先锋股票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



注：

1.按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的80%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金主要运用"profitability-valuation（估值-盈利）"选股模型构建核心股票库，筛选出具有低估值、高盈利特性的上市公司，本基金80%以上的股票资产投资于该模型筛选出的股票。

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2019年5月14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800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800指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信价值先锋股票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



注：

1.按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的80%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金主要运用"profitability-valuation（估值-盈利）"选股模型构建核心股票库，筛选出具有低估值、高盈利特性的上市公司，本基金80%以上的股票资产投资于该模型筛选出的股票。

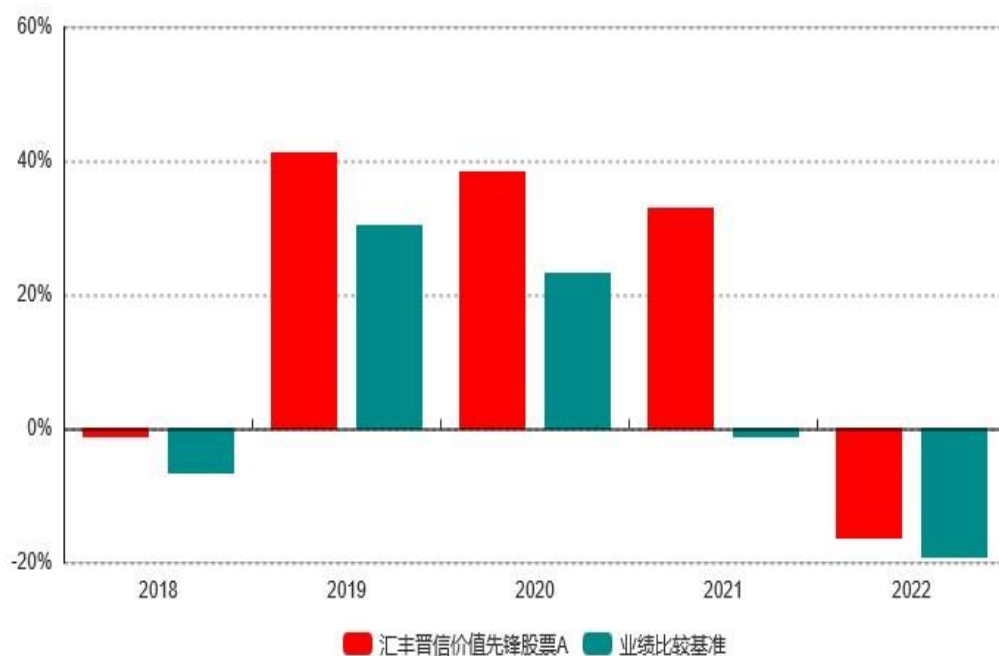
2.报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证800指数收益率*90%+同业存款利率（税后）*10%

3.上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证800指数成份股在报告期产生的股票红利收

益。

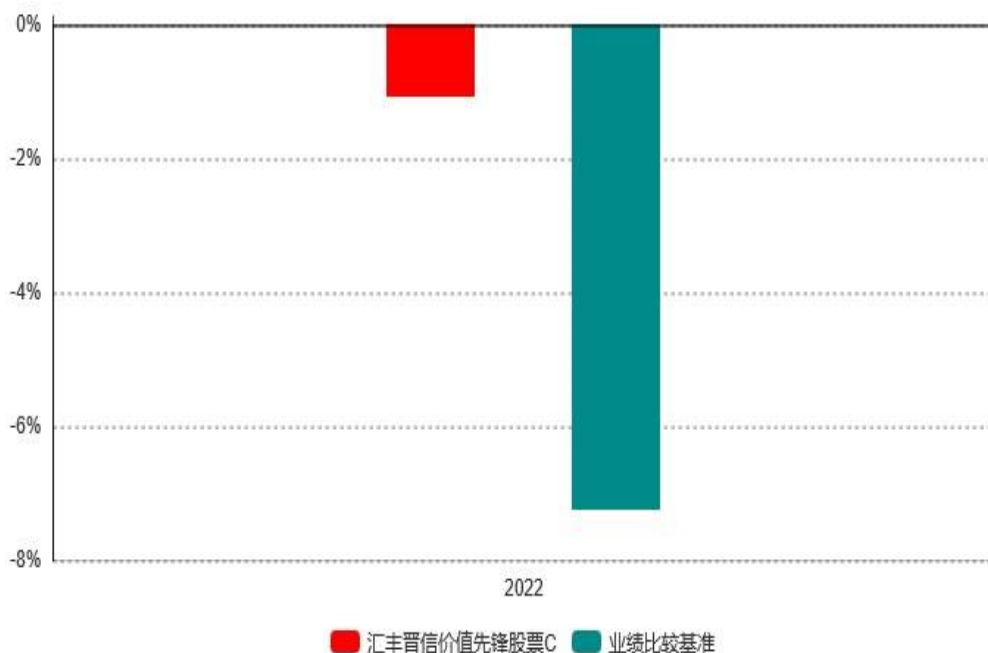
4.本基金自2022年4月1日起增加C类份额。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：①本基金A类份额于2018年11月14日生效，截至2022年12月31日，本基金A类份额运作未满五年。

②本基金A类份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：①本基金自2022年4月1日起增加C类份额，截至2022年12月31日，本基金C类份额运作未满五年。
②本基金C类份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

汇丰晋信价值先锋股票A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022年	4.000	168,834,611.49	40,004,891.28	208,839,502.77	-
2021年	-	-	-	-	-
2020年	-	-	-	-	-
合计	4.000	168,834,611.49	40,004,891.28	208,839,502.77	-

汇丰晋信价值先锋股票C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

	红数				
2022年	4.000	184,938.20	945.74	185,883.94	-
2021年	-	-	-	-	-
2020年	-	-	-	-	-
合计	4.000	184,938.20	945.74	185,883.94	-

§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12月31日，公司共管理34只开放式基金：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金（2006年5月23日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006年9月27日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007年4月9日成立）、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金（2008年7月23日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自2020年11月19日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009年6月24日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009年12月11日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010年6月8日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010年12月8日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011年7月27日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011年11月2日成立）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（2012年8月1日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014年11月26日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015年2月11日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015年9月30日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016年3月11日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016年11月10日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017年6月2日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018年11月14日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019年3月20日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019年8月2日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020年7月30日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020年8月13日成立）、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金（2020年10月29日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021年3月16日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021年5月24日

成立)、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金(2021年7月12日成立)、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金(2022年1月21日成立)、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金(2022年3月3日成立)、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金(2022年6月8日成立)、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金(2022年8月16日成立)、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金(2022年9月14日成立)、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金(2022年9月27日成立)和汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金(2022年12月20日成立)。

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		
吴培文	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金、汇丰晋信龙头优势混合证券投资基金、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金基金经理	2019-05-18	-	14	吴培文先生,清华大学工学硕士。历任宝钢股份研究员、东海证券研究员、平安证券高级研究员,2011年8月加入汇丰晋信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金、汇丰晋信龙头优势混合证券投资基金、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金基金经理。
闫滢	基金经理助理	2021-12-25	-	10	闫滢女士,硕士研究生。曾任易方达基金管理有限公司信用研究员、富国基

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

注：1.吴培文先生任职日期为本基金管理人公告吴培文先生担任本基金基金经理的日期；
2.闫滢女士任职日期为本基金管理人公告闫滢女士担任本基金基金经理助理的日期；
3.证券从业年限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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

公司对公平交易的控制方法包括：1、交易所市场的公平交易均通过恒生投资交易系统实现，通过开启公平交易程序，由恒生投资交易系统强制执行；2、银行间交易由执行交易员按照价格优先、比例分配的公平交易的原则实行分配，确保各投资组合获得公平的交易机会；3、对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交

易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、使用恒生投资交易系统的公平交易分析模块，定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析。公司对不同投资组合间同向交易的平均溢价率、溢价金额占投资组合平均净值百分比、正溢价率占比等指标进行专项计算分析，计算分析结果显示：以上各指标值均在合理正常的范围之内，未发现不同投资组合间相近交易日内的同向交易存在不公平及存在利益输送的行为。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

针对本产品，我们争取打造一个偏向于低估值风格的投资方案。该投资方案重点关注低估值的成长股、高股息率的成长股、处于运行周期底部或上行周期的周期股，以及其他可能被价值低估的标的。这些类型的标的，通常在以“profitability-valuation（估值-盈利）”为基础的价值投资框架中具有相对的估值优势。同时，我们还会优先对公司质地、业绩趋势、产业趋势等可能明显影响公司价值的因素做综合的考虑。

我们管理本产品时用到的投资策略和流程是相对稳定的。这是我们精心设计，严格实施的结果；是对汇丰晋信“可解释、可复制、可预期”的投资理念，在产品层面的落实。

会有助于我们的产品被投资者更容易地理解，更容易地使用。虽然面对股票市场，我们一定会有因时而变的投资观点，但我们更希望投资者关注我们对稳定性的坚持。

我们相信市场长期是向好的，但也存在四季，“春夏秋冬”都是必然会经历的过程。类似2022年那样的回调走势，在历史上屡见不鲜。如果可以把投资看的长一点，反而可能带来宝贵的投资机会。这是我们在2022年反复强调的观点。2023年开年以来，市场稳步上行，初步地验证了我们的看法。

去年四季度是资产配置上非常重要的调整期。我们积极研究国家在新的阶段将出现的重要变化，以及政策未来可能重点发力的领域。在投资上做出了调整，争取使配置结构与时代的变化同步。对受益于共同富裕的“大众消费品”，以及可以统筹发展和安全的“数字经济”领域（含信创），在布局上做了相对的加强，并基本保持至今。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类份额净值增长率为-16.54%，同期业绩比较基准收益率为-19.15%，本基金领先业绩比较基准2.61%；

本报告期内，本基金C类份额净值增长率为-1.06%，同期业绩比较基准收益率为-7.23%，本基金领先业绩比较基准6.17%。

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2023年，我们预计宏观经济增速将明显上升。尤其在上半年，可能会在较多行业出现较为显著的恢复信号。这对资本市场通常会是有利的支撑，市场可能会经历一个比较活跃的阶段。目前本产品的仓位，相应地维持在较高水平。

我们相信，站在中长期的维度上，2023年会是一个重要的起步之年。展望未来，中国资本市场仍将为投资者创造资产增值的机会。我们将继续平衡把握机会和风险，保持不骄不躁，科学、理性的态度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在公司内部监察稽核工作中本着规范运作、防范风险和保护基金份额持有人利益的原则，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司的经营管理、基金的投资运作以及员工行为规范等方面进行日常监控、定期检查和专项检查，及时发现问题并督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报送监管机构。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1.通过定期检查和专项检查的方式对公司日常经营活动和基金投资运作进行合规性监控，发现问题及时要求相关部门和相关人员及时解决处理，并跟踪问题的处理结果，对相关员工开展针对性的风险教育，防范在公司经营和基金投资运作中可能发生的风险；

2.按照法律法规和中国证监会规定，及时、准确、完整地完成了公司和基金的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和基金的各项公开信息。

3.定期和不定期地向中国证监会、上海证监局、中国证券业协会和人民银行等监管机构报送各类文件报告，确保监管机构文件报备工作的准确性和及时性。

4.加强对公司业务部门的合规监察工作，并将监察结果报告发给与相关部门主管沟通，对各项制度进行更新，提出改进建议，提请和督促业务部门进行跟踪和改善。

5.对基金募集申请材料、市场宣传推介材料、基金代销协议、基金交易单元租用协议等文件等进行严密的事前合法合规审核，以及完成公司其他日常法律事务工作。

6.定期为公司员工举办公司合规制度的培训，并就新颁布法律法规举办专项合规培训，向公司员工宣传合规守法的经营理念，强化公司的合规文化；对投资管理以及销售业务部门员工开展专项培训，以进一步规范和完善基金投资以及销售行为。

7.根据监管部门的要求，定期完成监察稽核报告，报送中国证监会和公司董事会审阅；

本基金管理人将继续致力于建立一个高效的内部控制体系，一贯本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益，切实保证基金安全、合规运作。

4.7 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开展工作，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。

4.8 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，本报告期末A类基金份额于2022年6月16日每10份基金份额派发现金红利4元，其中现金形式的分红金额为168,834,611.49元，红利再投资形式的分红金额为40,004,891.28元，利润分配共计208,839,502.77元；C类基金份额于2022年6月16日每10份基金份额派发现

金红利4元，其中现金形式的分红金额为184,938.20元，红利再投资形式的分红金额为945.74元，利润分配共计185,883.94元。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第23334号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金(以下简称"汇丰晋信价值先锋股票基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表, 2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了汇丰晋信价值先锋股票基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于汇丰晋信价值先锋股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>汇丰晋信价值先锋股票基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估汇丰晋信价值先锋股票基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续</p>

	<p>经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇丰晋信价值先锋股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督汇丰晋信价值先锋股票基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇丰晋信价值先锋股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇丰晋</p>

	信价值先锋股票基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张 振 波	施 翊 洲
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼	
审计报告日期	2023-03-28	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	78,183,020.61	53,378,789.21
结算备付金		539,397.34	533,149.83
存出保证金		177,420.67	25,642.55
交易性金融资产	7.4.7.2	549,781,943.89	233,987,472.00
其中：股票投资		549,781,943.89	233,987,472.00
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		87,995.42	1,469,507.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	3,516.50
资产总计		628,769,777.93	289,398,077.61
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		27,262,312.14	-
应付赎回款		31,100.82	361,979.29
应付管理人报酬		717,942.29	228,796.45
应付托管费		119,657.05	38,132.74
应付销售服务费		3,177.42	-
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	7.4.7.6	621,393.72	465,350.36
负债合计		28,755,583.44	1,094,258.84
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	341,670,678.24	111,854,635.35
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	258,343,516.25	176,449,183.42
净资产合计		600,014,194.49	288,303,818.77
负债和净资产总计		628,769,777.93	289,398,077.61

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额为341,670,678.24份，其中A类基金份额总额为335,647,837.64份，基金份额净值1.7562元；C类基金份额总额为6,022,840.60份，基金份额净值1.7488元。

7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-61,323,842.03	32,358,683.47
1.利息收入		260,052.99	53,520.82
其中：存款利息收入	7.4.7.9	252,840.66	32,904.38
债券利息收入		-	20,616.44
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		7,212.33	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,281,964.01	29,678,240.04
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-71,489,452.43	27,430,710.75

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	207,145.66	-600.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	12,000,342.76	2,248,129.29
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）	7.4.7.16	-4,949,488.60	2,196,566.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,647,557.59	430,356.35
减：二、营业总支出		11,089,333.39	2,849,771.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,326,895.87	1,306,241.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,554,482.64	217,706.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	8,795.79	-
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		0.54	-
8. 其他费用	7.4.7.18	199,158.55	1,325,823.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-72,413,175.42	29,508,911.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号		-72,413,175.42	29,508,911.63

填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-72,413,175.42	29,508,911.63

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	111,854,635.35	-	176,449,183.42	288,303,818.77
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）	111,854,635.35	-	176,449,183.42	288,303,818.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	229,816,042.89	-	81,894,332.83	311,710,375.72
（一）、综合收益总额	-	-	-72,413,175.42	-72,413,175.42
（二）、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）	229,816,042.89	-	363,332,894.96	593,148,937.85

其中：1.基金申购款	668,401,222.35	-	744,779,515.25	1,413,180,737.60
2.基金赎回款	-438,585,179.46	-	-381,446,620.29	-820,031,799.75
(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)	-	-	-209,025,386.71	-209,025,386.71
(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)	341,670,678.24	-	258,343,516.25	600,014,194.49
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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)	53,145,025.38	-	49,924,940.90	103,069,966.28
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)	53,145,025.38	-	49,924,940.90	103,069,966.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	58,709,609.97	-	126,524,242.52	185,233,852.49

(一)、综合收益总额	-	-	29,508,911.63	29,508,911.63
(二)、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)	58,709,609.97	-	97,015,330.89	155,724,940.86
其中: 1.基金申购款	117,423,343.96	-	161,898,232.88	279,321,576.84
2.基金赎回款	-58,713,733.99	-	-64,882,901.99	-123,596,635.98
(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)	111,854,635.35	-	176,449,183.42	288,303,818.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信价值先锋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[2017]166号《关于准予汇丰晋信价值先锋股票型

证券投资基金注册的批复》和机构部函[2018]1513号《关于汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金延期募集备案的回函》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《汇丰晋信价值先锋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416,637,462.04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(2018)第0674号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》于2018年11月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为416,741,629.70份基金份额，其中认购资金利息折合104,167.66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《关于汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》及修改后的《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金自2022年4月1日起增设C类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，不从本类别基金资产中计提销售服务费且收取申购费的基金份额类别，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费且不收取申购费的基金份额类别，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的80%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金主要运用"profitability-valuation(估值-盈利)"选股模型构建核心股票库，筛选出具有低估值、高盈利特性的上市公司，本基金80%以上的股票资产投资于该模型筛选出的股票。本基金的业绩比较基准为：中证800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2023年3月28日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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，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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。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。

7.4.4.4 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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 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扣除按票面利率(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后的净额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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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号一套期会计》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,财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号),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。

(i) 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53,378,789.21元、533,149.83元、25,642.55元、3,516.50元和1,469,507.52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53,382,054.31元、533,389.73元、25,654.05元、0.00元和1,469,507.52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233,987,472.00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233,987,472.00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、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为361,979.29元、228,796.45元、38,132.74元、325,136.11元和214.25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、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361,979.29元、228,796.45元、38,132.74元、325,136.11元和214.25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”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”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”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	78,183,020.61	53,378,789.21
等于：本金	78,173,621.32	53,378,789.21
加：应计利息	9,399.29	-
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	78,183,020.61	53,378,789.21

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	542,213,429.25	-	549,781,943.89	7,568,514.64
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	542,213,429.25	-	549,781,943.89	7,568,514.64
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	221,469,468.76	-	233,987,472.00	12,518,003.24
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	221,469,468.76	-	233,987,472.00	12,518,003.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	3,516.50
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	3,516.50

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2022年12月31日	2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.93	214.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	441,391.79	325,136.11
其中：交易所市场	441,391.79	325,136.11
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	140,000.00
合计	621,393.72	465,350.36

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 汇丰晋信价值先锋股票A

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信价值先锋股票A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,854,635.35	111,854,635.35
本期申购	661,543,004.21	661,543,004.21
本期赎回（以“-”号填列）	-437,749,801.92	-437,749,801.92
本期末	335,647,837.64	335,647,837.64

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.7.2 汇丰晋信价值先锋股票C

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信价值先锋股票C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	6,858,218.14	6,858,218.14
本期赎回（以“-”号填列）	-835,377.54	-835,377.54

本期末	6,022,840.60	6,022,840.60
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 汇丰晋信价值先锋股票A

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信价值先锋股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	170,626,638.23	5,822,545.19	176,449,183.42
本期利润	-67,265,633.71	-5,049,119.62	-72,314,753.33
本期基金份额交易产生的变动数	397,005,611.51	-38,467,041.22	358,538,570.29
其中：基金申购款	879,793,389.44	-140,478,045.64	739,315,343.80
基金赎回款	-482,787,777.93	102,011,004.42	-380,776,773.51
本期已分配利润	-208,839,502.77	-	-208,839,502.77
本期末	291,527,113.26	-37,693,615.65	253,833,497.61

7.4.7.8.2 汇丰晋信价值先锋股票C

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信价值先锋股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-198,053.11	99,631.02	-98,422.09
本期基金份额交易产生的变动数	5,573,407.04	-779,082.37	4,794,324.67
其中：基金申购款	6,414,382.07	-950,210.62	5,464,171.45
基金赎回款	-840,975.03	171,128.25	-669,846.78
本期已分配利润	-185,883.94	-	-185,883.94
本期末	5,189,469.99	-679,451.35	4,510,018.64

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	226,706.98	28,235.41
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	22,477.26	4,004.09
其他	3,656.42	664.88
合计	252,840.66	32,904.38

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	1,493,315,639.99	346,836,138.17
减：卖出股票成本总额	1,559,891,091.74	319,405,427.42
减：交易费用	4,914,000.68	-
买卖股票差价收入	-71,489,452.43	27,430,710.75

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	150.32	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	206,995.34	-600.00

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	207,145.66	-600.00

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	837,783.65	2,043,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	630,600.00	2,000,600.00
减：应计利息总额	154.80	43,000.00
减：交易费用	33.51	-
买卖债券差价收入	206,995.34	-600.00

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,000,342.76	2,248,129.29
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	12,000,342.76	2,248,129.29

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-4,949,488.60	2,196,566.26
——股票投资	-4,949,488.60	2,196,566.26
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-4,949,488.60	2,196,566.26

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	2,634,550.45	393,207.11
基金转换费收入	13,007.14	37,149.24
合计	2,647,557.59	430,356.35

注：

1.本基金对于持有A类基金份额少于30日的基金份额持有人所收取的赎回费，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个月的基金份额持有人所收取的赎回费，其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个月的基金份额持有人所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有A类基金份额不少于6个月的基金份额持有人所收取的赎回费，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。

对于持有C类基金份额少于30日的基金份额持有人所收取的赎回费，全额计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

本基金的赎回费率按持有期间递减。

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

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	798.55	4,703.25
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	360.00	360.00
交易费用	-	1,162,760.08
合计	199,158.55	1,325,823.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
山西信托股份有限公司("山西信托")	基金管理人的股东
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
山西证券股份有限公司("山西证券")	见注释①
汇丰银行(中国)有限公司("汇丰银行")	见注释②
恒生银行(中国)有限公司("恒生银行")	见注释③
汇丰前海证券有限责任公司("汇丰前海")	见注释④
汇丰人寿保险有限公司("汇丰人寿")	见注释⑤

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。

②汇丰银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

③恒生银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

④汇丰前海与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑤汇丰人寿与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
山西证券	47,506,191.65	1.41%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
山西证券	44,242.25	1.41%	44,242.25	10.02%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
山西证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,326,895.87	1,306,241.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,307,350.97	524,064.20

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,554,482.64	217,706.91

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C	合计
汇丰晋信	0.00	0.54	0.54
合计	0.00	0.54	0.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信价值先锋股票A	汇丰晋信价值先锋股票C	合计
汇丰晋信	0.00	0.00	0.00

合计	0.00	0.00	0.00
----	------	------	------

注：根据《关于汇丰晋信价值先锋混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及修改后的《汇丰晋信价值先锋混合型证券投资基金招募说明书》，本基金自2022年4月1日起增设C类基金份额。A类基金份额不计提销售服务费，C类基金份额按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇丰晋信，再由汇丰晋信计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：
C类基金份额日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.60%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	78,183,020.61	226,706.98	53,378,789.21	28,235.41

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

汇丰晋信价值先锋股票A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-0 6-16	2022-06-1 6	4.000	168,834,6 11.49	40,004,891.2 8	208,839,5 02.77	-
合计			4.000	168,834,6 11.49	40,004,891.2 8	208,839,5 02.77	-

汇丰晋信价值先锋股票C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-0 6-16	2022-06-1 6	4.000	184,938.2 0	945.74	185,883.9 4	-
合计			4.000	184,938.2 0	945.74	185,883.9 4	-

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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12月31日，本基金无债券投资(2021年12月31日：同)。

7.4.13.3 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12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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12月31日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2022年12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年1 2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	78,183,020.61	-	-	-	78,183,020.61
结算备付金	539,397.34	-	-	-	539,397.34
存出保证金	177,420.67	-	-	-	177,420.67
交易性金融资产	-	-	-	549,781,943.89	549,781,943.89
应收申购款	-	-	-	87,995.42	87,995.42
资产总计	78,899,838.62	-	-	549,869,939.31	628,769,777.93

汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金 2022 年年度报告

计					
负债					
应付清算款	-	-	-	27,262,312.14	27,262,312.14
应付赎回款	-	-	-	31,100.82	31,100.82
应付管理人报酬	-	-	-	717,942.29	717,942.29
应付托管费	-	-	-	119,657.05	119,657.05
应付销售服务费	-	-	-	3,177.42	3,177.42
其他负债	-	-	-	621,393.72	621,393.72
负债总计	-	-	-	28,755,583.44	28,755,583.44
利率敏感度缺口	78,899,838.62	-	-	521,114,355.87	600,014,194.49
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	53,378,789.21	-	-	-	53,378,789.21
结算备付金	533,149.83	-	-	-	533,149.83
存出保证金	25,642.55	-	-	-	25,642.55
交易性金融资产	-	-	-	233,987,472.00	233,987,472.00
其他资产	-	-	-	3,516.50	3,516.50
应收申购款	-	-	-	1,469,507.52	1,469,507.52
资产总计	53,937,581.59	-	-	235,460,496.02	289,398,077.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	361,979.29	361,979.29

应付管理人报酬	-	-	-	228,796.45	228,796.45
应付托管费	-	-	-	38,132.74	38,132.74
其他负债	-	-	-	465,350.36	465,350.36
负债总计	-	-	-	1,094,258.84	1,094,258.84
利率敏感度缺口	53,937,581.59	-	-	234,366,237.18	288,303,818.77

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31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净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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范围为基金资产的80%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金主要运用"profitability-valuation(估值-盈利)"选股模型构建核心股票库，筛选出具有低估值、高盈利特性的上市公司，本基金80%以上的股票资产投资于该模型筛选出的股票。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	549,781,943.89	91.63	233,987,472.00	81.16
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	549,781,943.89	91.63	233,987,472.00	81.16

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升5%	29,588,523.79	9,536,978.61
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降5%	-29,588,523.79	-9,536,978.61

4.1)下降5%		
----------	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	549,781,943.89	233,981,967.51
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	-
合计	549,781,943.89	233,987,472.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	549,781,943.89	87.44
	其中：股票	549,781,943.89	87.44
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	78,722,417.95	12.52
8	其他各项资产	265,416.09	0.04
9	合计	628,769,777.93	100.00

8.2 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	32,890,630.00	5.48
C	制造业	245,739,500.90	40.96

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	60,972,087.00	10.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,865,648.00	0.31
H	住宿和餐饮业	9,729,040.00	1.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	156,431,566.61	26.07
J	金融业	82,553.38	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,830,495.00	2.31
M	科学研究和技术服务业	3,928,860.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	9,539,712.00	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,983,279.00	0.83
R	文化、体育和娱乐业	9,788,572.00	1.63
S	综合	-	-
	合计	549,781,943.89	91.63

8.3 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	600941	中国移动	349,663	23,661,695.21	3.94
2	300138	晨光生物	1,146,700	20,330,991.00	3.39
3	600887	伊利股份	630,500	19,545,500.00	3.26
4	600859	王府井	689,000	19,388,460.00	3.23
5	603927	中科软	614,400	18,192,384.00	3.03
6	600968	海油发展	5,968,500	17,189,280.00	2.86
7	300454	深信服	150,100	16,893,755.00	2.82
8	600380	健康元	1,481,700	16,728,393.00	2.79

9	300308	中际旭创	550,400	14,877,312.00	2.48
10	601728	中国电信	3,509,000	14,702,710.00	2.45
11	600138	中青旅	910,500	13,830,495.00	2.31
12	002959	小熊电器	219,855	13,261,653.60	2.21
13	300170	汉得信息	1,542,210	12,553,589.40	2.09
14	603517	绝味食品	197,200	12,046,948.00	2.01
15	300379	东方通	588,700	12,027,141.00	2.00
16	002626	金达威	568,700	11,783,464.00	1.96
17	603899	晨光股份	210,600	11,578,788.00	1.93
18	603365	水星家纺	859,900	11,281,888.00	1.88
19	601607	上海医药	594,400	10,598,152.00	1.77
20	603711	香飘飘	697,100	10,484,384.00	1.75
21	002223	鱼跃医疗	306,000	9,749,160.00	1.62
22	002555	三七互娱	538,300	9,743,230.00	1.62
23	600258	首旅酒店	392,300	9,729,040.00	1.62
24	002065	东华软件	1,692,800	9,581,248.00	1.60
25	002216	三全食品	515,400	9,540,054.00	1.59
26	600054	黄山旅游	748,800	9,539,712.00	1.59
27	603043	广州酒家	364,200	9,403,644.00	1.57
28	300659	中孚信息	322,600	8,603,742.00	1.43
29	601808	中海油服	510,200	8,459,116.00	1.41
30	000521	长虹美菱	1,937,100	8,155,191.00	1.36
31	000651	格力电器	250,700	8,102,624.00	1.35
32	002063	远光软件	1,048,300	7,956,597.00	1.33
33	000650	仁和药业	1,225,600	7,586,464.00	1.26
34	000028	国药一致	216,600	7,123,974.00	1.19
35	300144	宋城演艺	463,600	6,768,560.00	1.13
36	600814	杭州解百	871,000	6,436,690.00	1.07
37	002273	水晶光电	537,400	6,335,946.00	1.06
38	603987	康德莱	443,100	6,105,918.00	1.02
39	600570	恒生电子	148,300	6,000,218.00	1.00

40	000417	合肥百货	1,088,900	5,934,505.00	0.99
41	000034	神州数码	255,900	5,614,446.00	0.94
42	300075	数字政通	289,900	5,081,947.00	0.85
43	300244	迪安诊断	198,300	4,983,279.00	0.83
44	600131	国网信通	323,900	4,845,544.00	0.81
45	002465	海格通信	583,800	4,740,456.00	0.79
46	600201	生物股份	520,400	4,688,804.00	0.78
47	002380	科远智慧	326,200	4,596,158.00	0.77
48	600873	梅花生物	427,200	4,348,896.00	0.72
49	002949	华阳国际	299,000	3,928,860.00	0.65
50	603727	博迈科	317,800	3,641,988.00	0.61
51	600583	海油工程	594,100	3,600,246.00	0.60
52	002705	新宝股份	205,700	3,424,905.00	0.57
53	300146	汤臣倍健	144,800	3,304,336.00	0.55
54	603866	桃李面包	203,600	3,135,440.00	0.52
55	300413	芒果超媒	100,600	3,020,012.00	0.50
56	002697	红旗连锁	534,000	3,006,420.00	0.50
57	002507	涪陵榨菜	116,400	2,999,628.00	0.50
58	600305	恒顺醋业	243,428	2,996,598.68	0.50
59	300007	汉威科技	176,200	2,977,780.00	0.50
60	000501	武商集团	256,200	2,869,440.00	0.48
61	002365	永安药业	247,700	2,600,850.00	0.43
62	002332	仙琚制药	178,300	2,014,790.00	0.34
63	600588	用友网络	82,400	1,991,608.00	0.33
64	002352	顺丰控股	32,300	1,865,648.00	0.31
65	600183	生益科技	58,900	848,749.00	0.14
66	300653	正海生物	15,500	666,500.00	0.11
67	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
68	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
69	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
70	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600030	中信证券	52,718,525.50	18.29
2	601601	中国太保	44,323,923.51	15.37
3	600887	伊利股份	43,429,295.11	15.06
4	601688	华泰证券	39,452,277.63	13.68
5	600859	王府井	38,417,603.05	13.33
6	600941	中国移动	35,966,638.51	12.48
7	300138	晨光生物	35,429,721.30	12.29
8	300308	中际旭创	33,901,175.15	11.76
9	002555	三七互娱	30,080,017.90	10.43
10	603987	康德莱	29,733,158.90	10.31
11	600380	健康元	28,884,138.52	10.02
12	300088	长信科技	28,809,113.00	9.99
13	601319	中国人保	28,377,944.00	9.84
14	603019	中科曙光	26,651,165.11	9.24
15	300244	迪安诊断	26,251,724.48	9.11
16	300170	汉得信息	25,912,778.02	8.99
17	601728	中国电信	25,382,355.19	8.80
18	601628	中国人寿	25,263,154.85	8.76
19	601995	中金公司	24,612,333.60	8.54
20	603365	水星家纺	24,543,883.00	8.51
21	600258	首旅酒店	24,421,872.82	8.47
22	002705	新宝股份	23,882,177.00	8.28
23	600138	中青旅	21,867,314.00	7.58
24	603899	晨光股份	21,711,215.95	7.53
25	002949	华阳国际	21,694,499.17	7.52

26	601598	中国外运	21,606,975.00	7.49
27	603927	中科软	21,565,424.50	7.48
28	300454	深信服	21,127,602.00	7.33
29	688169	石头科技	20,764,988.52	7.20
30	600201	生物股份	20,634,581.70	7.16
31	002223	鱼跃医疗	20,587,813.00	7.14
32	002273	水晶光电	20,366,149.28	7.06
33	600377	宁沪高速	20,352,449.04	7.06
34	603136	天目湖	19,599,496.60	6.80
35	601966	玲珑轮胎	18,301,480.00	6.35
36	600968	海油发展	18,141,421.00	6.29
37	603517	绝味食品	18,086,470.00	6.27
38	603383	顶点软件	17,857,337.77	6.19
39	600054	黄山旅游	17,473,946.00	6.06
40	603866	桃李面包	16,714,517.94	5.80
41	600050	中国联通	15,849,907.83	5.50
42	300379	东方通	15,663,065.42	5.43
43	603711	香飘飘	15,603,945.12	5.41
44	000333	美的集团	15,284,643.50	5.30
45	300659	中孚信息	15,048,527.00	5.22
46	000650	仁和药业	14,966,200.72	5.19
47	603738	泰晶科技	14,888,840.88	5.16
48	688696	极米科技	14,698,275.47	5.10
49	603043	广州酒家	14,452,361.84	5.01
50	000028	国药一致	14,428,717.00	5.00
51	002959	小熊电器	13,879,468.56	4.81
52	603989	艾华集团	13,602,680.30	4.72
53	601336	新华保险	13,447,904.00	4.66
54	601877	正泰电器	13,357,466.88	4.63
55	601318	中国平安	13,140,596.71	4.56
56	300144	宋城演艺	11,911,551.93	4.13

57	300529	健帆生物	11,784,913.64	4.09
58	002626	金达威	11,774,837.76	4.08
59	601298	青岛港	11,761,457.00	4.08
60	300638	广和通	11,602,510.53	4.02
61	002013	中航机电	11,500,256.02	3.99
62	600131	国网信通	11,358,765.00	3.94
63	002216	三全食品	11,336,970.80	3.93
64	002465	海格通信	11,132,262.78	3.86
65	601607	上海医药	10,969,678.85	3.80
66	600958	东方证券	10,490,982.00	3.64
67	603538	美诺华	10,459,732.00	3.63
68	600487	亨通光电	10,330,220.18	3.58
69	002065	东华软件	10,183,644.88	3.53
70	600570	恒生电子	10,161,734.48	3.52
71	603486	科沃斯	9,943,993.08	3.45
72	600873	梅花生物	9,836,693.00	3.41
73	300146	汤臣倍健	9,721,417.00	3.37
74	600977	中国电影	9,573,466.92	3.32
75	688015	交控科技	9,432,588.34	3.27
76	688058	宝兰德	9,344,274.50	3.24
77	000858	五粮液	9,094,963.00	3.15
78	600299	安迪苏	9,089,423.53	3.15
79	300133	华策影视	9,077,611.00	3.15
80	600372	中航电子	8,958,626.00	3.11
81	600416	湘电股份	8,735,333.00	3.03
82	000521	长虹美菱	8,683,046.96	3.01
83	601808	中海油服	8,323,302.00	2.89
84	000888	峨眉山 A	8,283,814.00	2.87
85	000651	格力电器	8,254,458.00	2.86
86	601018	宁波港	8,056,863.99	2.79
87	601398	工商银行	7,935,555.00	2.75

88	601288	农业银行	7,898,890.00	2.74
89	002063	远光软件	7,806,581.60	2.71
90	600285	羚锐制药	7,276,031.00	2.52
91	002007	华兰生物	6,930,353.00	2.40
92	600183	生益科技	6,753,778.00	2.34
93	002649	博彦科技	6,593,394.00	2.29
94	002281	光迅科技	6,536,927.00	2.27
95	603868	飞科电器	6,034,210.87	2.09
96	002236	大华股份	6,005,434.32	2.08
97	603108	润达医疗	5,911,817.20	2.05
98	603657	春光科技	5,907,381.00	2.05
99	600529	山东药玻	5,833,060.00	2.02
100	002573	清新环境	5,828,387.00	2.02

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600030	中信证券	49,246,735.55	17.08
2	601601	中国太保	37,300,644.32	12.94
3	601688	华泰证券	33,544,119.00	11.63
4	601319	中国人保	28,433,407.00	9.86
5	300088	长信科技	28,128,487.32	9.76
6	600377	宁沪高速	27,142,895.62	9.41
7	603987	康德莱	27,059,455.00	9.39
8	601995	中金公司	26,588,798.22	9.22
9	601628	中国人寿	25,985,618.93	9.01
10	603383	顶点软件	24,833,592.45	8.61
11	002705	新宝股份	24,619,942.22	8.54

12	603019	中科曙光	24,547,064.10	8.51
13	603136	天目湖	24,244,202.05	8.41
14	601598	中国外运	24,074,192.99	8.35
15	600050	中国联通	22,023,244.31	7.64
16	300138	晨光生物	20,741,389.33	7.19
17	600859	王府井	20,008,881.66	6.94
18	002273	水晶光电	19,606,506.97	6.80
19	002949	华阳国际	19,517,242.11	6.77
20	300244	迪安诊断	19,419,222.00	6.74
21	600887	伊利股份	19,399,144.00	6.73
22	600380	健康元	18,832,775.00	6.53
23	688169	石头科技	18,399,977.98	6.38
24	601877	正泰电器	18,072,038.14	6.27
25	600372	中航电子	17,993,985.00	6.24
26	002013	中航机电	17,595,590.00	6.10
27	600201	生物股份	17,121,027.00	5.94
28	002555	三七互娱	16,699,727.00	5.79
29	601298	青岛港	16,466,212.65	5.71
30	300308	中际旭创	16,121,836.28	5.59
31	601018	宁波港	16,066,916.00	5.57
32	688696	极米科技	15,061,742.70	5.22
33	600487	亨通光电	14,248,677.00	4.94
34	600138	中青旅	14,248,368.00	4.94
35	600258	首旅酒店	14,100,224.00	4.89
36	603738	泰晶科技	13,923,743.00	4.83
37	601966	玲珑轮胎	13,708,990.90	4.76
38	603866	桃李面包	13,491,493.60	4.68
39	600873	梅花生物	13,392,478.93	4.65
40	002223	鱼跃医疗	13,347,533.40	4.63
41	000333	美的集团	13,218,965.49	4.59
42	600054	黄山旅游	13,145,397.50	4.56

43	300638	广和通	12,928,473.81	4.48
44	600131	国网信通	12,882,829.72	4.47
45	600941	中国移动	12,863,812.15	4.46
46	603989	艾华集团	12,647,793.80	4.39
47	300170	汉得信息	11,613,842.70	4.03
48	603365	水星家纺	11,535,869.00	4.00
49	601336	新华保险	11,487,650.00	3.98
50	601318	中国平安	11,366,992.00	3.94
51	600285	羚锐制药	11,261,568.00	3.91
52	601728	中国电信	11,261,061.00	3.91
53	002573	清新环境	11,100,785.00	3.85
54	603899	晨光股份	10,974,203.12	3.81
55	300529	健帆生物	10,687,213.00	3.71
56	600416	湘电股份	10,667,850.00	3.70
57	603486	科沃斯	10,629,911.00	3.69
58	002465	海格通信	10,430,196.21	3.62
59	688058	宝兰德	10,364,291.64	3.59
60	000888	峨眉山 A	10,353,441.99	3.59
61	600299	安迪苏	10,090,281.12	3.50
62	002007	华兰生物	9,751,614.81	3.38
63	688015	交控科技	9,661,453.33	3.35
64	600958	东方证券	9,636,506.00	3.34
65	603538	美诺华	9,626,903.60	3.34
66	000858	五粮液	9,408,074.00	3.26
67	000538	云南白药	9,339,250.40	3.24
68	000650	仁和药业	9,337,887.00	3.24
69	600312	平高电气	9,303,162.96	3.23
70	603868	飞科电器	9,294,212.00	3.22
71	600977	中国电影	9,236,175.77	3.20
72	600803	新奥股份	9,045,145.00	3.14
73	603108	润达医疗	8,857,618.02	3.07

74	002959	小熊电器	8,528,373.00	2.96
75	600183	生益科技	8,325,411.00	2.89
76	300659	中孚信息	7,987,748.00	2.77
77	300114	中航电测	7,928,216.00	2.75
78	601398	工商银行	7,838,417.00	2.72
79	300133	华策影视	7,836,761.62	2.72
80	601288	农业银行	7,802,676.00	2.71
81	300215	电科院	7,594,833.00	2.63
82	603517	绝味食品	7,505,848.06	2.60
83	600529	山东药玻	7,325,677.73	2.54
84	002281	光迅科技	7,298,949.11	2.53
85	300146	汤臣倍健	7,290,617.00	2.53
86	300454	深信服	7,053,449.00	2.45
87	603711	香飘飘	7,021,606.21	2.44
88	002649	博彦科技	6,772,149.00	2.35
89	603678	火炬电子	6,490,760.00	2.25
90	603986	兆易创新	6,338,514.00	2.20
91	603927	中科软	6,124,753.79	2.12
92	603043	广州酒家	6,063,766.00	2.10
93	300286	安科瑞	6,031,723.44	2.09
94	000028	国药一致	5,907,821.00	2.05
95	600570	恒生电子	5,855,128.00	2.03

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。

8.4.3 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	1,880,635,052.23
卖出股票收入（成交）总额	1,493,315,639.99

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	177,420.67

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	87,995.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,416.09

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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)	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
汇丰 晋信 价值 先锋 股票A	3,014	111,362.92	297,766,318.72	88.71%	37,881,518.92	11.29%

汇丰晋信价值先锋股票C	110	54,753.10	5,684,473.38	94.38%	338,367.22	5.62%
合计	3,124	109,369.62	303,450,792.10	88.81%	38,219,886.14	11.19%

9.2 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	汇丰晋信价值先锋股票A	323,157.55	0.0963%
	汇丰晋信价值先锋股票C	138.02	0.0023%
	合计	323,295.57	0.0946%

9.3 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	汇丰晋信价值先锋股票A	0
	汇丰晋信价值先锋股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信价值先锋股票A	10~50
	汇丰晋信价值先锋股票C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信价值先锋股票 A	汇丰晋信价值先锋股票 C
基金合同生效日(2018年11月14日)基金份额总额	416,741,629.70	-
本报告期期初基金份额总额	111,854,635.35	-
本报告期基金总申购份额	661,543,004.21	6,858,218.14
减：本报告期基金总赎回份额	437,749,801.92	835,377.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	335,647,837.64	6,022,840.60

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2022年2月21日,经公司股东会审议批准,何慧芬女士担任本公司董事,巴培卓(Pedro Augusto Botelho Bastos)先生不再担任本公司董事。

2022年12月31日,基金管理人发布公告,杨剑青先生担任公司首席信息官(信息技术负责人),吴平先生担任公司风控负责人,罗琤女士担任公司财务负责人。

本报告期内,本公司高级管理人员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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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,本基金报告年度预提审计费60000元,根据与普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)签订的《审计业

务约定书》，应实际支付2022年度审计费60000元。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	-	-	-	-
光大证券	1	32,348,711.21	0.96%	30,127.56	0.96%	-
国金证券	1	121,615,965.90	3.61%	113,258.81	3.61%	-
国泰君安	1	203,461,658.58	6.03%	189,484.53	6.03%	-
海通证券	1	114,812,257.42	3.40%	106,926.42	3.40%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	47,506,191.65	1.41%	44,242.25	1.41%	-
申万宏源	1	728,514,258.12	21.60%	678,468.13	21.60%	-
西南证券	1	265,258,074.46	7.86%	247,035.24	7.86%	-

中信建投	1	68,412,353.88	2.03%	63,712.88	2.03%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	325,005,692.99	9.64%	302,673.71	9.64%	-
东吴证券	2	807,414,062.11	23.94%	751,950.14	23.94%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	460,044,915.39	13.64%	428,440.07	13.64%	-
中金公司	2	198,509,420.66	5.89%	184,870.84	5.89%	-

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。

11.7.2 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	-	-	20,000,000. 00	40.00%	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	837,783.6 5	100.00%	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	30,000,000. 00	60.00%	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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关于新增恒泰证券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	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-04
3	汇丰晋信基金管理有限公司	本基金指定报刊、指定互联	2022-01-04

	关于旗下基金参加恒泰证券费率优惠的公告	网网站	
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加平安证券费率优惠的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-01-20
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增广发证券为汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-22

13	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在光大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	2022-03-24
14	关于汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-30
15	汇丰晋信基金管理有限公司关于汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金C类开通定期定额投资、转换业务的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-30
16	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-30
17	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金托管协议	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-03-30
18	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
19	汇丰晋信价值先锋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	2022-04-01
20	汇丰晋信价值先锋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	2022-04-01
21	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-01
22	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
23	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增东方证券为旗下部	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-13

	分开放式基金代销机构的公告		
24	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
25	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
26	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金在华泰证券的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-18
27	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增部分销售机构为汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金C类代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-18
28	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增天风证券为汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-18
29	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中泰证券为汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金C类代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-04-19
30	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
31	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司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	2022-04-28
32	汇丰晋信价值先锋股票型证	本基金指定报刊、指定互联	2022-05-25

	券投资基金暂停机构客户50000元以上申购、转换转入、定期定额投资业务公告	网网站	
33	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增德邦证券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	2022-05-27
34	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增诺亚正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	2022-05-30
35	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金分红公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-15
36	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金恢复机构客户50000元以上申购、转换转入、定期定额投资业务公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-16
37	汇丰晋信价值先锋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
38	汇丰晋信价值先锋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
39	汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金更新招募说明书(2022年第2号)	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-06-30
40	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增万得基金为旗下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	2022-07-08
41	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增联泰基金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	2022-07-15

42	汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金2022年第二季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-07-21
43	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在腾安基金的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-08-04
44	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人寿保险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	2022-08-08
45	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增华宝证券为旗下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	2022-08-19
46	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在华宝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	2022-08-19
47	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2022年中期报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-08-31
48	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增兴业银行为旗下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	2022-09-13
49	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增利得基金为旗下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	2022-09-16
50	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在蚂蚁（杭州）基金销售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	2022-09-22
51	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增众禄基金为旗下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	2022-09-27

52	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2022年第三季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-10-26
53	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增平安证券为汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金C类基金份额代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-11-04
54	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在上海天天基金销售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	2022-11-04
55	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增腾安基金为旗下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	2022-12-07
56	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金在平安证券的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-12-29
57	汇丰晋信基金管理有限公司关于提请直销投资者及时更新投资者分类资料并接受或重新接受风险承受能力调查的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-12-30
58	汇丰晋信基金管理有限公司关于完善客户身份信息的提示	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-12-30
59	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2022-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20220119 - 20220126; 20220207 - 20220418; 20220506 - 20220714	16,336,681.77	207,215,440.26	223,552,122.03	0.00	0.00%
	2	20220715-20221231	0.00	98,342,430.05	0.00	98,342,430.05	28.78%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信价值先锋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价值先锋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

13.2 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

13.3 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
二〇二三年三月三十一日