

# 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金

## 2023年第1季度报告

2023年03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

报告送出日期:2023年04月21日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年03月31日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |        |
|------------|--|--------|
| 基金简称       | 汇丰晋信2026周期混合   |        |
| 基金主代码      | 540004   |        |
| 交易代码       | 540004   | 541004 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |        |
| 基金合同生效日    | 2008年07月23日  |        |
| 报告期末基金份额总额 | 35,648,014.66份   |        |
| 投资目标       | 通过基于内在价值判断的股票投资方法，基于宏观经济、现金流、信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程，本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求高于业绩比较基准的收益。  |        |
| 投资策略       | <p>1. 动态调整的资产配置策略</p> <p>本基金投资的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，基金的投资风格相应的从"进取"，转变为"稳健"，再转变为"保守"，股票类资产比例逐步下降，而非股票类资产比例逐步上升。</p> <p>2. 以风险控制为前提的股票筛选策略</p> <p>根据投研团队的研究成果，本基金首先筛选出</p> |        |

|                    | <p>股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票；同时，再通过严格的基本面分析（CFR OI为核心的财务分析、公司治理结构分析）和公司实地调研，最终挑选出质地优良的具有高收益风险比的优选股票。</p> <p>3. 动态投资的固定收益类资产投资策略<br/>在投资初始阶段，本基金债券投资将奉行较为"积极"的策略；随着目标期限的临近和达到，本基金债券投资将逐步转向"稳健"和"保守"，在组合久期配置、组合久期浮动权限、个券选择上相应变动。</p>  |        |             |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
|--------------------|--|--------|-------------|--------|-------------|--------------------|-------|----|----|--------------------|-------|----|----|--------------------|-------|----|----|--------------------|-------|----|----|
| <p>业绩比较基准</p>      | <p>1.基金合同生效日~2026年8月31日（包括2026年8月31日）<br/>业绩比较基准=X * MSCI中国A股在岸指数收益率 + (1-X) *中债新综合指数收益率（全价）<br/>其中X值见下表：</p> <table border="1" data-bbox="735 1032 1378 1503"> <thead> <tr> <th>时间段</th> <th>股票类资产比例%</th> <th>X值 (%)</th> <th>(1-X) 值 (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>基金合同生效之日至2012/8/31</td> <td>60-95</td> <td>75</td> <td>25</td> </tr> <tr> <td>2012/9/1-2016/8/31</td> <td>50-80</td> <td>65</td> <td>35</td> </tr> <tr> <td>2016/9/1-2021/8/31</td> <td>30-65</td> <td>45</td> <td>55</td> </tr> <tr> <td>2021/9/1-2026/8/31</td> <td>10-40</td> <td>20</td> <td>80</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. 2026年9月1日（包括2026年9月1日）后<br/>业绩比较基准=中债新综合指数收益率（全价）。</p> | 时间段    | 股票类资产比例%    | X值 (%) | (1-X) 值 (%) | 基金合同生效之日至2012/8/31 | 60-95 | 75 | 25 | 2012/9/1-2016/8/31 | 50-80 | 65 | 35 | 2016/9/1-2021/8/31 | 30-65 | 45 | 55 | 2021/9/1-2026/8/31 | 10-40 | 20 | 80 |
| 时间段                | 股票类资产比例%   | X值 (%) | (1-X) 值 (%) |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
| 基金合同生效之日至2012/8/31 | 60-95  | 75     | 25          |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
| 2012/9/1-2016/8/31 | 50-80  | 65     | 35          |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
| 2016/9/1-2021/8/31 | 30-65  | 45     | 55          |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
| 2021/9/1-2026/8/31 | 10-40  | 20     | 80          |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |
| <p>风险收益特征</p>      | <p>本基金是一只生命周期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。</p> <p>本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于较高水平；随着目标投资期限的逐步接近，本基金将逐步降低预期风险与收益水平，转变成为中等风险的证券投资基金；在临近目标期限</p>   |        |             |        |             |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |                    |       |    |    |

|       |                              |
|-------|------------------------------|
|       | 和目标期限达到以后，本基金转变成为低风险的证券投资基金。 |
| 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                 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2023年01月01日 - 2023年03月31日） |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 2,878,863.56                   |
| 2.本期利润         | 4,217,747.48                   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1168                         |
| 4.期末基金资产净值     | 107,159,160.93                 |
| 5.期末基金份额净值     | 3.0060                         |

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 3.97%   | 0.29%     | 1.20%      | 0.16%         | 2.77%   | 0.13% |
| 过去六个月      | 4.20%   | 0.31%     | 1.07%      | 0.20%         | 3.13%   | 0.11% |
| 过去一年       | 3.25%   | 0.43%     | 0.20%      | 0.23%         | 3.05%   | 0.20% |
| 过去三年       | 39.47%  | 0.90%     | 16.64%     | 0.42%         | 22.83%  | 0.48% |
| 过去五年       | 104.03% | 0.98%     | 17.76%     | 0.52%         | 86.27%  | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 372.20% | 1.36%     | 57.12%     | 0.98%         | 315.08% | 0.38% |

注：

过去三个月指2023年1月1日-2023年3月31日

过去六个月指2022年10月1日-2023年3月31日

过去一年指2022年4月1日—2023年3月31日

过去三年指2020年4月1日—2023年3月31日

过去五年指2018年4月1日—2023年3月31日

自基金合同生效起至今指2008年7月23日—2023年3月31日

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

汇丰晋信2026生命周期证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：

1.按照基金合同的约定，自基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例60-95%，非股票类资产比例5-40%。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过6个月内完成建仓，截止2009年1月23日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2.根据基金合同的约定，自2012年9月1日起至2016年8月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例50-80%，非股票类资产比例20-50%。

3.根据基金合同的约定，自2016年9月1日起至2021年8月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例30-65%，非股票类资产比例35-70%。

4.根据基金合同的约定，自2021年9月1日起至2026年8月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例10-40%，非股票类资产比例60-90%。

5.基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的业绩比较基

准 = 75% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 25% × 中信标普全债指数收益率。根据基金合同的约定，自 2012 年 9 月 1 日起至 2014 年 5 月 31 日，本基金的业绩比较基准调整为：65% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 35% × 中信标普全债指数收益率。2014 年 6 月 1 日起至 2016 年 8 月 31 日，本基金的业绩比较基准调整为：65% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 35% × 中债新综合指数收益率（全价）。2016 年 9 月 1 日起至 2021 年 8 月 31 日，本基金的业绩比较基准调整为：45% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 55% × 中债新综合指数收益率（全价）。2021 年 9 月 1 日起至 2026 年 8 月 31 日，本基金的业绩比较基准调整为：20% × MSCI 中国 A 股在岸指数收益率 + 80% × 中债新综合指数收益率（全价）。（MSCI 中国 A 股在岸指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中，本基金业绩比较基准中的中债新综合指数收益率为中债新综合全价（总值）指数收益率，是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中）。

6.2018 年 3 月 1 日，MSCI 中国 A 股指数更名为 MSCI 中国 A 股在岸指数。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--|-------------|------|--------|---|
|     |  | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 闵良超 | 助理研究总监，汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理 | 2021-09-30  | -    | 9      | 闵良超先生，硕士研究生。曾任平安证券股份有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级宏观策略分析师。现任助理研究总监、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金和汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理。 |

注：1. 任职日期为本基金管理人公告闵良超先生担任本基金基金经理的日期；  
2. 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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年第一季度，生产消费弱复苏，经济有所回暖。一季度以来，国内经济继续回暖，通胀压力减弱。国内方面，中观及宏观总量数据指向：1) 生产端，3月制造业PMI继续处于扩张区间，但较2月有所放缓;同时受返工慢影响，生产复苏相对较弱。1-2月工业增加值同比增长2.4%，为2022年10月以来首次回升，但环比仅分别增长0.26%、0.12%，工业企业利润也出现同比回落。2) 需求端，本报告期，出口回补和出海“抢订单”拉动出口略超预期，基建、制造业投资仍维持高位，地产部门边际改善较为明显，同时场景

恢复也带动消费弱复苏。3) 融资端, 2月新增社融3.16万亿元, 比上年同期多增1.95万亿元; 新增人民币贷款1.81万亿元, 同比多增5928亿元; M2同比12.9%, 高于前值12.6%, 2月社融数据延续了“总量高, 结构好”的格局。4) 通胀方面, 2月CPI、PPI同比均低于预期, 消费端通胀超预期下行, 生产端价格仍处收缩区间。5) 政策端, 财政赤字率上调但适度, 兼顾“加力”与“可持续”, 同时货币政策或将保持适度宽松。海外方面, 美国2月失业率意外上行, 衰退预期抬头。在海外风险事件背景下, 美联储宣布加息25bp至4.75%-5.0%, 但点阵图指向加息近尾声。另外, 欧央行3月会议加息50bp, 抗通胀决心不变。

往后看, 海外方面, 虽然最新FOMC市场解读为鸽派, 但是对于未来降息的路径联储较前期未出现明显调整, 这反映了其背后受到两大制约--内忧通胀复位, 外患资金流出。从这个角度来看, 关于降息的博弈可能会使得美债利率短期“下不去”, 而金融风险及企业盈利压力意味着对美股也需维持谨慎。国内方面, 生产消费弱复苏, 且需求改善强于生产, 被动去库存阶段确认。从历史经验来看, 被动去库存阶段可持续约4个月左右的时间, 考虑到2022年底疫情的扰动, 不排除本次被动去库存阶段会有所延长。被动去库存时期, 往往是企业盈利增速回升的阶段, 股市整体表现较好。结合当前经济数据, 全球资金对中国资产的关注度可能会提升。但市场轮动加速也是这一时期资产表现的应有特征。

一季度, A股市场的表现既有符合我们预期的地方, 也有在我们预期之外的部分。随着经济的弱复苏, 市场整体开始有一定的表现, 并且以科技为代表的成长风格跑赢, 这些都是我们有所预期的, 超预期在于风格的演绎在一季度中后期趋于极致, 在人工智能的产业趋势之下, 科技板块迎来了估值的大幅扩张, TMT板块的成交占比一度达到非常高的水平。债券角度, 一季度国内经济生活进一步向常态化恢复, 但疫情对经济造成的影响仍将长期存在, 我们认为经济复苏的方向是确定的, 但短期修复力度有所减弱, 仍需要政策持续呵护。在这一背景下, 预计债市短期出现大幅调整的风险有限, 而随着收益率缓慢上行, 配置价值也开始逐渐上升, 预计下阶段债市将继续宽幅震荡。

因此, 展望二季度, 本基金将继续保持股债均衡的策略, 具体到股票配置, 预计市场并不会有极致的分化行情, 而是会趋于均衡, 在控制回撤的前提下, 本基金相对看好三大方向: 1) TMT板块中, 看好半导体板块的周期性恢复; 2) 周期板块中的结构性机会, 包括炼化板块; 3) 高端制造板块中的顺周期和新能源板块。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内, 基金份额净值增长率为3.97%, 同期业绩比较基准收益率为1.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### §5 投资组合报告

第 8 页, 共 14 页

INTERNAL



## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 34,501,230.76  | 31.85         |
|    | 其中：股票             | 34,501,230.76  | 31.85         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 53,663,874.40  | 49.54         |
|    | 其中：债券             | 53,663,874.40  | 49.54         |
|    | 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      | 20,031,665.57  | 18.49         |
| 8  | 其他资产              | 137,404.97     | 0.13          |
| 9  | 合计                | 108,334,175.70 | 100.00        |

## 5.2 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              | 4,360,734.00  | 4.07          |
| C  | 制造业              | 25,235,146.24 | 23.55         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,619.60      | 0.01          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,698,689.92  | 2.52          |
| J  | 金融业              | -             | -             |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业          | 2,200,041.00  | 2.05  |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 34,501,230.76 | 32.20 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 002128 | 电投能源 | 253,200 | 3,403,008.00 | 3.18         |
| 2  | 601233 | 桐昆股份 | 226,800 | 3,256,848.00 | 3.04         |
| 3  | 002531 | 天顺风能 | 206,100 | 3,042,036.00 | 2.84         |
| 4  | 002212 | 天融信  | 187,000 | 2,290,750.00 | 2.14         |
| 5  | 600782 | 新钢股份 | 544,000 | 2,284,800.00 | 2.13         |
| 6  | 002092 | 中泰化学 | 305,600 | 2,215,600.00 | 2.07         |
| 7  | 600048 | 保利发展 | 155,700 | 2,200,041.00 | 2.05         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 5,400   | 2,192,670.00 | 2.05         |
| 9  | 688125 | 安达智能 | 42,794  | 2,178,642.54 | 2.03         |
| 10 | 603313 | 梦百合  | 200,900 | 2,147,621.00 | 2.00         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 29,943,659.34 | 27.94        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,515,597.26 | 19.14        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,515,597.26 | 19.14        |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 4  | 企业债券      | -             | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | -             | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 3,204,617.80  | 2.99  |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 53,663,874.40 | 50.08 |

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 239906 | 23贴现国债06 | 300,000 | 29,943,659.34 | 27.94        |
| 2  | 200212 | 20国开12   | 100,000 | 10,401,832.88 | 9.71         |
| 3  | 210202 | 21国开02   | 100,000 | 10,113,764.38 | 9.44         |
| 4  | 127022 | 恒逸转债     | 18,000  | 2,021,591.10  | 1.89         |
| 5  | 127032 | 苏行转债     | 10,100  | 1,183,026.70  | 1.10         |

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

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
无。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**  
无。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
无。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**  
无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 34,231.98  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 103,172.99 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 137,404.97 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 127022 | 恒逸转债 | 2,021,591.10 | 1.89         |
| 2  | 127032 | 苏行转债 | 1,183,026.70 | 1.10         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 37,277,882.68 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,040,434.99  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,670,303.01  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 35,648,014.66 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信2026生命周期证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金托管协议
- 5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 6) 基金管理人业务资格批件和营业执照

- 7) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8) 报告期内汇丰晋信2026生命周期证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 9) 中国证监会要求的其他文件

## 9.2 存放地点

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

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

2023年04月21日