

# 汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年01月01日起至2024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.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告.....	18
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等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 净资产变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	48
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.....	49
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
§9 开放式基金份额变动 .....	56
§10 重大事件揭示 .....	56
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
§12 备查文件目录 .....	63
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信2016周期混合	
基金主代码	540001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年05月23日	
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	210,259,147.93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2016周期混合A	汇丰晋信2016周期混合C
下属分级基金的交易代码	540001	019242
报告期末下属分级基金的份额总额	204,383,028.21份	5,876,119.72份

注：1、本基金自2023年9月19日起增加C类份额。

2、本基金A类份额前端交易代码：540001，后端交易代码：541001。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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，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，而固定收益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，本基金首先筛选出股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票；同时，</p>

	<p>再通过严格的基本面分析（CFROI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</p> <p>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"，在组合久期配置和个券选择上作相应变动。</p>																																												
<p>业绩比较基准</p>	<p>1. 2016年6月1日前业绩比较基准</p> <p>基金合同生效后至2016年5月31日，本基金业绩比较基准如下：</p> <p>业绩比较基准 = X * MSCI中国A股在岸指数+ (1-X) * 中债新综合指数（全价）其中X值见下表：</p> <table border="1" data-bbox="668 835 1359 1461"> <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2007/5/31</td> <td>0-65</td> <td>45.5</td> <td>54.5</td> </tr> <tr> <td>2007/6/1-2008/5/31</td> <td>0-60</td> <td>42.0</td> <td>58.0</td> </tr> <tr> <td>2008/6/1-2009/5/31</td> <td>0-55</td> <td>38.5</td> <td>61.5</td> </tr> <tr> <td>2009/6/1-2010/5/31</td> <td>0-45</td> <td>31.5</td> <td>68.5</td> </tr> <tr> <td>2010/6/1-2011/5/31</td> <td>0-40</td> <td>28.0</td> <td>72.0</td> </tr> <tr> <td>2011/6/1-2012/5/31</td> <td>0-35</td> <td>24.5</td> <td>75.5</td> </tr> <tr> <td>2012/6/1-2013/5/31</td> <td>0-25</td> <td>17.5</td> <td>82.5</td> </tr> <tr> <td>2013/6/1-2014/5/31</td> <td>0-20</td> <td>14.0</td> <td>86.0</td> </tr> <tr> <td>2014/6/1-2015/5/31</td> <td>0-15</td> <td>10.5</td> <td>89.5</td> </tr> <tr> <td>2015/6/1-2016/5/31</td> <td>0-10</td> <td>7.0</td> <td>93.0</td> </tr> </tbody> </table> <p>注：</p> <p>1.2008年11月11日，新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。</p> <p>2.2010年12月16日，新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。</p> <p>3.2013年2月1日起，本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先"X * 富时中国A全指 + (1-X) * 新华巴克莱资本中国全债指数"，变更为"X * 富时中国A全指 + (1-X) * 中债新综合指数（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2007/5/31	0-65	45.5	54.5	2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0	2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5	2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5	2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0	2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5	2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5	2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0	2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5	2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0
时间段	股票类资产比例%	X值 (%)	(1-X) 值 (%)																																										
基金合同生效之日至2007/5/31	0-65	45.5	54.5																																										
2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0																																										
2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5																																										
2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5																																										
2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0																																										
2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5																																										
2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5																																										
2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0																																										
2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5																																										
2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0																																										

	<p>4.2015年4月1日起,本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先"<math>X * \text{富时中国A全指} + (1-X) * \text{中债新综合指数(全价)}</math>",变更为"<math>X * \text{MSCI中国A股在岸指数} + (1-X) * \text{中债新综合指数(全价)}</math>".</p> <p>5.2018年3月1日, MSCI中国A股指数更名为MSCI中国A股在岸指数。</p> <p>6.2016年6月1日后业绩比较基准</p> <p>2016年6月1日起, 本基金业绩比较基准 = 银行活期存款利率(税后)</p>
<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中等水平; 随着目标投资期限的逐步接近, 本基金会逐步降低预期风险与收益水平, 转变成为中低风险的证券投资基金; 在临近目标期限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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周慧	方圆
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨小勇	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金中期报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼；交通银行股份有限公司：中国（上海）长宁区仙霞路18号

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	汇丰晋信2016周期混合A	汇丰晋信2016周期混合C
本期已实现收益	1,011,919.80	-16,771.15
本期利润	4,750,128.98	14,014.86
加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0007
本期加权平均净值利润率	1.57%	0.06%
本期基金份额净值增长率	1.65%	1.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	39,642,152.39	1,116,968.22

期末可供分配基金份额利润	0.1940	0.1901
期末基金资产净值	244,025,180.60	6,993,087.94
期末基金份额净值	1.1940	1.1901
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	254.31%	1.01%

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。

### 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2016周期混合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	-0.12%	0.14%	0.03%	0.00%	-0.15%	0.14%
过去三个月	1.22%	0.11%	0.09%	0.00%	1.13%	0.11%
过去六个月	1.65%	0.11%	0.18%	0.00%	1.47%	0.11%
过去一年	1.92%	0.09%	0.36%	0.00%	1.56%	0.09%
过去三年	9.01%	0.10%	1.07%	0.00%	7.94%	0.10%
自基金合同生效起至今	254.31%	0.52%	126.62%	0.47%	127.69%	0.05%

注：

过去一个月指2024年6月1日－2024年6月30日

过去三个月指2024年4月1日－2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日－2024年6月30日

过去一年指2023年7月1日－2024年6月30日

过去三年指2021年7月1日－2024年6月30日

自基金合同生效起至今指2006年5月23日－2024年6月30日

汇丰晋信2016周期混合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	-0.15%	0.14%	0.03%	0.00%	-0.18%	0.14%
过去三个月	1.11%	0.11%	0.09%	0.00%	1.02%	0.11%
过去六个月	1.43%	0.11%	0.18%	0.00%	1.25%	0.11%
成立至今	1.01%	0.10%	0.28%	0.00%	0.73%	0.10%

注：

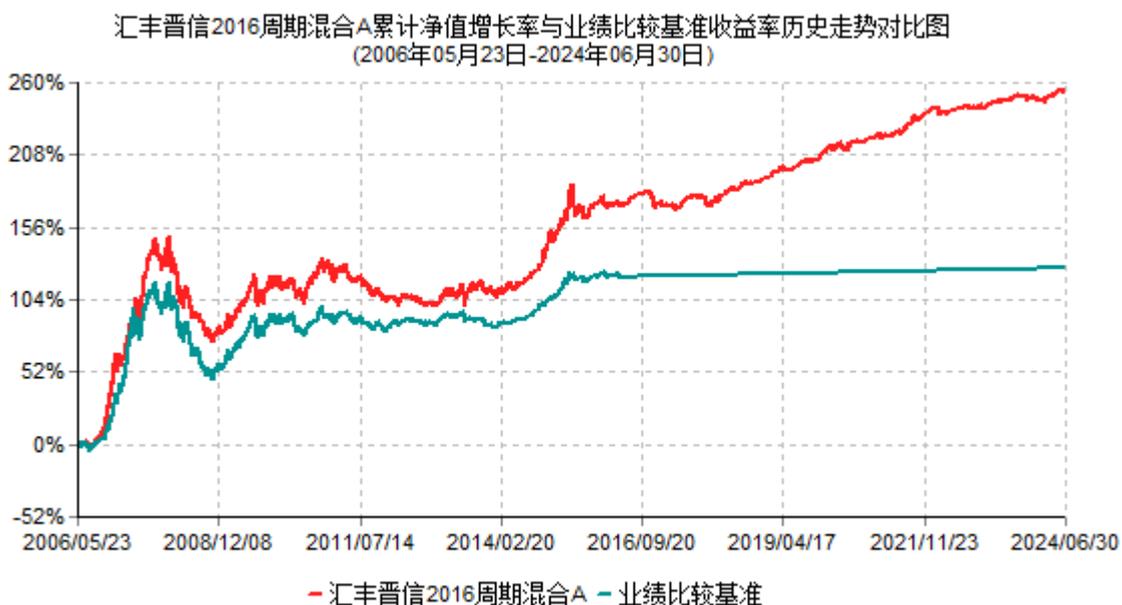
过去一个月指2024年6月1日－2024年6月30日

过去三个月指2024年4月1日－2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日－2024年6月30日

成立至今指2023年9月19日－2024年6月30日

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



注：

- 1.按照基金合同的约定，自基金合同生效日（2006年5月23日）至2007年5月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例0-65%，固定收益类资产比例35-100%。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2006年11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2007年6月1日起至2008年5月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例0-60%，固定收益类资产比例40-100%。
- 3.根据基金合同的约定，自2008年6月1日起至2009年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-55%，固定收益类资产比例45-100%。
- 4.根据基金合同的约定，自2009年6月1日起至2010年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-45%，固定收益类资产比例55-100%。
- 5.根据基金合同的约定，自2010年6月1日起至2011年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-40%，固定收益类资产比例60-100%。
- 6.根据基金合同的约定，自2011年6月1日起至2012年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-35%，固定收益类资产比例65-100%。
- 7.根据基金合同的约定，自2012年6月1日起至2013年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-25%，固定收益类资产比例75-100%。
- 8.根据基金合同的约定，自2013年6月1日起至2014年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-20%，固定收益类资产比例80-100%。
- 9.根据基金合同的约定，自2014年6月1日起至2015年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-15%，固定收益类资产比例85-100%。
- 10.根据基金合同的约定，自2015年6月1日起至2016年5月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-10%，固定收益类资产比例90-100%。
- 11.根据基金合同的约定，自2016年6月1日起本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例0-5%，固定收益类资产比例95-100%。
- 12.基金合同生效日（2006年5月23日）至2007年5月31日，本基金的业绩比较基准=45.5%×富时中国A全指+54.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；根据基金合同的约定，自2007年6月1日起至2008年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：42%×富时中国A全指+58%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2008年6月1日起至2009年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：38.5%×富时中国A全指+61.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2009年6月1日起至2010年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：31.5%×富时中国A全指+68.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2010年6月1日起至2011年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：28%×富时中国A全指+72%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2011年6月1日起至2012年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为：24.5%×富时

中国A全指+75.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。自2012年6月1日起至2013年1月31日，本基金的业绩比较基准调整为：17.5%×富时中国A全指+82.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。2013年2月1日起至2013年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为"17.5%×富时中国A全指+82.5%×中债新综合指数（全价）。2013年6月1日起至2014年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为"14%×富时中国A全指+86%×中债新综合指数（全价）。2014年6月1日起至2015年3月31日，本基金的业绩比较基准调整为"10.5%×富时中国A全指+89.5%×中债新综合指数（全价）"。2015年4月1日起至2015年5月31日，本基金的业绩比较基准修改为"10.5%×MSCI中国A股在岸指数+89.5%×中债新综合指数（全价）"。2015年6月1日起至2016年5月31日，本基金的业绩比较基准调整为"7%×MSCI中国A股在岸指数+93%×中债新综合指数（全价）"。2016年6月1日起，本基金的业绩比较基准调整为"银行活期存款利率（税后）"。

13.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新华富时中国A全指成份股在报告期产生的股票红利收益。业绩比较基准中的中债新综合指数收益率（全价）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。

14.2008年11月11日，新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。

15.2010年12月16日，新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。

16.2018年3月1日，MSCI中国A股指数更名为MSCI中国A股在岸指数。

汇丰晋信2016周期混合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  
(2023年09月19日-2024年06月30日)



注：

1.按照基金合同的约定，本报告期内，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例0-5%，固定收益类资产比例95-100%。

2.本报告期内，本基金的业绩比较基准为“银行活期存款利率（税后）”。

3.本基金自2023年9月19日起增加C类份额。

## §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2024年6月30日，公司共管理38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）、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）、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金（2023年1月17日成立）、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（2023年12月12日成立）、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金（2024年4月16日成立）和汇丰晋信养老目标日期2036一年持有期混合型基金中基金(FOF)（2024年6月12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		
吴刘	总经理助理、固定收益投资部总监兼汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理	2024-05-18	-	9.5	吴刘先生，硕士研究生。曾任中汇信息技术（上海）有限公司职员、交通银行股份有限公司投资经理、中信银行股份有限公司投资经理、信银理财有限责任公司固收投资条线团队负责人及条线总经理助理，现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资部总监兼汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理。
蔡若林	公募固收投资副总监、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券	2016-01-30	-	13	蔡若林先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理策略分析师、助理研究员、固定收益信用分析师、汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。现任公募固

	型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金 基金经理			收投资副总监、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券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蔡若林先生、吴刘先生担任本基金基金经理的日期；
- 2.2024年8月10日，基金管理人发布公告，聘任刘洋先生担任本基金基金经理；2024年8月24日，基金管理人发布公告，蔡若林先生不再担任本基金基金经理；
- 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 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

2024年上半年，全球经济整体保持相对韧性，但结构和区域上有所分化。其中，美国消费趋向放缓，就业市场降温，通胀数据连续回落，市场对美联储的降息预期回归。

国内方面，经济在一季度有所复苏，但势头在二季度出现放缓，二季度我国GDP增速为4.7%，低于一季度的5.3%。进出口方面，6月出口金额同比8.6%，创去年下半年以来单月同比增速新高，但进口数据持续走弱，显示内需动能有待进一步提振。消费方面，6月社零同比2%，较前值回落1.7个百分点，增速创2023年以来新低。投资方面，1-6月固定资产投资累计同比3.9%，较前值回落0.1个百分点。地产角度，1-6月商品房销售面积、地产投资累计同比分别为-19%、-10.1%，较前值反弹1.3和0个百分点；新开工增速有所回升，施工竣工继续回落。6月地产数据反弹可能与5月新一轮地产政策有关，但7月以来地产高频数据再度走弱。1-6月制造业投资累计同比9.5%，较前值回落0.1个百分点，仍然维持高位。此外，PMI重新回落至荣枯线下，6月中国官方制造业PMI与5月持

平于49.5，分项指数中，新订单指数49.5，新出口订单指数48.3，反映需求依然相对较弱；生产指数50.6，尚保持在扩张区间，但较3月回落1.6。

通胀方面，6月CPI同比增速为0.2%（前值0.3%），核心CPI同比持平于0.6%，继续保持温和上涨。6月PPI同比增速为-0.8%（前值-1.4%），环比下降0.2%，主要受国际大宗商品价格波动及国内部分工业品市场需求不足等因素影响。

货币政策层面，一季度央行通过PSL、下调存款准备金率和LPR等方式推动社会综合融资成本稳中有降，二季度央行未展开降准、降息操作，主要通过公开市场操作维持资金面稳定。财政政策层面，赤字率目标维持不变，从地方债发行进度看财政发力可能后移。房地产政策层面，“517”楼市新政出台，涉及下调最低首付比例并取消房贷利率政策下限等，截至二季度末，一线城市先后就楼市政策进行优化，后续还需观察政策实施效果。

综合影响下，上半年债市稳步上涨，具体看，期间中债新综合全价指数上涨2.42%，中债信用债全价指数上涨1.49%，中债金融债全价指数上涨1.4%，中债国债全价指数上涨3.02%。

权益方面，A股总体波动较大，一季度伊始受风险偏好持续回落影响，指数加速下行，但随后在监管和政策的多重利好影响下，叠加经济数据转好，市场情绪明显修复，指数随之反弹。二季度宏观经济增速边际放缓，叠加监管政策影响小盘股风险偏好，指数先涨后跌。具体来看，上半年沪深300指数+0.89%，上证50指数+2.95%，创业板指数-10.99%。

基金操作上，基于控制组合波动的考虑，在权益市场反弹之后降低了权益仓位，相应上调可转债仓位。二季度末可转债市场波动性放大，可转债仓位调降。纯债部分久期有所拉长，信用债配置上依然以短久期高评级品种为主。

#### 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1.65%，同期业绩比较基准为0.18%，本基金A类领先同期比较基准1.47%；本基金C类本报告期内净值变化幅度为1.43%，同期业绩比较基准为0.18%，本基金C类领先同期比较基准1.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计国内经济保持复苏态势。但是，海外经济体的衰退风险和海外地缘政治风险等可能进一步放大宏观和金融环境的波动。国内政策层面，货币政策维持稳健基调，保持流动性合理充裕，债券资产仍具备较高的配置价值。含权资产方面，经历了较为明显的调整之后，当前点位中长期配置价值逐步凸显，但预计呈现一定波动。转债市场跟随权益市场调整，叠加低价转债的快速下跌，当前估值已经处于低位，待资金面企稳后，有望迎来较好的配置机会。

#### 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，根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引，结合本基金基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司特设估值委员会作为公司基金估值的主要决策机关。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规以及基金估值运作等方面的专业胜任能力，估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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

本报告期内，基金托管人在汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	952,215.41	39,993,964.41
结算备付金		999,038.78	391,101.65
存出保证金		20,226.21	11,993.65
交易性金融资产	6.4.7.2	238,964,077.30	308,298,745.65
其中：股票投资		-	6,997,385.60
基金投资		-	-
债券投资		238,964,077.30	301,301,360.05
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	10,000,000.00	136,037,174.00
应收清算款		4,581,184.84	434,873.46
应收股利		-	-
应收申购款		53,692.22	63,718.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		255,570,434.76	485,231,571.44
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		2024年06月30日	2023年12月31日
<b>负债：</b>			
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		3,510,426.94	34,121,112.08
应付赎回款		433,156.58	720,922.12
应付管理人报酬		80,207.36	106,621.45
应付托管费		21,107.22	28,058.31
应付销售服务费		2,454.61	10,334.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		413,682.06	423,700.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,131.45	189,888.50
负债合计		4,552,166.22	35,600,637.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	210,259,147.93	382,857,087.60
未分配利润	6.4.7.8	40,759,120.61	66,773,846.72
净资产合计		251,018,268.54	449,630,934.32
负债和净资产总计		255,570,434.76	485,231,571.44

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额为210,259,147.93份，其中A类基金份额总额为204,383,028.21份，基金份额净值1.1940元；C类基金份额总额为5,876,119.72份，基金份额净值1.1901元。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		5,712,329.01	5,342,021.10
1.利息收入		154,437.12	123,667.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,148.70	27,737.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		120,288.42	95,930.18
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		1,662,823.01	4,323,797.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,024,401.88	11,010.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,692,755.35	4,246,159.85
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	-5,530.46	66,627.17
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	3,768,995.19	813,285.38
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	126,073.69	81,270.54
<b>减：二、营业总支出</b>		948,185.17	819,081.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	617,759.73	551,305.10

2.托管费	6.4.10.2.2	162,568.40	145,080.32
3.销售服务费	6.4.10.2.3	45,055.58	-
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		12,499.63	14,664.67
8.其他费用	6.4.7.18	110,301.83	108,031.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,764,143.84	4,522,939.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,764,143.84	4,522,939.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,764,143.84	4,522,939.72

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	382,857,087.60	66,773,846.72	449,630,934.32
二、本期期初净资产	382,857,087.60	66,773,846.72	449,630,934.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-172,597,939.67	-26,014,726.11	-198,612,665.78

（一）、综合收益总额	-	4,764,143.84	4,764,143.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-172,597,939.67	-30,778,869.95	-203,376,809.62
其中：1.基金申购款	30,805,819.13	5,765,913.03	36,571,732.16
2.基金赎回款	-203,403,758.80	-36,544,782.98	-239,948,541.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	210,259,147.93	40,759,120.61	251,018,268.54
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	234,805,679.02	35,911,677.53	270,717,356.55
二、本期期初净资产	234,805,679.02	35,911,677.53	270,717,356.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,143,904.43	8,152,168.20	30,296,072.63
（一）、综合收益总额	-	4,522,939.72	4,522,939.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	22,143,904.43	3,629,228.48	25,773,132.91

列)			
其中：1.基金申购款	114,798,320.05	19,108,768.18	133,907,088.23
2.基金赎回款	-92,654,415.62	-15,479,539.70	-108,133,955.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	256,949,583.45	44,063,845.73	301,013,429.18

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

苑忠磊

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2016生命周期开放式证券投资基金(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[2006]第53号《关于核准汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金募集的批复》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2016生命周期开放式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,921,117,535.97元，业经毕马威华振会计师事务所有限公司KPMG-B(2006)CRNo.0017验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金合同》于2006年5月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,921,919,211.81份基金份额，其中认购资金利息折合801,675.84份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《关于汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金增加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2016生命周期开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金自2023年9月19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2016生命周期开放式证券投资基金基金合同》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、债券、央行票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在基金实际管理过程中，基金管理人将随着投资人目标期限的临近和根据中国证券市场的阶段性变化，逐年适时调整基金资产在股票类资产、固定收益类资产间的配置比例。同时在正常市场情况下，本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

2016年6月1日前，本基金的原业绩比较基准为： $X \times \text{富时中国A全指} + (1-X) \times \text{中债新综合指数(全价)}$ 。本基金的逐年资产配置和业绩比较基准所用的X值如下表所示：

时间段	股票类资产比例%	X值 (%)	(1-X)值 (%)
基金合同生效之日至2007/5/31	0-65	45.5	54.5
2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0
2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5
2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5
2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0
2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5
2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5
2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0
2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5
2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0

注：2008年11月11日，新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。

2010年12月16日，新华富时中国A全指更名为富时中国A全指。

2013年2月1日起，本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先" $X \times \text{富时中国A全指} + (1-X) \times \text{新华巴克莱资本中国全债指数}$ "，变更为" $X \times \text{富时中国A全指} + (1-X) \times \text{中债新综合指数(全价)}$ "。

2015年4月1日起，本基金2016年6月1日前的业绩比较基准由原先" $X \times \text{富时中国A全指} + (1-X) \times \text{中债新综合指数(全价)}$ "，变更为" $X \times \text{MSCI中国A股指数} + (1-X) \times \text{中债新综合指数(全价)}$ "。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。

自2016年6月1日起，本基金业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。

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2024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、《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2016生命周期开放式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2024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2024年06月30日的财务状况以及2024年上半年度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

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号

《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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2018年1月1日起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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	952,215.41	
等于：本金	950,901.81	
加：应计利息	1,313.60	
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	952,215.41	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	62,253,430.69	294,874.93	62,460,816.30	-87,489.32
	银行间市场	172,752,985.81	2,912,761.00	176,503,261.00	837,514.19
	合计	235,006,416.50	3,207,635.93	238,964,077.30	750,024.87
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	235,006,416.50	3,207,635.93	238,964,077.30	750,024.87

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	353.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,287.50
其中：交易所市场	-

银行间市场	2,287.50
应付利息	-
预提费用	88,490.52
合计	91,131.45

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 汇丰晋信2016周期混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信2016周期混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	323,354,830.33	323,354,830.33
本期申购	22,436,825.41	22,436,825.41
本期赎回（以“-”号填列）	-141,408,627.53	-141,408,627.53
本期末	204,383,028.21	204,383,028.21

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2016周期混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇丰晋信2016周期混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,502,257.27	59,502,257.27
本期申购	8,368,993.72	8,368,993.72
本期赎回（以“-”号填列）	-61,995,131.27	-61,995,131.27
本期末	5,876,119.72	5,876,119.72

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2016周期混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(汇丰晋信2016周期混合A)			
上年度末	236,933,431.56	-180,469,188.25	56,464,243.31
本期期初	236,933,431.56	-180,469,188.25	56,464,243.31
本期利润	1,011,919.80	3,738,209.18	4,750,128.98
本期基金份额交易产生的变动数	-87,306,048.62	65,733,828.72	-21,572,219.90
其中：基金申购款	16,506,403.36	-12,306,715.35	4,199,688.01
基金赎回款	-103,812,451.98	78,040,544.07	-25,771,907.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	150,639,302.74	-110,997,150.35	39,642,152.39

#### 6.4.7.8 汇丰晋信2016周期混合C

单位：人民币元

项目 (汇丰晋信2016周期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,518,747.49	-33,209,144.08	10,309,603.41
本期期初	43,518,747.49	-33,209,144.08	10,309,603.41
本期利润	-16,771.15	30,786.01	14,014.86
本期基金份额交易产生的变动数	-39,193,568.85	29,986,918.80	-9,206,650.05
其中：基金申购款	6,132,875.13	-4,566,650.11	1,566,225.02
基金赎回款	-45,326,443.98	34,553,568.91	-10,772,875.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,308,407.49	-3,191,439.27	1,116,968.22

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	26,390.75

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,617.09
其他	140.86
合计	34,148.70

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	30,183,638.87
减：卖出股票成本总额	31,138,716.35
减：交易费用	69,324.40
买卖股票差价收入	-1,024,401.88

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,952,239.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,259,484.53
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	2,692,755.35

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	558,280,226.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	550,021,060.98
减：应计利息总额	10,496,284.85
减：交易费用	22,364.84
买卖债券差价收入	-2,259,484.53

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 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

无。

#### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	-5,530.46
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	-5,530.46

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	3,768,995.19
——股票投资	630,098.75
——债券投资	3,138,896.44
——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	3,768,995.19

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	104,990.48
基金转换费收入	21,083.21
合计	126,073.69

注：

1. 对持续持有期少于7日的A类投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期大于等于7日的A类投资者收取0.3%的赎回费，不低于赎回费总额25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

对持续持有期少于7日的C类投资者收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对持续持有期大于等于7日的C类投资者不收取赎回费。

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。

### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	28,818.18
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,211.31
账户维护费	18,600.00
合计	110,301.83

## 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

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司("汇丰晋信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
山西证券股份有限公司("山西证券")	见注释①

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

### 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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	617,759.73	551,305.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	237,295.53	210,552.72
应支付基金管理人的净管理费	380,464.20	340,752.38

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的如下年费率计提，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 × 年管理费率/当年天数。

时间段	年管理费率
自基金合同生效之日至 2011/05/31	1.50%
自 2011/06/01 至 2016/05/31	0.75%
自 2016/06/01 起	0.38%

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	162,568.40	145,080.32

注：支付基金托管行交通银行的托管费按前一日基金资产净值的如下年费率计提，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 × 年托管费率/当年天数。

时间段	年托管费率
自基金合同生效之日至 2011/05/31	0.25%

自 2011/06/01 至 2016/05/31	0.20%
自2016/06/01起	0.10%

### 6.4.10.2.3 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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信2016周期混合A	汇丰晋信2016周期混合C	合计
汇丰晋信	0.00	0.87	0.87
合计	0.00	0.87	0.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信2016周期混合A	汇丰晋信2016周期混合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2016生命周期开放式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及更新的《汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金招募说明书》，本基金自2023年9月19日起增设C类基金份额。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%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。A类基金份额不收取基金销售服务费，C类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率0.40%。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值X0.40%/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方	本期 2024年01月01日至2024年06月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

名称						
山西证券	56,079,587.24	21,256,653.93	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
山西证券	51,663,144.66	15,409,022.88	-	-	-	-

#### 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

无。

##### 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

无。

##### 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	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023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
交通银行	952,215.41	26,390.75	619,197.11	20,240.14

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

##### 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

无。

## **6.4.12 期末（2024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**

无。

### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### **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**

无。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

## **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限定在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,204,278.69	17,934,275.76
合计	10,204,278.69	17,934,275.76

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	91,547,799.89	167,300,688.69
AAA以下	35,477,358.41	77,907,984.60
未评级	101,734,640.31	38,158,411.00
合计	228,759,798.61	283,367,084.29

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

### 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上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2024年6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(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。

#### 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2024年06月30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2024年06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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	952,215.41	-	-	-	952,215.41
结算备 付金	999,038.78	-	-	-	999,038.78
存出保	20,226.21	-	-	-	20,226.21

证金					
交易性金融资产	90,796,454.72	110,464,547.92	37,703,074.66	-	238,964,077.30
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收清算款	-	-	-	4,581,184.84	4,581,184.84
应收申购款	-	-	-	53,692.22	53,692.22
资产总计	102,767,935.12	110,464,547.92	37,703,074.66	4,634,877.06	255,570,434.76
负债					
应付清算款	-	-	-	3,510,426.94	3,510,426.94
应付赎回款	-	-	-	433,156.58	433,156.58
应付管理人报酬	-	-	-	80,207.36	80,207.36
应付托管费	-	-	-	21,107.22	21,107.22
应付销售服务费	-	-	-	2,454.61	2,454.61
应交税费	-	-	-	413,682.06	413,682.06
其他负债	-	-	-	91,131.45	91,131.45
负债总计	-	-	-	4,552,166.22	4,552,166.22
利率敏感度缺口	102,767,935.12	110,464,547.92	37,703,074.66	82,710.84	251,018,268.54
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023年1 2月31日					
资产					
货币资 金	39,993,964.41	-	-	-	39,993,964.41
结算备 付金	391,101.65	-	-	-	391,101.65
存出保 证金	11,993.65	-	-	-	11,993.65
交易性 金融资 产	202,079,357.59	87,064,940.80	12,157,061.66	6,997,385.60	308,298,745.65
买入返 售金融 资产	136,037,174.00	-	-	-	136,037,174.00
应收清 算款	-	-	-	434,873.46	434,873.46
应收申 购款	-	-	-	63,718.62	63,718.62
资产总 计	378,513,591.30	87,064,940.80	12,157,061.66	7,495,977.68	485,231,571.44
负债					
应付清 算款	-	-	-	34,121,112.08	34,121,112.08
应付赎 回款	-	-	-	720,922.12	720,922.12
应付管 理人报 酬	-	-	-	106,621.45	106,621.45
应付托 管费	-	-	-	28,058.31	28,058.31
应付销 售服务 费	-	-	-	10,334.41	10,334.41
应交税 费	-	-	-	423,700.25	423,700.25
其他负	-	-	-	189,888.50	189,888.50

债					
负债总计	-	-	-	35,600,637.12	35,600,637.12
利率敏感度缺口	378,513,591.30	87,064,940.80	12,157,061.66	-28,104,659.44	449,630,934.32

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.市场利率上升25个基点	-1,519,406.74	-1,158,926.89
	2.市场利率下降25个基点	1,543,889.04	1,190,783.31

#### 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。在基金实际管理过程中，基金管理人将随着投资人目标期限的临近和根据中国证券市场的阶段性变化，逐年适时调整基金资产在股票类资产、固定收益类资产间的配置比例。同时在正常市场情况下，本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括

VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	-	-	6,997,385.60	1.56
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	-	-	6,997,385.60	1.56

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2023年12月31日：本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为1.56%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	44,997,778.62	53,911,341.14
第二层次	193,966,298.68	254,387,404.51
第三层次	-	-
合计	238,964,077.30	308,298,745.65

##### 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的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2024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(2023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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	238,964,077.30	93.50
	其中：债券	238,964,077.30	93.50
	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	10,000,000.00	3.91
	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	1,951,254.19	0.76
8	其他各项资产	4,655,103.27	1.82
9	合计	255,570,434.76	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

### 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

无。

### 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	601615	明阳智能	2,065,478.00	0.46
2	000932	华菱钢铁	1,364,000.00	0.30
3	600309	万华化学	1,181,510.00	0.26
4	002352	顺丰控股	1,169,942.00	0.26
5	600597	光明乳业	1,152,002.00	0.26
6	002458	益生股份	1,028,840.00	0.23
7	002064	华峰化学	1,026,099.00	0.23
8	002756	永兴材料	1,019,629.00	0.23
9	300498	温氏股份	939,819.00	0.21
10	600546	山煤国际	881,249.00	0.20
11	002142	宁波银行	848,200.00	0.19
12	600036	招商银行	842,100.00	0.19
13	600481	双良节能	795,000.00	0.18
14	300014	亿纬锂能	745,810.00	0.17
15	000708	中信特钢	736,000.00	0.16
16	601018	宁波港	732,000.00	0.16
17	600031	三一重工	706,000.00	0.16
18	601298	青岛港	701,000.00	0.16
19	600585	海螺水泥	693,000.00	0.15
20	300454	深信服	655,000.00	0.15

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	601615	明阳智能	2,063,637.00	0.46
2	601336	新华保险	1,354,710.00	0.30
3	000932	华菱钢铁	1,310,000.00	0.29

4	600309	万华化学	1,213,407.00	0.27
5	600597	光明乳业	1,191,322.00	0.26
6	002352	顺丰控股	1,117,212.00	0.25
7	002458	益生股份	1,063,961.00	0.24
8	002064	华峰化学	1,002,500.00	0.22
9	002756	永兴材料	956,248.00	0.21
10	600036	招商银行	950,300.00	0.21
11	300498	温氏股份	914,136.00	0.20
12	601607	上海医药	909,202.27	0.20
13	300014	亿纬锂能	840,000.00	0.19
14	600546	山煤国际	835,086.00	0.19
15	002142	宁波银行	826,603.98	0.18
16	600481	双良节能	823,500.00	0.18
17	000708	中信特钢	742,000.00	0.17
18	600031	三一重工	736,225.00	0.16
19	601298	青岛港	716,141.00	0.16
20	300454	深信服	707,088.00	0.16

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	23,511,232.00
卖出股票收入（成交）总额	30,183,638.87

注：本表"买入股票成本（成交）总额"，"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,047,085.21	1.21

2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,687,555.10	39.31
	其中：政策性金融债	98,687,555.10	39.31
4	企业债券	10,143,885.48	4.04
5	企业短期融资券	10,204,278.69	4.07
6	中期票据	67,611,427.21	26.93
7	可转债(可交换债)	49,269,845.61	19.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	238,964,077.30	95.20

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	240205	24国开05	200,000	20,787,502.73	8.28
2	230207	23国开07	200,000	20,603,852.46	8.21
3	190205	19国开05	100,000	10,778,393.44	4.29
4	102383038	23鲁钢铁MTN010	100,000	10,603,281.97	4.22
5	220220	22国开20	100,000	10,545,964.48	4.20

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  
无。

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  
无。

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  
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

## 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

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

### 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	20,226.21
2	应收清算款	4,581,184.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,692.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,655,103.27

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	5,411,929.32	2.16

2	132026	G三峡EB2	4,272,066.99	1.70
3	113055	成银转债	4,128,447.91	1.64
4	110062	烽火转债	4,079,684.66	1.63
5	110073	国投转债	4,035,174.94	1.61
6	113623	凤21转债	4,026,238.80	1.60
7	113021	中信转债	4,017,211.78	1.60
8	127027	能化转债	3,855,191.92	1.54
9	127020	中金转债	3,613,300.68	1.44
10	110079	杭银转债	3,381,482.52	1.35
11	113045	环旭转债	2,375,781.37	0.95
12	110084	贵燃转债	2,364,941.56	0.94
13	113047	旗滨转债	2,017,595.29	0.80
14	123119	康泰转2	646,593.16	0.26

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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)	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2	4,6 56	43,896.70	69,509,348.49	34.0 1%	134,873,679.72	65.99%

016周 期混 合A						
汇丰 晋信2 016周 期混 合C	825	7,122.57	0.00	0.00%	5,876,119.72	100.00%
合计	5,4 81	38,361.46	69,509,348.49	33.0 6%	140,749,799.44	66.94%

### 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2016周 期混合A	159,890.09	0.0782%
	汇丰晋信2016周 期混合C	84.92	0.0014%
	合计	159,975.01	0.0761%

### 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2016周期 混合A	10~50
	汇丰晋信2016周期 混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	汇丰晋信2016周期 混合A	0
	汇丰晋信2016周期 混合C	0

	合计	0
--	----	---

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信2016周期混合 A	汇丰晋信2016周期混合 C
基金合同生效日(2006年05月23日)基金份额总额	2,921,919,211.81	-
本报告期期初基金份额总额	323,354,830.33	59,502,257.27
本报告期基金总申购份额	22,436,825.41	8,368,993.72
减：本报告期基金总赎回份额	141,408,627.53	61,995,131.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	204,383,028.21	5,876,119.72

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

2024年5月18日，基金管理人发布公告，聘任吴刘先生担任本基金基金经理。

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。

报告期内，本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

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于2015年4月18日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），并报中国证券监督管理委员会备案。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。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年02月01日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	基金管理人被采取责令改正的行政监管措施，相关高级管理人员被采取出具警示函的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	公司内部控制管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，按要求及时完成整改，监管机构已验收通过整改结果，公司所有业务均正常开展
其他	无

### 10.6.2 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	27,087,505.27	50.45%	25,621.66	50.45%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 君安	2	-	-	-	-	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华福 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
汇丰 前海	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	26,607,365.60	49.55%	25,167.83	49.55%	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
野村 东方	2	-	-	-	-	-

招商 证券	2	-	-	-	-	-
浙商 证券	2	-	-	-	-	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	3	-	-	-	-	-
东兴 证券	3	-	-	-	-	-
广发 证券	3	-	-	-	-	-
银河 证券	3	-	-	-	-	-

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
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	233,088,352.10	58.06%	935,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

民生证券	168,390,695.62	41.94%	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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旗下部分基金2023年第四季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-01-22
2	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中信建投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	2024-03-15
3	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-03-29
4	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-04-22
5	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金更新招募说	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-05-22

	说明书（2024年第1号）		
6	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金A类基金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	2024-05-22
7	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金C类基金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	2024-05-22
8	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-05-18
9	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金更新招募说明书（2024年第2号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28
10	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28
11	汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28

## §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

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金招募说明书

- 4) 汇丰晋信2016生命周期开放式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2016生命周期开放式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

## 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

二〇二四年八月三十一日