

汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 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 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 17 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 17 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 17 |
| 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 | 17 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 17 |
| §6 中期财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表 | 17 |
| 6.2 利润表 | 19 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 21 |
| 6.4 报表附注 | 24 |
| §7 投资组合报告 | 50 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 50 |
| 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 | 50 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 51 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 53 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 59 |
| 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 | 59 |
| 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 | 59 |
| 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 | 59 |
| 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 | 59 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 59 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 59 |
| §8 基金份额持有人信息 | 60 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 60 |

| | |
|---|----|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 62 |
| §10 重大事件揭示..... | 62 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 62 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 63 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 63 |
| 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..... | 63 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 63 |
| 10.8 其他重大事件..... | 65 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 70 |
| 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..... | 70 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 70 |
| §12 备查文件目录..... | 70 |
| 12.1 备查文件目录..... | 70 |
| 12.2 存放地点..... | 70 |
| 12.3 查阅方式..... | 70 |

§ 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 | 534,889,927.07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 | 534,538,305.31份 | 351,621.76份 |

注：本基金自2022年4月1日起增加C类份额。

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</p> |

| | |
|---------------|--|
| | <p>润的变化方向，调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</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> |

| | |
|--------|---|
| 风险收益特征 | 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，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
|--------|---|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------------------------------------|----------------------|
| 名称 | 汇丰晋信基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 古韵 |
| | 联系电话 | 021-20376868 |
| | 电子邮箱 | compliance@hsbcjt.cn |
| 客户服务电话 | 021-20376888 | 021-60637111 |
| 传真 | 021-20376999 | 021-60635778 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | 杨小勇 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日) | |
|---------------|----------------------------------|-----------------|
| | 汇丰晋信价值先锋 股票A | 汇丰晋信价值先锋 股票C |
| 本期已实现收益 | -24,143,989.59 | -15,919.27 |
| 本期利润 | -18,785,894.81 | 78,706.16 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0604 | 0.2292 |
| 本期加权平均净值利润率 | -2.82% | 11.36% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.65% | 3.84% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 447,892,563.81 | 293,716.14 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.8379 | 0.8353 |
| 期末基金资产净值 | 982,430,869.12 | 645,337.90 |
| 期末基金份额净值 | 1.8379 | 1.8353 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 125.13% | 3.84% |

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

②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

④本基金自2022年04月01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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 6.43% | 1.00% | 8.11% | 0.95% | -1.68% | 0.05% |
| 过去三个月 | 3.96% | 1.45% | 4.68% | 1.33% | -0.72% | 0.12% |
| 过去六个月 | -12.65% | 1.45% | -8.95% | 1.32% | -3.70% | 0.13% |
| 过去一年 | 7.37% | 1.24% | -10.91% | 1.09% | 18.28% | 0.15% |
| 过去三年 | 90.66% | 1.26% | 18.30% | 1.13% | 72.36% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 125.13% | 1.25% | 35.42% | 1.17% | 89.71% | 0.08% |

注：

过去一个月指 2022 年 6 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

过去三个月指 2022 年 4 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

过去六个月指 2022 年 1 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

过去一年指 2021 年 7 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

过去三年指 2019 年 7 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2018 年 11 月 14 日—2022 年 6 月 30 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 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 6.37% | 1.00% | 8.11% | 0.95% | -1.74% | 0.05% |
| 过去三个月 | 3.84% | 1.45% | 4.68% | 1.33% | -0.84% | 0.12% |
| 成立至今 | 3.84% | 1.45% | 4.68% | 1.33% | -0.84% | 0.12% |

注：

过去一个月指 2022 年 6 月 1 日—2022 年 6 月 30 日

过去三个月指 2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

成立至今指 2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日

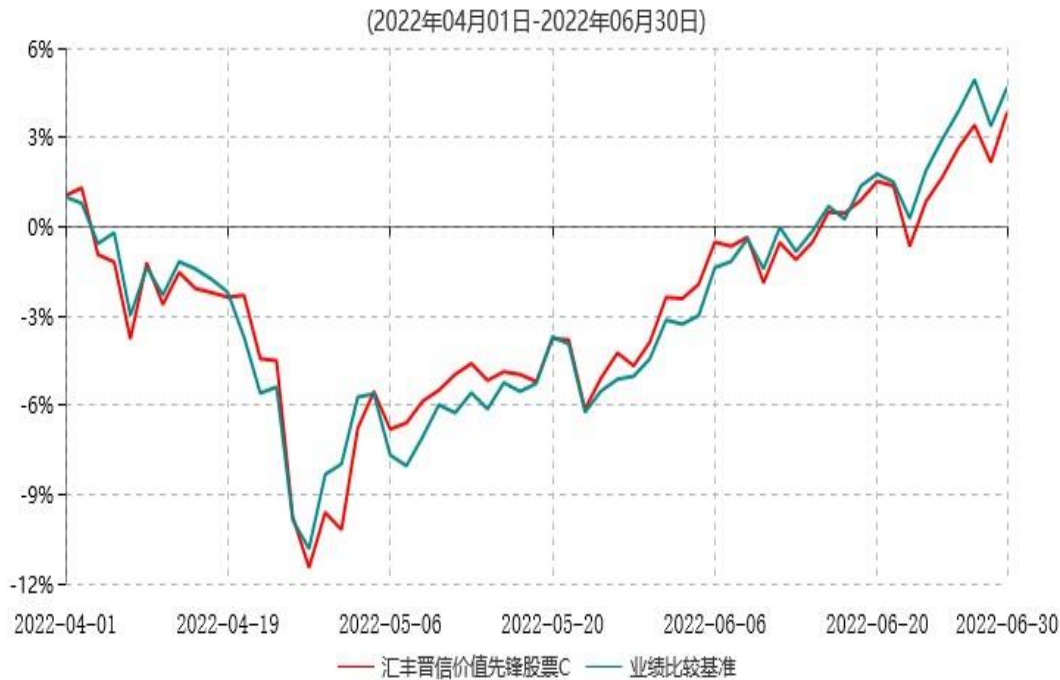
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：

- 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。
- 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。
- 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%
- 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2022年6月30日，公司共管理30只开放式基金：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金（2006年5月23日成立）、汇丰晋信

龙腾混合型证券投资基金（2006年9月27日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007年4月9日成立）、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金（2008年7月23日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自2020年11月19日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009年6月24日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009年12月11日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010年6月8日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010年12月8日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011年7月27日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011年11月2日成立）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（2012年8月1日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014年11月26日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015年2月11日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015年9月30日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016年3月11日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016年11月10日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017年6月2日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018年11月14日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019年3月20日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019年8月2日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020年7月30日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020年8月13日成立）、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金（2020年10月29日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021年3月16日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021年5月24日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021年7月12日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022年1月21日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022年3月3日成立）和汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金（2022年6月8日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴培文 | 本基金、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金基金经理 | 2019-05-18 | - | 13 | 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，201 |

| | | | | | |
|----|--------|------------|---|---|--|
| | | | | | 1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。现任本基金、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金基金经理。 |
| 闫滢 | 基金经理助理 | 2021-12-25 | - | 9 | 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. 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；闫滢女士担任本基金基金经理助理的日期；

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或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

报告期内价值先锋产品的投资策略和管理流程，保持稳定。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。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。这种稳定性会降低投资者选择产品和持有、跟踪产品的成本；并有助于投资者以本产品为基础，构建符合自身风险收益目标的资产组合。

管理人在管理中运用的主动投资策略和流程是稳定的。其核心是基于汇丰“profitability-valuation（估值-盈利）”选股模型为基础的价值投资框架，并给予公司质地、业绩趋势、产业趋势等因素，相对优先的选择。我们相信，价值是决定长期回报率的最大因素。而公司质地、业绩趋势、产业趋势，是规避价值陷阱和判断价值稳定性的重要因素。并根据产品定位，我们在主动管理中加强了价值特征的权重。

我们在一季报中谈到，证券市场总是在理性和非理性中迂回前进。类似一季度这样，显著回调的走势，在历史上屡见不鲜。如果可以把投资看的长一点，这会带来宝贵的投

资机会。所以我们在4月将仓位提升至较高区间。二季度我们认为，市场的估值回升虽然在总量上已经相当可观，但在结构上仍然是不充分的。估值出现显著提升的，仅限于新能源和军工领域。此外较多的行业和标的，仍处于低估值区间。但这些估值修复不充分的行业，同样有望受益于疫情的好转、产业升级的趋势以及稳增长的政策。所以至二季度末，我们重点投资了估值仍处于低位区间的标的，同时维持了较高的仓位。

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-12.65%，同期业绩比较基准收益率为-8.95%，净值表现落后业绩比较基准3.70%；

本报告期内，本基金C类份额净值增长率为3.84%，同期业绩比较基准收益率为4.68%，净值表现落后业绩比较基准0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然较低的市场估值，会给投资者带来长期的投资机会。但希望迅速收获，以及过于冒进，都是不足取的。2022年我们将面临全球流动性的边际收紧，以及全球宏观经济相对较弱的情形。这会导致，市场底部会表现为一个区域。尤其在二季度出现连续上涨之后，我们认为市场在局部行业，已经走向过于乐观的边缘。我们对此非常警惕。我们认为，这个时候仍要坚持，“重点在较低预期和较低估值的领域寻找机会”。这是我们年初提出的全年投资策略。目前看来，对于下半年仍然适用。我们当前的持仓，按照这个策略，主要集中在处于估值低位区间的标的。

没有寒春的播种，就不会有金秋的收获。站在2~3年的维度上，今年很可能是一个非常重要的起点。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。我们后续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。

4.7 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A类基金于2022年6月16日每10份基金份额派发现金红利4.00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类基金于2022年6月16日每10份基金份额派发现金红利4.00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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金

第 17 页，共 71 页

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 59,085,010.36 | 53,378,789.21 |
| 结算备付金 | | 4,958,612.41 | 533,149.83 |
| 存出保证金 | | 321,596.98 | 25,642.55 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 922,192,043.14 | 233,987,472.00 |
| 其中：股票投资 | | 922,192,043.14 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 971,543.06 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 98,413.35 | 1,469,507.52 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 3,516.50 |
| 资产总计 | | 987,627,219.30 | 289,398,077.61 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 968,716.10 | - |
| 应付赎回款 | | 651,028.69 | 361,979.29 |
| 应付管理人报酬 | | 1,300,360.53 | 228,796.45 |
| 应付托管费 | | 216,726.75 | 38,132.74 |
| 应付销售服务费 | | 441.18 | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,413,739.03 | 465,350.36 |
| 负债合计 | | 4,551,012.28 | 1,094,258.84 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 534,889,927.07 | 111,854,635.35 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 448,186,279.95 | 176,449,183.42 |
| 净资产合计 | | 983,076,207.02 | 288,303,818.77 |
| 负债和净资产总计 | | 987,627,219.30 | 289,398,077.61 |

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额为534,889,927.07份，其中A 类基金份额净值1.8379元，基金份额534,538,305.31份；C 类基金份额净值1.8353元，基金份额351,621.76份。

6.2 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06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日至 2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日 |
|-------------------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -12,936,466.57 | 8,648,185.81 |
| 1. 利息收入 | | 169,268.15 | 28,769.78 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 166,679.11 | 9,920.46 |
| 债券利息收入 | | - | 18,849.32 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,589.04 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -19,841,343.36 | 17,349,307.66 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -28,373,090.78 | 15,675,459.17 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 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 | 8,531,747.42 | 1,673,848.49 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 5,452,720.21 | -9,022,967.47 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” | 6.4.7.17 | 1,282,888.43 | 293,075.84 |

| | | | |
|---------------------------------|----------------|----------------|--------------|
| 号填列) | | | |
| 减：二、营业总支出 | | 5,770,722.08 | 1,319,143.31 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2. 1 | 4,860,846.54 | 609,953.12 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2. 2 | 810,141.10 | 101,658.82 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2. 3 | 989.29 | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 98,745.15 | 607,531.37 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | -18,707,188.65 | 7,329,042.50 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | -18,707,188.65 | 7,329,042.50 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -18,707,188.65 | 7,329,042.50 |

6.3 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06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
|-----|-------------------------------|------------|-------|-------|
| | 实收基金 | 其他综合收 益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| | | | | |

| | | | | |
|--|------------------------------------|-------|---------------------|----------------------|
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 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) | 423,035,291. 72 | - | 271,737,096. 53 | 694,772,388. 25 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -18,707,188. 65 | -18,707,188. 65 |
| (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) | 423,035,291. 72 | - | 499,469,671. 89 | 922,504,963. 61 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 589,555,606. 24 | - | 684,598,328. 70 | 1,274,153,93 4.94 |
| 2. 基金赎回款 | -166,520,31 4.52 | - | -185,128,65 6.81 | -351,648,97 1.33 |
| (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) | - | - | -209,025,38 6.71 | -209,025,38 6.71 |
| (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) | 534,889,927. 07 | - | 448,186,279. 95 | 983,076,207. 02 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | 益 | | |
|--|--------------------|---|--------------------|--------------------|
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 53,145,025.3 8 | - | 49,924,940.9 0 | 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) | 53,145,025.3 8 | - | 49,924,940.9 0 | 103,069,966. 28 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列) | -17,763,782. 86 | - | -11,118,191. 52 | -28,881,974. 38 |
| (一)、综合收益总 额 | - | - | 7,329,042.50 | 7,329,042.50 |
| (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) | -17,763,782. 86 | - | -18,447,234. 02 | -36,211,016. 88 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 24,897,850.7 8 | - | 26,104,112.4 8 | 51,001,963.2 6 |
| 2. 基金赎回 款 | -42,661,633. 64 | - | -44,551,346. 50 | -87,212,980. 14 |
| (三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收 益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 (基金净值) | 35,381,242.5 2 | - | 38,806,749.3 8 | 74,187,991.9 0 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

李选进

赵琳

杨洋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信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×90%+同业存款利率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2022年8月30日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

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

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为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”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

| | |
|--------------|---------------|
| 活期存款 | 59,085,010.36 |
| 等于：本金 | 59,079,035.06 |
| 加：应计利息 | 5,975.30 |
| 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 | 59,085,010.36 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | | |
|---------------|--------------------|------|----------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 904,221,319.69 | - | 922,192,043.14 | 17,970,723.45 |
| 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 | 904,221,319.69 | - | 922,192,043.14 | 17,970,723.45 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,288.69 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 1,263,190.19 |
| 其中：交易所市场 | 1,263,190.19 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 149,260.15 |
| 合计 | 1,413,739.03 |

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇丰晋信价值先锋股票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06月30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 | 588,896,358.34 | 588,896,358.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -166,212,688.38 | -166,212,688.38 |
| 本期末 | 534,538,305.31 | 534,538,305.31 |

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04月01日至2022年06月30日 | |
|---------------------|-------------------------------|-------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 659,247.90 | 659,247.90 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -307,626.14 | -307,626.14 |
| 本期末 | 351,621.76 | 351,621.76 |

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 | -24,143,989.59 | 5,358,094.78 | -18,785,894.81 |

| | | | |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 591,037,609.45 | -91,968,831.48 | 499,068,777.97 |
| 其中：基金申购款 | 814,284,006.45 | -130,374,404.79 | 683,909,601.66 |
| 基金赎回款 | -223,246,397.00 | 38,405,573.31 | -184,840,823.69 |
| 本期已分配利润 | -208,839,502.77 | - | -208,839,502.77 |
| 本期末 | 528,680,755.32 | -80,788,191.51 | 447,892,563.81 |

6.4.7.8.2 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 | -15,919.27 | 94,625.43 | 78,706.16 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 548,719.88 | -147,825.96 | 400,893.92 |
| 其中：基金申购款 | 901,457.01 | -212,729.97 | 688,727.04 |
| 基金赎回款 | -352,737.13 | 64,904.01 | -287,833.12 |
| 本期已分配利润 | -185,883.94 | - | -185,883.94 |
| 本期末 | 346,916.67 | -53,200.53 | 293,716.14 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 148,119.65 |
| 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 | 17,200.71 |
| 其他 | 1,358.75 |
| 合计 | 166,679.11 |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 827,534,347.03 |
| 减：卖出股票成本总额 | 852,680,779.47 |
| 减：交易费用 | 3,226,658.34 |
| 买卖股票差价收入 | -28,373,090.78 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,531,747.42 |
| 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 | 8,531,747.42 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 5,452,720.21 |
| ——股票投资 | 5,452,720.21 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |

| | |
|------------------------|--------------|
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 5,452,720.21 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,270,738.07 |
| 转换费收入 | 12,150.36 |
| 合计 | 1,282,888.43 |

注：1. 本基金对于持有基金份额少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有基金份额不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其75%计入基金财产；对于持有基金份额不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有基金份额不少于6个月的基金份额所收取的赎回费，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。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减。

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组成，其中赎回费部分按照上述规则归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 485.00 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 98,745.15 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 汇丰晋信基金管理有限公司(“汇丰晋信”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,860,846.54 | 609,953.12 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 760,125.59 | 307,708.69 |

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 810,141.10 | 101,658.82 |

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

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 2022年01月01日至2022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 | 0.35 | 0.35 |
| 合计 | 0.00 | 0.35 | 0.35 |

注：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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|-------------------------|------------|-------------------------|----------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 建设银行 | 59,085,010.36 | 148,119.65 | 2,752,604.99 | 7,210.80 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

汇丰晋信价值先锋股票A

单位：人民币元

| 序号 | 权益 | 除息日 | 每10份基金 | 现金形式 | 再投资形式 | 本期利润 | 备注 |
|----|----|-----|--------|------|-------|------|----|
|----|----|-----|--------|------|-------|------|----|

| | 登记日 | | 份额分红数 | 发放总额 | 发放总额 | 分配合计 | |
|----|------------|------------|-------|----------------|---------------|----------------|---|
| 1 | 2022-06-16 | 2022-06-16 | 4.000 | 168,834,611.49 | 40,004,891.28 | 208,839,502.77 | - |
| 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

| 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 | 2022-06-16 | 2022-06-16 | 4.000 | 184,938.20 | 945.74 | 185,883.94 | - |
| 合计 | | | 4.000 | 184,938.20 | 945.74 | 185,883.94 | - |

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于2022年06月30日，本基金无债券投资(2021年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2022年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2022年6月30日，本基金未持有流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2022年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管

产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年0 6月30 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 59,085,010.36 | - | - | - | 59,085,010.36 |
| 结算备付金 | 4,958,612.41 | - | - | - | 4,958,612.41 |
| 存出保证金 | 321,596.98 | - | - | - | 321,596.98 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 922,192,043.14 | 922,192,043.14 |
| 应收清算款 | - | - | - | 971,543.06 | 971,543.06 |
| 应收申购款 | - | - | - | 98,413.35 | 98,413.35 |
| 资产总计 | 64,365,219.75 | - | - | 923,261,999.55 | 987,627,219.30 |

| | | | | | |
|---------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 计 | | | | | |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 968,716.10 | 968,716.10 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 651,028.69 | 651,028.69 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,300,360.53 | 1,300,360.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | 216,726.75 | 216,726.75 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 441.18 | 441.18 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,413,739.03 | 1,413,739.03 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,551,012.28 | 4,551,012.28 |
| 利率敏感度缺口 | 64,365,219.75 | - | - | 918,710,987.27 | 983,076,207.02 |
| 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 |
| 应收利息 | - | - | - | 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 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 325,136.11 | 325,136.11 |
| 其他负债 | - | - | - | 140,214.25 | 140,214.25 |
| 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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例范围为基金资产的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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 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 | 922,192,043.14 | 93.81 | 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 | 922,192,043.14 | 93.81 | 233,987,472.00 | 81.16 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|-------------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) | |
| | | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5% | 44,722,877.04 | 9,536,978.61 |

| | | |
|-----------------------------|----------------|---------------|
| 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降5% | -44,722,877.04 | -9,536,978.61 |
|-----------------------------|----------------|---------------|

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 922,192,043.14 | 233,981,967.51 |
| 第二层次 | - | 5,504.49 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 922,192,043.14 | 233,987,472.00 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 922,192,043.14 | 93.37 |
| | 其中：股票 | 922,192,043.14 | 93.37 |
| 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 | 64,043,622.77 | 6.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,391,553.39 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 987,627,219.30 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 471,918,561.18 | 48.00 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| 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 | 28,509,318.00 | 2.90 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 30,552,683.33 | 3.11 |
| H | 住宿和餐饮业 | 15,385,920.00 | 1.57 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 182,727,543.63 | 18.59 |
| J | 金融业 | 119,671,950.00 | 12.17 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 25,702,660.00 | 2.61 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,858,120.00 | 0.70 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,159,587.00 | 2.25 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 13,142,860.00 | 1.34 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,562,840.00 | 0.57 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 922,192,043.14 | 93.81 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1 | 600030 | 中信证券 | 1,883,600 | 40,798,776.00 | 4.15 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 910,200 | 35,452,290.00 | 3.61 |
| 3 | 603987 | 康德莱 | 1,585,400 | 31,597,022.00 | 3.21 |
| 4 | 300138 | 晨光生物 | 2,015,700 | 31,384,449.00 | 3.19 |
| 5 | 300308 | 中际旭创 | 920,200 | 28,572,210.00 | 2.91 |
| 6 | 600941 | 中国移动 | 461,900 | 27,944,950.00 | 2.84 |
| 7 | 603019 | 中科曙光 | 944,300 | 27,403,586.00 | 2.79 |
| 8 | 600138 | 中青旅 | 1,994,000 | 25,702,660.00 | 2.61 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 9 | 002705 | 新宝股份 | 1,159,200 | 25,490,808.00 | 2.59 |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 1,165,900 | 24,752,057.00 | 2.52 |
| 11 | 300170 | 汉得信息 | 2,507,810 | 22,595,368.10 | 2.30 |
| 12 | 601995 | 中金公司 | 503,800 | 22,414,062.00 | 2.28 |
| 13 | 300088 | 长信科技 | 3,013,200 | 22,357,944.00 | 2.27 |
| 14 | 600380 | 健康元 | 1,796,000 | 22,180,600.00 | 2.26 |
| 15 | 601688 | 华泰证券 | 1,539,000 | 21,853,800.00 | 2.22 |
| 16 | 601628 | 中国人寿 | 692,900 | 21,535,332.00 | 2.19 |
| 17 | 601728 | 中国电信 | 5,441,000 | 20,294,930.00 | 2.06 |
| 18 | 603365 | 水星家纺 | 1,334,000 | 19,983,320.00 | 2.03 |
| 19 | 601598 | 中国外运 | 5,043,500 | 19,568,780.00 | 1.99 |
| 20 | 603899 | 晨光股份 | 346,000 | 19,403,680.00 | 1.97 |
| 21 | 600859 | 王府井 | 726,300 | 18,869,274.00 | 1.92 |
| 22 | 002959 | 小熊电器 | 292,155 | 18,210,021.15 | 1.85 |
| 23 | 300454 | 深信服 | 175,400 | 18,203,012.00 | 1.85 |
| 24 | 002273 | 水晶光电 | 1,404,700 | 17,010,917.00 | 1.73 |
| 25 | 600050 | 中国联通 | 4,568,800 | 15,808,048.00 | 1.61 |
| 26 | 600258 | 首旅酒店 | 620,400 | 15,385,920.00 | 1.57 |
| 27 | 603866 | 桃李面包 | 927,100 | 15,343,505.00 | 1.56 |
| 28 | 688169 | 石头科技 | 24,287 | 14,977,792.90 | 1.52 |
| 29 | 600054 | 黄山旅游 | 1,163,000 | 14,281,640.00 | 1.45 |
| 30 | 603383 | 顶点软件 | 567,737 | 14,017,426.53 | 1.43 |
| 31 | 603927 | 中科软 | 600,600 | 14,005,992.00 | 1.42 |
| 32 | 688696 | 极米科技 | 44,601 | 13,731,309.87 | 1.40 |
| 33 | 000333 | 美的集团 | 226,000 | 13,648,140.00 | 1.39 |
| 34 | 300244 | 迪安诊断 | 422,600 | 13,142,860.00 | 1.34 |
| 35 | 601319 | 中国人保 | 2,583,000 | 13,069,980.00 | 1.33 |
| 36 | 603738 | 泰晶科技 | 389,200 | 12,224,772.00 | 1.24 |
| 37 | 603989 | 艾华集团 | 410,585 | 11,578,497.00 | 1.18 |
| 38 | 603043 | 广州酒家 | 448,700 | 11,316,214.00 | 1.15 |
| 39 | 600377 | 宁沪高速 | 1,281,669 | 10,983,903.33 | 1.12 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|---------------|------|
| 40 | 002223 | 鱼跃医疗 | 408,200 | 10,474,412.00 | 1.07 |
| 41 | 300379 | 东方通 | 564,100 | 9,933,801.00 | 1.01 |
| 42 | 000028 | 国药一致 | 323,600 | 9,640,044.00 | 0.98 |
| 43 | 000858 | 五粮液 | 46,500 | 9,389,745.00 | 0.96 |
| 44 | 300146 | 汤臣倍健 | 429,900 | 9,307,335.00 | 0.95 |
| 45 | 300659 | 中孚信息 | 427,500 | 9,092,925.00 | 0.92 |
| 46 | 603711 | 香飘飘 | 688,300 | 8,349,079.00 | 0.85 |
| 47 | 600201 | 生物股份 | 896,100 | 8,208,276.00 | 0.83 |
| 48 | 600183 | 生益科技 | 476,200 | 8,090,638.00 | 0.82 |
| 49 | 000888 | 峨眉山 A | 859,100 | 7,877,947.00 | 0.80 |
| 50 | 002949 | 华阳国际 | 511,800 | 6,858,120.00 | 0.70 |
| 51 | 000650 | 仁和药业 | 979,200 | 6,247,296.00 | 0.64 |
| 52 | 002649 | 博彦科技 | 595,400 | 6,079,034.00 | 0.62 |
| 53 | 300144 | 宋城演艺 | 362,400 | 5,562,840.00 | 0.57 |
| 54 | 002216 | 三全食品 | 269,600 | 5,281,464.00 | 0.54 |
| 55 | 002281 | 光迅科技 | 244,400 | 4,296,552.00 | 0.44 |
| 56 | 000977 | 浪潮信息 | 134,300 | 3,556,264.00 | 0.36 |
| 57 | 688015 | 交控科技 | 107,142 | 2,582,122.20 | 0.26 |
| 58 | 002690 | 美亚光电 | 58,100 | 1,259,608.00 | 0.13 |
| 59 | 002138 | 顺络电子 | 36,300 | 989,175.00 | 0.10 |
| 60 | 002013 | 中航机电 | 52,900 | 653,315.00 | 0.07 |
| 61 | 601966 | 玲珑轮胎 | 24,205 | 614,080.85 | 0.06 |
| 62 | 688080 | 映翰通 | 11,964 | 479,636.76 | 0.05 |
| 63 | 600299 | 安迪苏 | 24,600 | 235,668.00 | 0.02 |
| 64 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |

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 | 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 | 38,383,849.63 | 13.31 |
| 5 | 300138 | 晨光生物 | 30,527,769.30 | 10.59 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 29,842,371.15 | 10.35 |
| 7 | 600941 | 中国移动 | 29,502,438.51 | 10.23 |
| 8 | 002555 | 三七互娱 | 29,103,261.90 | 10.09 |
| 9 | 603987 | 康德莱 | 28,911,287.60 | 10.03 |
| 10 | 600859 | 王府井 | 27,952,405.05 | 9.70 |
| 11 | 300088 | 长信科技 | 26,713,011.00 | 9.27 |
| 12 | 300244 | 迪安诊断 | 26,251,724.48 | 9.11 |
| 13 | 601319 | 中国人保 | 25,538,240.00 | 8.86 |
| 14 | 601628 | 中国人寿 | 25,263,154.85 | 8.76 |
| 15 | 601995 | 中金公司 | 24,612,333.60 | 8.54 |
| 16 | 603019 | 中科曙光 | 24,462,288.11 | 8.48 |
| 17 | 600258 | 首旅酒店 | 24,421,872.82 | 8.47 |
| 18 | 002705 | 新宝股份 | 23,882,177.00 | 8.28 |
| 19 | 300170 | 汉得信息 | 23,134,776.02 | 8.02 |
| 20 | 603365 | 水星家纺 | 22,811,662.00 | 7.91 |
| 21 | 601728 | 中国电信 | 21,984,757.00 | 7.63 |
| 22 | 601598 | 中国外运 | 21,606,975.00 | 7.49 |
| 23 | 600138 | 中青旅 | 20,793,611.00 | 7.21 |
| 24 | 002273 | 水晶光电 | 20,366,149.28 | 7.06 |
| 25 | 600377 | 宁沪高速 | 20,352,449.04 | 7.06 |
| 26 | 688169 | 石头科技 | 19,251,260.42 | 6.68 |
| 27 | 002949 | 华阳国际 | 19,130,004.17 | 6.64 |
| 28 | 603899 | 晨光股份 | 19,113,519.95 | 6.63 |
| 29 | 603136 | 天目湖 | 18,611,158.60 | 6.46 |
| 30 | 002223 | 鱼跃医疗 | 18,447,947.00 | 6.40 |
| 31 | 601966 | 玲珑轮胎 | 18,301,480.00 | 6.35 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 32 | 600380 | 健康元 | 18,275,689.52 | 6.34 |
| 33 | 603383 | 顶点软件 | 17,857,337.77 | 6.19 |
| 34 | 600054 | 黄山旅游 | 16,385,241.00 | 5.68 |
| 35 | 600050 | 中国联通 | 15,849,907.83 | 5.50 |
| 36 | 300454 | 深信服 | 15,686,037.00 | 5.44 |
| 37 | 603866 | 桃李面包 | 15,639,676.94 | 5.42 |
| 38 | 688696 | 极米科技 | 14,698,275.47 | 5.10 |
| 39 | 600201 | 生物股份 | 14,273,416.30 | 4.95 |
| 40 | 000333 | 美的集团 | 14,184,959.50 | 4.92 |
| 41 | 603927 | 中科软 | 13,909,152.50 | 4.82 |
| 42 | 603738 | 泰晶科技 | 13,628,771.88 | 4.73 |
| 43 | 603989 | 艾华集团 | 13,602,680.30 | 4.72 |
| 44 | 601336 | 新华保险 | 13,447,904.00 | 4.66 |
| 45 | 000028 | 国药一致 | 13,361,188.00 | 4.63 |
| 46 | 601877 | 正泰电器 | 13,357,466.88 | 4.63 |
| 47 | 601318 | 中国平安 | 13,140,596.71 | 4.56 |
| 48 | 300529 | 健帆生物 | 11,784,913.64 | 4.09 |
| 49 | 601298 | 青岛港 | 11,761,457.00 | 4.08 |
| 50 | 300638 | 广和通 | 11,602,510.53 | 4.02 |
| 51 | 002013 | 中航机电 | 11,500,256.02 | 3.99 |
| 52 | 603043 | 广州酒家 | 10,949,322.84 | 3.80 |
| 53 | 002959 | 小熊电器 | 10,792,344.56 | 3.74 |
| 54 | 603711 | 香飘飘 | 10,777,870.00 | 3.74 |
| 55 | 600958 | 东方证券 | 10,490,982.00 | 3.64 |
| 56 | 603538 | 美诺华 | 10,459,732.00 | 3.63 |
| 57 | 300659 | 中孚信息 | 10,423,335.00 | 3.62 |
| 58 | 600487 | 亨通光电 | 10,330,220.18 | 3.58 |
| 59 | 300379 | 东方通 | 9,995,068.42 | 3.47 |
| 60 | 603486 | 科沃斯 | 9,943,993.08 | 3.45 |
| 61 | 600977 | 中国电影 | 9,573,466.92 | 3.32 |
| 62 | 688058 | 宝兰德 | 9,344,274.50 | 3.24 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 63 | 300146 | 汤臣倍健 | 9,173,964.00 | 3.18 |
| 64 | 000858 | 五粮液 | 9,094,963.00 | 3.15 |
| 65 | 300133 | 华策影视 | 9,077,611.00 | 3.15 |
| 66 | 600372 | 中航电子 | 8,958,626.00 | 3.11 |
| 67 | 600416 | 湘电股份 | 8,735,333.00 | 3.03 |
| 68 | 300144 | 宋城演艺 | 8,647,815.93 | 3.00 |
| 69 | 000888 | 峨眉山 A | 8,283,814.00 | 2.87 |
| 70 | 601018 | 宁波港 | 8,056,863.99 | 2.79 |
| 71 | 000650 | 仁和药业 | 8,025,278.72 | 2.78 |
| 72 | 601398 | 工商银行 | 7,935,555.00 | 2.75 |
| 73 | 601288 | 农业银行 | 7,898,890.00 | 2.74 |
| 74 | 688015 | 交控科技 | 7,699,314.08 | 2.67 |
| 75 | 600285 | 羚锐制药 | 7,276,031.00 | 2.52 |
| 76 | 002007 | 华兰生物 | 6,930,353.00 | 2.40 |
| 77 | 603517 | 绝味食品 | 6,826,137.00 | 2.37 |
| 78 | 600183 | 生益科技 | 6,753,778.00 | 2.34 |
| 79 | 002649 | 博彦科技 | 6,593,394.00 | 2.29 |
| 80 | 600131 | 国网信通 | 6,550,410.00 | 2.27 |
| 81 | 002281 | 光迅科技 | 6,536,927.00 | 2.27 |
| 82 | 002465 | 海格通信 | 6,383,257.00 | 2.21 |
| 83 | 603868 | 飞科电器 | 6,034,210.87 | 2.09 |
| 84 | 002236 | 大华股份 | 6,005,434.32 | 2.08 |
| 85 | 603108 | 润达医疗 | 5,911,817.20 | 2.05 |
| 86 | 603657 | 春光科技 | 5,907,381.00 | 2.05 |
| 87 | 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。

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 | 601601 | 中国太保 | 37,300,644.32 | 12.94 |
| 2 | 603136 | 天目湖 | 23,218,246.05 | 8.05 |
| 3 | 601877 | 正泰电器 | 18,072,038.14 | 6.27 |
| 4 | 600372 | 中航电子 | 17,993,985.00 | 6.24 |
| 5 | 002013 | 中航机电 | 17,059,431.00 | 5.92 |
| 6 | 600377 | 宁沪高速 | 16,572,713.00 | 5.75 |
| 7 | 601298 | 青岛港 | 16,466,212.65 | 5.71 |
| 8 | 601018 | 宁波港 | 16,066,916.00 | 5.57 |
| 9 | 002949 | 华阳国际 | 14,468,508.83 | 5.02 |
| 10 | 600487 | 亨通光电 | 14,248,677.00 | 4.94 |
| 11 | 600873 | 梅花生物 | 13,392,478.93 | 4.65 |
| 12 | 601966 | 玲珑轮胎 | 13,037,767.25 | 4.52 |
| 13 | 601319 | 中国人保 | 12,999,974.00 | 4.51 |
| 14 | 300638 | 广和通 | 12,928,473.81 | 4.48 |
| 15 | 601688 | 华泰证券 | 12,889,482.00 | 4.47 |
| 16 | 600131 | 国网信通 | 12,882,829.72 | 4.47 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 12,694,423.65 | 4.40 |
| 18 | 300244 | 迪安诊断 | 12,615,081.00 | 4.38 |
| 19 | 601336 | 新华保险 | 11,487,650.00 | 3.98 |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 11,366,992.00 | 3.94 |
| 21 | 600285 | 羚锐制药 | 11,261,568.00 | 3.91 |
| 22 | 002573 | 清新环境 | 11,100,785.00 | 3.85 |
| 23 | 300529 | 健帆生物 | 10,687,213.00 | 3.71 |
| 24 | 600416 | 湘电股份 | 10,667,850.00 | 3.70 |
| 25 | 603486 | 科沃斯 | 10,629,911.00 | 3.69 |
| 26 | 002465 | 海格通信 | 10,430,196.21 | 3.62 |
| 27 | 688058 | 宝兰德 | 10,364,291.64 | 3.59 |
| 28 | 002007 | 华兰生物 | 9,751,614.81 | 3.38 |
| 29 | 600958 | 东方证券 | 9,636,506.00 | 3.34 |
| 30 | 603538 | 美诺华 | 9,626,903.60 | 3.34 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 600859 | 王府井 | 9,475,014.18 | 3.29 |
| 32 | 600887 | 伊利股份 | 9,455,515.00 | 3.28 |
| 33 | 000538 | 云南白药 | 9,339,250.40 | 3.24 |
| 34 | 600312 | 平高电气 | 9,303,162.96 | 3.23 |
| 35 | 603868 | 飞科电器 | 9,294,212.00 | 3.22 |
| 36 | 002273 | 水晶光电 | 9,251,906.97 | 3.21 |
| 37 | 600977 | 中国电影 | 9,236,175.77 | 3.20 |
| 38 | 600258 | 首旅酒店 | 9,128,648.00 | 3.17 |
| 39 | 600803 | 新奥股份 | 9,045,145.00 | 3.14 |
| 40 | 603108 | 润达医疗 | 8,857,618.02 | 3.07 |
| 41 | 002223 | 鱼跃医疗 | 8,602,260.00 | 2.98 |
| 42 | 600201 | 生物股份 | 8,161,348.00 | 2.83 |
| 43 | 300114 | 中航电测 | 7,928,216.00 | 2.75 |
| 44 | 601398 | 工商银行 | 7,838,417.00 | 2.72 |
| 45 | 300133 | 华策影视 | 7,836,761.62 | 2.72 |
| 46 | 601288 | 农业银行 | 7,802,676.00 | 2.71 |
| 47 | 600054 | 黄山旅游 | 7,767,581.27 | 2.69 |
| 48 | 300215 | 电科院 | 7,594,833.00 | 2.63 |
| 49 | 603517 | 绝味食品 | 7,505,848.06 | 2.60 |
| 50 | 603987 | 康德莱 | 7,088,282.00 | 2.46 |
| 51 | 603678 | 火炬电子 | 6,490,760.00 | 2.25 |
| 52 | 601995 | 中金公司 | 6,442,313.00 | 2.23 |
| 53 | 601628 | 中国人寿 | 6,404,052.00 | 2.22 |
| 54 | 600050 | 中国联通 | 6,341,400.00 | 2.20 |
| 55 | 603986 | 兆易创新 | 6,338,514.00 | 2.20 |
| 56 | 002705 | 新宝股份 | 6,231,449.61 | 2.16 |
| 57 | 600529 | 山东药玻 | 6,204,397.73 | 2.15 |
| 58 | 300088 | 长信科技 | 6,186,673.00 | 2.15 |
| 59 | 300286 | 安科瑞 | 6,031,723.44 | 2.09 |

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 | 1,535,432,630.40 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 827,534,347.03 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 321,596.98 |
| 2 | 应收清算款 | 971,543.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 98,413.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,391,553.39 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 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 | 3,445 | 155,163.51 | 494,632,168.17 | 92.53% | 39,906,137.14 | 7.47% |
| 汇丰晋信价值先锋股票C | 86 | 4,088.63 | 77,136.01 | 21.94% | 274,485.75 | 78.06% |
| 合计 | 3,531 | 151,483.98 | 494,709,304.18 | 92.49% | 40,180,622.89 | 7.51% |

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 | 汇丰晋信价值先锋股票A | 288,772.02 | 0.0540% |
| | 汇丰晋信价值先锋股票C | 138.02 | 0.0393% |
| | 合计 | 288,910.04 | 0.0540% |

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、基金投资和研发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 | 0 |

| | | |
|-----------------|-------------|-------|
| | 股票C | |
| | 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 |

§ 9 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 | 588,896,358.34 | 659,247.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 166,212,688.38 | 307,626.14 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 534,538,305.31 | 351,621.76 |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | 32,348,711.21 | 1.37% | 30,127.56 | 1.37% | - |
| 国金证券 | 1 | 121,615,965.90 | 5.15% | 113,258.81 | 5.15% | - |
| 国泰君安 | 1 | 129,745,497.11 | 5.49% | 120,833.19 | 5.49% | - |
| 海通证券 | 1 | 114,812,257.42 | 4.86% | 106,926.42 | 4.86% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 山西 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万 宏源 | 1 | 655,582,160.21 | 27.75% | 610,546.78 | 27.75% | - |
| 西南 证券 | 1 | 68,951,720.54 | 2.92% | 64,213.28 | 2.92% | - |
| 中信 建投 | 1 | 68,412,353.88 | 2.90% | 63,712.88 | 2.90% | - |
| 安信 证券 | 2 | 98,465,181.03 | 4.17% | 91,699.62 | 4.17% | - |
| 东吴 证券 | 2 | 525,205,226.46 | 22.23% | 489,129.63 | 22.23% | - |
| 国信 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风 证券 | 2 | 348,804,756.68 | 14.76% | 324,842.34 | 14.76% | - |
| 中金 公司 | 2 | 198,509,420.66 | 8.40% | 184,870.84 | 8.40% | - |
| 中信 证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：

1、报告期内无新增加的交易单元

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

a. 实力雄厚，信誉良好；

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

c. 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

d. 公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；

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

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

a. 研究报告的数量和质量；

b. 提供研究服务的主动性；

c. 资讯提供的及时性及便利性；

d. 其他可评价的考核标准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 20,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------------|------------|
| 1 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关准则的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2022-01-01 |

| | | | |
|----|---|-----------------|------------|
| 2 | 汇丰晋信基金管理有限公司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关于旗下基金参加恒泰证券费率优惠的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2022-01-04 |
| 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 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2022-03-21 |

| | | | |
|----|---|-----------------|------------|
| | 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 | 网网站 | |
| 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 | 本基金指定报刊、指定互联 | 2022-04-01 |

| | | | |
|----|---|-----------------|------------|
| | 券投资基金(C类份额)基金产品资料概要 | 网网站 | |
| 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 | 2022-04-13 |
| 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 | 本基金指定报刊、指定互联 | 2022-04-22 |

| | | | |
|----|---|-----------------|------------|
| | 旗下基金2022年第一季度报告 | 网网站 | |
| 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 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2022-05-25 |
| 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 |

§ 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

| 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 - 20220630 | 16,336,681.77 | 207,215,440.26 | 64,336,946.17 | 159,215,175.86 | 29.77% |
| 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。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日