

汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金

2022年第2季度报告

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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至2022年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信2016周期混合	
基金主代码	540001	
交易代码	540001	541001
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	
报告期末基金份额总额	199,906,196.29份	
投资目标	通过基于内在价值判断的股票投资方法、基于宏观经济/现金流/信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程，本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求高于业绩比较基准的收益。	
投资策略	<p>1. 动态调整的资产配置策略</p> <p>本基金投资的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，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，再通过严格的基本面分析（CFROI为核心的财</p>	

	<p>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="715 891 1401 1568"> <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>”。</p> <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“X *富时中国A全指 + (1-X) *中债新综合指数(全价)”,变更为“X * MSCI 中国A股在岸指数+(1-X)*中债新综合指数(全价)”。</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 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>
风险收益特征	<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>
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日)
1. 本期已实现收益	1,038,064.44
2. 本期利润	2,045,662.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0113
4. 期末基金资产净值	230,189,166.70
5. 期末基金份额净值	1.1515

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。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。

2、本基金基金合同生效之日（含基金合同生效之日）至2011/05/31（含2011/05/31）年管理费率为1.5% ，年托管费率为0.25% 。2011/06/01（含2011/06/01）至2016/05/31（含2016/05/31）年管理费率为0.75% ，年托管费率为0.20% 。2016/06/01起（含2016/06/01）年管理费率为0.38% ，年托管费率为0.10% 。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.93%	0.08%	0.09%	0.00%	0.84%	0.08%
过去六个月	0.36%	0.11%	0.18%	0.00%	0.18%	0.11%
过去一年	5.13%	0.12%	0.35%	0.00%	4.78%	0.12%
过去三年	14.37%	0.11%	1.07%	0.00%	13.30%	0.11%
过去五年	24.28%	0.13%	1.78%	0.00%	22.50%	0.13%
自基金合同生效起至今	241.70%	0.55%	125.06%	0.49%	116.64%	0.06%

注：

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

过去五年指2017年7月1日-2022年6月30日

自基金合同生效起至今指2006年5月23日-2022年6月30日

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



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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
蔡若林	本基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、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基金经理	2016-01-30	-	11	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。现任本基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、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基金经理。

注：

1. 任职日期为本基金管理人公告蔡若林先生担任本基金基金经理的日期；
2. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输

送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度，全球金融市场依然处在相对高波动、高不确定性的宏观环境中。俄乌冲突仍未结束，一季度首轮冲击之后，其对大宗商品价格乃至全球地缘政治格局的影响仍在持续发酵。海外主要经济体取消疫情管制之后经济复苏力度不及预期，叠加不断走高的通胀增速，海外央行货币政策收紧，加剧了经济衰退的担忧。国内方面，二季度疫情一度在全国范围内出现反复，我国继续坚持“动态清零”政策，最终随着6月上海基本实现全面复工复产，象征着本轮疫情被较好地控制。

受疫情反复影响，二季度国内经济下行压力短期有所加大，4月官方制造业PMI一度降至47.4，但随着疫情好转复工复产迅速推进，经济逐渐企稳。6月官方制造业PMI反弹至50.2，重新回到荣枯线之上，分项指标中，生产指数和新订单指数均回到荣枯线上方，但新出口订单和从业指数仍在收缩区间，显示疫情对经济的中长期影响仍不容忽视。

通胀方面，二季度CPI同比增速维持平稳，5月CPI同比增长2.1%。其中食品价格同比增长2.3%，复工复产后物流恢复使得主要食品价格重新企稳；非食品价格同比增长2.1%，内需相对疲弱的背景下大宗商品价格对下游的传导作用相对有限，通胀风险整体依然可控。

货币政策上，央行在二季度继续通过相对积极的操作来应对外部环境的不确定性以及对冲国内经济下行压力。4月中旬央行宣布下调金融机构存款准备金率25个基点，并且在之后还宣布已上缴利润6000亿元用于留抵退税和向地方政府转移支付，相当于投放

基础货币6000亿元，效果基本相当于全面降准25个基点。5月15日，央行、银保监会发布《关于调整差别化住房信贷政策有关问题的通知》，商住房首套贷款利率下限调整为不低于相应期限LPR减20个基点（原为不低于LPR）。5月20日5年期以上LPR报价下行15个基点至4.45%。央行主要通过数量型工具向市场投放流动性，对价格型工具的使用依然相对谨慎，因此二季度国债收益率继续震荡，信用利差进一步压缩。具体看，二季度中债新综合全价指数上涨0.29%，中债信用债指数上涨0.55%，中债金融债指数上涨0.11%，中债国债指数下跌0.10%。

权益方面，俄乌冲突、海外央行货币政策收紧和疫情的影响在二季度初被进一步消化后，A股在5月份开始反弹。具体看，二季度沪深300指数上涨6.21%，上证50指数上涨5.5%，中小板指上涨8.70%，创业板指上涨5.68%。

基金操作上，二季度小幅增加了权益仓位，并小幅下调债券组合久期，信用债配置上依然以短久期高评级品种为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为0.93%，同期业绩比较基准收益率为0.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,295,650.00	1.85
	其中：股票	4,295,650.00	1.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	210,968,044.77	91.10
	其中：债券	210,968,044.77	91.10
	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	13,000,000.00	5.61
	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	2,284,528.99	0.99
8	其他资产	1,031,166.16	0.45
9	合计	231,579,389.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,058,150.00	1.33
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,237,500.00	0.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,295,650.00	1.87

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	000651	格力电器	25,000	843,000.00	0.37
2	603520	司太立	20,000	562,400.00	0.24
3	600104	上汽集团	30,000	534,300.00	0.23
4	601601	中国太保	20,000	470,600.00	0.20
5	600837	海通证券	40,000	392,400.00	0.17
6	000001	平安银行	25,000	374,500.00	0.16
7	600496	精工钢构	70,000	323,400.00	0.14
8	000333	美的集团	5,000	301,950.00	0.13
9	605007	五洲特纸	15,000	291,600.00	0.13
10	002353	杰瑞股份	5,000	201,500.00	0.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	12,466,622.16	5.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,637,015.06	13.74
	其中：政策性金融债	26,510,660.27	11.52
4	企业债券	42,148,016.84	18.31
5	企业短期融资券	20,182,714.52	8.77
6	中期票据	76,673,293.65	33.31
7	可转债（可交换债）	27,860,382.54	12.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	210,968,044.77	91.65

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	160409	16农发09	100,000	10,728,273.97	4.66
2	210205	21国开05	100,000	10,523,334.25	4.57
3	101801448	18海尔金控MTN001	100,000	10,432,139.73	4.53

4	102101351	21宝湾物流MTN002	50,000	5,370,302.74	2.33
5	127830	18珠江债	50,000	5,351,756.16	2.32

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券股份有限公司（600837）外，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。

本基金持有的“海通证券”的发行主体海通证券股份有限公司（以下简称“公司”），在2015年至2018年底期间作为独立财务顾问对奥瑞德履行持续督导职责，海通证券在2017年度对奥瑞德持续督导过程中未勤勉尽责，出具的《2017年度持续督导意见》、《2017

年度现场检查报告》存在虚假记载，上述行为违反2005年《证券法》第一百七十三条规定，构成2005年《证券法》第二百二十三条所述情形。重庆证监局于2021年10月15日依据2005年《证券法》第二百二十三条的规定，责令海通证券改正，没收财务顾问业务收入100万元，并处以300万元罚款（中国证券监督管理委员会重庆监管局行政处罚决定书[2021]5号）。

根据公司公告，公司将持续遵循稳健的经营理念，进一步强化投资银行业务内控机制，提高规范运作意识，全面提升投行合规风险管理水平，切实履行勤勉尽责义务，目前公司的经营情况正常。

本基金管理人会紧密跟踪并及时采取相应投资决策，截至目前，本基金对海通证券的投资决策流程符合本公司规定。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,737.77
2	应收证券清算款	943,449.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	80,979.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,031,166.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	113563	柳药转债	2,102,040.96	0.91
2	110043	无锡转债	1,807,607.76	0.79
3	132009	17中油EB	1,796,452.88	0.78
4	113623	凤21转债	1,709,358.62	0.74
5	113605	大参转债	1,707,323.52	0.74
6	128144	利民转债	1,699,112.51	0.74
7	113047	旗滨转债	1,678,424.48	0.73

8	128136	立讯转债	1,316,700.33	0.57
9	113011	光大转债	1,276,015.89	0.55
10	113024	核建转债	1,143,766.87	0.50
11	113632	鹤21转债	1,091,970.16	0.47
12	113593	沪工转债	964,665.96	0.42
13	110059	浦发转债	856,470.04	0.37
14	113584	家悦转债	848,456.45	0.37
15	128097	奥佳转债	832,637.15	0.36
16	128132	交建转债	711,900.33	0.31
17	127015	希望转债	703,799.18	0.31
18	127005	长证转债	694,409.51	0.30
19	127012	招路转债	685,356.58	0.30
20	123119	康泰转2	648,400.43	0.28
21	110075	南航转债	559,348.27	0.24
22	113013	国君转债	503,231.74	0.22
23	123108	乐普转2	455,199.67	0.20
24	113044	大秦转债	436,232.33	0.19
25	110062	烽火转债	400,540.27	0.17
26	123131	奥飞转债	384,600.41	0.17
27	127020	中金转债	352,231.03	0.15

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	154,933,072.35
报告期期间基金总申购份额	54,245,592.97
减：报告期期间基金总赎回份额	9,272,469.03
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以	-

“-” 填列)	
报告期期末基金份额总额	199,906,196.29

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20220401 - 20220630	40,003,309.49	16,225,566.39	0.00	56,228,875.88	28.13%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信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

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

2022年07月21日