

汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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:2024年10月25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2024年10月24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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信慧嘉债券
基金主代码	016651
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年01月17日
报告期末基金份额总额	116,355,703.53份
投资目标	在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在债券、股票及现金等类别资产间的分配比例。（二）债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。（三）国债期货投资策略 基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中

	<p>将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。（四）信用衍生品投资策略 本基金将根据风险管理的原则，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，在信用衍生品投资中根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品的投资，以管理投资组合信用风险敞口为主要目的。（五）股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。（六）港股通标的股票投资策略 港股通标的股票投资策略方面，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将优先把基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。</p>	
业绩比较基准	中债新综合全价（总值）指数收益率*85% + 沪深300指数收益率*15%	
风险收益特征	<p>本基金属于债券型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金若投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</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	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信慧嘉债券A	汇丰晋信慧嘉债券C
下属分级基金的交易代码	016651	016652
报告期末下属分级基金的份额总额	91,837,928.83份	24,517,774.70份

§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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	汇丰晋信慧嘉债券A	汇丰晋信慧嘉债券C
1.本期已实现收益	271,646.37	21,623.48
2.本期利润	1,546,737.86	269,564.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0156	0.0233
4.期末基金资产净值	95,261,196.91	25,299,814.11
5.期末基金份额净值	1.0373	1.0319

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

②上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信慧嘉债券A净值表现

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	1.71%	0.12%	2.63%	0.20%	-0.92%	-0.08%
过去六个月	1.91%	0.12%	3.16%	0.16%	-1.25%	-0.04%
过去一年	3.84%	0.11%	4.33%	0.15%	-0.49%	-0.04%
自基金合同生效起至今	3.73%	0.10%	3.68%	0.14%	0.05%	-0.04%

注：

过去三个月指 2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

过去六个月指 2024 年 4 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

过去一年指 2023 年 10 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2023 年 1 月 17 日-2024 年 9 月 30 日

汇丰晋信慧嘉债券C净值表现

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	1.69%	0.13%	2.63%	0.20%	-0.94%	-0.07%
过去六个月	1.81%	0.12%	3.16%	0.16%	-1.35%	-0.04%
过去一年	3.55%	0.12%	4.33%	0.15%	-0.78%	-0.03%
自基金合同生效起至今	3.19%	0.10%	3.68%	0.14%	-0.49%	-0.04%

注：

过去三个月指 2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

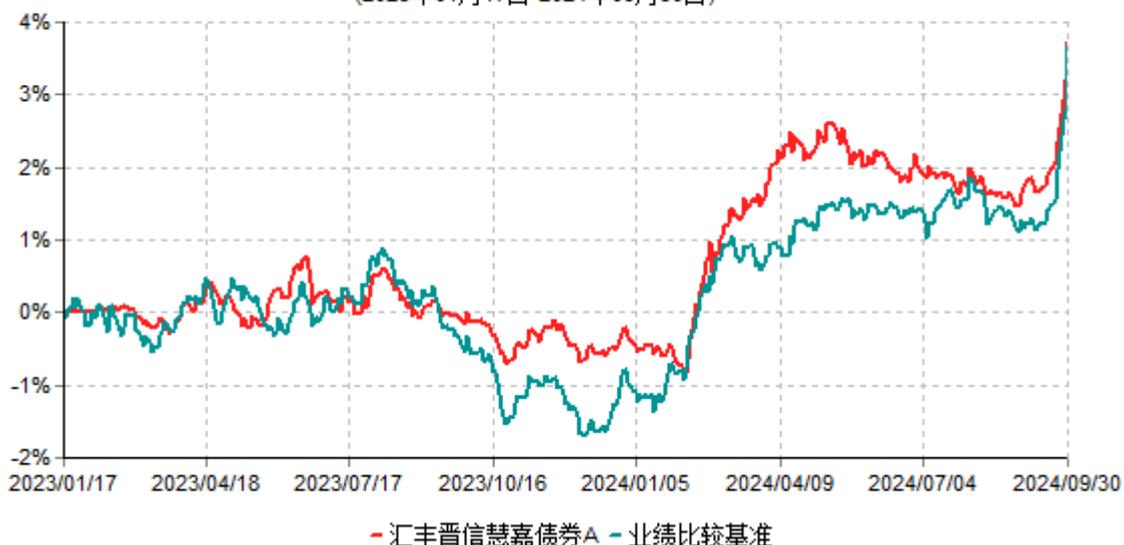
过去六个月指 2024 年 4 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

过去一年指 2023 年 10 月 1 日-2024 年 9 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2023 年 1 月 17 日-2024 年 9 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

汇丰晋信慧嘉债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年01月17日-2024年09月30日)



注：

- 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至 2023 年 7 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
- 本基金业绩比较基准：中债新综合全价（总值）指数收益率*85% + 沪深 300 指数收益率*15%。
- 本基金业绩比较基准中的中债新综合全价（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。

5. 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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信慧嘉债券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01月17日-2024年09月30日)



注：

- 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至 2023 年 7 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
- 本基金业绩比较基准：中债新综合全价（总值）指数收益率*85% + 沪深 300 指数收益率*15%。
- 本基金业绩比较基准中的中债新综合全价（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。
- 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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡若林	公募固收投资副总	2023-	2024-	13	蔡若林先生，硕士研究生。

	<p>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</p>	01-17	08-24		<p>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、基金经理助理、公募固收投资副总监、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、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。</p>
范坤祥	<p>汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金经理</p>	2023-03-11	2024-09-28	17	<p>范坤祥先生，硕士研究生。曾任海通证券研究所研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员、未来益财投资管理（上海）有限公司研究部副总监、格林基金管理有限公司研究部副总监、汇丰晋信基金管理有限公司研究总监、投资经理、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金经理。</p>

<p>刘洋</p>	<p>汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理</p>	<p>2024-09-28</p>	<p>-</p>	<p>7</p>	<p>刘洋先生，博士研究生。曾任青岛银行股份有限公司固收交易员，长江养老保险股份有限公司固收交易员，交银理财有限责任公司投资经理，上海浦银安盛资产管理有限公司投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司总经理办公室业务经理、投资经理，现任汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。</p>
<p>吴刘</p>	<p>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、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基</p>	<p>2024-09-28</p>	<p>-</p>	<p>9.5</p>	<p>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、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合</p>

	金经理			型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。
--	-----	--	--	--

- 注：1.蔡若林先生任职日期为本基金基金合同生效日的日期；
 2.范坤祥先生、刘洋先生、吴刘先生任职日期为本基金管理人公告范坤祥先生、刘洋先生、吴刘先生担任本基金基金经理的日期；
 3.蔡若林先生、范坤祥先生离任日期为本基金管理人公告蔡若林先生、范坤祥先生不再担任本基金基金经理的日期；
 4.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 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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度，全球宏观经济形势继续呈现波动。一方面，俄乌冲突持续，巴以冲突扩大化，拜登退选后，美国大选局势摇摆也加大了未来全球地缘政治和经济的不确定性。此外，从PMI数据来看，除印度外，各主要经济体制造业大多走弱；另一方面，美国通胀回落，开启降息周期，就业市场仍具韧性，消费维持较好表现。

国内方面，经济数据表现偏弱，内需有待企稳。工业增加值、固定资产投资和社会消费品零售总额增速皆延续下行。其中，工业增加值同比增速从6月5.3%回落至8月的4.5%，固定资产投资累计同比增速从6月份的3.9%降至8月份的3.4%，地产投资继续形成较大拖累，社零同比增速2.1%与6月份相当，保持低位。而出口数据则维持稳健，7月出口额同比增速暂时回落后，8月同比增速较前值回升1.7pct至8.7%，并超过6月份增速。而9月的制造业采购经理指数（PMI）为49.8%，继续在荣枯线以下，经济企稳回升的动能有待增强。

通胀方面，8月CPI同比增速为0.6%（前值0.5%），扣除食品和能源价格，核心CPI同比上涨0.3%（前值0.4%）。8月PPI同比增速为-1.8%（前值-0.8%），维持在负值区间，进一步验证了需求偏弱的状况。

政策方面，二十届三中全会强调，坚定不移实现全年经济社会发展目标，7月政治局会议提出储备并适时推出一批增量政策，但同时强调“保持战略定力”。货币政策方面，央行提出新的货币政策框架，考虑以7天期逆回购操作利率为代表的短期操作利率为主要政策利率，适度收窄利率走廊的宽度，同时将二级市场国债买卖纳入货币政策工具箱；财政政策方面，政策着力点主要是推动大规模设备更新和消费品以旧换新，持续强化基本民生保障，保证必要的财政支出。9月底，“一行一局一会”召开新闻发布会，发布了降低购房首付比例和存量房贷利率，及支持资本市场等相关的政策措施，随后央行降息、一线城市地产政策调整快速跟进。同时，9月政治局会议罕见地关注经济问题，进一步强化了市场对决策层托底经济、呵护资本市场的预期，市场期待潜在政策的出台，经济基本面预期得到改善，资本市场情绪提振明显。

综合影响下，三季度债市呈现波动，9月收益率快速上行后，三季度债券资产总体仍收涨。具体看，期间中债新综合全价指数上涨0.26%，中债信用债指数下跌0.32%，中债金融债指数上涨0.13%，中债国债指数上涨0.72%。

权益方面，A股先跌后涨，前期受经济数据疲弱、市场情绪低迷影响，9月底，新政策出台后，A股连续快速冲高，市场情绪明显改善。具体来看，三季度沪深300指数上涨16.07%，上证50指数上涨15.05%，创业板指数上涨29.21%。

基金操作方面，权益自上而下来看基本面和风险偏好方面都缺乏充分支撑，注重自下而上的选股，从家电、出口链等方向寻找基本面有支撑的标的。固收方面，利率的波动性上升，注重通过利率债进行灵活的久期管理，适当寻求波段交易收益。

4.5 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1.71%，同期业绩比较基准收益率为2.63%；本基金C类份额净值增长率为1.69%，同期业绩比较基准收益率为2.63%。

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	13,761,803.97	11.39
	其中：股票	13,761,803.97	11.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,983,005.53	72.83
	其中：债券	87,983,005.53	72.83
	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	5,242,770.32	4.34
8	其他资产	13,822,968.15	11.44
9	合计	120,810,547.97	100.00

注：权益投资中未通过沪港通机制投资香港股票；通过深港通机制投资香港股票金额1,555,952.97元，占基金资产净值的比例为1.29%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,307,655.00	1.91
C	制造业	7,115,761.00	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	908,567.00	0.75
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	1,104,170.00	0.92
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	769,698.00	0.64
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,205,851.00	10.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
医疗保健	835,039.50	0.69
公用事业	720,913.47	0.60
合计	1,555,952.97	1.29

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	23,400	1,223,820.00	1.02
2	600000	浦发银行	109,000	1,104,170.00	0.92
3	000400	许继电气	29,300	1,001,767.00	0.83
4	000338	潍柴动力	60,700	963,309.00	0.80
5	600547	山东黄金	31,900	934,351.00	0.78
6	600795	国电电力	166,100	908,567.00	0.75
7	H02666	环球医疗	183,000	835,039.50	0.69
8	002452	长高电新	96,700	815,181.00	0.68
9	002025	航天电器	14,000	782,880.00	0.65
10	000526	学大教育	12,200	769,698.00	0.64

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	28,786,568.64	23.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,157,891.43	17.55
	其中：政策性金融债	21,157,891.43	17.55
4	企业债券	22,322,499.18	18.52
5	企业短期融资券	10,144,060.82	8.41
6	中期票据	5,212,959.02	4.32
7	可转债（可交换债）	359,026.44	0.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,983,005.53	72.98

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	220210	22国开10	100,000	10,669,263.01	8.85

2	230305	23进出05	100,000	10,488,628.42	8.70
3	042480122	24海沧投资CP001	100,000	10,144,060.82	8.41
4	240010	24付息国债10	100,000	10,128,452.05	8.40
5	249953	24贴现国债53	100,000	9,973,002.20	8.27

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期末，本基金投资的前十名证券的发行主体除北京首都开发股份有限公司（以下简称“首开股份”）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"22首股02(债券代码:185769)"的发行主体首开股份,因其信息披露违反了《证券法》第七十八条第二款、《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第180号)第四条、《银行间债券市场非金融企业债务融资工具管理办法》(中国人民银行令〔2008〕第1号)第七条的规定,构成《证券法》第一百九十七条第二款所述的违法行为,中国证券监督管理委员会北京监管局于2023年11月30日下发《行政处罚决定书》,对其给予警告,并处以150万元的罚款。根据首开股份2023年12月1日披露的《关于收到<行政处罚决定书>的公告》,截至该公告披露日,公司生产经营活动正常,对于《行政处罚决定书》中涉及的前期差错事项,公司已于2023年4月29日披露《关于前期差错更正的公告》予以更正。

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,本基金对北京首都开发股份有限公司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	17,740.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,794.76
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,802,433.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,822,968.15

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	110059	浦发转债	359,026.44	0.30

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信慧嘉债券A	汇丰晋信慧嘉债券C
报告期期初基金份额总额	106,498,642.89	11,917,581.15
报告期期间基金总申购份额	391,044.23	13,380,493.33
减：报告期期间基金总赎回份额	15,051,758.29	780,299.78
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	91,837,928.83	24,517,774.70

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20240701 - 20240930	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	42.97%
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

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信慧嘉债券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

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及
其余备查文件存放在基金管理人处。

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

2024年10月25日