

# 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人: 汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人: 交通银行股份有限公司

报告送出日期: 2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03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。

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31日止。

## 1.2 目录

|                                      |           |
|--------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录 .....</b>             | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示.....                        | 1         |
| 1.2 目录.....                          | 2         |
| <b>§ 2 基金简介.....</b>                 | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                     | 6         |
| 2.2 基金产品说明 .....                     | 6         |
| 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 .....                     | 8         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....</b> | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                 | 8         |
| 3.2 基金净值表现 .....                     | 9         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....               | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告 .....</b>               | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....               | 10        |
| 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.....     | 14        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....         | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....       | 15        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 4.9 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.....       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告 .....</b>                       | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                 | 16        |
| 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..... | 16        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....     | 16        |
| <b>§ 6 审计报告.....</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                           | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                          | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表.....</b>                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表 .....                              | 19        |
| 7.2 利润表 .....                                | 21        |
| 7.3 净资产变动表 .....                             | 22        |
| 7.4 报表附注.....                                | 23        |
| <b>§ 8 投资组合报告.....</b>                       | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 47        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                   | 48        |
| 8.3 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 .....      | 48        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                    | 48        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 48        |
| 8.6 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 .....     | 49        |
| 8.7 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 .....  | 49        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.8 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 ..... | 49        |
| 8.9 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 .....    | 49        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 49        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>50</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 9.3 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 .....      | 51        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>51</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 11.2 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 .....      | 51        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 52        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>58</b> |
| 12.1 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 .....    | 59        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |

|                  |    |
|------------------|----|
| § 13 备查文件目录..... | 59 |
| 13.1 备查文件目录..... | 59 |
| 13.2 存放地点 .....  | 59 |
| 13.3 查阅方式 .....  | 59 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                                        |
|------------|----------------------------------------|
| 基金名称       | 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金         |
| 基金简称       | 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期               |
| 基金主代码      | 019017                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置 7 天的最短持有期限 |
| 基金合同生效日    | 2023 年 12 月 12 日                       |
| 基金管理人      | 汇丰晋信基金管理有限公司                           |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司                             |
| 报告期末基金份额总额 | 229,034,006.27 份                       |
| 基金合同存续期    | 不定期                                    |

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金主要投资于同业存单，通过指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略 | <p>本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的证券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、资产配置策略 本基金主要以标的指数的成份券和备选成份券为基础，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。</p> <p>2、同业存单投资策略 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率</p> |

|        |                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。 4、债券投资策略 本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略，力求获取高于业绩比较基准的回报。未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为同业存单指数基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。                                                                                        |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                                   |
|--------|----------------------|----------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼    |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2025 年         | 2024 年         | 2023 年 12 月 12 日<br>（基金合同生效日）－<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|----------------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 3,636,341.36   | 10,804,658.43  | 1,792,460.95                                       |
| 本期利润          | 3,329,558.94   | 11,273,479.21  | 1,727,407.52                                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0114         | 0.0203         | 0.0012                                             |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.11%          | 2.00%          | 0.12%                                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.17%          | 2.02%          | 0.12%                                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末        | 2024 年末        | 2023 年末                                            |
| 期末可供分配利润      | 7,527,769.12   | 10,279,487.24  | 1,727,407.52                                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0329         | 0.0203         | 0.0012                                             |
| 期末基金资产净值      | 236,651,226.78 | 517,491,935.92 | 1,474,886,442.94                                   |
| 期末基金份额净值      | 1.0333         | 1.0214         | 1.0012                                             |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2025 年末        | 2024 年末        | 2023 年末                                            |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.33%          | 2.14%          | 0.12%                                              |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.29%    | 0.01%       | 0.41%      | 0.01%         | -0.12% | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.55%    | 0.01%       | 0.81%      | 0.01%         | -0.26% | 0.00% |
| 过去一年       | 1.17%    | 0.01%       | 1.65%      | 0.01%         | -0.48% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.33%    | 0.01%       | 4.24%      | 0.01%         | -0.91% | 0.00% |

注：

过去三个月指 2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去六个月指 2025 年 7 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去一年指 2025 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

自基金合同生效起至今指 2023 年 12 月 12 日-2025 年 12 月 31 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

汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期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12月12日-2025年12月31日)



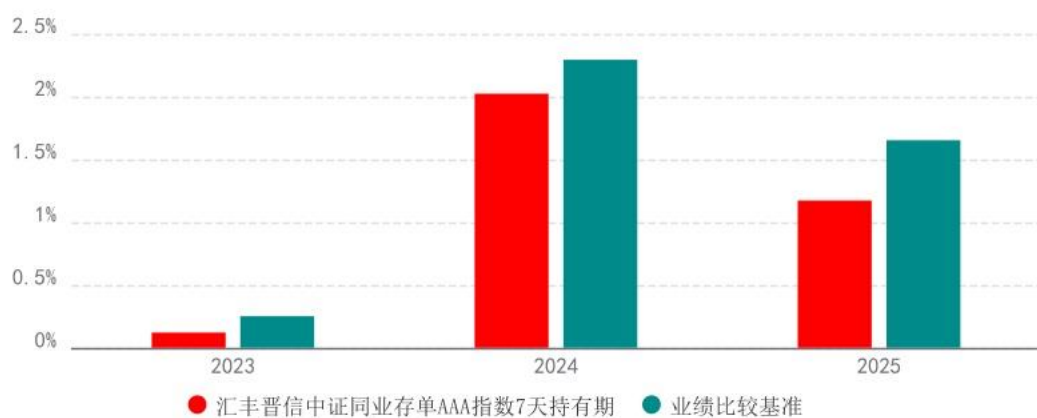
注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金

不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2. 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 2024 年 6 月 12 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

3. 报告期内本基金的业绩比较基准=中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本基金的基金合同于 2023 年 12 月 12 日生效，截至 2025 年 12 月 31 日基金合同生效未满五年。

2、本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 2025 年 12 月 31 日，公司共管理 41 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生

命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自 2020 年 11 月 19 日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011 年 7 月 27 日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 日成立）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014 年 11 月 26 日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015 年 9 月 30 日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016 年 3 月 11 日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016 年 11 月 10 日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017 年 6 月 2 日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018 年 11 月 14 日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019 年 3 月 20 日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019 年 8 月 2 日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020 年 7 月 30 日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020 年 8 月 13 日成立）、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金（2020 年 10 月 29 日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021 年 3 月 16 日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021 年 5 月 24 日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021 年 7 月 12 日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022 年 1 月 21 日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022 年 3 月 3 日成立）、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金（2022 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金（2022 年 8 月 16 日成立）、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金（2022 年 9 月 14 日成立）、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金（2022 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金（2022 年 12 月 20 日成立）、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金（2023 年 1 月 17 日成立）、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（2023 年 12 月 12 日成立）、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金（2024 年 4 月 16 日成立）、汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金（FOF）（2024 年 6 月 12 日成立）、汇丰晋信绿色债券型证券投资基金（2024 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信景气优选混合型证券投资基金（2025 年 5 月 28 日成立）和汇丰晋信港股通核心资产股票型发起式证券投资基金（2025 年 8 月 12 日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期            | 离任日期 |        |    |
|    |    |                 |      |        |    |

|     |                                                                                                                                                                              |            |   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 傅煜清 | 汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈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、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理                        | 2023-12-12 | - | 9.5 年 | 傅煜清女士，硕士研究生。曾任上海国际货币经纪有限责任公司债券经纪人，加拿大皇家银行信用分析员，汇丰晋信基金管理有限公司信用分析员、基金经理助理。现任汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈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、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金以及汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理。                                                            |
| 刘洋  | 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、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理 | 2024-05-11 | - | 9 年   | 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、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限是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 公平交易制度和控制方法

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

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

公司对公平交易的控制方法包括：1、交易所市场的公平交易均通过恒生投资交易系统实现，通过开启公平交易程序，由恒生投资交易系统强制执行；2、银行间交易由执行交易员按照价格优先、比例分配的公平交易的原则实行分配，确保各投资组合获得公平的交易机会；3、对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、使用衡泰风险管理与绩效评估系统定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。公司对不同组合同一证券同向交易的溢费率均值进行 T 检验，对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、贡献率、自由度、交易数量和交易时间等指标进行专项计算分析，计算分析结果显示：以上各指标值均在合理正常的范围之内，未发现不同投资组合间相近交易日内的同向交易存在不公平及存在利益输送的行为。

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。

### 4.3.3 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

投资策略方面，本基金通过指数化投资，跟踪同业存单指数，力求投资组合与同业存单市场表现高度相关。资产配置方面，本基金主要配置 AAA 级同业存单，注重投资组合的安全性。同时，基金经理通过分散投资，降低单一银行的风险暴露，提高投资组合的稳定性。流动性管理方面，本基金通过合理配置不同期限的同业存单，提高应对大额赎回时及时变现的能力。同时，基金经理通过调整杠杆水平，力求在控制风险的前提下提高收益。

##### 4.4.2 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 1.17%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%，净值表现落后同期比较基准 0.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，中国宏观经济或将延续“弱复苏+政策支持”格局。2026 年作为“十五五”启航之年，宏观经济基本面有望在多重利好驱动下实现稳中有进。一方面，经济增速目标保持稳定，符合中长期发展诉求，投资企稳与消费回暖有望构成增长双支柱：制造业投资有望受益于政策倾斜与 PPI 回升，基建投资维持韧性，服务消费占比预计将进一步提升。另一方面，结构转型深化，科技自立自强与产业升级提速，战略性新兴产业及未来产业获政策支持，关键核心技术攻关突破可期。全球流动性宽松，亦为出口与跨境资本流动创造有利环境。新旧动能转换窗口期内，经济修复动能与高质量发展潜力可能同步增强。

整体来看，预计 GDP 增速保持稳定，财政政策保持稳健，货币政策有望进一步宽松，政策利率存在下降空间，或为债市提供利率下行支撑。同业存单预计面临“供需再平衡”。一方面，银行存款利率持续下行；另一方面，商业银行同业存单净偿还趋势延续，供给压力缓解，叠加非银机构配置需求稳定。风险方面，需关注股市回暖引发资金再配置的情况，以及部分小规模产品因变现能力不足而引发的流动性管理压力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在公司内部监察稽核工作中本着规范运作、防范风险和保护基金份额持有人利益的原则，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司的经营管理、基金的投资运作以及员工行为规范等方面进行日常监控、定期检查和专项检查，及时发现问题并督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报送监管机构。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1. 通过定期检查和专项检查的方式对公司日常经营活动和基金投资运作进行合规性监控，发现问题及时要求相关部门和有关人员及时解决处理，并跟踪问题的处理结果，对相关员工开展针对性的风险教育，防范在公司经营和基金投资运作中可能发生的风险。

2. 按照法律法规和中国证监会规定，及时、准确、完整地公司完成公司和基金的各项法定信息披露文件，并在规定媒介进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和基金的各项公开信息。

3. 定期和不定期地向中国证监会、上海证监局、中国证券投资基金业协会和人民银行等监管机构报送各类文件报告，确保监管机构文件报备工作的准确性和及时性。

4. 加强对公司业务部门的合规监察工作，并将监察结果报告发予相关部门主管沟通，对各项制度进行更新，提出改进建议，提请和督促业务部门进行跟踪和改善。

5. 对基金募集申请材料、市场宣传推介材料、基金代销协议、基金交易单元租用协议等文件等进行严密的事前合法合规审核，以及完成公司其他日常法律事务工作。

6. 定期为公司员工举办公司合规制度的培训，并就新颁布法律法规举办专项合规培训，向公司员工宣传合规守法的经营理念，强化公司的合规文化；对投资管理以及销售业务部门员工开展专项培训，以进一步规范和完善基金投资以及销售行为。

7. 根据监管部门的要求，定期完成监察稽核报告，报送公司董事会审阅。

本基金管理人将继续致力于建立一个高效的内部控制体系，一贯本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益，切实保证基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引，结合本基金基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的证券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |         |
|------------|---------|
| 财务报表是否经过审计 | 是       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见 |

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字（2026）第 20478 号 |
|--------|-------------------------|

6.2 审计报告的基本内容

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题          | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 审计报告收件人         | 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 审计意见            | <p>（一） 我们审计的内容</p> <p>我们审计了汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下简称“汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金”）的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>（二） 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。</p>                                                                                                                           |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 其他信息            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇丰晋信中证同业存单 AAA 指</p>                                                                                  |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |     |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|                 | <p>数 7 天持有期基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称       | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |     |
| 注册会计师的姓名        | 叶尔甸                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 段黄霖 |
| 会计师事务所的地址       | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |     |
| 审计报告日期          | 2026-03-27                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |     |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                         |                          |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 3,411,721.54            | 7,016,466.82             |
| 结算备付金    |         | -                       | -                        |
| 存出保证金    |         | -                       | 1,236.75                 |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 293,520,377.96          | 523,165,032.07           |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 293,520,377.96          | 523,165,032.07           |
| 资产支持证券投资 |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                       | -                        |
| 其他投资     |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | -                       | 20,002,427.40            |
| 应收清算款    |         | -                       | -                        |
| 应收股利     |         | -                       | -                        |
| 应收申购款    |         | -                       | 67,031,503.30            |
| 递延所得税资产  |         | -                       | -                        |
| 其他资产     | 7.4.7.5 | -                       | -                        |
| 资产总计     |         | 296,932,099.50          | 617,216,666.34           |

| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 负 债：      |         |                         |                          |
| 短期借款      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融负债   |         | -                       | -                        |
| 衍生金融负债    | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |         | 60,008,176.03           | 99,518,196.92            |
| 应付清算款     |         | -                       | -                        |
| 应付赎回款     |         | -                       | -                        |
| 应付管理人报酬   |         | 39,539.46               | 63,957.53                |
| 应付托管费     |         | 9,884.88                | 15,989.37                |
| 应付销售服务费   |         | 39,539.46               | 63,957.53                |
| 应付投资顾问费   |         | -                       | -                        |
| 应交税费      |         | 1,007.14                | 2,126.38                 |
| 应付利润      |         | -                       | -                        |
| 递延所得税负债   |         | -                       | -                        |
| 其他负债      | 7.4.7.6 | 182,725.75              | 60,502.69                |
| 负债合计      |         | 60,280,872.72           | 99,724,730.42            |
| 净 资 产：    |         |                         |                          |
| 实收基金      | 7.4.7.7 | 229,034,006.27          | 506,653,865.56           |
| 未分配利润     | 7.4.7.8 | 7,617,220.51            | 10,838,070.36            |
| 净资产合计     |         | 236,651,226.78          | 517,491,935.92           |
| 负债和净资产总计  |         | 296,932,099.50          | 617,216,666.34           |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 229,034,006.27 份，基金份额净值 1.0333 元。

7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2025 年 01 月 01 日<br>至 2025 年 12 月 31<br>日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日<br>至 2024 年 12 月 31<br>日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |            | 6,145,022.27                                    | 15,901,400.92                                        |
| 1. 利息收入                |            | 53,586.32                                       | 1,003,908.54                                         |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.9    | 45,906.40                                       | 608,544.24                                           |
| 债券利息收入                 |            | -                                               | -                                                    |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                               | -                                                    |
| 买入返售金融资产收入             |            | 7,679.92                                        | 395,364.30                                           |
| 其他利息收入                 |            | -                                               | -                                                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 6,398,218.37                                    | 14,428,671.60                                        |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.10   | -                                               | -                                                    |
| 基金投资收益                 |            | -                                               | -                                                    |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.11   | 6,398,218.37                                    | 14,428,671.60                                        |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.12   | -                                               | -                                                    |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.13   | -                                               | -                                                    |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.14   | -                                               | -                                                    |
| 股利收益                   | 7.4.7.15   | -                                               | -                                                    |
| 其他投资收益                 |            | -                                               | -                                                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | -306,782.42                                     | 468,820.78                                           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                               | -                                                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | -                                               | -                                                    |
| 减：二、营业总支出              |            | 2,815,463.33                                    | 4,627,921.71                                         |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 600,390.37                                      | 1,123,043.75                                         |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 150,097.51                                      | 280,760.92                                           |

|                     |            |              |               |
|---------------------|------------|--------------|---------------|
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | 600,390.37   | 1,123,043.75  |
| 4. 投资顾问费            |            | -            | -             |
| 5. 利息支出             |            | 1,265,933.65 | 2,022,611.11  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 1,265,933.65 | 2,022,611.11  |
| 6. 信用减值损失           |            | -            | -             |
| 7. 税金及附加            |            | 1,451.43     | 4,489.18      |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.18   | 197,200.00   | 73,973.00     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 3,329,558.94 | 11,273,479.21 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 3,329,558.94 | 11,273,479.21 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -            | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 3,329,558.94 | 11,273,479.21 |

7.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                                 | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 |                |                 |
|-------------------------------------|------------------------------------------|----------------|-----------------|
|                                     | 实收基金                                     | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                           | 506,653,865.56                           | 10,838,070.36  | 517,491,935.92  |
| 二、本期期初净资产                           | 506,653,865.56                           | 10,838,070.36  | 517,491,935.92  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -277,619,859.29                          | -3,220,849.85  | -280,840,709.14 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                        | 3,329,558.94   | 3,329,558.94    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -277,619,859.29                          | -6,550,408.79  | -284,170,268.08 |
| 其中：1. 基金申购款                         | 501,931,419.79                           | 13,506,077.29  | 515,437,497.08  |
| 2. 基金赎回款                            | -779,551,279.08                          | -20,056,486.08 | -799,607,765.16 |
| （三）、本期向基金份额持有人                      | -                                        | -              | -               |

|                                          |                                               |                |                       |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|-----------------------|
| 分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）               |                                               |                |                       |
| 四、本期期末净资产                                | 229,034,006.27                                | 7,617,220.51   | 236,651,226.78        |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |                |                       |
|                                          | 实收基金                                          | 未分配利润          | 净资产合计                 |
| 一、上期期末净资产                                | 1,473,159,035.42                              | 1,727,407.52   | 1,474,886,442.94      |
| 二、本期期初净资产                                | 1,473,159,035.42                              | 1,727,407.52   | 1,474,886,442.94      |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -966,505,169.86                               | 9,110,662.84   | -957,394,507.02       |
| （一）、综合收益总额                               | -                                             | 11,273,479.21  | 11,273,479.21         |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -966,505,169.86                               | -2,162,816.37  | -968,667,986.23       |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,796,188,755.09                              | 17,559,564.25  | 1,813,748,319.34      |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>2,762,693,924.95                         | -19,722,380.62 | -<br>2,782,416,305.57 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                             | -              | -                     |
| 四、本期期末净资产                                | 506,653,865.56                                | 10,838,070.36  | 517,491,935.92        |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 李选进      | 苑忠磊       | 张薇      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2023]1548 号《关于准予汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》准予注册，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《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,472,707,154.86 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(2023)第 0580 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,473,159,035.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 451,880.56 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金对每份基金份额设 7 天的最短持有期。最短持有期的到期日为自基金合同生效日或申购

确认日或转入确认日起的第 7 日，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日。在最短持有期到期日（不含当日）之前，投资者不能提出赎回或者转换转出申请；最短持有期到期日（含当日）起，投资者方可申请赎回或转换转出。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括非标的指数成份券和备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、地方政府债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券等）、短期融资券、超短期融资券、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、现金等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券以及其他带有权属属性的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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 2026 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

##### (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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### (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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不可

应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债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扣除按票面利率(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后的净额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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部

分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[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债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 3,411,721.54            | 7,016,466.82             |
| 等于：本金          | 3,410,405.04            | 7,014,231.99             |
| 加：应计利息         | 1,316.50                | 2,234.83                 |
| 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             | 3,411,721.54            | 7,016,466.82             |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日  |              |                |            |
|---------------|-------|--------------------------|--------------|----------------|------------|
|               |       | 成本                       | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -            | -              | -          |
| 债券            | 交易所市场 | -                        | -            | -              | -          |
|               | 银行间市场 | 290,466,515.07           | 2,956,877.96 | 293,520,377.96 | 96,984.93  |
|               | 合计    | 290,466,515.07           | 2,956,877.96 | 293,520,377.96 | 96,984.93  |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -          |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 合计            |       | 290,466,515.07           | 2,956,877.96 | 293,520,377.96 | 96,984.93  |
| 项目            |       | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |              |                |            |
|               |       | 成本                       | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -            | -              | -          |
| 债券            | 交易所市场 | -                        | -            | -              | -          |
|               | 银行间市场 | 516,762,732.65           | 5,998,532.07 | 523,165,032.07 | 403,767.35 |
|               | 合计    | 516,762,732.65           | 5,998,532.07 | 523,165,032.07 | 403,767.35 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -          |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -          |
| 合计            |       | 516,762,732.65           | 5,998,532.07 | 523,165,032.07 | 403,767.35 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------|
|----|----------------------|

|       | 账面余额                  | 其中：买断式逆回购 |
|-------|-----------------------|-----------|
| 交易所市场 | -                     | -         |
| 银行间市场 | -                     | -         |
| 合计    | -                     | -         |
| 项目    | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                  | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 20,002,427.40         | -         |
| 银行间市场 | -                     | -         |
| 合计    | 20,002,427.40         | -         |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券  
无。

7.4.7.5 其他资产  
无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 13,425.75               | 11,202.69                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 13,425.75               | 11,202.69                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 169,300.00              | 49,300.00                |
| 合计          | 182,725.75              | 60,502.69                |

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|------------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                  | 账面金额            |
| 上年度末          | 506,653,865.56                           | 506,653,865.56  |
| 本期申购          | 501,931,419.79                           | 501,931,419.79  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -779,551,279.08                          | -779,551,279.08 |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 229,034,006.27 | 229,034,006.27 |
|-----|----------------|----------------|

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分       | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------------|----------------|
| 上年度末           | 10,279,487.24  | 558,583.12  | 10,838,070.36  |
| 本期期初           | 10,279,487.24  | 558,583.12  | 10,838,070.36  |
| 本期利润           | 3,636,341.36   | -306,782.42 | 3,329,558.94   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,388,059.48  | -162,349.31 | -6,550,408.79  |
| 其中：基金申购款       | 12,943,144.69  | 562,932.60  | 13,506,077.29  |
| 基金赎回款          | -19,331,204.17 | -725,281.91 | -20,056,486.08 |
| 本期已分配利润        | -              | -           | -              |
| 本期末            | 7,527,769.12   | 89,451.39   | 7,617,220.51   |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 45,518.09                                   | 110,040.52                                       |
| 定期存款利息收入  | -                                           | 481,841.79                                       |
| 其他存款利息收入  | -                                           | -                                                |
| 结算备付金利息收入 | 59.22                                       | 16,620.14                                        |
| 其他        | 329.09                                      | 41.79                                            |
| 合计        | 45,906.40                                   | 608,544.24                                       |

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目           | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|--------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 6,619,396.83                                | 14,144,275.77                                    |

|                              |              |               |
|------------------------------|--------------|---------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -221,178.46  | 284,395.83    |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -            | -             |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -            | -             |
| 合计                           | 6,398,218.37 | 14,428,671.60 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 955,229,474.99                              | 3,191,028,304.27                                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 944,269,665.23                              | 3,160,340,038.67                                 |
| 减：应计利息总额               | 11,164,853.22                               | 30,364,482.27                                    |
| 减：交易费用                 | 16,135.00                                   | 39,387.50                                        |
| 买卖债券差价收入               | -221,178.46                                 | 284,395.83                                       |

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------|----|---------|
|------|----|---------|

|                        | 2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -306,782.42                           | 468,820.78                            |
| ——股票投资                 | -                                     | -                                     |
| ——债券投资                 | -306,782.42                           | 468,820.78                            |
| ——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                     | -306,782.42                           | 468,820.78                            |

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|---------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 审计费用    | 40,000.00                                   | 36,373.00                                        |
| 信息披露费   | 120,000.00                                  | -                                                |
| 证券出借违约金 | -                                           | -                                                |
| 账户维护费   | 37,200.00                                   | 37,200.00                                        |
| 其他      | -                                           | 400.00                                           |
| 合计      | 197,200.00                                  | 73,973.00                                        |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                      | 与本基金的关系             |
|----------------------------|---------------------|
| 汇丰晋信基金管理有限公司（“汇丰晋信”）       | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）         | 基金托管人、基金销售机构        |
| 山西信托股份有限公司（“山西信托”）         | 基金管理人的股东            |
| 汇丰环球投资管理（英国）有限公司           | 基金管理人的股东            |
| 山西证券股份有限公司（“山西证券”）         | 见注释①                |
| 汇丰银行（中国）有限公司（“汇丰银行”）       | 见注释②                |
| 恒生银行（中国）有限公司（“恒生银行”）       | 见注释③                |
| 汇丰前海证券有限责任公司（“汇丰前海”）       | 见注释④                |
| 汇丰人寿保险有限公司（“汇丰人寿”）         | 见注释⑤                |
| 汇丰保险经纪有限公司（“汇丰保险”）         | 见注释⑥                |
| 汇丰投资基金（香港）有限公司（“汇丰投资基金香港”） | 见注释⑦                |

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

②汇丰银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

③恒生银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

④汇丰前海与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑤汇丰人寿与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑥汇丰保险与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑦汇丰投资基金香港与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 600,390.37                                  | 1,123,043.75                                     |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 288,816.67                                  | 552,236.15                                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 311,573.70                                  | 570,807.60                                       |

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 0.20% 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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年<br>12 月 31 日 |
|----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 150,097.51                                  | 280,760.92                                       |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.10.2.3 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<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------------------------------------|
|----------------|------------------------------------------|

|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                              |
|----------------|-----------------------------------------------|
| 交通银行           | 15,621.84                                     |
| 汇丰银行           | 447,455.64                                    |
| 恒生银行           | 61,233.63                                     |
| 汇丰保险           | 6,797.41                                      |
| 汇丰晋信           | 8,010.63                                      |
| 合计             | 539,119.15                                    |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                              |
| 交通银行           | 173,811.23                                    |
| 汇丰银行           | 656,434.36                                    |
| 恒生银行           | 149,798.96                                    |
| 汇丰保险           | 15,349.88                                     |
| 汇丰晋信           | 46.28                                         |
| 合计             | 995,440.71                                    |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.20%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：日销售服务费＝前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日      |               |               |          |          |          |          |
|--------------------------------------------|---------------|---------------|----------|----------|----------|----------|
| 银行间市场交易的各<br>关联方名称                         | 债券交易金额        |               | 基金逆回购    |          | 基金正回购    |          |
|                                            | 基金买入          | 基金卖出          | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金<br>额 | 利息支<br>出 |
| 交通银行                                       | -             | 10,013,834.79 | -        | -        | -        | -        |
| 山西证券                                       | -             | -             | -        | -        | -        | -        |
| 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |               |               |          |          |          |          |
| 银行间市场交易的各<br>关联方名称                         | 债券交易金额        |               | 基金逆回购    |          | 基金正回购    |          |
|                                            | 基金买入          | 基金卖出          | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金<br>额 | 利息支<br>出 |
| 交通银行                                       | -             | -             | -        | -        | -        | -        |
| 山西证券                                       | 10,472,250.00 | -             | -        | -        | -        | -        |

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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                            |            |
|-------|------------------------------------|-----------|------------------------------------|------------|
|       | 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 |           | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |            |
|       | 期末余额                               | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入     |
| 交通银行  | 3,411,721.54                       | 45,518.09 | 7,016,466.82                       | 110,040.52 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 200,000 张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币 19,820,639.01 元，占基金净资产的比例为 8.38%（2024 年 12 月 31 日，本基金持有 300,000 张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币 29,786,763.74 元，占基金净资产的比例为 5.76%）。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 60,008,176.03 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|---------------|------------|--------|---------|---------------|
| 112508248 | 25 中信银行 CD248 | 2026-01-06 | 99.01  | 110,000 | 10,890,980.66 |
| 112509272 | 25 浦发银行 CD272 | 2026-01-07 | 98.70  | 200,000 | 19,740,090.63 |
| 112510068 | 25 兴业银行 CD068 | 2026-01-06 | 99.73  | 50,000  | 4,986,618.03  |
| 112511054 | 25 平安银行 CD054 | 2026-01-05 | 99.43  | 110,000 | 10,937,637.05 |
| 112511054 | 25 平安银行 CD054 | 2026-01-07 | 99.43  | 20,000  | 1,988,661.28  |
| 112513140 | 25 浙商银行 CD140 | 2026-01-06 | 98.56  | 100,000 | 9,856,122.63  |
| 112517073 | 25 光大银行 CD073 | 2026-01-06 | 99.68  | 70,000  | 6,977,580.44  |
| 合计        |               |            |        | 660,000 | 65,377,690.72 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 5,016,245.21            | 20,163,123.29            |
| 合计     | 5,016,245.21            | 20,163,123.29            |

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

|        |                |                |
|--------|----------------|----------------|
| A-1    | —              | —              |
| A-1 以下 | —              | —              |
| 未评级    | 268,132,274.12 | 466,981,936.47 |
| 合计     | 268,132,274.12 | 466,981,936.47 |

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 10,291,154.52           | 30,932,103.82            |
| AAA 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | 10,080,704.11           | 5,087,868.49             |
| 合计     | 20,371,858.63           | 36,019,972.31            |

注：未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.3 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在基金最短持有期限到期日起（含当日）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 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 60,008,176.03 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通

暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 2025 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2025 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 12<br>月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计             |
|----------------------------|----------------|-------|-------|-----|----------------|
| 资产                         |                |       |       |     |                |
| 货币资金                       | 3,411,721.54   | -     | -     | -   | 3,411,721.54   |
| 交易性金融                      | 293,520,377.96 | -     | -     | -   | 293,520,377.96 |

|                             |                |       |       |               |                |
|-----------------------------|----------------|-------|-------|---------------|----------------|
| 资产                          |                |       |       |               |                |
| 资产总计                        | 296,932,099.50 | -     | -     | -             | 296,932,099.50 |
| 负债                          |                |       |       |               |                |
| 卖出回购金<br>融资产款               | 60,008,176.03  | -     | -     | -             | 60,008,176.03  |
| 应付管理人<br>报酬                 | -              | -     | -     | 39,539.46     | 39,539.46      |
| 应付托管费                       | -              | -     | -     | 9,884.88      | 9,884.88       |
| 应付销售服<br>务费                 | -              | -     | -     | 39,539.46     | 39,539.46      |
| 应交税费                        | -              | -     | -     | 1,007.14      | 1,007.14       |
| 其他负债                        | -              | -     | -     | 182,725.75    | 182,725.75     |
| 负债总计                        | 60,008,176.03  | -     | -     | 272,696.69    | 60,280,872.72  |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 236,923,923.47 | -     | -     | -272,696.69   | 236,651,226.78 |
| 上年度末<br>2024 年 12<br>月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计             |
| 资产                          |                |       |       |               |                |
| 货币资金                        | 7,016,466.82   | -     | -     | -             | 7,016,466.82   |
| 存出保证金                       | 1,236.75       | -     | -     | -             | 1,236.75       |
| 交易性金融<br>资产                 | 523,165,032.07 | -     | -     | -             | 523,165,032.07 |
| 买入返售金<br>融资产                | 20,002,427.40  | -     | -     | -             | 20,002,427.40  |
| 应收申购款                       | -              | -     | -     | 67,031,503.30 | 67,031,503.30  |
| 资产总计                        | 550,185,163.04 | -     | -     | 67,031,503.30 | 617,216,666.34 |
| 负债                          |                |       |       |               |                |
| 卖出回购金<br>融资产款               | 99,518,196.92  | -     | -     | -             | 99,518,196.92  |
| 应付管理人<br>报酬                 | -              | -     | -     | 63,957.53     | 63,957.53      |
| 应付托管费                       | -              | -     | -     | 15,989.37     | 15,989.37      |
| 应付销售服<br>务费                 | -              | -     | -     | 63,957.53     | 63,957.53      |
| 应交税费                        | -              | -     | -     | 2,126.38      | 2,126.38       |
| 其他负债                        | -              | -     | -     | 60,502.69     | 60,502.69      |
| 负债总计                        | 99,518,196.92  | -     | -     | 206,533.50    | 99,724,730.42  |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 450,666,966.12 | -     | -     | 66,824,969.80 | 517,491,935.92 |

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|--------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                          |
|    |                    | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 市场利率上升 25 个基点   | -318,067.91                     | -504,534.94              |
|    | 2. 市场利率下降 25 个基点   | 319,020.95                      | 505,877.09               |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |

|      |                |                |
|------|----------------|----------------|
| 第二层次 | 293,520,377.96 | 523,165,032.07 |
| 第三层次 | -              | -              |
| 合计   | 293,520,377.96 | 523,165,032.07 |

7.4.14.2.2 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。  
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | -              | -             |
|    | 其中：股票  | -              | -             |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 293,520,377.96 | 98.85         |
|    | 其中：债券  | 293,520,377.96 | 98.85         |
|    | 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      | 3,411,721.54   | 1.15   |
| 8 | 其他各项资产            | -              | -      |
| 9 | 合计                | 296,932,099.50 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

无。

8.4.2 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

无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 5,016,245.21  | 2.12         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,080,704.11 | 4.26         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,080,704.11 | 4.26         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6  | 中期票据      | 10,291,154.52  | 4.35   |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -      |
| 8  | 同业存单      | 268,132,274.12 | 113.30 |
| 9  | 其他        | -              | -      |
| 10 | 合计        | 293,520,377.96 | 124.03 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 112515004 | 25 民生银行 CD004 | 200,000 | 19,992,364.33 | 8.45         |
| 2  | 112505054 | 25 建设银行 CD054 | 200,000 | 19,964,982.90 | 8.44         |
| 3  | 112510068 | 25 兴业银行 CD068 | 200,000 | 19,946,472.11 | 8.43         |
| 4  | 112503087 | 25 农业银行 CD087 | 200,000 | 19,940,062.90 | 8.43         |
| 5  | 112517073 | 25 光大银行 CD073 | 200,000 | 19,935,944.11 | 8.42         |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细  
无。

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

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

8.10 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

无。

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 1,480        | 154,752.71    | 22,085,872.91 | 9.64%  | 206,948,133.36 | 90.36% |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 575,063.38 | 0.2511%  |

## 9.3 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）基金份额总额 | 1,473,159,035.42 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 506,653,865.56   |
| 本报告期基金总申购份额                     | 501,931,419.79   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 779,551,279.08   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 229,034,006.27   |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2025 年 1 月 25 日，基金管理人发布公告，自 2025 年 1 月 24 日起，张毅杰先生不再担任公司

副总经理。

2025 年 9 月 20 日，基金管理人发布公告，自 2025 年 9 月 18 日起，吴平先生不再担任公司风控负责人。

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内，孟羽任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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，根据与普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）签订的《审计业务约定书》，应实际支付 2025 年度审计费 40,000.00 元。自本基金成立以来，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。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况          | 内容                                |
|-----------------------|-----------------------------------|
| 受到调查或处罚等措施的主体         | 汇丰晋信基金管理有限公司                      |
| 受到调查或处罚等措施的时间         | 2025 年 12 月 16 日                  |
| 采取调查或处罚等措施的机构         | 中国证监会上海监管局                        |
| 受到调查或处罚等措施类型          | 行政监管措施                            |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函                             |
| 受到调查或处罚等措施的原因         | 信息披露                              |
| 受到处罚的依据               | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》             |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司高度重视，进一步完善制度，加强内部管理，公司所有业务均正常开展 |
| 其他                    | 无                                 |

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未有受调查或处罚等情况发生。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    |
| 申万宏源 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 东兴证券 | 3      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 东吴证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 东方证券 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 东方财富 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 中信建投 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 中信证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 中泰证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 中金公司 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 中银国际 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 信达证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 光大证券 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 兴业证券 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 华创证券 | 1      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 华安证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 华泰证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 华福证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 华西证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |
| 国投证券 | 2      | —    | —            | —         | —          | —  |

|           |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰海通      | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联民生      | 4 | - | - | - | - | - |
| 国金证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证<br>券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券      | 3 | - | - | - | - | - |
| 开源证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海      | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 财通证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 野村东方      | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券      | 2 | - | - | - | - | - |

注：

1、报告期内退租国泰海通、川财证券、国投证券、国联民生交易单元；

2、选择证券公司参与证券交易的标准和程序

1) 选择证券公司参与证券交易的标准

a. 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

b. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

c. 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2) 选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 本公司投资部根据上述评价标准对证券公司进行评估，经公司督察长和风控会审议批准后，可被选择成为提供证券交易服务的公司。

(2) 公司与被选中提供证券交易服务的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

#### 11.7.2 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 |
| 申万宏源 | -    | -            | 36,501,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 东兴证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方财富 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中银国际 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 信达证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |

|           |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 华安证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华福证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国投证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海<br>通  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国海证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国联民<br>生  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋<br>证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 开源证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 汇丰前<br>海  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证<br>券  | - | - | - | - | - | - | - | - |

|          |   |   |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 西南证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村东<br>方 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 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  | 关于汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金于 2025 年春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告  | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-01-17 |
| 2  | 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 | 2025-01-21 |
| 3  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告                                     | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-01-22 |
| 4  | 汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                                          | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-01-25 |
| 5  | 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欧财富的交易限额的公告                                | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-02-07 |
| 6  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况（2024 年度）                          | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-03-31 |
| 7  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告                                       | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-03-31 |
| 8  | 关于汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金于 2025 年劳动节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-04-22 |
| 9  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告                                   | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-04-22 |
| 10 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄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 | 2025-06-11 |
| 11 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告                                        | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-06-24 |

|    |                                                                    |                 |            |
|----|--------------------------------------------------------------------|-----------------|------------|
| 12 | 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）                 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-06-30 |
| 13 | 汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要更新                           | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-06-30 |
| 14 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告                          | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-07-15 |
| 15 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增创金启富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 | 2025-07-21 |
| 16 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告                                  | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-07-21 |
| 17 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增阳光人寿为旗下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 | 2025-08-01 |
| 18 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中信银行为旗下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 | 2025-08-01 |
| 19 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告                                      | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-08-29 |
| 20 | 汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                                         | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-09-20 |
| 21 | 关于汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金于 2025 年国庆假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-09-23 |
| 22 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告                                  | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-10-28 |
| 23 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增嘉实财富为旗下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 | 2025-10-29 |
| 24 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告                          | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-11-03 |
| 25 | 关于汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金于 2026 年元旦假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-12-23 |
| 26 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于提请直销投资者及时更新投资者分类资料并接受或重新接受风险承受能力调查的公告                | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-12-31 |
| 27 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告                                       | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-12-31 |
| 28 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于完善客户身份信息的提示                                          | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2025-12-31 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# § 13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的文件
  - （二）《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》
  - （三）《汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》
  - （四）关于申请募集注册汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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。

## 13.2 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

## 13.3 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

二〇二六年三月三十一日