

汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 07 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年07月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券
基金主代码	019673
基金运作方式	契约型开放式，每个开放日办理申购，在每份基金份额的最短持有期到期日起（含当日）办理基金份额的赎回。本基金对每份基金份额设置六个月的最短持有期。
基金合同生效日	2024 年 04 月 16 日
报告期末基金份额总额	102,145,146.84 份
投资目标	本基金采取稳健的资产配置策略，主要投资于固定收益类品种，强调资产配置的均衡，分散风险。严格管理权益类品种的投资比例，把握相对确定的股票二级市场投资机会。在控制投资组合下行风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在债券、股票及现金等类别资产间的分配比例。 （二）债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。 1、久期管理策略 久期管理策略是债券型基金最基本的投资策略。久期管理策略在本质上是一种自上而下的策略，其目的在于通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。 2、品种选择策略 综合考虑收益性、流动性和风险性，进行主动性的品种选择，主要

	包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。 3、信用债（含资产支持证券）投资策略 本基金投资的信用债券（含资产支持证券，不包含可转债及可交换债，下同）的信用评级需在 AA+级（含）以上，投资于信用评级为 AA+级信用债的比例不高于信用债资产的 50%，投资于信用评级为 AAA 级及以上信用债的比例不低于信用债资产的 50%。 4、可转换债券、可交换债券投资策略 本基金将对所有可转换债券、可交换债券所对应的股票进行基本面分析，采用定量分析和定性分析相结合的方式精选具有良好成长潜力且估值合理的标的股票，分享标的股票上涨的收益。 （三）国债期货投资策略 基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。 （四）信用衍生品投资策略 本基金将根据风险管理的原则，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，在信用衍生品投资中根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品的投资，以管理投资组合信用风险敞口为主要目的。 （五）股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。 （六）港股通标的股票投资策略 港股通标的股票投资策略方面，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将优先把基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股通标的股票纳入本基金的股票投资组合。		
业绩比较基准	中债-新综合全价（总值）指数收益率*90%+中证 800 指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%		
风险收益特征	本基金属于债券型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金若投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。		
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 A	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 C	
下属分级基金的交易代码	019673	019674	
报告期末下属分级基金的份额总额	55,605,064.77 份	46,540,082.07 份	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 A	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 C
1. 本期已实现收益	87,240.37	15,503.78
2. 本期利润	122,024.60	45,705.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0016	0.0007
4. 期末基金资产净值	59,345,392.81	49,284,416.79
5. 期末基金份额净值	1.0673	1.0590

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.11%	0.03%	1.48%	0.13%	-1.37%	-0.10%
过去六个月	-0.94%	0.12%	1.42%	0.12%	-2.36%	0.00%
过去一年	0.63%	0.12%	2.00%	0.11%	-1.37%	0.01%
自基金合同 生效起至今	6.73%	0.12%	6.73%	0.12%	0.00%	0.00%

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2024 年 4 月 16 日-2026 年 6 月 30 日

汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.02%	0.03%	1.48%	0.13%	-1.46%	-0.10%
过去六个月	-1.11%	0.12%	1.42%	0.12%	-2.53%	0.00%

过去一年	0.27%	0.12%	2.00%	0.11%	-1.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.90%	0.12%	6.73%	0.12%	-0.83%	0.00%

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2024 年 4 月 16 日-2026 年 6 月 30 日

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

汇丰晋信慧鑫6个月持有期债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年04月16日-2026年06月30日)



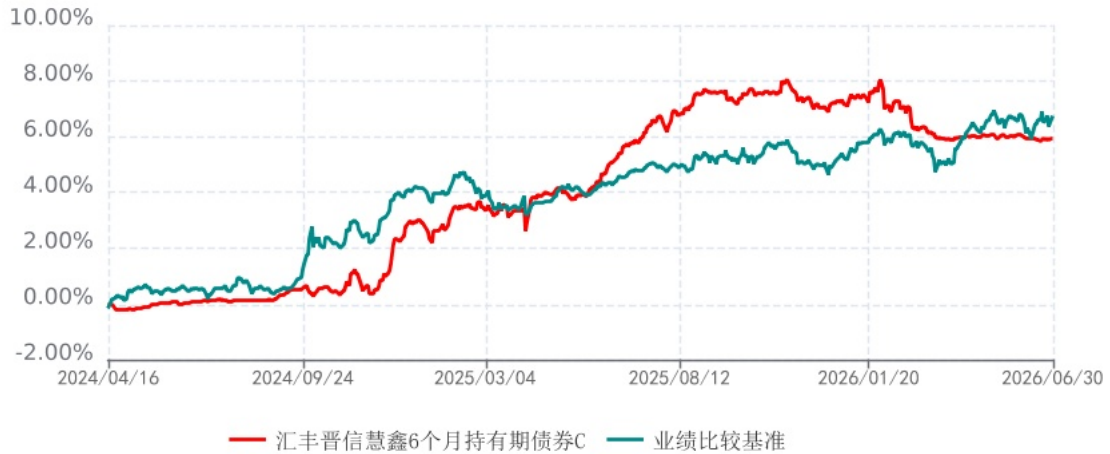
注：

1. 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
2. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2024 年 10 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
3. 本基金业绩比较基准：中债-新综合全价（总值）指数收益率*90%+中证 800 指数收益率*8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。
4. 本基金业绩比较基准中的中债-新综合全价（总值）指数收益率是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中。
5. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证 800 指数、中证港股通综合指数成份股在报告期产生的股票红利收

益。

汇丰晋信慧鑫6个月持有期债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年04月16日-2026年06月30日)



注：

1. 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
2. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2024 年 10 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
3. 本基金业绩比较基准：中债-新综合全价（总值）指数收益率*90%+中证 800 指数收益率*8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。
4. 本基金业绩比较基准中的中债-新综合全价（总值）指数收益率是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中。
5. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证 800 指数、中证港股通综合指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴刘	汇丰晋信基金	2024-07-06	-	11.5 年	吴刘先生，硕

	管理有限公司 总经理助理、 固定收益投资 部总监兼汇丰 晋信 2016 生 命周期开放式 证券投资基 金、汇丰晋信 丰盈债券型证 券投资基金、 汇丰晋信慧鑫 六个月持有期 债券型证券投资 基金、汇丰 晋信慧悦混合 型证券投资基 金、汇丰晋信 慧盈混合型证 券投资基金和 汇丰晋信慧泰 债券型证券投资 基金基金经 理				士研究生。曾任中汇信息技术（上海）有限公司职员、交通银行股份有限公司投资经理、中信银行股份有限公司投资经理、信银理财有限责任公司固收投资条线团队负责人及条线总经理助理，汇丰晋信基金管理有限公司汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资部总监兼汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金和汇丰晋信慧泰债券型证券投资基金基金经理。
刘洋	汇丰晋信丰宁	2024-08-10	-	9 年	刘洋先生，博

	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、汇丰晋信绿色债券型证券投资基金和汇丰晋信慧泰债券型证券投资基金基金经理				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、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金经理，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、汇丰晋信绿色
--	---	--	--	--	---

					债券型证券投资基金和汇丰晋信慧泰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遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，中国经济延续总体平稳运行态势，但结构分化较一季度进一步显现。生产端保持韧性，4 月、5 月和 6 月制造业采购经理指数（PMI）分别为 50.3%、50.0%和 50.3%，整体围绕荣枯线窄幅波动，其中 6 月生产指数和新订单指数分别回升至 51.4%和 51.2%，显示制造业景气度有所修复。5 月规模以上工业增加值同比增长 4.5%，先进制造和出口链条仍是经济的重要支撑。需求端来看，外需表现仍然相对较强，前 5 个月我国货物贸易出口同比保持较快增长，5 月出口同比增长 19.4%，对生产和名义增长形成支撑。但内需修复仍不均衡，5 月社会消费品零售总额同比下降 0.6%，1—5 月固定资产投资同比下降 4.1%。价格方面，4 月、5 月 CPI 同比均上涨 1.2%，5 月 PPI 同比上涨 3.9%，涨幅较 4 月扩大，价格回升主要受到上游资源品、能源及部分先进制造需求等因素影响，向终端需求的传导仍不充分。

政策层面，二季度宏观政策总体保持支持性取向。4 月中央政治局会议强调，我国经济持续稳中向好的基础还需进一步巩固，要用好用足宏观政策，精准有效实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。增强货币政策前瞻性灵活性针对性，保持流动性充裕；持续优化财政支出结构，兜牢基层“三保”底线。

债券市场方面，二季度资金面总体维持相对平稳，基本面偏弱和经济弱复苏仍是债券市场的重要决定因素。10 年期国债收益率由一季度末约 1.82%附近震荡下行至 6 月末约 1.73%，期间受到价格修复、政府债供给、跨季资金面和风险偏好变化等因素扰动，但长端利率整体仍处于低位。信用债方面，在债基配置需求、票息需求等共同作用下表现相对较强，但低利差环境下信用挖掘和流动性管理的重要性进一步上升。

股票市场方面，二季度权益市场较一季度明显修复，但结构和交易层面的分化较为极致。报告期内，上证指数、沪深 300 和创业板指均有所上涨，其中科技成长和高弹性资产表现相对占优，半导体、通信等方向受产业趋势和业绩预期支撑涨幅居前；板块之间的收益差距扩大，成交也明显向少数高辨识度主线品种集中。相比之下，地产链、传统消费、部分金融和红利资产等低估值方向相对承压，多数个股的实际收益体验弱于主要指数，反映指数修复并不等同于市场整体普涨。市场由一季度的总量修复预期逐步转向对产业趋势、盈利兑现和资金拥挤度的集中定价，后续存在从极致风格向基本面、估值和风险收益匹配度再平衡的内在需求。

可转债市场跟随权益市场风险偏好修复，整体先上后下。报告期内，中证转债指数总体收涨，成交维持较高活跃度，但转债整体估值仍处于相对偏高水平。同时，本轮权益市场主线主要集中在少数科技成长和高弹性行业，可转债正股中与上述主线高度匹配、且价格和溢价率仍具性价比的标的相对有限，导致转债市场的弹性弱于权益主线。在此环境下，管理上需要更加重视正股基本面、转债价格和溢价率的匹配，控制高价高溢价品种在波动放大时对组合净值的影响。

本报告期内，本基金延续固收+产品定位，以绝对收益和回撤控制为主要目标。权益和转债方面，在二季度市场修复过程中适度参与结构性机会，重点关注估值波动相对可控、基本面稳定性较强、与组合风险收益目标匹配的方向；对于涨幅较大、估值扩张较快或交易拥挤度较高的品种，本基金保持较为谨慎的仓位管理，并在市场波动放大阶段降低高弹性敞口。二季度股票市场的上涨主要集中在少数高弹性成长方向，低估值、稳健型资产相对表现偏弱。本报告期内，本基金没有明显追逐高波动热点，部分低估值和防御属性较强的持仓阶段性影响了组合相对收益，但其估值安全边际和

波动特征与低波动固收+产品的风险收益定位相匹配。后续本基金将继续在控制回撤和净值波动的基础上，关注市场风格再平衡过程中低估值稳健资产和优质转债的配置机会。债券方面，保持较好的流动性，同时根据资金面和利率波动适当把握交易机会，力争在控制净值波动的基础上提升组合收益稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.11%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%；本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,526,901.71	1.38
	其中：股票	1,526,901.71	1.38
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	100,860,196.40	91.47
	其中：债券	100,860,196.40	91.47
	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	4,500,000.00	4.08
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付 金合计	2,028,648.17	1.84
8	其他资产	1,348,504.40	1.22
9	合计	110,264,250.68	100.00

注：权益投资中未通过沪港通机制投资香港股票；通过深港通机制投资香港股票金额 105,476.71 元，占基金资产净值的比例为 0.10%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	555,372.00	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	778,896.00	0.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	87,157.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,421,425.00	1.31

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	52,946.81	0.05
金融	52,529.90	0.05
合计	105,476.71	0.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰海通	18,500	336,700.00	0.31
2	601377	兴业证券	45,900	277,236.00	0.26

3	002648	卫星化学	10,300	241,947.00	0.22
4	601688	华泰证券	8,000	164,960.00	0.15
5	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.11
6	603259	药明康德	700	87,157.00	0.08
7	002078	太阳纸业	6,400	79,936.00	0.07
8	300502	新易盛	100	60,700.00	0.06
9	600585	海螺水泥	3,200	54,240.00	0.05
10	00883	中国海洋石油	3,000	52,946.81	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	91,704,797.98	84.42
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	9,155,398.42	8.43
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	100,860,196.40	92.85

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019785	25 国债 13	330,000	33,416,640.82	30.76
2	019782	25 国债 12	160,000	16,044,878.90	14.77
3	019778	25 国债 09	94,000	9,403,991.78	8.66
4	019761	24 国债 24	90,000	9,049,951.23	8.33
5	019792	25 国债 19	70,000	7,073,446.30	6.51

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,660.33
2	应收证券清算款	1,300,287.62
3	应收股利	6,955.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	601.25

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,348,504.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110073	国投转债	6,031,575.39	5.55
2	128129	青农转债	3,123,823.03	2.88

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 A	汇丰晋信慧鑫 6 个月持有期债券 C
报告期期初基金份额总额	95,402,176.70	86,795,624.34
报告期期间基金总申购份额	200,231.56	328,112.95
减：报告期期间基金总赎回份额	39,997,343.49	40,583,655.22
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	55,605,064.77	46,540,082.07

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日