# 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

**2024 年年度報告**
2024年12月31日

汇丰晋信

# 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

## 2024年年度報告

## 2024年12月31日

基金管理人：滙豐晉信基金管理有限公司
基金託管人：交通銀行股份有限公司
送出日期：2025年03月31日

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金
2024年12月31日基金年度報告
向香港投資者提供的資料

在2024年12月31日基金年度報告中所提及的基金，除滙豐晉信大盤股票型證券投資基金和滙豐晉信動態策略混合型證券投資基金滙豐晉信（如適用）外，其他基金在香港未獲香港證券及期貨事務監察委員會認可及並非供香港居民投資。

香港證券及期貨事務監察委員會的有關認可並非對本基金的推薦或認許，亦非對本基金的商業利弊或其表現作出保證，更不代表本基金適合所有投資者，亦非認許其適合任何特定投資者或投資者類別。

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金只有H類別份額可供香港投資者認購。

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited
（滙豐投資基金（香港）有限公司）
香港代表
2025年3月31日

## §1 重要提示及目錄

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人交通銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於2025年3月28日複核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證複核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募説明書及其更新。

香港證監會認可不等如對該計劃作出推介或認許，亦不是對該計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

本報告期自2024年01月01日起至2024年12月31日止。

## 1.2 目錄


**§1 重要提示及目錄** . . . 3
1.1 重要提示 . . . 3
1.2 目錄 . . . 4
**§2 基金簡介** . . . 6
2.1 基金基本情況 . . . 6
2.2 基金產品說明 . . . 7
2.3 基金管理人和基金託管人 . . . 8
2.4 信息披露方式 . . . 8
2.5 其他相關資料 . . . 8
**§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況** . . . 9
3.1 主要會計數據和財務指標 . . . 9
3.2 基金淨值表現 . . . 10
3.3 過去三年基金的利潤分配情況 . . . 17
**§4 管理人報告** . . . 18
4.1 基金管理人及基金經理情況 . . . 18
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明 . . . 21
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明 . . . 21
4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明 . . . 22
4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望 . . . 23
4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況 . . . 23
4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明 . . . 24
4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明 . . . 25
4.9 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明 . . . 25
**§5 託管人報告** . . . 25
5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明 . . . 25
5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明 . . . 25
5.3 託管人對本年度報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見 . . . 25
**§6 審計報告** . . . 26
6.1 審計報告基本信息 . . . 26
6.2 審計報告的基本內容 . . . 26
**§7 年度財務報表** . . . 29
7.1 資產負債表 . . . 29
7.2 利潤表 . . . 31
7.3 淨資產變動表 . . . 33
7.4 報表附註 . . . 35

**§8 投資組合報告** 74
8.1 期末基金資產組合情況 74
8.2 報告期末按行業分類的境內股票投資組合 75
8.3 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細 76
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動 78
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合 82
8.6 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細 82
8.7 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細 82
8.8 報告期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細 82
8.9 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細 82
8.10 本基金投資股指期貨的投資政策 82
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況説明 82
8.12 投資組合報告附註 83
8.13 投資組合報告(供香港投資人參閱) 84
**§9 基金份額持有人信息** 86
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構 86
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況 87
9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況 87
**§10 開放式基金份額變動** 88
**§11 重大事件揭示** 88
11.1 基金份額持有人大會決議 88
11.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動 88
11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟 89
11.4 基金投資策略的改變 89
11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況 89
11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況 90
11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況 91
11.8 其他重大事件 94
**§12 影響投資者決策的其他重要信息** 96
12.1 報告期內單一投資者持有基金淨值比例達到或超過20%的情況 96
12.2 影響投資者決策的其他重要信息 96
**§13 備查文件目錄** 97
13.1 備查文件目錄 97
13.2 存放地點 97
13.3 查閱方式 97

## §2 基金簡介

### 2.1 基金基本情況

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名稱 | 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金 | | |
| 基金簡稱 | 滙豐晉信大盤股票 | | |
| 基金主代碼 | 540006 | | |
| 基金運作方式 | 契約型開放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2009年06月24日 | | |
| 基金管理人 | 滙豐晉信基金管理有限公司 | | |
| 基金託管人 | 交通銀行股份有限公司 | | |
| 報告期末基金份額總額 | 598,767,403.73份 | | |
| 基金合同存續期 | 不定期 | | |
| 下屬分級基金的基金簡稱 | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C |
| 下屬分級基金的交易代碼 | 540006 | 960000 | 019243 |
| 報告期末下屬分級基金的份額總額 | 536,688,229.58份 | 45,183,877.64份 | 16,895,296.51份 |

註：本基金自2015年12月30日起增加H類份額，自2023年11月13日起增加C類份額。

## 2.2 基金產品説明

| | |
|---|---|
| 投資目標 | 通過投資於盈利預期持續穩定增長，在各行業中具有領先地位的大盤藍籌型股票，在合理控制風險的基礎上，追求穩健的分紅收益及長期資本利得，實現基金資產持續超越業績比較基準的收益。 |
| 投資策略 | 1、資產配置策略<br>根據本基金所奉行的「較高倉位、藍籌公司、精選研究」的投資理念和「研究創造價值」的股票精選策略，在投資決策中，本基金僅根據精選的各類證券的風險收益特徵的相對變化，適度的調整確定基金資產在股票、債券及現金等類別資產間的分配比例。<br><br>2、行業配置策略<br>行業研究員通過分析行業特徵，定期提出行業投資評級和配置建議。行業比較分析師綜合內、外部研究資源，結合宏觀基本面分析等狀況，提出重點行業配置比重的建議。<br><br>3、股票資產投資策略<br>本基金專注於分析大盤股特有的競爭優勢，基金管理人將對初選股票給予全面的價值、成長分析，並結合行業地位分析，優選出具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌型股票進行投資。 |
| 業績比較基準 | 滬深300指數*90%+同業存款利率*10%。 |
| 風險收益特徵 | 本基金屬於股票型基金產品，在開放式基金中，其預期風險和收益水平高於債券型基金和混合型基金，屬於風險水平較高的基金產品。本基金主要投資於大盤藍籌股票，在股票型基金中屬於中等風險水平的投資產品。 |

### 2.3 基金管理人和基金託管人

| 項目 | | 基金管理人 | 基金託管人 |
|---|---|---|---|
| 名稱 | | 滙豐晉信基金管理有限公司 | 交通銀行股份有限公司 |
| 信息披露負責人 | 姓名 | 周慧 | 方圓 |
| | 聯繫電話 | 021-20376868 | 95559 |
| | 電子郵箱 | compliance@hsbcjt.cn | fangy_20@bankcomm.com |
| 客戶服務電話 | | 021-20376888 | 95559 |
| 傳真 | | 021-20376999 | 021-62701216 |
| 註冊地址 | | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓 | 中國(上海)自由貿易試驗區銀城中路188號 |
| 辦公地址 | | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓 | 中國(上海)長寧區仙霞路18號 |
| 郵政編碼 | | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | | 劉鵬飛 | 任德奇 |

### 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金選定的信息披露報紙名稱 | *《證券時報》* |
| 登載基金年度報告正文的管理人互聯網網址 | www.hsbcjt.cn |
| 基金年度報告備置地點 | 滙豐晉信基金管理有限公司：中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓；交通銀行股份有限公司：中國(上海)長寧區仙霞路18號 |

### 2.5 其他相關資料

| 項目 | 名稱 | 辦公地址 |
|---|---|---|
| 會計師事務所 | 普華永道中天會計師事務所(特殊普通合夥) | 上海市黃浦區湖濱路202號企業天地2號樓普華永道中心11樓 |
| 註冊登記機構 | 滙豐晉信基金管理有限公司 | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓 |

## §3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況

### 3.1 主要會計數據和財務指標

金額單位：人民幣元

| 3.1.1 期間數據和指標 | 2024年 | | | 2023年 | | | 2022年 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C |
| 本期已實現收益 | 126,678,409.74 | 4,216,449.73 | 6,925,358.19 | 47,298,663.72 | 7,408,332.00 | -519,420.76 | -333,779,427.86 | -30,823,686.86 | - |
| 本期利潤 | 251,132,759.39 | 7,807,222.65 | 6,637,350.66 | -75,786,159.85 | -1,632,591.68 | -1,758,137.74 | -521,388,538.35 | -49,009,025.98 | - |
| 加權平均基金份額本期利潤 | 0.4286 | 0.1498 | 0.3040 | -0.1890 | -0.0254 | -0.2157 | -1.5272 | -0.6357 | - |
| 本期加權平均淨值利潤率 | 11.38% | 9.83% | 8.05% | -4.91% | -1.61% | -5.90% | -35.04% | -35.87% | - |
| 本期基金份額淨值增長率 | 10.31% | 10.16% | 9.84% | -2.91% | -2.94% | -3.37% | -28.28% | -28.29% | - |
| **3.1.2 期末數據和指標** | 2024年末 | | | 2023年末 | | | 2022年末 | | |
| 期末可供分配利潤 | 1,634,298,357.08 | 55,640,754.02 | 51,119,882.53 | 1,344,036,130.50 | 62,033,561.06 | 25,845,488.88 | 915,777,545.87 | 85,201,618.98 | - |
| 期末可供分配基金份額利潤 | 3.0452 | 1.2314 | 3.0257 | 2.6670 | 1.0802 | 2.6649 | 2.7768 | 1.1253 | - |
| 期末基金資產淨值 | 2,170,986,586.66 | 74,093,608.89 | 68,019,779.76 | 1,847,992,273.47 | 85,487,639.66 | 35,546,677.44 | 1,245,567,671.25 | 116,123,459.55 | - |
| 期末基金份額淨值 | 4.0452 | 1.6398 | 4.0260 | 3.6670 | 1.4886 | 3.6652 | 3.7768 | 1.5337 | - |
| **3.1.3 累計期末指標** | 2024年末 | | | 2023年末 | | | 2022年末 | | |
| 基金份額累計淨值增長率 | 328.76% | 63.98% | 6.14% | 288.67% | 48.86% | -3.37% | 300.31% | 53.37% | - |

註：
①本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用和信用減值損失後的餘額；本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益；
②期末可供分配利潤，採用期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數（為期末餘額，不是當期發生數）；
③上述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用（例如，開放式基金的申購贖回費、紅利再投資費、基金轉換費等），計入費用後實際收益水平要低於所列數字。
④本基金自2015年12月30日起增加H類份額，自2023年11月13日起增加C類份額。

## 3.2 基金淨值表現

### 3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

**滙豐晉信大盤股票A**

| 階段 | 份額淨值增長率① | 份額淨值增長率標準差② | 業績比較基準收益率③ | 業績比較基準收益率標準差④ | ① – ③ | ② – ④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 過去三個月 | –4.29% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.44% | 0.01% |
| 過去六個月 | 9.35% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –2.97% | 0.17% |
| 過去一年 | 10.31% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –2.94% | 0.33% |
| 過去三年 | –23.18% | 1.29% | –18.21% | 1.06% | –4.97% | 0.23% |
| 過去五年 | 7.92% | 1.34% | –3.36% | 1.11% | 11.28% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 328.76% | 1.38% | 25.79% | 1.27% | 302.97% | 0.11% |

註：
過去三個月指2024年10月1日－2024年12月31日
過去六個月指2024年7月1日－2024年12月31日
過去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
過去三年指2022年1月1日－2024年12月31日
過去五年指2020年1月1日－2024年12月31日
自基金合同生效起至今指2009年6月24日－2024年12月31日

**滙豐晉信大盤股票H**

| 階段 | 份額淨值增長率① | 份額淨值增長率標準差② | 業績比較基準收益率③ | 業績比較基準收益率標準差④ | ① – ③ | ② – ④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 過去三個月 | –4.29% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.44% | 0.01% |
| 過去六個月 | 9.31% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –3.01% | 0.17% |
| 過去一年 | 10.16% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –3.09% | 0.33% |
| 過去三年 | –23.33% | 1.29% | –18.21% | 1.06% | –5.12% | 0.23% |
| 過去五年 | 7.56% | 1.34% | –3.36% | 1.11% | 10.92% | 0.23% |
| 成立至今 | 63.98% | 1.27% | 4.62% | 1.09% | 59.36% | 0.18% |

註：
過去三個月指2024年10月1日－2024年12月31日
過去六個月指2024年7月1日－2024年12月31日
過去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
過去三年指2022年1月1日－2024年12月31日
過去五年指2020年1月1日－2024年12月31日
成立至今指2015年12月30日－2024年12月31日

**滙豐晉信大盤股票C**

| 階段 | 份額淨值增長率① | 份額淨值增長率標準差② | 業績比較基準收益率③ | 業績比較基準收益率標準差④ | ① – ③ | ② – ④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 過去三個月 | –4.39% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.54% | 0.01% |
| 過去六個月 | 9.09% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –3.23% | 0.17% |
| 過去一年 | 9.84% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –3.41% | 0.33% |
| 成立至今 | 6.14% | 1.46% | 8.78% | 1.15% | –2.64% | 0.31% |

註：
過去三個月指2024年10月1日－2024年12月31日
過去六個月指2024年7月1日－2024年12月31日
過去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
成立至今指2023年11月13日－2024年12月31日

### 3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

滙豐晉信大盤股票A累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖
（2009年6月24日至2024年12月31日）

註： 1. 按照基金合同的約定，本基金的股票投資比例範圍為基金資產的85%-95%，其中，本基金將不低於80%的股票資產投資於國內A股市場上具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌股票。本基金固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的5%-15%，其中現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的投資比例不低於基金資產淨值的5%。按照基金合同的約定，本基金自基金合同生效日起不超過6個月內完成建倉，截止2009年12月24日，本基金的各項投資比例已達到基金合同約定的比例。

2. 報告期內本基金的業績比較基準＝滬深300指數*90%＋同業存款利率*10%。

3. 上述基金淨值增長率的計算已包含本基金所投資股票在報告期產生的股票紅利收益。同期業績比較基準收益率的計算未包含滬深300指數成份股在報告期產生的股票紅利收益。

滙豐晉信大盤股票H累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖
（2015年12月30日至2024年12月31日）

註：

1. 按照基金合同的約定，本基金的股票投資比例範圍為基金資產的85%-95%，其中，本基金將不低於80%的股票資產投資於國內A股市場上具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌股票。本基金固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的5%-15%，其中現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的投資比例不低於基金資產淨值的5%。

2. 報告期內本基金的業績比較基準 = 滬深300指數*90% + 同業存款利率*10%。

3. 上述基金淨值增長率的計算已包含本基金所投資股票在報告期產生的股票紅利收益。同期業績比較基準收益率的計算未包含滬深300指數成份股在報告期產生的股票紅利收益。

4. 本基金自2015年12月30日起增加H類份額。

滙豐晉信大盤股票C累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖
（2023年11月13日至2024年12月31日）

註：

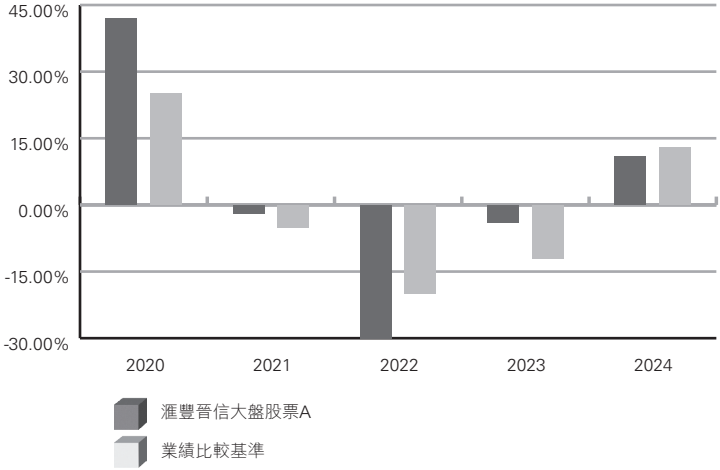
1. 按照基金合同的約定，本基金的股票投資比例範圍為基金資產的85%-95%，其中，本基金將不低於80%的股票資產投資於國內A股市場上具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌股票。本基金固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的5%-15%，其中現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的投資比例不低於基金資產淨值的5%。

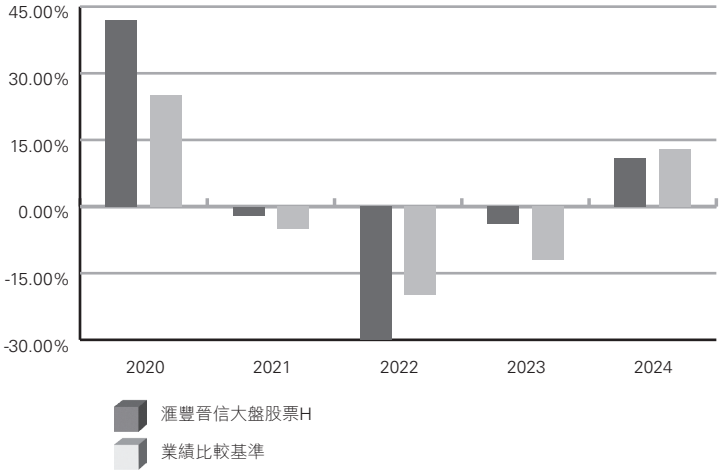
2. 報告期內本基金的業績比較基準 = 滬深300指數*90% + 同業存款利率*10%。

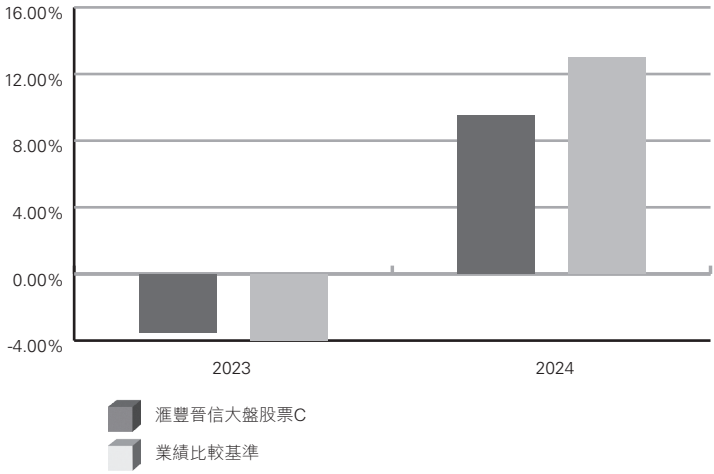
3. 上述基金淨值增長率的計算已包含本基金所投資股票在報告期產生的股票紅利收益。同期業績比較基準收益率的計算未包含滬深300指數成份股在報告期產生的股票紅利收益。

4. 本基金自2023年11月13日起增加C類份額。

### 3.2.3 過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較






註：本基金自2023年11月13日起增加C類份額，截至2024年12月31日C類份額成立未滿五年。

本基金C類份額成立當年按實際存續期計算，不按整個自然年度進行折算。

### 3.3 過去三年基金的利潤分配情況

無。

## §4 管理人報告

### 4.1 基金管理人及基金經理情況

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

滙豐晉信基金管理有限公司經中國證券監督管理委員會批准，於2005年11月16日正式成立。公司由山西信託股份有限公司與滙豐環球投資管理（英國）有限公司合資設立，註冊資本為2億元人民幣，註冊地在上海。截止2024年12月31日，公司共管理39只開放式基金：滙豐晉信2016生命週期開放式證券投資基金（2006年5月23日成立）、滙豐晉信龍騰混合型證券投資基金（2006年9月27日成立）、滙豐晉信動態策略混合型證券投資基金（2007年4月9日成立）、滙豐晉信2026生命週期證券投資基金（2008年7月23日成立）、滙豐晉信平穩增利中短債債券型證券投資基金（自2020年11月19日起，原滙豐晉信平穩增利債券型證券投資基金轉型為滙豐晉信平穩增利中短債債券型證券投資基金）、滙豐晉信大盤股票型證券投資基金（2009年6月24日成立）、滙豐晉信中小盤股票型證券投資基金（2009年12月11日成立）、滙豐晉信低碳先鋒股票型證券投資基金（2010年6月8日成立）、滙豐晉信消費紅利股票型證券投資基金（2010年12月8日成立）、滙豐晉信科技先鋒股票型證券投資基金（2011年7月27日成立）、滙豐晉信貨幣市場基金（2011年11月2日成立）、滙豐晉信恒生A股行業龍頭指數證券投資基金（2012年8月1日成立）、滙豐晉信雙核策略混合型證券投資基金（2014年11月26日成立）、滙豐晉信新動力混合型證券投資基金（2015年2月11日成立）、滙豐晉信智造先鋒股票型證券投資基金（2015年9月30日成立）、滙豐晉信大盤波動精選股票型證券投資基金（2016年3月11日成立）、滙豐晉信滬港深股票型證券投資基金（2016年11月10日成立）、滙豐晉信珠三角區域發展混合型證券投資基金（2017年6月2日成立）、滙豐晉信價值先鋒股票型證券投資基金（2018年11月14日成立）、滙豐晉信港股通精選股票型證券投資基金（2019年3月20日成立）、滙豐晉信港股通雙核策略混合型證券投資基金（2019年8月2日成立）、滙豐晉信慧盈混合型證券投資基金（2020年7月30日成立）、滙豐晉信中小盤低波動策略股票型證券投資基金（2020年8月13日成立）、滙豐晉信惠安純債63個月定期開放債券型證券投資基金（2020年10月29日成立）、滙豐晉信創新先鋒股票型證券投資基金（2021年3月16日成立）、滙豐晉信核心成長混合型證券投資基金（2021年5月24日成立）、滙豐晉信醫療先鋒混合型證券投資基金（2021年7月12日成立）、滙豐晉信研究精選混合型證券投資基金（2022年1月21日成立）、滙豐晉信慧悅混合型證券投資基金（2022年3月3日成立）、滙豐晉信時代先鋒混合型證券投資基金（2022年6月8日成立）、滙豐晉信豐盈債券型證券投資基金（2022年8月16日成立）、滙豐晉信策略優選混合型證券投資基金（2022年9月14日成立）、滙豐晉信龍頭優勢混合型證券投資基金（2022年9月27日成立）、滙豐晉信豐寧三個月定期開放債券型證券投資基金（2022年12月20日成立）、滙豐晉信慧嘉債券型證券投資基金（2023年1月17日成立）、滙豐晉信中證同業存單AAA指數7天持有期證券投資基金（2023年12月12日成立）、滙豐晉信慧鑫六個月持有期債券型證券投資基金（2024年4月16日成立）、滙豐晉信養老目標日期2036一年持有期混合型基金中基金(FOF)（2024年6月12日成立）和滙豐晉信綠色債券型證券投資基金（2024年12月11日成立）。

### 4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理簡介

| 姓名 | 職務 | 任本基金的基金經理（助理）期限 | | 證券從業年限 | 説明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任職日期 | 離任日期 | | |
| 閔良超 | 滙豐晉信基金管理有限公司股票研究總監，滙豐晉信2026生命週期證券投資基金、滙豐晉信新動力混合型證券投資基金、滙豐晉信大盤股票型證券投資基金、滙豐晉信滬港深股票型證券投資基金基金經理 | 2023-03-18 | – | 11 | 閔良超先生，碩士研究生。曾任平安證券股份有限公司研究員、滙豐晉信基金管理有限公司研究員、高級宏觀策略分析師、助理研究總監、研究副總監，現任滙豐晉信基金管理有限公司股票研究總監，滙豐晉信2026生命週期證券投資基金、滙豐晉信新動力混合型證券投資基金、滙豐晉信大盤股票型證券投資基金、滙豐晉信滬港深股票型證券投資基金基金經理。 |

| 姓名 | 職務 | 任本基金的基金經理（助理）期限 | | 證券從業年限 | 說明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任職日期 | 離任日期 | | |
| 閆湜 | 滙豐晉信基金管理有限公司基金經理助理 | 2021-12-25 | 2024-12-20 | 12 | 閆湜女士，碩士研究生。曾任易方達基金管理有限公司信用研究員、富國基金管理有限公司基金經理助理、萬家基金管理有限公司基金經理助理，滙豐晉信基金管理有限公司基金經理助理。現任滙豐晉信貨幣市場基金、滙豐晉信惠安純債63個月定期開放債券型證券投資基金基金經理。 |

註：

1. 上述任職日期為根據公司決定確定的聘任日期，離任日期為根據公司決定確定的解聘日期；首任基金經理任職日期為基金合同生效日。

2. 證券從業年限為證券投資相關的工作經歷年限。

### 4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的説明

本報告期內，本基金管理人嚴格遵守《證券投資基金法》及其他相關法規、中國證監會的規定和基金合同的約定，本著誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，在嚴格控制風險的前提下，為基金份額持有人謀求最大利益。報告期內未有損害基金份額持有人利益的行為。

### 4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項説明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

為了保護公司所管理的不同投資組合得到公平對待，充分保護基金份額持有人的合法權益，滙豐晉信基金管理有限公司制定了《滙豐晉信基金管理有限公司公平交易制度》。

《滙豐晉信基金管理有限公司公平交易制度》規定：在投資管理活動中應公平對待不同投資組合，嚴禁直接或者通過與第三方的交易安排在不同投資組合之間進行利益輸送。《公平交易制度》適用於投資的全過程，用以規範基金投資相關工作，包括授權、研究分析、投資決策、交易執行、以及投資管理過程中涉及的行為監控和業績評估等投資管理活動相關的各個環節。

公司對公平交易的控制方法包括：1、交易所市場的公平交易均通過恒生投資交易系統實現，通過開啟公平交易程序，由恒生投資交易系統強制執行；2、銀行間交易由執行交易員按照價格優先、比例分配的公平交易的原則實行分配，確保各投資組合獲得公平的交易機會；3、對於債券一級市場申購、非公開發行股票申購等以基金管理人名義進行的交易，各投資組合經理在交易前獨立地確定各投資組合的交易價格和數量，交易部按照價格優先、比例分配的原則對交易結果進行分配；4、使用衡泰風險管理與績效評估系統定期進行報告分析，對公平交易的情況進行檢查。

#### 4.3.2 公平交易制度的執行情況

報告期內，公司各相關部門均按照公平交易制度的規定進行投資管理活動、研究分析活動以及交易活動。同時，我公司切實履行了各項公平交易行為監控、分析評估及報告義務，並建立了相關記錄。

報告期內，公司對連續四個季度期間內、不同時間窗下（如日內、3日內、5日內）公司管理的不同投資組合同向交易的交易價差進行分析。公司對不同組合同一證券同向交易的溢價率均值進行T檢驗，對於未通過T檢驗的交易，再根據同向交易占優比、貢獻率、自由度、交易數量和交易時間等指標進行專項計算分析，計算分析結果顯示：以上各指標值均在合理正常的範圍之內，未發現不同投資組合間相近交易日內的同向交易存在不公平及存在利益輸送的行為。

報告期內，未發現本基金管理人存在不公平對待不同投資組合，或直接或者通過與第三方的交易安排在不同投資組合之間進行利益輸送的行為。

#### 4.3.3 異常交易行為的專項說明

公司制定了《滙豐晉信基金管理有限公司異常交易監控與報告制度》，加強防範不同投資組合之間可能發生的利益輸送，密切監控可能會損害基金份額持有人利益的異常交易行為。

報告期內，公司按照《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《滙豐晉信基金管理有限公司異常交易監控與報告制度》的規定，對同一投資組合以及不同投資組合中的交易行為進行了監控分析，未發現異常交易行為。

報告期內未發生各投資組合參與的交易所公開競價同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該證券當日成交量的5%的情形。

### 4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

#### 4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2024年，主要的寬基指數均有一定幅度的漲幅。尤其是9月份政策轉向之後，市場迎來了較為明顯的估值擴張。2024年尤其是上半年，基於經濟弱復蘇的假設下，本產品採取了相對均衡的配置思路，同時在市值上也做到了相對中性。行業配置上，一方面增加配置內需相關的板塊，同時對於經濟相關度較低的板塊也進行配置，反映的是我們既關注內需復蘇的可能性，同時又認為這個復蘇可能只是弱復蘇。從結果上來看，由於內需的復蘇不及預期，內需相關板塊的表現較弱，但同時在TMT板塊中，年初配置的人工智慧板塊和消費電子板塊，對於今年上半年的貢獻比較突出。到了2024年下半年，市場的交易主線切換至科技板塊，而本產品更多的配置到了內需相關的資產，尤其是具備成本優勢的優質公司我們認為已經有了比較好的性價比。

#### 4.4.2 報告期內基金的業績表現

本報告期內，本基金A類淨值變化幅度為10.31%，同期業績比較基準為13.25%，本基金A類落後同期比較基準為2.94%；本基金H類本報告期內淨值變化幅度為10.16%，同期業績比較基準為13.25%，本基金H類落後同期比較基準為3.09%；本基金C類本報告期內淨值變化幅度為9.84%，同期業績比較基準為13.25%，本基金C類落後同期比較基準為3.41%。

### 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

大盤基金專注於分析大盤股特有的競爭優勢，基金管理人將對初選股票給予全面的價值、成長分析，並結合行業地位分析，優選出具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌型股票進行投資。

展望2025年，我們有理由相信市場會迎來破局和重構。市場破局的第一個變量是政策的發力。近期市場已經迎來了政策的顯著發力，貨幣政策端通過降息和降低存量房貸利率來降實際有效利率，財政政策預計也會持續發力。市場破局的第二個變量是行業供需結構的反轉，很多行業在過去幾年面臨的較大挑戰是供給產能的過剩，積極的信號在於很多行業已經開始縮減資本開支甚至降低開工率來應對價格的通縮，進入2025年，在需求弱復蘇的假設下，部分行業有望率先走出反轉，這也是預期市場會有不錯表現的基本面支撐。

向前看，我們圍繞以下幾個方向進行配置：1）我們看好2025年經濟的需求結構性恢復，同時供給同時受到約束的順週期板塊，有望帶來較大的價格和盈利恢復彈性。2）在經濟相關度較低的板塊或者由自身產業週期邏輯來驅動的成長細分方向，主要集中部分消費及高端製造細分領域。

### 4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

報告期內，本基金管理人在公司內部監察稽核工作中本著規範運作、防範風險和保護基金份額持有人利益的原則，由獨立於各業務部門的監察稽核人員對公司的經營管理、基金的投資運作以及員工行為規範等方面進行日常監控、定期檢查和專項檢查，及時發現問題並督促有關部門整改，並定期製作監察稽核報告報送監管機構。

本報告期內，基金管理人內部監察稽核主要工作如下：

1. 通過定期檢查和專項檢查的方式對公司日常經營活動和基金投資運作進行合規性監控，發現問題及時要求相關部門和相關人員及時解決處理，並跟蹤問題的處理結果，對相關員工開展針對性的風險教育，防範在公司經營和基金投資運作中可能發生的風險。

2. 按照法律法規和中國證監會規定，及時、準確、完整地完成公司和基金的各項法定信息披露文件，並在規定媒介進行披露，確保基金投資人和公眾及時、準確和完整地獲取公司和基金的各項公開信息。

3. 定期和不定期地向中國證監會、上海證監局、中國證券投資基金業協會和人民銀行等監管機構報送各類文件報告，確保監管機構文件報備工作的準確性和及時性。

4. 加強對公司業務部門的合規監察工作，並將監察結果報告發予相關部門主管溝通，對各項制度進行更新，提出改進建議，提請和督促業務部門進行跟蹤和改善。

5. 對基金募集申請材料、市場宣傳推介材料、基金代銷協議、基金交易單元租用協議等文件等進行嚴密的事前合法合規審核，以及完成公司其他日常法律事務工作。

6. 定期為公司員工舉辦公司合規制度的培訓，並就新頒佈法律法規舉辦專項合規培訓，向公司員工宣傳合規守法的經營理念，強化公司的合規文化；對投資管理以及銷售業務部門員工開展專項培訓，以進一步規範和完善基金投資以及銷售行為。

7. 根據監管部門的要求，定期完成監察稽核報告，報送公司董事會審閱。

本基金管理人將繼續致力於建立一個高效的內部控制體系，一貫本著誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，不斷提高監察稽核工作的科學性和有效性，努力防範各種風險，為基金份額持有人謀求最大利益，切實保證基金安全、合規運作。

**4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明**

本基金的基金管理人為確保及時、準確、公正、合理地進行基金份額淨值計價，更好地保護基金份額持有人的合法權益，根據企業會計準則、中國證監會相關規定、中國證券投資基金業協會相關指引，結合本基金基金合同關於估值的約定，對基金所持有的投資品種進行估值。

公司特設估值委員會作為公司基金估值的主要決策機關。估值委員會負責組織制定和適時修訂基金估值政策和程序，指導和監督整個估值流程。估值委員會成員具有多年的證券、基金從業經驗，熟悉相關法律法規，具備投資、研究、風險管理、法律合規以及基金估值運作等方面的專業勝任能力，估值委員會各方不存在任何重大利益衝突。基金經理可參與估值原則和方法的討論，但不參與估值原則和方法的最終決策和日常估值的執行。

本基金管理人已與中央國債登記結算有限責任公司及中證指數有限公司簽署服務協議，由其按約定分別提供銀行間同業市場及交易所交易的證券品種的估值數據。

### 4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的説明

根據基金相關法律法規和基金合同的要求，結合本基金實際運作情況，本報告期內，本基金暫不進行利潤分配。

### 4.9 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的説明

本報告期內未發生連續二十個工作日出現基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

## §5 託管人報告

### 5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，基金託管人在滙豐晉信大盤股票型證券投資基金的託管過程中，嚴格遵守了《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同、託管協議，盡職盡責地履行了託管人應盡的義務，不存在任何損害基金持有人利益的行為。

### 5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的説明

本報告期內，滙豐晉信基金管理有限公司在滙豐晉信大盤股票型證券投資基金投資運作、基金資產淨值的計算、基金份額申購贖回價格的計算、基金費用開支、基金收益分配等問題上，託管人未發現損害基金持有人利益的行為。

### 5.3 託管人對本年度報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見

本報告期內，由滙豐晉信基金管理有限公司編制並經託管人複核審查的有關滙豐晉信大盤股票型證券投資基金的年度報告中財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告相關內容、投資組合報告等內容真實、準確、完整。

## §6 審計報告

### 6.1 審計報告基本信息

| | |
|---|---|
| 財務報表是否經過審計 | 是 |
| 審計意見類型 | 標準無保留意見 |
| 審計報告編號 | 普華永道中天審字(2025)第20695號 |

### 6.2 審計報告的基本內容

| | |
|---|---|
| 審計報告標題 | 審計報告 |
| 審計報告收件人 | 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金全體基金份額持有人： |
| 審計意見 | （一）我們審計的內容<br><br>我們審計了滙豐晉信大盤股票型證券投資基金（以下簡稱「滙豐晉信大盤股票基金」）的財務報表，包括2024年12月31日的資產負債表，2024年度的利潤表和淨資產變動表以及財務報表附註。<br><br>（二）我們的意見<br><br>我們認為，後附的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則和在財務報表附註中所列示的中國證券監督管理委員會（以下簡稱「中國證監會」）、中國證券投資基金業協會（以下簡稱「中國基金業協會」）發佈的有關規定及允許的基金行業實務操作編制，公允反映了滙豐晉信大盤股票基金2024年12月31日的財務狀況以及2024年度的經營成果和淨資產變動情況。 |
| 形成審計意見的基礎 | 我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的「註冊會計師對財務報表審計的責任」部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。<br><br>按照中國註冊會計師職業道德守則，我們獨立於滙豐晉信大盤股票基金，並履行了職業道德方面的其他責任。 |

| | |
|---|---|
| 強調事項 | – |
| 其他事項 | – |
| 其他信息 | – |
| 管理層和治理層對財務報表的責任 | 滙豐晉信大盤股票基金的基金管理人滙豐晉信基金管理有限公司(以下簡稱「基金管理人」)管理層負責按照企業會計準則和中國證監會、中國基金業協會發佈的有關規定及允許的基金行業實務操作編制財務報表，使其實現公允反映，並設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。<br><br>在編制財務報表時，基金管理人管理層負責評估滙豐晉信大盤股票基金的持續經營能力，披露與持續經營相關的事項(如適用)，並運用持續經營假設，除非基金管理人管理層計劃清算滙豐晉信大盤股票基金、終止運營或別無其他現實的選擇。<br><br>基金管理人治理層負責監督滙豐晉信大盤股票基金的財務報告過程。 |
| 註冊會計師對財務報表審計的責任 | 我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證，並出具包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證，但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致，如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策，則通常認為錯報是重大的。<br><br>在按照審計準則執行審計工作的過程中，我們運用職業判斷，並保持職業懷疑。同時，我們也執行以下工作：<br><br>(一) 識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險；設計和實施審計程序以應對這些風險，並獲取充分、適當的審計證據，作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或淩駕於內部控制之上，未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。 |

| | | |
|---|---|---|
| | （二）瞭解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。<br><br>（三）評價基金管理人管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。<br><br>（四）對基金管理人管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對滙豐晉信大盤股票基金持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的信息。然而，未來的事項或情況可能導致滙豐晉信大盤股票基金不能持續經營。<br><br>（五）評價財務報表的總體列報（包括披露）、結構和內容，並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。<br><br>我們與基金管理人治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。 | |
| 會計師事務所的名稱 | 普華永道中天會計師事務所（特殊普通合夥） | |
| 註冊會計師的姓名 | 葉爾甸 | 段黃霖 |
| 會計師事務所的地址 | 上海市黃浦區湖濱路202號企業天地2號樓普華永道中心11樓 | |
| 審計報告日期 | 2025-03-26 | |

## §7 年度財務報表

### 7.1 資產負債表

會計主體：滙豐晉信大盤股票型證券投資基金
報告截止日：2024年12月31日

單位：人民幣元

| 資產 | 附註號 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **資產：** | | | |
| 貨幣資金 | 7.4.7.1 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |
| 結算備付金 | | 955,260.88 | 2,157,455.37 |
| 存出保證金 | | 731,225.55 | 623,232.05 |
| 交易性金融資產 | 7.4.7.2 | 2,131,923,533.95 | 1,907,614,387.32 |
| 其中： 股票投資 | | 2,131,923,533.95 | 1,847,686,110.40 |
| 基金投資 | | – | – |
| 債券投資 | | – | 59,928,276.92 |
| 資產支持證券投資 | | – | – |
| 貴金屬投資 | | – | – |
| 其他投資 | | – | – |
| 衍生金融資產 | 7.4.7.3 | – | – |
| 買入返售金融資產 | 7.4.7.4 | – | – |
| 應收清算款 | | – | – |
| 應收股利 | | – | – |
| 應收申購款 | | 395,751.17 | 3,246,043.03 |
| 遞延所得稅資產 | | – | – |
| 其他資產 | 7.4.7.5 | – | – |
| **資產總計** | | 2,323,092,705.06 | 1,975,513,124.89 |

| 負債和淨資產 | 附註號 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **負債：** | | | |
| 短期借款 | | – | – |
| 交易性金融負債 | | – | – |
| 衍生金融負債 | 7.4.7.3 | – | – |
| 賣出回購金融資產款 | | – | – |
| 應付清算款 | | 4,175,090.69 | 1,035,729.30 |
| 應付贖回款 | | 1,298,914.07 | 735,231.91 |
| 應付管理人報酬 | | 2,982,400.51 | 2,481,511.20 |
| 應付託管費 | | 497,066.73 | 413,585.22 |
| 應付銷售服務費 | | 23,801.98 | 13,574.53 |
| 應付投資顧問費 | | – | – |
| 應交稅費 | | – | – |
| 應付利潤 | | – | – |
| 遞延所得稅負債 | | – | – |
| 其他負債 | 7.4.7.6 | 1,015,455.77 | 1,806,902.16 |
| **負債合計** | | 9,992,729.75 | 6,486,534.32 |
| **淨資產：** | | | |
| 實收基金 | 7.4.7.7 | 572,040,981.68 | 537,111,410.13 |
| 未分配利潤 | 7.4.7.8 | 1,741,058,993.63 | 1,431,915,180.44 |
| 淨資產合計 | | 2,313,099,975.31 | 1,969,026,590.57 |
| **負債和淨資產總計** | | 2,323,092,705.06 | 1,975,513,124.89 |

註：報告截止日2024年12月31日，基金份額總額為598,767,403.73份，其中A類基金份額總額為536,688,229.58份，基金份額淨值4.0452元；C類基金份額總額為16,895,296.51份，基金份額淨值4.0260元；H類基金份額總額為45,183,877.64份，基金份額淨值1.6398元。

## 7.2 利潤表

會計主體：滙豐晉信大盤股票型證券投資基金
本報告期：2024年01月01日至2024年12月31日

單位：人民幣元

| 項目 | 附註號 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **一、營業總收入** | | 307,646,163.72 | –50,115,263.85 |
| 1.利息收入 | | 1,036,593.63 | 923,229.36 |
| 其中： 存款利息收入 | 7.4.7.9 | 1,036,593.63 | 923,229.36 |
| 債券利息收入 | | – | – |
| 資產支持證券利息收入 | | – | – |
| 買入返售金融資產收入 | | – | – |
| 其他利息收入 | | – | – |
| 2.投資收益（損失以「-」填列） | | 177,626,232.82 | 82,053,262.35 |
| 其中：股票投資收益 | 7.4.7.10 | 113,929,481.81 | 57,547,242.11 |
| 基金投資收益 | | – | – |
| 債券投資收益 | 7.4.7.11 | 70,043.08 | 191,388.40 |
| 資產支持證券投資收益 | 7.4.7.12 | – | – |
| 貴金屬投資收益 | 7.4.7.13 | – | – |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | – | – |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |
| 其他投資收益 | | – | – |
| 3.公允價值變動收益（損失以「-」號填列） | 7.4.7.16 | 127,757,115.04 | –133,364,464.23 |
| 4.匯兑收益（損失以「-」號填列） | | – | – |
| 5.其他收入（損失以「-」號填列） | 7.4.7.17 | 1,226,222.23 | 272,708.67 |

| 項目 | 附註號 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **減：二、營業總支出** | | 42,068,831.02 | 29,061,625.42 |
| 1.管理人報酬 | 7.4.10.2.1 | 35,575,065.55 | 24,657,014.73 |
| 2.託管費 | 7.4.10.2.2 | 5,929,177.61 | 4,109,502.36 |
| 3.銷售服務費 | 7.4.10.2.3 | 326,577.86 | 16,619.32 |
| 4.投資顧問費 | | – | – |
| 5.利息支出 | | – | – |
| 其中：賣出回購金融資產支出 | | – | – |
| 6.信用減值損失 | | – | – |
| 7.稅金及附加 | | – | – |
| 8.其他費用 | 7.4.7.18 | 238,010.00 | 278,489.01 |
| **三、利潤總額（虧損總額以「-」號填列）** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |
| 減：所得稅費用 | | – | – |
| **四、淨利潤（淨虧損以「-」號填列）** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |
| **五、其他綜合收益的稅後淨額** | | – | – |
| **六、綜合收益總額** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |

### 7.3 淨資產變動表

會計主體：滙豐晉信大盤股票型證券投資基金
本報告期：2024年01月01日至2024年12月31日

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 實收基金 | 未分配利潤 | 淨資產合計 |
| 一、上期期末淨資產 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |
| 二、本期期初淨資產 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |
| 三、本期增減變動額（減少以「-」號填列） | 34,929,571.55 | 309,143,813.19 | 344,073,384.74 |
| （一）、綜合收益總額 | – | 265,577,332.70 | 265,577,332.70 |
| （二）、本期基金份額交易產生的淨資產變動數（淨資產減少以「-」號填列） | 34,929,571.55 | 43,566,480.49 | 78,496,052.04 |
| 其中：1.基金申購款 | 314,616,326.64 | 858,655,642.69 | 1,173,271,969.33 |
| 2.基金贖回款 | –279,686,755.09 | –815,089,162.20 | –1,094,775,917.29 |
| （三）、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動（淨資產減少以「-」號填列） | – | – | – |
| 四、本期期末淨資產 | 572,040,981.68 | 1,741,058,993.63 | 2,313,099,975.31 |

| 項目 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 實收基金 | 未分配利潤 | 淨資產合計 |
| 一、上期期末淨資產 | 360,711,965.95 | 1,000,979,164.85 | 1,361,691,130.80 |
| 二、本期期初淨資產 | 360,711,965.95 | 1,000,979,164.85 | 1,361,691,130.80 |
| 三、本期增減變動額(減少以「-」號填列) | 176,399,444.18 | 430,936,015.59 | 607,335,459.77 |
| (一)、綜合收益總額 | – | –79,176,889.27 | –79,176,889.27 |
| (二)、本期基金份額交易產生的淨資產變動數(淨資產減少以「-」號填列) | 176,399,444.18 | 510,112,904.86 | 686,512,349.04 |
| 其中：1.基金申購款 | 233,105,658.74 | 674,448,620.86 | 907,554,279.60 |
| 2.基金贖回款 | –56,706,214.56 | –164,335,716.00 | –221,041,930.56 |
| (三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動(淨資產減少以「-」號填列) | – | – | – |
| 四、本期期末淨資產 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |

報表附註為財務報表的組成部分。

本報告7.1至7.4財務報表由下列負責人簽署：

| 李選進 | 苑忠磊 | 張薇 |
|---|---|---|
| 基金管理人負責人 | 主管會計工作負責人 | 會計機構負責人 |

## 7.4 報表附註

### 7.4.1 基金基本情況

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金（以下簡稱「本基金」）經中國證券監督管理委員會（以下簡稱「中國證監會」）證監基金字[2009]第343號《關於同意滙豐晉信大盤股票型證券投資基金募集的批復》核准，由滙豐晉信基金管理有限公司依照《中華人民共和國證券投資基金法》和《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同》負責公開募集。本基金為契約型開放式，存續期限不定，首次設立募集不包括認購資金利息共募集人民幣2,884,896,208.13元，業經畢馬威華振會計師事務所（特殊普通合夥）（原「畢馬威華振會計師事務所有限公司」）KPMG-B(2009)CRNo.0031驗資報告予以驗證。經向中國證監會備案，《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同》於2009年6月24日正式生效，基金合同生效日的基金份額總額為2,885,554,241.41份基金份額，其中認購資金利息折合658,033.28份基金份額。本基金的基金管理人為滙豐晉信基金管理有限公司，基金託管人為交通銀行股份有限公司。根據《關於滙豐晉信大盤股票型證券投資基金增設基金份額類別並修改基金合同的公告》以及更新的《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金招募説明書》的有關規定，自2015年12月28日起，本基金根據銷售對象的不同，將基金份額分為不同的類別。在中國內地銷售的、為中國內地投資者設立的份額，稱為A類基金份額；在中國香港地區銷售的、為中國香港投資者設立的份額，稱為H類基金份額。本基金A類基金份額、H類基金份額單獨設置基金代碼，分別計算和公告基金份額淨值和基金份額累計淨值。除非基金管理人在未來條件成熟後另行公告開通相關業務，本基金不同基金份額類別之間不得互相轉換。根據《關於滙豐晉信大盤股票型證券投資基金增加C類基金份額並修改基金合同及託管協議等事項的公告》以及更新的《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金招募説明書》，自2023年11月13日起，本基金新增C類基金份額，該類收費模式不收取申購費，而是從基金資產中計提銷售服務費。本基金原有的A類基金份額與H類基金份額收費模式不變。本基金A類基金份額、C類基金份額均為在內地銷售的、為內地投資者設立的份額類別。H類基金份額為在香港銷售機構銷售的、為香港投資者設立的份額類別。由於基金費用收取方式的不同，本基金A類基金份額、C類基金份額和H類基金份額將分別計算並公告基金份額淨值。根據《中華人民共和國證券投資基金法》和《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同》的有關規定，本基金的投資範圍為國內依法發行上市的股票、國債、金融債、企業債、央行票據、可轉換債券、權證、資產支持證券以及國家證券監管機構允許基金投資的其它金融工具。本基金的投資組合比例為：股票投資比例範圍為基金資產的85%-95%，權證投資比例範圍為基金資產淨值的0-3%。固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的5%-15%，其中現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的投資比例不低於基金資產淨值的5%。本基金將不低於80%的股票資產投資於國內A股市場上具有盈利持續穩定增長、價值低估、且在各行業中具有領先地位的大盤藍籌股票。本基金的業績比較基準為：滬深300指數 ×90%+同業存款利率 ×10%。

本財務報表由本基金的基金管理人滙豐晉信基金管理有限公司於2025年3月26日批准報出。

### 7.4.2 會計報表的編制基礎

本基金的財務報表按照財政部於2006年2月15日及以後期間頒佈的《企業會計準則－基本準則》、各項具體會計準則、《資產管理產品相關會計處理規定》及其他相關規定（以下合稱「企業會計準則」）、中國證監會頒佈的《證券投資基金信息披露XBRL模板第3號＜年度報告和中期報告＞》、中國證券投資基金業協會（以下簡稱「中國基金業協會」）頒佈的《證券投資基金會計核算業務指引》、《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同》和在財務報表附註7.4.4所列示的中國證監會、中國基金業協會發佈的有關規定及允許的基金行業實務操作編制。

本財務報表以持續經營為基礎編制。

### 7.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本基金2024年度財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金2024年12月31日的財務狀況以及2024年度的經營成果和淨資產變動情況等有關信息。

### 7.4.4 重要會計政策和會計估計

*7.4.4.1 會計年度*

本基金會計年度為公曆1月1日起至12月31日止。

*7.4.4.2 記帳本位幣*

本基金的記帳本位幣為人民幣。

*7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類*

金融工具，是指形成一方的金融資產並形成其他方的金融負債或權益工具的合同。當本基金成為金融工具合同的一方時，確認相關的金融資產、金融負債或權益工具。

(1) 金融資產

金融資產於初始確認時分類為：以攤余成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。金融資產的分類取決於本基金管理金融資產的業務模式和金融資產的合同現金流量特徵。本基金現無金融資產分類為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產。

債務工具

本基金持有的債務工具是指從發行方角度分析符合金融負債定義的工具，分別採用以下兩種方式進行計量：
以攤余成本計量：

本基金管理以攤余成本計量的金融資產的業務模式為以收取合同現金流量為目標，且以攤余成本計量的金融資產的合同現金流量特徵與基本借貸安排相一致，即在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。本基金持有的以攤余成本計量的金融資產主要為銀行存款、買入返售金融資產和其他各類應收款項等。

以公允價值計量且其變動計入當期損益：

本基金將持有的未劃分為以攤余成本計量的債務工具，以公允價值計量且其變動計入當期損益。本基金持有的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產主要為債券投資，在資產負債表中以交易性金融資產列示。

權益工具

權益工具是指從發行方角度分析符合權益定義的工具。本基金將對其沒有控制、共同控制和重大影響的權益工具(主要為股票投資)按照公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為交易性金融資產。

(2) 金融負債

金融負債於初始確認時分類為以攤余成本計量的金融負債和以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金目前暫無金融負債分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金持有的以攤余成本計量的金融負債包括賣出回購金融資產款和其他各類應付款項等。

(3) 衍生金融工具

本基金將持有的衍生金融工具以公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為衍生金融資產／負債。

*7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認*

金融資產或金融負債在初始確認時以公允價值計量。對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產和金融負債，相關交易費用計入當期損益；對於支付的價款中包含的債券起息日或上次除息日至購買日止的利息，確認為應計利息，包含在交易性金融資產的帳面價值中。對於其他類別的金融資產和金融負債，相關交易費用計入初始確認金額。

對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，按照公允價值進行後續計量；對於應收款項和其他金融負債採用實際利率法，以攤余成本進行後續計量。

本基金對於以攤余成本計量的金融資產，以預期信用損失為基礎確認損失準備。

本基金考慮有關過去事項、當前狀況以及對未來經濟狀況的預測等合理且有依據的信息，以發生違約的風險為權重，計算合同應收的現金流量與預期能收到的現金流量之間差額的現值的概率加權金額，確認預期信用損失。

於每個資產負債表日，本基金對於處於不同階段的金融工具的預期信用損失分別進行計量。金融工具自初始確認後信用風險未顯著增加的，處於第一階段，本基金按照未來12個月內的預期信用損失計量損失準備；金融工具自初始確認後信用風險已顯著增加但尚未發生信用減值的，處於第二階段，本基金按照該工具整個存續期的預期信用損失計量損失準備；金融工具自初始確認後已經發生信用減值的，處於第三階段，本基金按照該工具整個存續期的預期信用損失計量損失準備。

對於在資產負債表日具有較低信用風險的金融工具，本基金假設其信用風險自初始確認後並未顯著增加，認定為處於第一階段的金融工具，按照未來12個月內的預期信用損失計量損失準備。本基金對於處於第一階段和第二階段的金融工具，按照其未扣除減值準備的帳面餘額和實際利率計算利息收入。對於處於第三階段的金融工具，按照其帳面餘額減已計提減值準備後的攤余成本和實際利率計算利息收入。

本基金將計提或轉回的損失準備計入當期損益。

金融資產滿足下列條件之一的，予以終止確認：(1) 收取該金融資產現金流量的合同權利終止；(2) 該金融資產已轉移，且本基金將金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬轉移給轉入方；或者 (3) 該金融資產已轉移，雖然本基金既沒有轉移也沒有保留金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬，但是放棄了對該金融資產控制。

金融資產終止確認時，其帳面價值與收到的對價的差額，計入當期損益。

當金融負債的現時義務全部或部分已經解除時，終止確認該金融負債或義務已解除的部分。終止確認部分的帳面價值與支付的對價之間的差額，計入當期損益。

*7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則*

本基金持有的股票投資和債券投資按如下原則確定公允價值並進行估值：

(1) 存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易且最近交易日後未發生影響公允價值計量的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。有充足證據表明估值日或最近交易日的市場交易價格不能真實反映公允價值的，應對市場交易價格進行調整，確定公允價值。與上述投資品種相同，但具有不同特徵的，應以相同資產或負債的公允價值為基礎，並在估值技術中考慮不同特徵因素的影響。特徵是指對資產出售或使用的限制等，如果該限制是針對資產持有者的，那麼在估值技術中不應將該限制作為特徵考慮。此外，基金管理人不應考慮因大量持有相關資產或負債所產生的溢價或折價。

(2) 當金融工具不存在活躍市場，採用在當前情況下適用並且有足夠可利用數據和其他信息支持的估值技術確定公允價值。採用估值技術時，優先使用可觀察輸入值，只有在無法取得相關資產或負債可觀察輸入值或取得不切實可行的情況下，才可以使用不可觀察輸入值。

(3) 如經濟環境發生重大變化或證券發行人發生影響金融工具價格的重大事件，應對估值進行調整並確定公允價值。

*7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷*

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金 1) 具有抵銷已確認金額的法定權利且該種法定權利現在是可執行的；且 2) 交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

*7.4.4.7 實收基金*

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平准金分攤部分後的餘額。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

本基金發行的份額作為可回售工具具備以下特徵：(1)賦予基金份額持有人在基金清算時按比例份額獲得該基金淨資產的權利，這裡所指基金淨資產是扣除所有優先於該基金份額對基金資產要求權之後的剩餘資產；這裡所指按比例份額是清算時將基金的淨資產分拆為金額相等的單位，並且將單位金額乘以基金份額持有人所持有的單位數量；(2)該工具所屬的類別次於其他所有工具類別，即本基金份額在歸屬於該類別前無須轉換為另一種工具，且在清算時對基金資產沒有優先於其他工具的要求權；(3)該工具所屬的類別中（該類別次於其他所有工具類別），所有工具具有相同的特徵（例如它們必須都具有可回售特徵，並且用於計算回購或贖回價格的公式或其他方法都相同）；(4)除了發行方應當以現金或其他金融資產回購或贖回該基金份額的合同義務外，該工具不滿足金融負債定義中的任何其他特徵；(5)該工具在存續期內的預計現金流量總額，應當實質上基於該基金存續期內基金的損益、已確認淨資產的變動、已確認和未確認淨資產的公允價值變動（不包括本基金的任何影響）。

可回售工具，是指根據合同約定，持有方有權將該工具回售給發行方以獲取現金或其他金融資產的權利，或者在未來某一不確定事項發生或者持有方死亡或退休時，自動回售給發行方的金融工具。

本基金沒有同時具備下列特徵的其他金融工具或合同：(1)現金流量總額實質上基於基金的損益、已確認淨資產的變動、已確認和未確認淨資產的公允價值變動（不包括該基金或合同的任何影響）；(2)實質上限制或固定了上述工具持有方所獲得的剩餘回報。

本基金將實收基金分類為權益工具，列報於淨資產。

*7.4.4.8 損益平准金*

損益平准金包括已實現平准金和未實現平准金。已實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益占淨資產比例計算的金額。未實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益占淨資產比例計算的金額。損益平准金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤／（累計虧損）。

*7.4.4.9 收入／(損失)的確認和計量*

股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益。債券投資在持有期間應取得的按票面利率(對於貼現債為按發行價計算的利率)或合同利率計算的利息扣除在適用情況下由債券發行企業代扣代繳的個人所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動扣除按票面利率(對於貼現債為按發行價計算的利率)或合同利率計算的利息後的淨額確認為公允價值變動損益；於處置時，其處置價格與初始確認金額之間的差額扣除相關交易費用後的淨額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的則按直線法計算。

*7.4.4.10 費用的確認和計量*

本基金的管理人報酬、託管費和銷售服務費在費用涵蓋期間按基金合同約定的費率和計算方法逐日確認。以攤余成本計量的金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的則按直線法計算。

*7.4.4.11 基金的收益分配政策*

本基金同一類別的每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，A類基金份額和C類基金份額的基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅除權日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資；H類基金份額的收益分配僅採用現金方式。若期末未分配利潤中的未實現部分為正數，包括基金經營活動產生的未實現損益以及基金份額交易產生的未實現平准金等，則期末可供分配利潤的金額為期末未分配利潤中的已實現部分；若期末未分配利潤的未實現部分為負數，則期末可供分配利潤的金額為期末未分配利潤，即已實現部分相抵未實現部分後的餘額。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從淨資產轉出。

*7.4.4.12 分部報告*

本基金以內部組織結構、管理要求、內部報告制度為依據確定經營分部，以經營分部為基礎確定報告分部並披露分部信息。經營分部是指本基金內同時滿足下列條件的組成部分：(1) 該組成部分能夠在日常活動中產生收入、發生費用；(2) 本基金的基金管理人能夠定期評價該組成部分的經營成果，以決定向其配置資源、評價其業績；(3) 本基金能夠取得該組成部分的財務狀況、經營成果和現金流量等有關會計信息。如果兩個或多個經營分部具有相似的經濟特徵，並且滿足一定條件的，則合併為一個經營分部。

本基金目前以一個單一的經營分部運作，不需要披露分部信息。

*7.4.4.13 其他重要的會計政策和會計估計*

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：

(1) 對於證券交易所上市的股票，若出現重大事項停牌或交易不活躍（包括漲跌停時的交易不活躍）等情況，本基金根據中國證監會公告 [2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》，根據具體情況採用《關於發佈中基協 (AMAC) 基金行業股票估值指數的通知》提供的指數收益法等估值技術進行估值。

(2) 對於在鎖定期內的非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等流通受限股票，根據中國基金業協會中基協發 [2017]6 號《關於發佈 < 證券投資基金投資流通受限股票估值指引（試行）> 的通知》之附件《證券投資基金投資流通受限股票估值指引（試行）》（以下簡稱「指引」），按估值日在證券交易所上市交易的同一股票的公允價值扣除中證指數有限公司根據指引所獨立提供的該流通受限股票剩餘限售期對應的流動性折扣後的價值進行估值。

(3) 對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種（可轉換債券除外）及在銀行間同業市場交易的固定收益品種，根據中國證監會公告 [2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》及中國基金業協會中基協字 [2022]566 號《關於發佈 < 關於固定收益品種的估值處理標準 > 的通知》之附件《關於固定收益品種的估值處理標準》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種（可轉換債券除外），按照中證指數有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場固定收益品種按照中債金融估值中心有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。

### 7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的説明

*7.4.5.1 會計政策變更的説明*

本基金本報告期未發生會計政策變更。

*7.4.5.2 會計估計變更的説明*

本基金本報告期未發生會計估計變更。

*7.4.5.3 差錯更正的説明*

本基金在本報告期間無須説明的會計差錯更正。

### 7.4.6 税項

根據財政部、國家税務總局財税[2002]128號《關於開放式證券投資基金有關税收問題的通知》、財税[2008]1號《關於企業所得税若干優惠政策的通知》、財税[2012]85號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得税政策有關問題的通知》、財税[2015]101號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得税政策有關問題的通知》、財税[2015]125號《關於內地與香港基金互認有關税收政策的通知》、財税[2016]36號《關於全面推開營業税改征增值税試點的通知》、財税[2016]46號《關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》、財税[2016]70號《關於金融機構同業往來等增值税政策的補充通知》、財税[2016]140號《關於明確金融房地產開發教育輔助服務等增值税政策的通知》、財税[2017]2號《關於資管產品增值税政策有關問題的補充通知》、財税[2017]56號《關於資管產品增值税有關問題的通知》、財税[2017]90號《關於租入固定資產進項税額抵扣等增值税政策的通知》及其他相關財税法規和實務操作，主要税項列示如下：

(1) 資管產品運營過程中發生的增值税應税行為，以資管產品管理人為增值税納税人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值税應税行為，暫適用簡易計税方法，按照3%的徵收率繳納增值税。對資管產品在2018年1月1日前運營過程中發生的增值税應税行為，未繳納增值税的，不再繳納；已繳納增值税的，已納税額從資管產品管理人以後月份的增值税應納税額中抵減。對證券投資基金管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免征增值税，對國債、地方政府債以及金融同業往來利息收入亦免征增值税。資管產品管理人運營資管產品提供的貸款服務，以2018年1月1日起產生的利息及利息性質的收入為銷售額。

(2) 對基金從證券市場中取得的收入，包括買賣股票、債券的差價收入，股票的股息、紅利收入，債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得税。

(3) 對於內地投資者持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由發行債券的企業在向基金支付利息時代扣代繳20%的個人所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，持股期限在1個月以內（含1個月）的，其股息紅利所得全額計入應納稅所得額；持股期限在1個月以上至1年（含1年）的，暫減按50%計入應納稅所得額；持股期限超過1年的，暫免徵收個人所得稅。對基金持有的上市公司限售股，解禁後取得的股息、紅利收入，按照上述規定計算納稅，持股時間自解禁日起計算；解禁前取得的股息、紅利收入繼續暫減按50%計入應納稅所得額。上述所得統一適用20%的稅率計征個人所得稅。對於香港市場投資者通過基金互認持有的基金類別，對基金取得的企業債券利息收入，應由發行債券的企業在向該內地基金分配利息時按照7%的稅率代扣代繳所得稅。對基金從上市公司取得的股息紅利所得，應由內地上市公司向該內地基金分配股息紅利時按照10%的稅率代扣代繳所得稅。

(4) 基金賣出股票按0.1%的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。根據財政部、國家稅務總局公告2023年第39號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》，自2023年8月28日起，證券交易印花稅實施減半徵收。

(5) 本基金的城市維護建設稅、教育費附加和地方教育附加等稅費按照實際繳納增值稅額的適用比例計算繳納。

### 7.4.7 重要財務報表項目的説明

*7.4.7.1 貨幣資金*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |
| 等於： 本金 | 189,066,298.02 | 61,845,422.92 |
| 加：應計利息 | 20,635.49 | 26,584.20 |
| 減：壞賬準備 | – | – |
| 定期存款 | – | – |
| 等於： 本金 | – | – |
| 加：應計利息 | – | – |
| 減：壞賬準備 | – | – |
| 其中： 存款期限1個月以內 | – | – |
| 存款期限1-3個月 | – | – |
| 存款期限3個月以上 | – | – |
| 其他存款 | – | – |
| 等於： 本金 | – | – |
| 加：應計利息 | – | – |
| 減：壞賬準備 | – | – |
| 合計 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |

*7.4.7.2 交易性金融資產*

單位：人民幣元

| 項目 | | 本期末<br>2024年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 應計利息 | 公允價值 | 公允價值變動 |
| 股票 | | 2,102,250,369.57 | – | 2,131,923,533.95 | 29,673,164.38 |
| 貴金屬投資－金交所黃金合約 | | – | – | – | – |
| 債券 | 交易所市場 | – | – | – | – |
| | 銀行間市場 | – | – | – | – |
| | 合計 | – | – | – | – |
| 資產支持證券 | | – | – | – | – |
| 基金 | | – | – | – | – |
| 其他 | | – | – | – | – |
| 合計 | | 2,102,250,369.57 | – | 2,131,923,533.95 | 29,673,164.38 |

| 項目 | | 上年度末<br>2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 應計利息 | 公允價值 | 公允價值變動 |
| 股票 | | 1,945,768,381.06 | – | 1,847,686,110.40 | –98,082,270.66 |
| 貴金屬投資－金交所黃金合約 | | – | – | – | – |
| 債券 | 交易所市場 | – | – | – | – |
| | 銀行間市場 | 59,695,680.00 | 234,276.92 | 59,928,276.92 | –1,680.00 |
| | 合計 | 59,695,680.00 | 234,276.92 | 59,928,276.92 | –1,680.00 |
| 資產支持證券 | | – | – | – | – |
| 基金 | | – | – | – | – |
| 其他 | | – | – | – | – |
| 合計 | | 2,005,464,061.06 | 234,276.92 | 1,907,614,387.32 | –98,083,950.66 |

*7.4.7.3 衍生金融資產／負債*

無。

*7.4.7.4 買入返售金融資產*

7.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

無。

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

*7.4.7.5 其他資產*

無。

*7.4.7.6 其他負債*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 應付券商交易單元保證金 | – | – |
| 應付贖回費 | 4,464.08 | 2,816.89 |
| 應付證券出借違約金 | – | – |
| 應付交易費用 | 810,891.11 | 1,564,085.27 |
| 其中：交易所市場 | 810,891.11 | 1,563,785.27 |
| 銀行間市場 | – | 300.00 |
| 應付利息 | – | – |
| 預提費用 | 200,000.00 | 240,000.00 |
| 其他應付 | 100.58 | – |
| 合計 | 1,015,455.77 | 1,806,902.16 |

*7.4.7.7 實收基金*

7.4.7.7.1　滙豐晉信大盤股票A

金額單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票A） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份額（份） | 帳面金額 |
| 上年度末 | 503,956,142.97 | 503,956,142.97 |
| 本期申購 | 263,423,851.36 | 263,423,851.36 |
| 本期贖回（以「-」號填列） | –230,691,764.75 | –230,691,764.75 |
| 本期末 | 536,688,229.58 | 536,688,229.58 |

註：A類與C類基金份額申購含轉換入份額；贖回含轉換出份額。

7.4.7.7.2　滙豐晉信大盤股票H

金額單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票H） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份額（份） | 帳面金額 |
| 上年度末 | 57,429,880.76 | 23,454,078.60 |
| 本期申購 | – | – |
| 本期贖回（以「-」號填列） | –12,246,003.12 | –5,001,223.73 |
| 本期末 | 45,183,877.64 | 18,452,854.87 |

7.4.7.7.3　滙豐晉信大盤股票C

金額單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票C） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份額（份） | 帳面金額 |
| 上年度末 | 9,698,515.35 | 9,701,188.56 |
| 本期申購 | 51,178,535.38 | 51,192,475.28 |
| 本期贖回（以「-」號填列） | –43,981,754.22 | –43,993,766.61 |
| 本期末 | 16,895,296.51 | 16,899,897.23 |

註：A類與C類基金份額申購含轉換入份額；贖回含轉換出份額。

*7.4.7.8 未分配利潤*

7.4.7.8.1 滙豐晉信大盤股票A

單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票A） | 已實現部分 | 未實現部分 | 未分配利潤合計 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 1,537,133,236.96 | -193,097,106.46 | 1,344,036,130.50 |
| 本期期初 | 1,537,133,236.96 | -193,097,106.46 | 1,344,036,130.50 |
| 本期利潤 | 126,678,409.74 | 124,454,349.65 | 251,132,759.39 |
| 本期基金份額交易產生的變動數 | 85,724,716.84 | -46,595,249.65 | 39,129,467.19 |
| 其中：基金申購款 | 817,592,904.32 | -95,133,497.39 | 722,459,406.93 |
| 基金贖回款 | -731,868,187.48 | 48,538,247.74 | -683,329,939.74 |
| 本期已分配利潤 | - | - | - |
| 本期末 | 1,749,536,363.54 | -115,238,006.46 | 1,634,298,357.08 |

7.4.7.8.2 滙豐晉信大盤股票H

單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票H） | 已實現部分 | 未實現部分 | 未分配利潤合計 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 70,933,426.97 | -8,899,865.91 | 62,033,561.06 |
| 本期期初 | 70,933,426.97 | -8,899,865.91 | 62,033,561.06 |
| 本期利潤 | 4,216,449.73 | 3,590,772.92 | 7,807,222.65 |
| 本期基金份額交易產生的變動數 | -15,593,107.74 | 1,393,078.05 | -14,200,029.69 |
| 其中：基金申購款 | - | - | - |
| 基金贖回款 | -15,593,107.74 | 1,393,078.05 | -14,200,029.69 |
| 本期已分配利潤 | - | - | - |
| 本期末 | 59,556,768.96 | -3,916,014.94 | 55,640,754.02 |

7.4.7.8.3　滙豐晉信大盤股票C

單位：人民幣元

| 項目<br>（滙豐晉信大盤股票C） | 已實現部分 | 未實現部分 | 未分配利潤合計 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 29,561,085.69 | –3,715,596.81 | 25,845,488.88 |
| 本期期初 | 29,561,085.69 | –3,715,596.81 | 25,845,488.88 |
| 本期利潤 | 6,925,358.19 | –288,007.53 | 6,637,350.66 |
| 本期基金份額交易產生的變動數 | 18,272,594.95 | 364,448.04 | 18,637,042.99 |
| 其中：基金申購款 | 156,291,034.29 | –20,094,798.53 | 136,196,235.76 |
| 基金贖回款 | –138,018,439.34 | 20,459,246.57 | –117,559,192.77 |
| 本期已分配利潤 | – | – | – |
| 本期末 | 54,759,038.83 | –3,639,156.30 | 51,119,882.53 |

*7.4.7.9 存款利息收入*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 973,827.08 | 849,883.65 |
| 定期存款利息收入 | – | – |
| 其他存款利息收入 | – | – |
| 結算備付金利息收入 | 52,449.55 | 62,025.71 |
| 其他 | 10,317.00 | 11,320.00 |
| 合計 | 1,036,593.63 | 923,229.36 |

*7.4.7.10 股票投資收益－買賣股票差價收入*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 賣出股票成交總額 | 4,965,521,849.05 | 4,947,698,280.43 |
| 減：賣出股票成本總額 | 4,841,397,747.77 | 4,875,305,187.96 |
| 減：交易費用 | 10,194,619.47 | 14,845,850.36 |
| 買賣股票差價收入 | 113,929,481.81 | 57,547,242.11 |

*7.4.7.11 債券投資收益*

7.4.7.11.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 債券投資收益－利息收入 | 104,123.08 | 250,751.60 |
| 債券投資收益－買賣債券（債轉股及債券到期兑付）差價收入 | –34,080.00 | –59,363.20 |
| 債券投資收益－贖回差價收入 | – | – |
| 債券投資收益－申購差價收入 | – | – |
| 合計 | 70,043.08 | 191,388.40 |

7.4.7.11.2 債券投資收益－買賣債券差價收入

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 賣出債券（債轉股及債券到期兑付）成交總額 | 60,000,000.00 | 45,516,500.00 |
| 減：賣出債券（債轉股及債券到期兑付）成本總額 | 59,695,680.00 | 44,934,038.20 |
| 減：應計利息總額 | 338,400.00 | 641,350.00 |
| 減：交易費用 | – | 475.00 |
| 買賣債券差價收入 | –34,080.00 | –59,363.20 |

7.4.7.11.3 債券投資收益－贖回差價收入

無。

7.4.7.11.4 債券投資收益－申購差價收入

無。

*7.4.7.12 資產支持證券投資收益*

7.4.7.12.1 資產支持證券投資收益項目構成

無。

7.4.7.12.2 資產支持證券投資收益－買賣資產支持證券差價收入

無。

7.4.7.12.3 資產支持證券投資收益－贖回差價收入

無。

7.4.7.12.4 資產支持證券投資收益－申購差價收入

無。

*7.4.7.13 貴金屬投資收益*

7.4.7.13.1 貴金屬投資收益項目構成

無。

7.4.7.13.2 貴金屬投資收益－買賣貴金屬差價收入

無。

7.4.7.13.3 貴金屬投資收益－贖回差價收入

無。

7.4.7.13.4 貴金屬投資收益－申購差價收入

無。

*7.4.7.14 衍生工具收益*

7.4.7.14.1 衍生工具收益－買賣權證差價收入

無。

7.4.7.14.2 衍生工具收益－其他投資收益

無。

*7.4.7.15 股利收益*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投資產生的股利收益 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |
| 其中：證券出借權益補償收入 | – | – |
| 基金投資產生的股利收益 | – | – |
| 合計 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |

*7.4.7.16 公允價值變動收益*

單位：人民幣元

| 項目名稱 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融資產 | 127,757,115.04 | –133,364,464.23 |
| －股票投資 | 127,755,435.04 | –133,434,282.43 |
| －債券投資 | 1,680.00 | 69,818.20 |
| －資產支持證券投資 | – | – |
| －基金投資 | – | – |
| －貴金屬投資 | – | – |
| －其他 | – | – |
| 2.衍生工具 | – | – |
| －權證投資 | – | – |
| 3.其他 | – | – |
| 減：應稅金融商品公允價值變動產生的預估增值稅 | – | – |
| 合計 | 127,757,115.04 | –133,364,464.23 |

*7.4.7.17 其他收入*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金贖回費收入 | 503,710.81 | 243,848.76 |
| 基金轉換費收入 | 722,511.42 | 28,859.91 |
| 合計 | 1,226,222.23 | 272,708.67 |

註：

1. 對A類基金份額持續持有期少於7日的投資者收取1.5%的贖回費，贖回費全額計入基金財產；對A類基金份額持續持有期大於等於7日的投資者收取0.5%的贖回費，不低於贖回費總額25%的部分歸基金財產所有，其餘部分用於支付註冊登記費和其他必要的手續費。

   對C類基金份額持續持有期少於7日的投資者收取1.5%的贖回費，贖回費全額計入基金財產；對C類基金份額持續持有期大於等於7日，小於30日的投資者收取0.5%的贖回費，贖回費全額計入基金財產；其餘部分用於支付註冊登記費和其他必要的手續費；對C類基金份額持續持有期大於等於30日的投資者不收取贖回費。

   A、C類基金份額的轉換費由申購補差費和轉出基金的贖回費兩部分組成，其中贖回費部分按照上述規則歸入轉出基金的基金資產。

2. H類基金份額的贖回費率為0.13%，贖回費總額100%歸入基金資產。H類基金份額暫未開通轉換業務。

*7.4.7.18 其他費用*

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 審計費用 | 80,000.00 | 120,000.00 |
| 信息披露費 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 證券出借違約金 | – | – |
| 匯劃手續費 | 810.00 | 1,289.01 |
| 帳戶維護費 | 36,900.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 300.00 | 1,200.00 |
| 合計 | 238,010.00 | 278,489.01 |

**7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明**

*7.4.8.1 或有事項*

無。

*7.4.8.2 資產負債表日後事項*

無。

### 7.4.9 關聯方關係

| 關聯方名稱 | 與本基金的關係 |
|---|---|
| 滙豐晉信基金管理有限公司(「滙豐晉信」) | 基金管理人、註冊登記機構、基金銷售機構 |
| 交通銀行股份有限公司(「交通銀行」) | 基金託管人、基金銷售機構 |
| 山西信託股份有限公司(「山西信託」) | 基金管理人的股東 |
| 滙豐環球投資管理(英國)有限公司 | 基金管理人的股東 |
| 山西證券股份有限公司(「山西證券」) | 見注釋① |
| 滙豐銀行(中國)有限公司(「滙豐銀行」) | 見注釋② |
| 恒生銀行(中國)有限公司(「恒生銀行」) | 見注釋③ |
| 滙豐前海證券有限責任公司(「滙豐前海」) | 見注釋④ |
| 滙豐人壽保險有限公司(「滙豐人壽」) | 見注釋⑤ |
| 滙豐保險經紀有限公司(「滙豐保險」) | 見注釋⑥ |
| 滙豐投資基金(香港)有限公司(「滙豐投資基金香港」) | 見注釋⑦ |

註：

① 山西證券與本基金管理人的股東－山西信託共同受山西金融投資控股集團有限公司控制。

② 滙豐銀行與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

③ 恒生銀行與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

④ 滙豐前海與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

⑤ 滙豐人壽與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

⑥ 滙豐保險與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

⑦ 滙豐投資基金香港與本基金管理人的股東-滙豐投資管理共同受滙豐控股有限公司控制。

下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

### 7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

*7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易*

7.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

| 關聯方名稱 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金額 | 占當期股票成交總額的比例 | 成交金額 | 占當期股票成交總額的比例 |
| 滙豐前海 | 144,577,753.89 | 1.45% | 73,920,359.89 | 0.70% |
| 山西證券 | 28,359,977.96 | 0.28% | – | – |

7.4.10.1.2 權證交易

無。

7.4.10.1.3 債券交易

無。

7.4.10.1.4 債券回購交易

無。

7.4.10.1.5 應支付關聯方的傭金

金額單位：人民幣元

| 關聯方名稱 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 當期傭金 | 占當期傭金總量的比例 | 期末應付傭金餘額 | 占期末應付傭金總額的比例 |
| 滙豐前海 | 136,757.50 | 1.93% | – | – |
| 山西證券 | 12,362.74 | 0.17% | 12,362.74 | 1.52% |

| 關聯方名稱 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 當期傭金 | 占當期傭金總量的比例 | 期末應付傭金餘額 | 占期末應付傭金總額的比例 |
| 滙豐前海 | 69,920.46 | 0.72% | – | – |
| 山西證券 | – | – | – | – |

註：

1. 上述傭金參考市場價格經本基金的基金管理人與對方協商確定，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取的證管費和經手費的淨額列示。

2. 該類傭金協議的服務範圍還包括傭金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場信息服務等。根據中國證監會公告[2024]3號《公開募集證券投資基金證券交易費用管理規定》，自2024年7月1日起，針對被動股票型基金，不再通過交易傭金支付研究服務、流動性服務等其他費用，針對其他類型基金可以通過交易傭金支付研究服務費用，但不再通過交易傭金支付研究服務之外的其他費用。

*7.4.10.2 關聯方報酬*

7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 當期發生的基金應支付的管理費 | 35,575,065.55 | 24,657,014.73 |
| 其中：應支付銷售機構的客戶維護費 | 10,963,322.13 | 9,827,902.07 |
| 應支付基金管理人的淨管理費 | 24,611,743.42 | 14,829,112.66 |

註：支付基金管理人滙豐晉信的管理人報酬按前一日基金資產淨值1.50%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。其計算公式為：

日管理人報酬＝前一日基金資產淨值X 1.50%/當年天數。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 當期發生的基金應支付的託管費 | 5,929,177.61 | 4,109,502.36 |

註：支付基金託管人交通銀行的託管費按前一日基金資產淨值0.25%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。其計算公式為：

日託管費＝前一日基金資產淨值 × 0.25%/當年天數。

7.4.10.2.3 銷售服務費

單位：人民幣元

| 獲得銷售服務費的各關聯方名稱 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 當期發生的基金應支付的銷售服務費 | | | |
| | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C | 合計 |
| 交通銀行 | 0.00 | 0.00 | 11.05 | 11.05 |
| 滙豐晉信 | 0.00 | 0.00 | 205,727.06 | 205,727.06 |
| 合計 | 0.00 | 0.00 | 205,738.11 | 205,738.11 |

| 獲得銷售服務費的各關聯方名稱 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 當期發生的基金應支付的銷售服務費 | | | |
| | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C | 合計 |
| 交通銀行 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 滙豐晉信 | 0.00 | 0.00 | 16,619.32 | 16,619.32 |
| 合計 | 0.00 | 0.00 | 16,619.32 | 16,619.32 |

註：根據《關於滙豐晉信大盤股票型證券投資基金增加C類基金份額並修改基金合同及託管協議等事項的公告》以及更新的《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金招募説明書》，本基金自2023年11月13日起增設C類基金份額。支付基金銷售機構的銷售服務費按前一日C類基金份額的基金資產淨值0.40%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付給滙豐晉信，再由滙豐晉信計算並支付給各基金銷售機構。A類、H類基金份額不計提銷售服務費，C類基金份額持有人約定的年基金銷售服務費率為0.40%。其計算公式為：C類基金份額日銷售服務費＝前一日C類基金資產淨值X0.40%／當年天數。

*7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易*

無。

*7.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況*

7.4.10.4.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

7.4.10.4.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

無。

*7.4.10.5 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入*

單位：人民幣元

| 關聯方名稱 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末餘額 | 當期利息收入 | 期末餘額 | 當期利息收入 |
| 交通銀行 | 189,086,933.51 | 973,827.08 | 61,872,007.12 | 849,883.65 |

註：本基金的銀行存款由基金託管人交通銀行保管，按銀行同業利率計息。

*7.4.10.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況*

無。

*7.4.10.7 其他關聯交易事項的說明*

無。

**7.4.11 利潤分配情況——固定淨值型貨幣市場基金之外的基金**

無。

### 7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限證券

*7.4.12.1 因認購新發／增發證券而於期末持有的流通受限證券*

無。

*7.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票*

無。

*7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券*

7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

### 7.4.13 金融工具風險及管理

*7.4.13.1 風險管理政策和組織架構*

本基金在日常經營活動中面臨的與這些金融工具相關的風險主要包括信用風險、流動性風險及市場風險。本基金的基金管理人從事風險管理的主要目標是爭取將以上風險控制在限定的範圍之內，使本基金在風險和收益之間取得最佳的平衡以實現「風險和收益相匹配」的風險收益目標。本基金管理人奉行全面風險管理體系的建設，在董事會下設立風險控制與審計委員會，負責制定風險管理的宏觀政策，設定最高風險承受度以及審議批准防範風險和內部控制的政策等；在管理層層面設立風險控制委員會，實施董事會風險控制與審計委員會制定的各項風險管理和內部控制政策；在業務操作層面風險管理職責主要由監察稽核部和風險管理部負責，協調並與各部門合作完成運作風險管理以及進行投資風險分析與績效評估。風險管理部對公司首席執行官負責，監察稽核部向督察長報告工作。

本基金管理人建立了以風險控制委員會為核心的、由督察長、風險控制委員會、監察稽核部、風險管理部和相關業務部門構成的風險管理架構體系。

本基金的基金管理人對於金融工具的風險管理方法是通過結合定性分析和定量分析方法，估測各種風險產生的可能損失。從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重程度和出現風險損失的頻度。而從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用金融工具的特徵，通過特定的風險量化指標、模型、日常的量化報告，確定相應置信程度和風險損失的限度，及時可靠地對各種風險進行監督、檢查和評估，並通過相應決策，將風險控制在可承受的範圍內。

*7.4.13.2 信用風險*

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息等情況，導致基金資產損失和收益變化的風險。

本基金的基金管理人在交易前對交易對手的資信狀況進行了充分的評估。本基金的銀行存款存放在本基金的託管人交通銀行，因而與銀行存款相關的信用風險不重大。本基金在交易所進行的交易均以中國證券登記結算有限責任公司為交易對手完成證券交收和款項清算，違約可能性很小；在銀行間同業市場進行交易前均對交易對手進行信用評估並對證券交割方式進行限制以控制相應的信用風險。

本基金的基金管理人建立了信用風險管理流程，通過對投資品種信用等級評估來控制證券發行人的信用風險，且通過分散化投資以分散信用風險。

於2024年12月31日，本基金無債券投資（2023年12月31日：本基金未持有除國債、央行票據和政策性金融債以外的債券）。

*7.4.13.3 流動性風險*

流動性風險是指基金在履行與金融負債有關的義務時遇到資金短缺的風險。本基金的流動性風險一方面來自於基金份額持有人可隨時要求贖回其持有的基金份額，另一方面來自於投資品種所處的交易市場不活躍而帶來的變現困難或因投資集中而無法在市場出現劇烈波動的情況下以合理的價格變現。

針對兑付贖回資金的流動性風險，本基金的基金管理人每日對本基金的申購贖回情況進行嚴密監控並預測流動性需求，保持基金投資組合中的可用現金頭寸與之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中設計了巨額贖回條款，約定在非常情況下贖回申請的處理方式，控制因開放申購贖回模式帶來的流動性風險，有效保障基金持有人利益。

於2024年12月31日，本基金所承擔的全部金融負債的合約約定到期日均為一個月以內且不計息，可贖回基金份額淨值（淨資產）無固定到期日且不計息，因此帳面餘額即為未折現的合約到期現金流量。

7.4.13.3.1 報告期內本基金組合資產的流動性風險分析

本基金的基金管理人在基金運作過程中嚴格按照《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》等法規的要求對本基金組合資產的流動性風險進行管理，通過獨立的風險管理部門對本基金的組合持倉集中度指標、流通受限制的投資品種比例以及組合在短時間內變現能力的綜合指標等流動性指標進行持續的監測和分析。

本基金投資於一家公司發行的證券市值不超過基金資產淨值的10%，且本基金與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發行的證券不得超過該證券的10%。本基金與由本基金的基金管理人管理的其他開放式基金共同持有一家上市公司發行的可流通股票不得超過該上市公司可流通股票的15%，本基金與由本基金的基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的30%（完全按照有關指數構成比例進行證券投資的開放式基金及中國證監會認定的特殊投資組合不受上述比例限制）。

本基金所持部分證券在證券交易所上市，其餘亦可在銀行間同業市場交易，部分基金資產流通暫時受限制不能自由轉讓的情況參見附註7.4.12。此外，本基金可通過賣出回購金融資產方式借入短期資金應對流動性需求，其上限一般不超過基金持有的債券投資的公允價值。本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過基金資產淨值的15%。於2024年12月31日，本基金無流動性受限資產。

本基金的基金管理人每日對基金組合資產中7個工作日可變現資產的可變現價值進行審慎評估與測算，確保每日確認的淨贖回申請不得超過7個工作日可變現資產的可變現價值。於2024年12月31日，本基金組合資產中7個工作日可變現資產的帳面價值超過經確認的當日淨贖回金額。

同時，本基金的基金管理人通過合理分散逆回購交易的到期日與交易對手的集中度；按照穿透原則對交易對手的財務狀況、償付能力及杠杆水平等進行必要的盡職調查與嚴格的准入管理，以及對不同的交易對手實施交易額度管理並進行動態調整等措施嚴格管理本基金從事逆回購交易的流動性風險和交易對手風險。此外，本基金的基金管理人建立了逆回購交易質押品管理制度：根據質押品的資質確定質押率水平；持續監測質押品的風險狀況與價值變動以確保質押品按公允價值計算足額；並在與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易時，可接受質押品的資質要求與基金合同約定的投資範圍保持一致。

*7.4.13.4 市場風險*

市場風險是指基金所持金融工具的公允價值或未來現金流量因所處市場各類價格因素的變動而發生波動的風險，包括利率風險、外匯風險和其他價格風險。

7.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量受市場利率變動而發生波動的風險。利率敏感性金融工具均面臨由於市場利率上升而導致公允價值下降的風險，其中浮動利率類金融工具還面臨每個付息期間結束根據市場利率重新定價時對於未來現金流影響的風險。

本基金的基金管理人定期對本基金面臨的利率敏感性缺口進行監控，並通過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

本基金持有及承擔的大部分金融資產和金融負債不計息，因此本基金的收入及經營活動的現金流量在很大程度上獨立於市場利率變化。本基金持有的利率敏感性資產主要為銀行存款、結算備付金、存出保證金和債券投資等。

7.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

| 本期末<br>2024年12月31日 | 1年以內 | 1-5年 | 5年以上 | 不計息 | 合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| **資產** | | | | | |
| 貨幣資金 | 189,086,933.51 | – | – | – | 189,086,933.51 |
| 結算備付金 | 955,260.88 | – | – | – | 955,260.88 |
| 存出保證金 | 731,225.55 | – | – | – | 731,225.55 |
| 交易性金融資產 | – | – | – | 2,131,923,533.95 | 2,131,923,533.95 |
| 應收申購款 | – | – | – | 395,751.17 | 395,751.17 |
| **資產總計** | 190,773,419.94 | – | – | 2,132,319,285.12 | 2,323,092,705.06 |
| **負債** | | | | | |
| 應付清算款 | – | – | – | 4,175,090.69 | 4,175,090.69 |
| 應付贖回款 | – | – | – | 1,298,914.07 | 1,298,914.07 |
| 應付管理人報酬 | – | – | – | 2,982,400.51 | 2,982,400.51 |
| 應付託管費 | – | – | – | 497,066.73 | 497,066.73 |
| 應付銷售服務費 | – | – | – | 23,801.98 | 23,801.98 |
| 其他負債 | – | – | – | 1,015,455.77 | 1,015,455.77 |
| **負債總計** | – | – | – | 9,992,729.75 | 9,992,729.75 |
| 利率敏感度缺口 | 190,773,419.94 | – | – | 2,122,326,555.37 | 2,313,099,975.31 |

| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1年以內 | 1-5年 | 5年以上 | 不計息 | 合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| **資產** | | | | | |
| 貨幣資金 | 61,872,007.12 | – | – | – | 61,872,007.12 |
| 結算備付金 | 2,157,455.37 | – | – | – | 2,157,455.37 |
| 存出保證金 | 623,232.05 | – | – | – | 623,232.05 |
| 交易性金融資產 | 59,928,276.92 | – | – | 1,847,686,110.40 | 1,907,614,387.32 |
| 應收申購款 | – | – | – | 3,246,043.03 | 3,246,043.03 |
| 資產總計 | 124,580,971.46 | – | – | 1,850,932,153.43 | 1,975,513,124.89 |
| **負債** | | | | | |
| **應付清算款** | – | – | – | 1,035,729.30 | 1,035,729.30 |
| 應付贖回款 | – | – | – | 735,231.91 | 735,231.91 |
| 應付管理人報酬 | – | – | – | 2,481,511.20 | 2,481,511.20 |
| 應付託管費 | – | – | – | 413,585.22 | 413,585.22 |
| 應付銷售服務費 | – | – | – | 13,574.53 | 13,574.53 |
| 其他負債 | – | – | – | 1,806,902.16 | 1,806,902.16 |
| **負債總計** | – | – | – | 6,486,534.32 | 6,486,534.32 |
| 利率敏感度缺口 | 124,580,971.46 | – | – | 1,844,445,619.11 | 1,969,026,590.57 |

註：表中所示為本基金資產及負債的帳面價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

7.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

於2024年12月31日，本基金未持有交易性債券投資(2023年12月31日：3.04%)，因此市場利率的變動對於本基金淨資產無重大影響(2023年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外匯風險

外匯風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量因外匯匯率變動而發生波動的風險。本基金的所有資產及負債以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

7.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險是指基金所持金融工具的公允價值或未來現金流量因除市場利率和外匯匯率以外的市場價格因素變動而發生波動的風險。本基金主要投資於證券交易所上市或銀行間同業市場交易的股票和債券，所面臨的其他價格風險來源於單個證券發行主體自身經營情況或特殊事項的影響，也可能來源於證券市場整體波動的影響。

本基金的基金管理人在構建和管理投資組合的過程中，本基金通過投資組合的分散化降低其他價格風險，並且本基金管理人每日對本基金所持有的證券價格實施監控。

本基金通過投資組合的分散化降低其他價格風險。本基金股票投資比例範圍為基金資產的85%-95%，權證投資比例範圍為基金資產淨值的0-3%。固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的5%-15%，其中現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的投資比例不低於基金資產淨值的5%。此外，本基金的基金管理人每日對本基金所持有的證券價格實施監控，定期運用多種定量方法對基金進行風險度量，包括VaR(ValueatRisk)指標等來測試本基金面臨的潛在價格風險，及時可靠地對風險進行跟蹤和控制。

7.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

| 項目 | 本期末<br>2024年12月31日 | | 上年度末<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允價值 | 占基金資產淨值比例(%) | 公允價值 | 占基金資產淨值比例(%) |
| 交易性金融資產－股票投資 | 2,131,923,533.95 | 92.17 | 1,847,686,110.40 | 93.84 |
| 交易性金融資產－基金投資 | - | - | - | - |
| 交易性金融資產－貴金屬投資 | - | - | - | - |
| 衍生金融資產－權證投資 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合計 | 2,131,923,533.95 | 92.17 | 1,847,686,110.40 | 93.84 |

7.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

| 假設 | 除業績比較基準(附註7.4.1)以外的其他市場變量保持不變 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相關風險變量的變動 | 對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元） | |
| | | 本期末 2024年12月31日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| | 1. 業績比較基準(附註7.4.1)上升5% | 131,236,719.94 | 104,879,603.83 |
| | 2. 業績比較基準(附註7.4.1)下降5% | –131,236,719.94 | –104,879,603.83 |

### 7.4.14 公允價值

*7.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法*

公允價值計量結果所屬的層次，由對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低層次決定：

第一層次： 相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價。

第二層次： 除第一層次輸入值外相關資產或負債直接或間接可觀察的輸入值。

第三層次： 相關資產或負債的不可觀察輸入值。

*7.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具*

7.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位：人民幣元

| 公允價值計量結果所屬的層次 | 本期末 2024年12月31日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 第一層次 | 2,131,923,533.95 | 1,847,686,110.40 |
| 第二層次 | – | 59,928,276.92 |
| 第三層次 | – | – |
| 合計 | **2,131,923,533.95** | **1,907,614,387.32** |

7.4.14.2.2 公允價值所屬層次間的重大變動

本基金以導致各層次之間轉換的事項發生日為確認各層次之間轉換的時點。

對於證券交易所上市的股票和債券，若出現重大事項停牌、交易不活躍（包括漲跌停時的交易不活躍）、或屬於非公開發行等情況，本基金不會於停牌日至交易恢復活躍日期間、交易不活躍期間及限售期間將相關股票和債券的公允價值列入第一層次；並根據估值調整中採用的不可觀察輸入值對於公允價值的影響程度，確定相關股票和債券的公允價值應屬第二層次還是第三層次。

7.4.14.2.3 第三層次公允價值餘額及變動情況

7.4.14.2.3.1 第三層次公允價值餘額及變動情況

單位：人民幣元

| 項目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融資產 | | 合計 |
| | 債券投資 | 股票投資 | |
| 期初餘額 | – | – | – |
| 當期購買 | – | – | – |
| 當期出售／結算 | – | – | – |
| 轉入第三層次 | – | 4,713.69 | 4,713.69 |
| 轉出第三層次 | – | 2,677.41 | 2,677.41 |
| 當期利得或損失總額 | – | –2,036.28 | –2,036.28 |
| 其中：計入損益的利得或損失 | – | –2,036.28 | –2,036.28 |
| 計入其他綜合收益的利得或損失 | – | – | – |
| 期末餘額 | – | – | – |
| 期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動－公允價值變動損益 | – | – | – |

| 項目 | 上年度可比期間<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融資產 | | 合計 |
| | 債券投資 | 股票投資 | |
| 期初餘額 | – | – | – |
| 當期購買 | – | – | – |
| 當期出售／結算 | – | – | – |
| 轉入第三層次 | – | 62,961.62 | 62,961.62 |
| 轉出第三層次 | – | 45,793.10 | 45,793.10 |
| 當期利得或損失總額 | – | –17,168.52 | –17,168.52 |
| 其中：計入損益的利得或損失 | – | –17,168.52 | –17,168.52 |
| 計入其他綜合收益的利得或損失 | – | – | – |
| 期末餘額 | – | – | – |
| 期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動－公允價值變動損益 | – | – | – |

註：於2024年12月31日，本基金未持有第三層次的交易性金融資產（2023年12月31日：同）。於2024年度，本基金從第三層次轉出的交易性金融資產均為限售期結束可正常交易的股票投資（2023年度：同）。計入損益的利得或損失分別計入利潤表中的公允價值變動損益、投資收益等項目。

*7.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的説明*

於2024年12月31日，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產（2023年12月31日：同）。

*7.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關説明*

不以公允價值計量的金融資產和負債主要包括應收款項和其他金融負債，其帳面價值與公允價值相差很小。

### 7.4.15 有助於理解和分析會計報表需要説明的其他事項

截至資產負債表日本基金無需要説明的其他重要事項。

## §8 投資組合報告

### 8.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

| 序號 | 項目 | 金額 | 占基金總資產的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 權益投資 | 2,131,923,533.95 | 91.77 |
| | 其中：股票 | 2,131,923,533.95 | 91.77 |
| 2 | 基金投資 | – | – |
| 3 | 固定收益投資 | – | – |
| | 其中：債券 | – | – |
| | 資產支持證券 | – | – |
| 4 | 貴金屬投資 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投資 | – | – |
| 6 | 買入返售金融資產 | – | – |
| | 其中：買斷式回購的買入返售金融資產 | – | – |
| 7 | 銀行存款和結算備付金合計 | 190,042,194.39 | 8.18 |
| 8 | 其他各項資產 | 1,126,976.72 | 0.05 |
| 9 | 合計 | 2,323,092,705.06 | 100.00 |

## 8.2 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

| 代碼 | 行業類別 | 公允價值（元） | 占基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 農、林、牧、漁業 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| B | 採礦業 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| C | 製造業 | 1,712,714,088.95 | 74.04 |
| D | 電力、熱力、燃氣及水生產和供應業 | – | – |
| E | 建築業 | – | – |
| F | 批發和零售業 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| G | 交通運輸、倉儲和郵政業 | 84,369,757.50 | 3.65 |
| H | 住宿和餐飲業 | – | – |
| I | 信息傳輸、軟件和信息技術服務業 | – | – |
| J | 金融業 | 222,777,977.50 | 9.63 |
| K | 房地產業 | 25,265,176.00 | 1.09 |
| L | 租賃和商務服務業 | – | – |
| M | 科學研究和技術服務業 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| N | 水利、環境和公共設施管理業 | – | – |
| O | 居民服務、修理和其他服務業 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 衛生和社會工作 | – | – |
| R | 文化、體育和娛樂業 | – | – |
| S | 綜合 | – | – |
| | 合計 | 2,131,923,533.95 | 92.17 |

**8.3 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細**

金額單位：人民幣元

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 數量（股） | 公允價值（元） | 占基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601233 | 桐昆股份 | 15,971,273 | 188,461,021.40 | 8.15 |
| 2 | 000807 | 雲鋁股份 | 10,017,097 | 135,531,322.41 | 5.86 |
| 3 | 600782 | 新鋼股份 | 38,442,800 | 128,398,952.00 | 5.55 |
| 4 | 000651 | 格力電器 | 2,377,500 | 108,057,375.00 | 4.67 |
| 5 | 601166 | 興業銀行 | 5,554,500 | 106,424,220.00 | 4.60 |
| 6 | 000338 | 濰柴動力 | 6,966,400 | 95,439,680.00 | 4.13 |
| 7 | 601688 | 華泰證券 | 5,145,250 | 90,504,947.50 | 3.91 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 5,425,300 | 89,408,944.00 | 3.87 |
| 9 | 000933 | 神火股份 | 4,929,900 | 83,315,310.00 | 3.60 |
| 10 | 601717 | 鄭煤機 | 6,351,999 | 82,448,947.02 | 3.56 |
| 11 | 603035 | 常熟汽飾 | 5,380,995 | 77,432,518.05 | 3.35 |
| 12 | 000951 | 中國重汽 | 4,410,000 | 74,881,800.00 | 3.24 |
| 13 | 600309 | 萬華化學 | 1,009,038 | 71,994,861.30 | 3.11 |
| 14 | 601615 | 明陽智能 | 4,585,500 | 57,823,155.00 | 2.50 |
| 15 | 002078 | 太陽紙業 | 3,773,300 | 56,108,971.00 | 2.43 |
| 16 | 000589 | 貴州輪胎 | 10,655,000 | 53,594,650.00 | 2.32 |
| 17 | 603816 | 顧家家居 | 1,710,600 | 47,178,348.00 | 2.04 |
| 18 | 300373 | 揚傑科技 | 979,296 | 42,618,961.92 | 1.84 |
| 19 | 603599 | 廣信股份 | 3,452,740 | 41,605,517.00 | 1.80 |
| 20 | 000725 | 京東方 A | 9,147,300 | 40,156,647.00 | 1.74 |
| 21 | 002727 | 一心堂 | 2,703,700 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| 22 | 000921 | 海信家電 | 1,189,800 | 34,385,220.00 | 1.49 |
| 23 | 601111 | 中國國航 | 4,040,300 | 31,958,773.00 | 1.38 |

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 數量（股） | 公允價值（元） | 占基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 24 | 603056 | 德邦股份 | 2,054,050 | 29,434,536.50 | 1.27 |
| 25 | 603225 | 新鳳鳴 | 2,607,000 | 29,015,910.00 | 1.25 |
| 26 | 600426 | 華魯恒升 | 1,222,300 | 26,413,903.00 | 1.14 |
| 27 | 600989 | 寶豐能源 | 1,552,000 | 26,135,680.00 | 1.13 |
| 28 | 000001 | 平安銀行 | 2,209,300 | 25,848,810.00 | 1.12 |
| 29 | 600048 | 保利發展 | 2,851,600 | 25,265,176.00 | 1.09 |
| 30 | 603611 | 諾力股份 | 1,404,260 | 25,206,467.00 | 1.09 |
| 31 | 002299 | 聖農發展 | 1,727,000 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| 32 | 688059 | 華鋭精密 | 519,028 | 23,200,551.60 | 1.00 |
| 33 | 600233 | 圓通速遞 | 1,619,200 | 22,976,448.00 | 0.99 |
| 34 | 603558 | 健盛集團 | 1,993,100 | 21,445,756.00 | 0.93 |
| 35 | 600482 | 中國動力 | 786,500 | 19,245,655.00 | 0.83 |
| 36 | 000739 | 普洛藥業 | 916,600 | 14,903,916.00 | 0.64 |
| 37 | 601899 | 紫金礦業 | 968,500 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| 38 | 603259 | 藥明康德 | 217,000 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| 39 | 688678 | 福立旺 | 662,885 | 9,843,842.25 | 0.43 |
| 40 | 300260 | 新萊應材 | 312,300 | 8,460,207.00 | 0.37 |

## 8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

### 8.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值2%或前20名的股票明細

金額單位：人民幣元

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 本期累計買入金額 | 占期初基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600782 | 新鋼股份 | 194,352,695.00 | 9.87 |
| 2 | 601233 | 桐昆股份 | 179,915,371.51 | 9.14 |
| 3 | 601688 | 華泰證券 | 142,624,888.00 | 7.24 |
| 4 | 000807 | 雲鋁股份 | 129,242,723.15 | 6.56 |
| 5 | 601166 | 興業銀行 | 106,762,880.38 | 5.42 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 105,040,888.50 | 5.33 |
| 7 | 600309 | 萬華化學 | 104,209,057.40 | 5.29 |
| 8 | 000338 | 濰柴動力 | 102,369,861.00 | 5.20 |
| 9 | 601717 | 鄭煤機 | 100,795,624.85 | 5.12 |
| 10 | 000651 | 格力電器 | 96,770,164.55 | 4.91 |
| 11 | 300750 | 寧德時代 | 89,135,879.73 | 4.53 |
| 12 | 002643 | 萬潤股份 | 89,122,690.00 | 4.53 |
| 13 | 000933 | 神火股份 | 86,742,696.20 | 4.41 |
| 14 | 601111 | 中國國航 | 85,768,892.00 | 4.36 |
| 15 | 600048 | 保利發展 | 85,396,775.00 | 4.34 |
| 16 | 600754 | 錦江酒店 | 75,993,612.41 | 3.86 |
| 17 | 002384 | 東山精密 | 75,397,907.00 | 3.83 |
| 18 | 000589 | 貴州輪胎 | 72,847,626.46 | 3.70 |
| 19 | 300034 | 鋼研高納 | 71,714,545.96 | 3.64 |
| 20 | 000001 | 平安銀行 | 71,170,927.00 | 3.61 |
| 21 | 000739 | 普洛藥業 | 69,545,047.40 | 3.53 |
| 22 | 603225 | 新鳳鳴 | 68,802,209.15 | 3.49 |
| 23 | 000951 | 中國重汽 | 67,805,040.53 | 3.44 |
| 24 | 300308 | 中際旭創 | 67,779,240.53 | 3.44 |
| 25 | 002727 | 一心堂 | 62,184,535.00 | 3.16 |

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 本期累計買入金額 | 占期初基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 26 | 603588 | 高能環境 | 61,990,135.80 | 3.15 |
| 27 | 300136 | 信維通信 | 61,772,769.16 | 3.14 |
| 28 | 603259 | 藥明康德 | 60,156,678.00 | 3.06 |
| 29 | 300498 | 溫氏股份 | 58,763,068.56 | 2.98 |
| 30 | 600036 | 招商銀行 | 57,924,649.00 | 2.94 |
| 31 | 601857 | 中國石油 | 56,811,994.14 | 2.89 |
| 32 | 603816 | 顧家家居 | 55,616,535.00 | 2.82 |
| 33 | 603035 | 常熟汽飾 | 55,518,116.09 | 2.82 |
| 34 | 688059 | 華鋭精密 | 55,286,079.46 | 2.81 |
| 35 | 002078 | 太陽紙業 | 54,499,808.00 | 2.77 |
| 36 | 600482 | 中國動力 | 54,025,105.49 | 2.74 |
| 37 | 603939 | 益豐藥房 | 52,856,364.92 | 2.68 |
| 38 | 603599 | 廣信股份 | 50,749,646.40 | 2.58 |
| 39 | 601138 | 工業富聯 | 50,474,487.73 | 2.56 |
| 40 | 000776 | 廣發證券 | 48,745,639.48 | 2.48 |
| 41 | 603056 | 德邦股份 | 48,135,540.18 | 2.44 |
| 42 | 600887 | 伊利股份 | 46,532,421.66 | 2.36 |
| 43 | 600837 | 海通證券 | 46,491,549.63 | 2.36 |
| 44 | 688403 | 匯成股份 | 46,289,392.11 | 2.35 |
| 45 | 002402 | 和而泰 | 44,939,524.58 | 2.28 |
| 46 | 601882 | 海天精工 | 43,446,431.67 | 2.21 |
| 47 | 600761 | 安徽合力 | 42,877,504.81 | 2.18 |
| 48 | 603611 | 諾力股份 | 42,818,542.80 | 2.17 |
| 49 | 000002 | 萬科A | 42,512,350.18 | 2.16 |
| 50 | 600233 | 圓通速遞 | 42,069,552.68 | 2.14 |
| 51 | 600989 | 寶豐能源 | 40,402,522.00 | 2.05 |
| 52 | 000725 | 京東方A | 39,414,736.00 | 2.00 |

註：本表「本期累計買入金額」按買入成交金額(成交單價乘以成交數量)填列，不考慮相關交易費用。

### 8.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值2%或前20名的股票明細

金額單位：人民幣元

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 本期累計賣出金額 | 占期初基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601111 | 中國國航 | 221,461,159.83 | 11.25 |
| 2 | 002384 | 東山精密 | 195,668,603.00 | 9.94 |
| 3 | 300750 | 寧德時代 | 180,203,454.10 | 9.15 |
| 4 | 600048 | 保利發展 | 176,050,643.02 | 8.94 |
| 5 | 600036 | 招商銀行 | 147,712,998.00 | 7.50 |
| 6 | 300498 | 溫氏股份 | 138,931,592.87 | 7.06 |
| 7 | 000100 | TCL科技 | 136,868,843.30 | 6.95 |
| 8 | 601688 | 華泰證券 | 121,864,621.25 | 6.19 |
| 9 | 300373 | 揚傑科技 | 109,135,740.44 | 5.54 |
| 10 | 600754 | 錦江酒店 | 107,516,667.76 | 5.46 |
| 11 | 000002 | 萬科A | 94,263,672.00 | 4.79 |
| 12 | 601166 | 興業銀行 | 94,136,596.58 | 4.78 |
| 13 | 601138 | 工業富聯 | 80,682,255.13 | 4.10 |
| 14 | 002643 | 萬潤股份 | 78,728,833.04 | 4.00 |
| 15 | 000776 | 廣發證券 | 77,143,526.82 | 3.92 |
| 16 | 300034 | 鋼研高納 | 72,054,750.60 | 3.66 |
| 17 | 300308 | 中際旭創 | 70,544,320.40 | 3.58 |
| 18 | 600782 | 新鋼股份 | 70,206,775.00 | 3.57 |
| 19 | 000059 | 華錦股份 | 66,341,555.87 | 3.37 |
| 20 | 000807 | 雲鋁股份 | 65,961,754.00 | 3.35 |
| 21 | 300136 | 信維通信 | 65,601,993.95 | 3.33 |
| 22 | 603236 | 移遠通信 | 63,885,333.04 | 3.24 |
| 23 | 603588 | 高能環境 | 60,873,605.03 | 3.09 |
| 24 | 000739 | 普洛藥業 | 60,284,342.00 | 3.06 |

| 序號 | 股票代碼 | 股票名稱 | 本期累計賣出金額 | 占期初基金資產淨值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 25 | 002468 | 申通快遞 | 56,757,939.00 | 2.88 |
| 26 | 601717 | 鄭煤機 | 56,267,041.39 | 2.86 |
| 27 | 688403 | 匯成股份 | 54,369,580.03 | 2.76 |
| 28 | 002402 | 和而泰 | 54,323,968.50 | 2.76 |
| 29 | 600029 | 南方航空 | 54,010,782.82 | 2.74 |
| 30 | 601857 | 中國石油 | 52,588,621.00 | 2.67 |
| 31 | 600919 | 江蘇銀行 | 50,546,989.20 | 2.57 |
| 32 | 603259 | 藥明康德 | 50,188,400.60 | 2.55 |
| 33 | 603939 | 益豐藥房 | 48,388,318.62 | 2.46 |
| 34 | 600887 | 伊利股份 | 46,893,238.00 | 2.38 |
| 35 | 600837 | 海通證券 | 46,795,211.97 | 2.38 |
| 36 | 600761 | 安徽合力 | 45,517,378.43 | 2.31 |
| 37 | 603056 | 德邦股份 | 44,440,426.00 | 2.26 |
| 38 | 000001 | 平安銀行 | 44,090,905.80 | 2.24 |
| 39 | 601117 | 中國化學 | 42,731,554.00 | 2.17 |
| 40 | 002531 | 天順風能 | 41,483,014.69 | 2.11 |

註：本表「本期累計賣出金額」按賣出成交金額(成交單價乘以成交數量)填列，不考慮相關交易費用。

#### 8.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

| | |
|---|---|
| 買入股票成本(成交)總額 | 4,997,879,736.28 |
| 賣出股票收入(成交)總額 | 4,965,521,849.05 |

註：本表「買入股票成本(成交)總額」，「賣出股票收入(成交)總額」均按買賣成交金額(成交單價乘以成交數量)填列，不考慮相關交易費用。

### 8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

無。

### 8.6 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細

無。

### 8.7 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細

無。

### 8.8 報告期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

無。

### 8.9 期末按公允價值占基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

無。

### 8.10 本基金投資股指期貨的投資政策

無。

### 8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況説明

#### 8.11.1 本期國債期貨投資政策

無。

#### 8.11.2 本期國債期貨投資評價

無。

## 8.12 投資組合報告附註

### 8.12.1 報告期末本基金投資的前十名證券的發行主體本期沒有出現被監管部門立案調查，或在報告編制日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

### 8.12.2 本基金投資的前十名股票中，沒有投資於超出基金合同規定備選股票庫之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

| 序號 | 名稱 | 金額 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保證金 | 731,225.55 |
| 2 | 應收清算款 | – |
| 3 | 應收股利 | – |
| 4 | 應收利息 | – |
| 5 | 應收申購款 | 395,751.17 |
| 6 | 其他應收款 | – |
| 7 | 待攤費用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合計 | 1,126,976.72 |

### 8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

無。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

無。

### 8.12.6 投資組合報告附註的其他文字描述部分

投資組合報告中，由於四捨五入原因，市值占淨值比例的分項之和與合計可能存在尾差；由於小數點後保留位數限制原因，市值占淨值比例可能顯示為零。

**8.13 投資組合報告（供香港投資人參閱）**

| 投資組合<br>於 2024/12/31 | *滙豐晉信大盤股票型證券投資基金* | | |
|---|---|---|---|
| | 持有數量 | 市值（人民幣） | 市值占淨值% |
| **股票投資** | | | |
| **上市股票** | | | |
| *A股* | | | |
| *中華人民共和國* | | | |
| 桐昆股份 | 15,971,273 | 188,461,021.40 | 8.15 |
| 雲鋁股份 | 10,017,097 | 135,531,322.41 | 5.86 |
| 新鋼股份 | 38,442,800 | 128,398,952.00 | 5.55 |
| 格力電器 | 2,377,500 | 108,057,375.00 | 4.67 |
| 興業銀行 | 5,554,500 | 106,424,220.00 | 4.6 |
| 濰柴動力 | 6,966,400 | 95,439,680.00 | 4.13 |
| 華泰證券 | 5,145,250 | 90,504,947.50 | 3.91 |
| 三一重工 | 5,425,300 | 89,408,944.00 | 3.87 |
| 神火股份 | 4,929,900 | 83,315,310.00 | 3.6 |
| 鄭煤機 | 6,351,999 | 82,448,947.02 | 3.56 |
| 常熟汽飾 | 5,380,995 | 77,432,518.05 | 3.35 |
| 中國重汽 | 4,410,000 | 74,881,800.00 | 3.24 |
| 萬華化學 | 1,009,038 | 71,994,861.30 | 3.11 |
| 明陽智能 | 4,585,500 | 57,823,155.00 | 2.5 |
| 太陽紙業 | 3,773,300 | 56,108,971.00 | 2.43 |
| 貴州輪胎 | 10,655,000 | 53,594,650.00 | 2.32 |
| 顧家家居 | 1,710,600 | 47,178,348.00 | 2.04 |
| 揚傑科技 | 979,296 | 42,618,961.92 | 1.84 |
| 廣信股份 | 3,452,740 | 41,605,517.00 | 1.8 |
| 京東方A | 9,147,300 | 40,156,647.00 | 1.74 |
| 一心堂 | 2,703,700 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| 海信家電 | 1,189,800 | 34,385,220.00 | 1.49 |
| 中國國航 | 4,040,300 | 31,958,773.00 | 1.38 |
| 德邦股份 | 2,054,050 | 29,434,536.50 | 1.27 |
| 新鳳鳴 | 2,607,000 | 29,015,910.00 | 1.25 |
| 華魯恒升 | 1,222,300 | 26,413,903.00 | 1.14 |
| 寶豐能源 | 1,552,000 | 26,135,680.00 | 1.13 |
| 平安銀行 | 2,209,300 | 25,848,810.00 | 1.12 |
| 保利發展 | 2,851,600 | 25,265,176.00 | 1.09 |

| 投資組合<br>於 2024/12/31 | *滙豐晉信大盤股票型證券投資基金* | | |
|---|---|---|---|
| | 持有數量 | 市值（人民幣） | 市值占淨值% |
| 諾力股份 | 1,404,260 | 25,206,467.00 | 1.09 |
| 聖農發展 | 1,727,000 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| 華銳精密 | 519,028 | 23,200,551.60 | 1 |
| 圓通速遞 | 1,619,200 | 22,976,448.00 | 0.99 |
| 健盛集團 | 1,993,100 | 21,445,756.00 | 0.93 |
| 中國動力 | 786,500 | 19,245,655.00 | 0.83 |
| 普洛藥業 | 916,600 | 14,903,916.00 | 0.64 |
| 紫金礦業 | 968,500 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| 藥明康德 | 217,000 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| 福立旺 | 662,885 | 9,843,842.25 | 0.43 |
| 新萊應材 | 312,300 | 8,460,207.00 | 0.37 |
| | | | |
| **投資總計** | | | |
| 投資總成本：2,102,250,369.57人民幣元 | | 2,131,923,533.95 | 92.17 |
| | | | |
| **其他淨資產** | | 181,176,441.36 | 7.83 |
| **基金資產淨值** | | 2,313,099,975.31 | 100.00 |

| 投資組合變動表 | 市值占淨值% | |
|---|---|---|
| | 2024/12/31 | 2023/12/31 |
| **股票** | 92.17 | 93.84 |
| | | |
| **投資總計** | 92.17 | 93.84 |
| **其他淨資產** | 7.83 | 6.16 |
| | | |
| 市值占淨值% | 100.00 | 100.00 |

## §9 基金份額持有人信息

### 9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

| 份額級別 | 持有人戶數(戶) | 戶均持有的基金份額 | 持有人結構 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 機構投資者 | | 個人投資者 | |
| | | | 持有份額 | 占總份額比例 | 持有份額 | 占總份額比例 |
| 滙豐晉信大盤股票A | 40,831 | 13,144.14 | 274,665,784.07 | 51.18% | 262,022,445.51 | 48.82% |
| 滙豐晉信大盤股票H | 5 | 9,036,775.53 | 45,183,877.64 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 滙豐晉信大盤股票C | 86 | 196,456.94 | 16,616,321.40 | 98.35% | 278,975.11 | 1.65% |
| 合計 | 40,922 | 14,631.92 | 336,465,983.11 | 56.19% | 262,301,420.62 | 43.81% |

註：依據香港市場的特點，香港投資者持有的本基金H類別份額將由香港銷售機構代表香港投資者名義持有，同時，香港銷售機構以名義持有人的形式出現在註冊登記機構的持有人名冊中。基金管理人無法得知具體的投資者信息，此處本基金H類份額持有人戶數為H類份額名義持有人戶數。

### 9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

| 項目 | 份額級別 | 持有份額總數（份） | 占基金總份額比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有從業人員持有本基金 | 滙豐晉信大盤股票A | 267,059.05 | 0.0498% |
| | 滙豐晉信大盤股票H | 0.00 | 0.0000% |
| | 滙豐晉信大盤股票C | 26,779.50 | 0.1585% |
| | 合計 | 293,838.55 | 0.0491% |

### 9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

| 項目 | 份額級別 | 持有基金份額總量的數量區間（萬份） |
|---|---|---|
| 本公司高級管理人員、基金投資和研究部門負責人持有本開放式基金 | 滙豐晉信大盤股票A | 0 |
| | 滙豐晉信大盤股票H | 0 |
| | 滙豐晉信大盤股票C | 0 |
| | 合計 | 0 |
| 本基金基金經理持有本開放式基金 | 滙豐晉信大盤股票A | 10~50 |
| | 滙豐晉信大盤股票H | 0 |
| | 滙豐晉信大盤股票C | 0 |
| | 合計 | 10~50 |

## §10 開放式基金份額變動

單位：份

| | 滙豐晉信大盤股票A | 滙豐晉信大盤股票H | 滙豐晉信大盤股票C |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日（2009年06月24日）基金份額總額 | 2,885,554,241.41 | – | – |
| 本報告期期初基金份額總額 | 503,956,142.97 | 57,429,880.76 | 9,698,515.35 |
| 本報告期基金總申購份額 | 263,423,851.36 | – | 51,178,535.38 |
| 減：本報告期基金總贖回份額 | 230,691,764.75 | 12,246,003.12 | 43,981,754.22 |
| 本報告期基金拆分變動份額 | – | – | – |
| 本報告期期末基金份額總額 | 536,688,229.58 | 45,183,877.64 | 16,895,296.51 |

註：此處申購含紅利再投、轉換入份額，贖回含轉換出份額。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份額持有人大會決議

本基金本報告期內未召開基金份額持有人大會。

### 11.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

2024年7月6日，基金管理人發佈公告，自2024年7月5日起，聘任何寒熙女士擔任公司副總經理。

2024年7月20日，基金管理人發佈公告，自2024年7月19日起，聘任周慧女士擔任公司督察長，古韻女士不再擔任公司督察長。

2024年7月22日，經公司股東會審議批准，聘任劉鵬飛先生、武旭先生擔任公司董事，楊小勇先生、郭晉普先生不再擔任公司董事；聘任姚偉先生擔任公司監事，焦楊先生不再擔任公司監事。

2024年7月22日，根據公司職工投票結果，聘任林琳女士、周韞女士擔任公司職工代表監事，曹菁女士、侯玉琦先生不再擔任公司職工代表監事。

2024年7月23日，經公司監事會審議批准，聘任姚偉先生擔任公司監事會主席。

2024年7月27日，基金管理人發佈公告，聘任劉鵬飛先生擔任公司董事長。

2024年12月20日，閆湜女士不再擔任本基金基金經理助理。

本報告期內，本公司高級管理人員未發生不能正常履行職責的情況。

本報告期內基金託管人的專門基金託管部門無重大人事變動。

**11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟**

本基金本報告期內無涉及本基金管理人和基金財產的訴訟事項。

本報告期內無涉及基金託管業務的訴訟事項。

**11.4 基金投資策略的改變**

本基金本報告期內未發生基金投資策略的改變。

**11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況**

經滙豐晉信基金管理有限公司董事會審議通過，並經基金託管人同意，本基金於2015年4月18日將為其審計的會計師事務所由畢馬威華振會計師事務所（特殊普通合夥）更換為普華永道中天會計師事務所（特殊普通合夥），並報中國證券監督管理委員會備案。

根據與普華永道中天會計師事務所（特殊普通合夥）簽訂的《審計業務約定書》，應實際支付2024年度審計費80000元。

## 11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

### 11.6.1 管理人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

| 措施1 | 內容 |
| --- | --- |
| 受到稽查或處罰等措施的主體 | 基金管理人及相關高級管理人員 |
| 受到稽查或處罰等措施的時間 | 2024年02月01日 |
| 採取稽查或處罰等措施的機構 | 中國證券監督管理委員會上海監管局 |
| 受到的具體措施類型 | 基金管理人被採取責令改正的行政監管措施，相關高級管理人員被採取出具警示函的行政監管措施 |
| 受到稽查或處罰等措施的原因 | 公司內部控制管理不完善 |
| 管理人採取整改措施的情況（如提出整改意見） | 公司高度重視，按要求及時完成整改，監管機構已驗收通過整改結果，公司所有業務均正常開展 |
| 其他 | 無 |

### 11.6.2 託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內，基金託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員未受到任何稽查或處罰。

## 11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

### 11.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及傭金支付情況

金額單位：人民幣元

| 券商名稱 | 交易單元數量 | 股票交易 | | 應支付該券商的傭金 | | 備註 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金額 | 占當期股票成交總額的比例 | 傭金 | 占當期傭金總量的比例 | |
| 川財證券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 東方證券 | 1 | 386,265,096.99 | 3.88% | 228,216.02 | 3.23% | – |
| 光大證券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 國金證券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 華創證券 | 1 | 39,688,640.02 | 0.40% | 17,299.64 | 0.24% | – |
| 平安證券 | 1 | 54,712,138.40 | 0.55% | 23,847.06 | 0.34% | – |
| 山西證券 | 1 | 28,359,977.96 | 0.28% | 12,362.74 | 0.17% | – |
| 申萬宏源 | 1 | 479,934,912.78 | 4.82% | 453,965.47 | 6.42% | – |
| 西南證券 | 1 | 70,409,889.19 | 0.71% | 30,690.18 | 0.43% | – |
| 興業證券 | 1 | 271,433,596.64 | 2.72% | 256,743.06 | 3.63% | – |
| 銀河證券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 中銀國際 | 1 | – | – | – | – | – |
| 財通證券 | 2 | 18,600,949.59 | 0.19% | 17,596.46 | 0.25% | – |
| 德邦證券 | 2 | 346,104,771.52 | 3.47% | 327,375.93 | 4.63% | – |
| 東方財富 | 2 | 38,076,396.88 | 0.38% | 16,591.60 | 0.23% | – |
| 東吳證券 | 2 | 314,279,330.98 | 3.15% | 259,743.50 | 3.67% | – |
| 方正證券 | 2 | 270,387,566.96 | 2.71% | 255,757.45 | 3.62% | – |
| 國海證券 | 2 | 318,351,872.17 | 3.20% | 237,454.16 | 3.36% | – |
| 國聯證券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 國盛證券 | 2 | 716,849,602.32 | 7.19% | 312,480.07 | 4.42% | – |
| 國泰君安 | 2 | 159,376,427.03 | 1.60% | 69,477.97 | 0.98% | – |
| 國投證券 | 2 | – | – | – | – | – |

| 券商名稱 | 交易單元數量 | 股票交易 | | 應支付該券商的傭金 | | 備註 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金額 | 占當期股票成交總額的比例 | 傭金 | 占當期傭金總量的比例 | |
| 海通證券 | 2 | 265,091,778.95 | 2.66% | 250,754.87 | 3.55% | – |
| 華安證券 | 2 | 61,825,629.16 | 0.62% | 36,113.67 | 0.51% | – |
| 華福證券 | 2 | 2,035,376,094.01 | 20.43% | 1,149,952.01 | 16.26% | – |
| 華泰證券 | 2 | 544,059,747.48 | 5.46% | 514,637.66 | 7.28% | – |
| 華西證券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 滙豐前海 | 2 | 144,577,753.89 | 1.45% | 136,757.50 | 1.93% | – |
| 開源證券 | 2 | 337,804,684.99 | 3.39% | 319,536.67 | 4.52% | – |
| 民生證券 | 2 | 618,166,961.51 | 6.20% | 458,883.65 | 6.49% | – |
| 太平洋證券 | 2 | 72,575,646.32 | 0.73% | 68,649.52 | 0.97% | – |
| 天風證券 | 2 | 61,654,632.93 | 0.62% | 58,319.86 | 0.82% | – |
| 西部證券 | 2 | 184,069,219.64 | 1.85% | 174,111.78 | 2.46% | – |
| 信達證券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 野村東方 | 2 | – | – | – | – | – |
| 招商證券 | 2 | 88,440,831.80 | 0.89% | 83,656.99 | 1.18% | – |
| 浙商證券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 中金公司 | 2 | – | – | – | – | – |
| 中泰證券 | 2 | 539,604,640.66 | 5.42% | 464,691.32 | 6.57% | – |
| 中信建投 | 2 | 39,543,546.07 | 0.40% | 27,208.55 | 0.38% | – |
| 中信證券 | 2 | 251,808,914.99 | 2.53% | 161,142.67 | 2.28% | – |
| 長江證券 | 3 | 466,726,662.46 | 4.68% | 241,319.65 | 3.41% | – |
| 東興證券 | 3 | – | – | – | – | – |
| 廣發證券 | 3 | 739,207,537.60 | 7.42% | 407,569.93 | 5.76% | – |

註： 1、 報告期內退租中信建投、長江證券交易單元；

2、 選擇證券公司參與證券交易的標準和程序

1) 選擇證券公司參與證券交易的標準

a. 財務狀況良好，經營行為規範，內控制度健全，在業內有良好的聲譽；

b. 具備基金運作所需的高效、安全的通訊條件，交易設施滿足基金進行證券交易的需要；

c. 具有較強的全方位金融服務能力和水平，包括但不限於：有較好的研究能力和行業分析能力，能及時、全面地向公司提供高質量的關於宏觀、行業及市場走向、個股分析的報告及豐富全面的資訊服務；能積極為公司投資業務的開展，投資信息的交流以及其他方面業務的開展提供良好的服務和支持。

2) 選擇證券公司參與證券交易的程序

(1) 本公司投資部根據上述評價標準對證券公司進行評估，經公司督察長和風控會審議批准後，可被選擇成為提供證券交易服務的公司。

(2) 公司與被選中提供證券交易服務的證券公司簽訂協議，並通知基金託管人。

3、 根據中國證監會公告【2024】3號《公開募集證券投資基金證券交易費用管理規定》，自2024年7月1日起，針對被動股票型基金，不再通過交易傭金支付研究服務、流動性服務等其他費用，針對其他類型基金可以通過交易傭金支付研究服務費用，但不再通過交易傭金支付研究服務之外的其他費用。

4、 本部分的數據統計時間區間與本報告的報告期一致；本公司網站披露的《滙豐晉信基金管理有限公司旗下公募基金通過證券公司證券交易及傭金支付情況（2024年度）》的報告期為2024年7月1日至2024年12月31日。敬請投資者關注上述報告統計時間區間的口徑差異。

### 11.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

無。

**11.8 其他重大事件**

| 序號 | 公告事項 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-01-22 |
| 2 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增中信建投證券為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-03-15 |
| 3 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-03-29 |
| 4 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增利得基金為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-04-19 |
| 5 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-04-22 |
| 6 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增基煜基金為滙豐晉信大盤股票型證券投資基金C類份額代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-05-08 |
| 7 | 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金更新招募説明書（2024年第1號） | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-06-28 |
| 8 | 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金產品資料概要更新A類份額 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-06-28 |
| 9 | 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金產品資料概要更新C類份額 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-06-28 |
| 10 | 滙豐晉信基金管理有限公司基金行業高級管理人員變更公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-07-06 |
| 11 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第二季度報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-07-19 |
| 12 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於高級管理人員變更公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-07-20 |
| 13 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增申萬宏源證券、申萬宏源西部證券為旗下開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-07-26 |

| 序號 | 公告事項 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 14 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於董事長變更公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-07-27 |
| 15 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2024年中期報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-08-31 |
| 16 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增中國郵政儲蓄銀行為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-09-03 |
| 17 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增交通銀行為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-09-05 |
| 18 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增工商銀行為滙豐晉信大盤股票型證券投資基金C類份額代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-09-11 |
| 19 | 滙豐晉信大盤波動精選股票型證券投資基金基金經理變更公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-09-28 |
| 20 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增匯成基金為滙豐晉信大盤股票型證券投資基金C類份額代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-10-14 |
| 21 | 滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第三季度報告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-10-25 |
| 22 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於調整旗下開放式基金在京東肯特瑞基金銷售有限公司的交易限額的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-10-25 |
| 23 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增中國人壽為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-11-11 |
| 24 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增騰安基金為旗下部分開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-11-15 |
| 25 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於旗下基金參加中歐財富費率優惠的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-18 |
| 26 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增中歐財富為旗下開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-18 |
| 27 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於調整旗下開放式基金在普益基金的交易限額的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |

| 序號 | 公告事項 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 28 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於旗下基金參加普益基金費率優惠的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |
| 29 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於新增普益基金為旗下開放式基金代銷機構的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |
| 30 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於提請直銷投資者及時更新投資者分類資料並接受或重新接受風險承受能力調查的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |
| 31 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於提醒投資者防範金融詐騙的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |
| 32 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於完善客戶身份信息的提示 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |
| 33 | 滙豐晉信基金管理有限公司關於調低旗下部分基金管理費率和託管費率並修改基金合同等法律文件的公告 | 本基金指定報刊、指定互聯網網站 | 2024-12-31 |

## §12 影響投資者決策的其他重要信息

### 12.1 報告期內單一投資者持有基金淨值比例達到或超過20%的情況

無。

### 12.2 影響投資者決策的其他重要信息

無。

## §13 備查文件目錄

### 13.1 備查文件目錄

1) 中國證監會批准滙豐晉信大盤股票型證券投資基金設立的文件

2) 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同

3) 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金招募説明書

4) 滙豐晉信大盤股票型證券投資基金託管協議

5) 滙豐晉信基金管理有限公司開放式基金業務規則

6) 基金管理人業務資格批件和營業執照

7) 基金託管人業務資格批件和營業執照

8) 報告期內滙豐晉信大盤股票型證券投資基金在指定媒體上披露的各項公告

9) 中國證監會要求的其他文件

### 13.2 存放地點

地點為管理人地址：中國（上海）自由貿易試驗區世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓

### 13.3 查閱方式

投資者可於本基金管理人辦公時間預約查閱。

投資者對本報告書如有疑問，可諮詢本基金管理人。

客戶服務中心電話：021-20376888
公司網址：http://www.hsbcjt.cn

滙豐晉信基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日

# 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

# 2024年年度报告

## 2024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
送出日期：2025年03月31日

HSBC Jintrust Large Cap Equity Securities Investment Fund
31 December 2024 Fund Annual Report
Information for Hong Kong Investors

In the 31 December 2024 Fund Annual Report, except HSBC Jintrust Large Cap Equity Securities Investment Fund and HSBC Jintrust Dynamic Strategy Mixed Securities Investment Fund (where applicable) ("Fund"), other funds are not authorized by the Securities and Futures Commission in Hong Kong and not available to Hong Kong residents for investment purposes.

SFC authorization is not a recommendation or endorsement of a product nor does it guarantee the commercial merits of a product or its performance. It does not mean the product is suitable for all investors nor is it an endorsement of its suitability for any particular investor or class of investors.

Only Class H units of HSBC Jintrust Large Cap Equity Securities Investment Fund are available to Hong Kong investors to subscribe.

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited
Hong Kong Representative
31 March 2025

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金
2024年12月31日基金年度報告
向香港投資者提供的資料

在2024年12月31日基金年度報告中所提及的基金，除滙豐晉信大盤股票型證券投資基金和滙豐晉信動態策略混合型證券投資基金滙豐晉信（如適用）外，其他基金在香港未獲香港證券及期貨事務監察委員會認可及並非供香港居民投資。

香港證券及期貨事務監察委員會的有關認可並非對本基金的推薦或認許，亦非對本基金的商業利弊或其表現作出保證，更不代表本基金適合所有投資者，亦非認許其適合任何特定投資者或投資者類別。

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金只有H類別份額可供香港投資者認購。

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited
（滙豐投資基金（香港）有限公司）
香港代表
2025年3月31日

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金
2024年12月31日基金年度报告
向香港投资者提供的资料

在2024年12月31日基金年度报告中所提及的基金，除汇丰晋信大盘股票型证券投资基金和汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（如适用）外，其他基金在香港未获香港证券及期货事务监察委员会认可及并非供香港居民投资。

香港证券及期货事务监察委员会的有关认可并非对本基金的推荐或认许，亦非对本基金的商业利弊或其表现作出保证，更不代表本基金适合所有投资者，亦非认许其适合任何特定投资者或投资者类别。

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金只有H类别份额可供香港投资者认购。

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited
（汇丰投资基金（香港）有限公司）
香港代表
2025年3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2025年3月28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。

香港证监会认可不等如对该计划作出推介或认许，亦不是对该计划的商业利弊或表现作出保证，更不代表该计划适合所有投资者，或认许该计划适合任何个别投资者或任何类别的投资者。

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31日止。

## 1.2 目录


**§1 重要提示及目录** . . . . . 5
1.1 重要提示 . . . . . 5
1.2 目录 . . . . . 6
**§2 基金简介** . . . . . 8
2.1 基金基本情况 . . . . . 8
2.2 基金产品说明 . . . . . 9
2.3 基金管理人和基金托管人 . . . . . 10
2.4 信息披露方式 . . . . . 10
2.5 其他相关资料 . . . . . 10
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况** . . . . . 11
3.1 主要会计数据和财务指标 . . . . . 11
3.2 基金净值表现 . . . . . 12
3.3 过去三年基金的利润分配情况 . . . . . 19
**§4 管理人报告** . . . . . 20
4.1 基金管理人及基金经理情况 . . . . . 20
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 . . . . . 23
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 . . . . . 23
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 . . . . . 24
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 . . . . . 25
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 . . . . . 25
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 . . . . . 26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 . . . . . 27
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 . . . . . 27
**§5 托管人报告** . . . . . 27
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 . . . . . 27
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 . . . . . 27
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 . . . . . 27
**§6 审计报告** . . . . . 28
6.1 审计报告基本信息 . . . . . 28
6.2 审计报告的基本内容 . . . . . 28
**§7 年度财务报表** . . . . . 31
7.1 资产负债表 . . . . . 31
7.2 利润表 . . . . . 33
7.3 净资产变动表 . . . . . 35
7.4 报表附注 . . . . . 37

**§8 投资组合报告** 76
8.1 期末基金资产组合情况 76
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 77
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 78
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 84
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 84
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 84
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 84
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 84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 84
8.12 投资组合报告附注 85
8.13 投资组合报告(供香港投资人参阅) 86
**§9 基金份额持有人信息** 88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 89
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 89
**§10 开放式基金份额变动** 90
**§11 重大事件揭示** 90
11.1 基金份额持有人大会决议 90
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 90
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 91
11.4 基金投资策略的改变 91
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 91
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 93
11.8 其他重大事件 96
**§12 影响投资者决策的其他重要信息** 98
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 98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 98
**§13 备查文件目录** 99
13.1 备查文件目录 99
13.2 存放地点 99
13.3 查阅方式 99

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名称 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 汇丰晋信大盘股票 | | |
| 基金主代码 | 540006 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2009年06月24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 | 598,767,403.73份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C |
| 下属分级基金的交易代码 | 540006 | 960000 | 019243 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 536,688,229.58份 | 45,183,877.64份 | 16,895,296.51份 |

注：本基金自2015年12月30日起增加H类份额，自2023年11月13日起增加C类份额。

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过投资于盈利预期持续稳定增长，在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票，在合理控制风险的基础上，追求稳健的分红收益及长期资本利得，实现基金资产持续超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略<br>根据本基金所奉行的“较高仓位、蓝筹公司、精选研究”的投资理念和“研究创造价值”的股票精选策略，在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。<br><br>2、行业配置策略<br>行业研究员通过分析行业特征，定期提出行业投资评级和配置建议。行业比较分析师综合内、外部研究资源，结合宏观基本面分析等状况，提出重点行业配置比重的建议。<br><br>3、股票资产投资策略<br>本基金专注于分析大盘股特有的竞争优势，基金管理人将对初选股票给予全面的价值、成长分析，并结合行业地位分析，优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数*90%+同业存款利率*10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金产品，在开放式基金中，其预期风险和收益水平高于债券型基金和混合型基金，属于风险水平较高的基金产品。本基金主要投资于大盘蓝筹股票，在股票型基金中属于中等风险水平的投资产品。 |

## 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 | *《证券时报》* |
| 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(特殊普通合夥) | 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 期間數據和指標 | 2024年 | | | 2023年 | | | 2022年 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C |
| 本期已实现收益 | 126,678,409.74 | 4,216,449.73 | 6,925,358.19 | 47,298,663.72 | 7,408,332.00 | -519,420.76 | -333,779,427.86 | -30,823,686.86 | - |
| 本期利润 | 251,132,759.39 | 7,807,222.65 | 6,637,350.66 | -75,786,159.85 | -1,632,591.68 | -1,758,137.74 | -521,388,538.35 | -49,009,025.98 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4286 | 0.1498 | 0.3040 | -0.1890 | -0.0254 | -0.2157 | -1.5272 | -0.6357 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.38% | 9.83% | 8.05% | -4.91% | -1.61% | -5.90% | -35.04% | -35.87% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.31% | 10.16% | 9.84% | -2.91% | -2.94% | -3.37% | -28.28% | -28.29% | - |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 2024年末 | | | 2023年末 | | | 2022年末 | | |
| 期末可供分配利润 | 1,634,298,357.08 | 55,640,754.02 | 51,119,882.53 | 1,344,036,130.50 | 62,033,561.06 | 25,845,488.88 | 915,777,545.87 | 85,201,618.98 | - |
| 期末可供分配基金份额利润 | 3.0452 | 1.2314 | 3.0257 | 2.6670 | 1.0802 | 2.6649 | 2.7768 | 1.1253 | - |
| 期末基金资产净值 | 2,170,986,586.66 | 74,093,608.89 | 68,019,779.76 | 1,847,992,273.47 | 85,487,639.66 | 35,546,677.44 | 1,245,567,671.25 | 116,123,459.55 | - |
| 期末基金份额净值 | 4.0452 | 1.6398 | 4.0260 | 3.6670 | 1.4886 | 3.6652 | 3.7768 | 1.5337 | - |
| **3.1.3 累计期末指标** | 2024年末 | | | 2023年末 | | | 2022年末 | | |
| 基金份额累计净值增长率 | 328.76% | 63.98% | 6.14% | 288.67% | 48.86% | -3.37% | 300.31% | 53.37% | - |

注：
①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
④本基金自2015年12月30日起增加H类份额，自2023年11月13日起增加C类份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**汇丰晋信大盘股票A**

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | –4.29% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.44% | 0.01% |
| 过去六个月 | 9.35% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –2.97% | 0.17% |
| 过去一年 | 10.31% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –2.94% | 0.33% |
| 过去三年 | –23.18% | 1.29% | –18.21% | 1.06% | –4.97% | 0.23% |
| 过去五年 | 7.92% | 1.34% | –3.36% | 1.11% | 11.28% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 328.76% | 1.38% | 25.79% | 1.27% | 302.97% | 0.11% |

注：
过去三个月指2024年10月1日－2024年12月31日
过去六个月指2024年7月1日－2024年12月31日
过去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
过去三年指2022年1月1日－2024年12月31日
过去五年指2020年1月1日－2024年12月31日
自基金合同生效起至今指2009年6月24日－2024年12月31日

**汇丰晋信大盘股票H**

| 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 | –4.29% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.44% | 0.01% |
| 过去六个月 | 9.31% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –3.01% | 0.17% |
| 过去一年 | 10.16% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –3.09% | 0.33% |
| 过去三年 | –23.33% | 1.29% | –18.21% | 1.06% | –5.12% | 0.23% |
| 过去五年 | 7.56% | 1.34% | –3.36% | 1.11% | 10.92% | 0.23% |
| 成立至今 | 63.98% | 1.27% | 4.62% | 1.09% | 59.36% | 0.18% |

注：
过去三个月指2024年10月1日－2024年12月31日
过去六个月指2024年7月1日－2024年12月31日
过去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
过去三年指2022年1月1日－2024年12月31日
过去五年指2020年1月1日－2024年12月31日
成立至今指2015年12月30日－2024年12月31日

**汇丰晋信大盘股票C**

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | –4.39% | 1.57% | –1.85% | 1.56% | –2.54% | 0.01% |
| 过去六个月 | 9.09% | 1.66% | 12.32% | 1.49% | –3.23% | 0.17% |
| 过去一年 | 9.84% | 1.54% | 13.25% | 1.21% | –3.41% | 0.33% |
| 成立至今 | 6.14% | 1.46% | 8.78% | 1.15% | –2.64% | 0.31% |

注：
过去三个月指2024年10月1日－2024年12月31日
过去六个月指2024年7月1日－2024年12月31日
过去一年指2024年1月1日－2024年12月31日
成立至今指2023年11月13日－2024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

汇丰晋信大盘股票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
（2009年6月24日至2024年12月31日）

注： 1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，其中，本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过6个月内完成建仓，截止2009年12月24日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准＝沪深300指数*90%＋同业存款利率*10%。

3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含沪深300指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信大盘股票H累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年12月30日至2024年12月31日）

注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，其中，本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准＝沪深300指数*90%＋同业存款利率*10%。

3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含沪深300指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4. 本基金自2015年12月30日起增加H类份额。

汇丰晋信大盘股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2023年11月13日至2024年12月31日）

注：

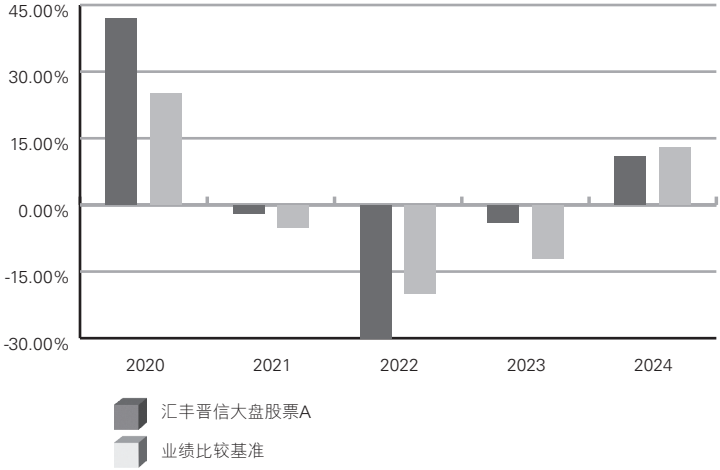
1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，其中，本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

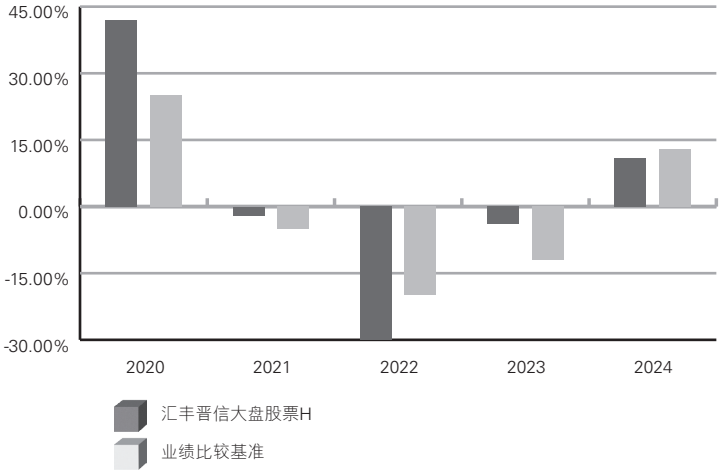
2. 报告期内本基金的业绩比较基准＝沪深300指数*90%＋同业存款利率*10%。

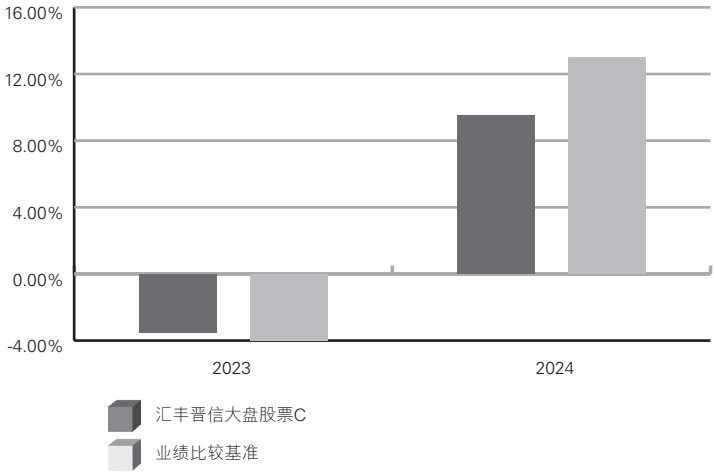
3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含沪深300指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4. 本基金自2023年11月13日起增加C类份额。

### 3.2.3 过去五年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：本基金自2023年11月13日起增加C类份额，截至2024年12月31日C类份额成立未满五年。

本基金C类份额成立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2024年12月31日，公司共管理39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）和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金（2024年12月11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 | | |
| 闵良超 | 汇丰晋信基金管理有限公司股票研究总监，汇丰晋信2026生命周期证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金经理 | 2023-03-18 | – | 11 | 闵良超先生，硕士研究生。曾任平安证券股份有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级宏观策略分析师、助理研究总监、研究副总监，现任汇丰晋信基金管理有限公司股票研究总监，汇丰晋信2026生命周期证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金经理。 |

| 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 | | |
| 闫湜 | 汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理 | 2021-12-25 | 2024-12-20 | 12 | 闫湜女士，硕士研究生。曾任易方达基金管理有限公司信用研究员、富国基金管理有限公司基金经理助理、万家基金管理有限公司基金经理助理，汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理。现任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. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 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价率均值进行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

2024年，主要的宽基指数均有一定幅度的涨幅。尤其是9月份政策转向之后，市场迎来了较为明显的估值扩张。2024年尤其是上半年，基于经济弱复苏的假设下，本产品采取了相对均衡的配置思路，同时在市值上也做到了相对中性。行业配置上，一方面增加配置内需相关的板块，同时对于经济相关度较低的板块也进行配置，反映的是我们既关注内需复苏的可能性，同时又认为这个复苏可能只是弱复苏。从结果上来看，由于内需的复苏不及预期，内需相关板块的表现较弱，但同时在TMT板块中，年初配置的人工智能板块和消费电子板块，对于今年上半年的贡献比较突出。到了2024年下半年，市场的交易主线切换至科技板块，而本产品更多的配置到了内需相关的资产，尤其是具备成本优势的优质公司我们认为已经有了比较好的性价比。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值变化幅度为10.31%，同期业绩比较基准为13.25%，本基金A类落后同期比较基准为2.94%；本基金H类本报告期内净值变化幅度为10.16%，同期业绩比较基准为13.25%，本基金H类落后同期比较基准为3.09%；本基金C类本报告期内净值变化幅度为9.84%，同期业绩比较基准为13.25%，本基金C类落后同期比较基准为3.41%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

大盘基金专注于分析大盘股特有的竞争优势，基金管理人将对初选股票给予全面的价值、成长分析，并结合行业地位分析，优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票进行投资。

展望2025年，我们有理由相信市场会迎来破局和重构。市场破局的第一个变量是政策的发力。近期市场已经迎来了政策的显著发力，货币政策端通过降息和降低存量房贷利率来降实际有效利率，财政政策预计也会持续发力。市场破局的第二个变量是行业供需结构的反转，很多行业在过去几年面临的较大挑战是供给产能的过剩，积极的信号在于很多行业已经开始缩减资本开支甚至降低开工率来应对价格的通缩，进入2025年，在需求弱复苏的假设下，部分行业有望率先走出反转，这也是预期市场会有不错表现的基本面支撑。

向前看，我们围绕以下几个方向进行配置：1）我们看好2025年经济的需求结构性恢复，同时供给同时受到约束的顺周期板块，有望带来较大的价格和盈利恢复弹性。2）在经济相关度较低的板块或者由自身产业周期逻辑来驱动的成长细分方向，主要集中部分消费及高端制造细分领域。

### 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相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大盘股票型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大盘股票型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大盘股票型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(2025)第20695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 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人： |
| 审计意见 | （一）我们审计的内容<br><br>我们审计了汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（以下简称“汇丰晋信大盘股票基金”）的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。<br><br>（二）我们的意见<br><br>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大盘股票基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。<br><br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇丰晋信大盘股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |

| | |
|---|---|
| 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 | 汇丰晋信大盘股票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。<br><br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇丰晋信大盘股票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大盘股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br><br>基金管理人治理层负责监督汇丰晋信大盘股票基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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。<br><br>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：<br><br>(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。 |

| | | |
|---|---|---|
| | （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。<br><br>（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。<br><br>（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大盘股票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大盘股票基金不能持续经营。<br><br>（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。<br><br>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。 | |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合夥） | |
| 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 | 2025-03-26 | |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金
报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **资产：** | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |
| 结算备付金 | | 955,260.88 | 2,157,455.37 |
| 存出保证金 | | 731,225.55 | 623,232.05 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 2,131,923,533.95 | 1,907,614,387.32 |
| 其中： 股票投资 | | 2,131,923,533.95 | 1,847,686,110.40 |
| 基金投资 | | – | – |
| 债券投资 | | – | 59,928,276.92 |
| 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 | – | – |
| 应收清算款 | | – | – |
| 应收股利 | | – | – |
| 应收申购款 | | 395,751.17 | 3,246,043.03 |
| 递延所得税资产 | | – | – |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | – | – |
| **资产总计** | | 2,323,092,705.06 | 1,975,513,124.89 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023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 | | – | – |
| 应付清算款 | | 4,175,090.69 | 1,035,729.30 |
| 应付赎回款 | | 1,298,914.07 | 735,231.91 |
| 应付管理人报酬 | | 2,982,400.51 | 2,481,511.20 |
| 应付托管费 | | 497,066.73 | 413,585.22 |
| 应付销售服务费 | | 23,801.98 | 13,574.53 |
| 应付投资顾问费 | | – | – |
| 应交税费 | | – | – |
| 应付利润 | | – | – |
| 递延所得税负债 | | – | – |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 1,015,455.77 | 1,806,902.16 |
| **负债合计** | | 9,992,729.75 | 6,486,534.32 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 572,040,981.68 | 537,111,410.13 |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 1,741,058,993.63 | 1,431,915,180.44 |
| 净资产合计 | | 2,313,099,975.31 | 1,969,026,590.57 |
| **负债和净资产总计** | | 2,323,092,705.06 | 1,975,513,124.89 |

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额为598,767,403.73份，其中A类基金份额总额为536,688,229.58份，基金份额净值4.0452元；C类基金份额总额为16,895,296.51份，基金份额净值4.0260元；H类基金份额总额为45,183,877.64份，基金份额净值1.6398元。

## 7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金
本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 307,646,163.72 | -50,115,263.85 |
| 1.利息收入 | | 1,036,593.63 | 923,229.36 |
| 其中： 存款利息收入 | 7.4.7.9 | 1,036,593.63 | 923,229.36 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 177,626,232.82 | 82,053,262.35 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 113,929,481.81 | 57,547,242.11 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 70,043.08 | 191,388.40 |
| 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 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |
| 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 | 127,757,115.04 | -133,364,464.23 |
| 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 | 1,226,222.23 | 272,708.67 |

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **减：二、营业总支出** | | 42,068,831.02 | 29,061,625.42 |
| 1.管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 35,575,065.55 | 24,657,014.73 |
| 2.托管费 | 7.4.10.2.2 | 5,929,177.61 | 4,109,502.36 |
| 3.销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 326,577.86 | 16,619.32 |
| 4.投资顾问费 | | – | – |
| 5.利息支出 | | – | – |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | – | – |
| 6.信用减值损失 | | – | – |
| 7.税金及附加 | | – | – |
| 8.其他费用 | 7.4.7.18 | 238,010.00 | 278,489.01 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |
| 减：所得税费用 | | – | – |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | – | – |
| **六、综合收益总额** | | 265,577,332.70 | –79,176,889.27 |

## 7.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金
本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<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 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |
| 二、本期期初净资产 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 34,929,571.55 | 309,143,813.19 | 344,073,384.74 |
| （一）、综合收益总额 | – | 265,577,332.70 | 265,577,332.70 |
| （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） | 34,929,571.55 | 43,566,480.49 | 78,496,052.04 |
| 其中：1.基金申购款 | 314,616,326.64 | 858,655,642.69 | 1,173,271,969.33 |
| 2.基金赎回款 | –279,686,755.09 | –815,089,162.20 | –1,094,775,917.29 |
| （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 | 572,040,981.68 | 1,741,058,993.63 | 2,313,099,975.31 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023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 | 360,711,965.95 | 1,000,979,164.85 | 1,361,691,130.80 |
| 二、本期期初净资产 | 360,711,965.95 | 1,000,979,164.85 | 1,361,691,130.80 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 176,399,444.18 | 430,936,015.59 | 607,335,459.77 |
| （一）、综合收益总额 | – | –79,176,889.27 | –79,176,889.27 |
| （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） | 176,399,444.18 | 510,112,904.86 | 686,512,349.04 |
| 其中：1.基金申购款 | 233,105,658.74 | 674,448,620.86 | 907,554,279.60 |
| 2.基金赎回款 | –56,706,214.56 | –164,335,716.00 | –221,041,930.56 |
| （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 | 537,111,410.13 | 1,431,915,180.44 | 1,969,026,590.57 |

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

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2009]第343号《关于同意汇丰晋信大盘股票型证券投资基金募集的批复》核准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,884,896,208.13元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合夥）（原“毕马威华振会计师事务所有限公司”）KPMG-B(2009)CRNo.0031验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》于2009年6月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,885,554,241.41份基金份额，其中认购资金利息折合658,033.28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。根据《关于汇丰晋信大盘股票型证券投资基金增设基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自2015年12月28日起，本基金根据销售对象的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额，称为A类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为H类基金份额。本基金A类基金份额、H类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。根据《关于汇丰晋信大盘股票型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及更新的《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书》，自2023年11月13日起，本基金新增C类基金份额，该类收费模式不收取申购费，而是从基金资产中计提销售服务费。本基金原有的A类基金份额与H类基金份额收费模式不变。本基金A类基金份额、C类基金份额均为在内地销售的、为内地投资者设立的份额类别。H类基金份额为在香港销售机构销售的、为香港投资者设立的份额类别。由于基金费用收取方式的不同，本基金A类基金份额、C类基金份额和H类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数 ×90%+ 同业存款利率 ×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2025年3月26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》、《汇丰晋信大盘股票型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2024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2024年12月31日的财务状况以及2024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。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产／负债。

*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*

本基金持有的股票投资和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*

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(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*

本基金同一类别的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，A类基金份额和C类基金份额的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；H类基金份额的收益分配仅采用现金方式。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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协 (AMAC) 基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发 [2017]6 号《关于发布 < 证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）> 的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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%的徵收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免徵收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不徵收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半徵收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半徵收。

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

### 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>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |
| 等于： 本金 | 189,066,298.02 | 61,845,422.92 |
| 加：应计利息 | 20,635.49 | 26,584.20 |
| 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 | 189,086,933.51 | 61,872,007.12 |

*7.4.7.2 交易性金融资产*

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<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 | | 2,102,250,369.57 | – | 2,131,923,533.95 | 29,673,164.38 |
| 贵金属投资－金交所黄金合约 | | – | – | – | – |
| 债券 | 交易所市场 | – | – | – | – |
| | 银行间市场 | – | – | – | – |
| | 合计 | – | – | – | – |
| 资产支持证券 | | – | – | – | – |
| 基金 | | – | – | – | – |
| 其他 | | – | – | – | – |
| 合计 | | 2,102,250,369.57 | – | 2,131,923,533.95 | 29,673,164.38 |

| 项目 | | 上年度末<br>2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,945,768,381.06 | – | 1,847,686,110.40 | –98,082,270.66 |
| 贵金属投资－金交所黄金合约 | | – | – | – | – |
| 债券 | 交易所市场 | – | – | – | – |
| | 银行间市场 | 59,695,680.00 | 234,276.92 | 59,928,276.92 | –1,680.00 |
| | 合计 | 59,695,680.00 | 234,276.92 | 59,928,276.92 | –1,680.00 |
| 资产支持证券 | | – | – | – | – |
| 基金 | | – | – | – | – |
| 其他 | | – | – | – | – |
| 合计 | | 2,005,464,061.06 | 234,276.92 | 1,907,614,387.32 | –98,083,950.66 |

*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

无。

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>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | – | – |
| 应付赎回费 | 4,464.08 | 2,816.89 |
| 应付证券出借违约金 | – | – |
| 应付交易费用 | 810,891.11 | 1,564,085.27 |
| 其中：交易所市场 | 810,891.11 | 1,563,785.27 |
| 银行间市场 | – | 300.00 |
| 应付利息 | – | – |
| 预提费用 | 200,000.00 | 240,000.00 |
| 其他应付 | 100.58 | – |
| 合计 | 1,015,455.77 | 1,806,902.16 |

*7.4.7.7 实收基金*

7.4.7.7.1　汇丰晋信大盘股票A

金额单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票A） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 503,956,142.97 | 503,956,142.97 |
| 本期申购 | 263,423,851.36 | 263,423,851.36 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | –230,691,764.75 | –230,691,764.75 |
| 本期末 | 536,688,229.58 | 536,688,229.58 |

注：A类与C类基金份额申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.7.2　汇丰晋信大盘股票H

金额单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票H） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 57,429,880.76 | 23,454,078.60 |
| 本期申购 | – | – |
| 本期赎回（以“-”号填列） | –12,246,003.12 | –5,001,223.73 |
| 本期末 | 45,183,877.64 | 18,452,854.87 |

7.4.7.7.3　汇丰晋信大盘股票C

金额单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票C） | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 9,698,515.35 | 9,701,188.56 |
| 本期申购 | 51,178,535.38 | 51,192,475.28 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | –43,981,754.22 | –43,993,766.61 |
| 本期末 | 16,895,296.51 | 16,899,897.23 |

注：A类与C类基金份额申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

*7.4.7.8 未分配利润*

7.4.7.8.1 汇丰晋信大盘股票A

单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票A） | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 1,537,133,236.96 | -193,097,106.46 | 1,344,036,130.50 |
| 本期期初 | 1,537,133,236.96 | -193,097,106.46 | 1,344,036,130.50 |
| 本期利润 | 126,678,409.74 | 124,454,349.65 | 251,132,759.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 85,724,716.84 | -46,595,249.65 | 39,129,467.19 |
| 其中：基金申购款 | 817,592,904.32 | -95,133,497.39 | 722,459,406.93 |
| 基金赎回款 | -731,868,187.48 | 48,538,247.74 | -683,329,939.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,749,536,363.54 | -115,238,006.46 | 1,634,298,357.08 |

7.4.7.8.2 汇丰晋信大盘股票H

单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票H） | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 70,933,426.97 | -8,899,865.91 | 62,033,561.06 |
| 本期期初 | 70,933,426.97 | -8,899,865.91 | 62,033,561.06 |
| 本期利润 | 4,216,449.73 | 3,590,772.92 | 7,807,222.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -15,593,107.74 | 1,393,078.05 | -14,200,029.69 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -15,593,107.74 | 1,393,078.05 | -14,200,029.69 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 59,556,768.96 | -3,916,014.94 | 55,640,754.02 |

7.4.7.8.3　汇丰晋信大盘股票C

单位：人民币元

| 项目<br>（汇丰晋信大盘股票C） | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 29,561,085.69 | –3,715,596.81 | 25,845,488.88 |
| 本期期初 | 29,561,085.69 | –3,715,596.81 | 25,845,488.88 |
| 本期利润 | 6,925,358.19 | –288,007.53 | 6,637,350.66 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 18,272,594.95 | 364,448.04 | 18,637,042.99 |
| 其中：基金申购款 | 156,291,034.29 | –20,094,798.53 | 136,196,235.76 |
| 基金赎回款 | –138,018,439.34 | 20,459,246.57 | –117,559,192.77 |
| 本期已分配利润 | – | – | – |
| 本期末 | 54,759,038.83 | –3,639,156.30 | 51,119,882.53 |

*7.4.7.9 存款利息收入*

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 973,827.08 | 849,883.65 |
| 定期存款利息收入 | – | – |
| 其他存款利息收入 | – | – |
| 结算备付金利息收入 | 52,449.55 | 62,025.71 |
| 其他 | 10,317.00 | 11,320.00 |
| 合计 | 1,036,593.63 | 923,229.36 |

*7.4.7.10 股票投资收益－买卖股票差价收入*

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 4,965,521,849.05 | 4,947,698,280.43 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,841,397,747.77 | 4,875,305,187.96 |
| 减：交易费用 | 10,194,619.47 | 14,845,850.36 |
| 买卖股票差价收入 | 113,929,481.81 | 57,547,242.11 |

*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>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 债券投资收益－利息收入 | 104,123.08 | 250,751.60 |
| 债券投资收益－买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | –34,080.00 | –59,363.20 |
| 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 | 70,043.08 | 191,388.40 |

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>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 60,000,000.00 | 45,516,500.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 59,695,680.00 | 44,934,038.20 |
| 减：应计利息总额 | 338,400.00 | 641,350.00 |
| 减：交易费用 | – | 475.00 |
| 买卖债券差价收入 | –34,080.00 | –59,363.20 |

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*

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | – | – |
| 基金投资产生的股利收益 | – | – |
| 合计 | 63,626,707.93 | 24,314,631.84 |

*7.4.7.16 公允价值变动收益*

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 127,757,115.04 | –133,364,464.23 |
| －股票投资 | 127,755,435.04 | –133,434,282.43 |
| －债券投资 | 1,680.00 | 69,818.20 |
| －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 | 127,757,115.04 | –133,364,464.23 |

*7.4.7.17 其他收入*

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 503,710.81 | 243,848.76 |
| 基金转换费收入 | 722,511.42 | 28,859.91 |
| 合计 | 1,226,222.23 | 272,708.67 |

注：

1. 对A类基金份额持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费，赎回费全额计入基金财产；对A类基金份额持续持有期大于等于7日的投资者收取0.5%的赎回费，不低于赎回费总额25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

   对C类基金份额持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费，赎回费全额计入基金财产；对C类基金份额持续持有期大于等于7日，小于30日的投资者收取0.5%的赎回费，赎回费全额计入基金财产；其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对C类基金份额持续持有期大于等于30日的投资者不收取赎回费。

   A、C类基金份额的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分组成，其中赎回费部分按照上述规则归入转出基金的基金资产。

2. H类基金份额的赎回费率为0.13%，赎回费总额100%归入基金资产。H类基金份额暂未开通转换业务。

*7.4.7.18 其他费用*

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 80,000.00 | 120,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | – | – |
| 汇划手续费 | 810.00 | 1,289.01 |
| 账户维护费 | 36,900.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 300.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 238,010.00 | 278,489.01 |

### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 汇丰前海 | 144,577,753.89 | 1.45% | 73,920,359.89 | 0.70% |
| 山西证券 | 28,359,977.96 | 0.28% | – | – |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 汇丰前海 | 136,757.50 | 1.93% | – | – |
| 山西证券 | 12,362.74 | 0.17% | 12,362.74 | 1.52% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 汇丰前海 | 69,920.46 | 0.72% | – | – |
| 山西证券 | – | – | – | – |

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据中国证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用，针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

*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>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 35,575,065.55 | 24,657,014.73 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 10,963,322.13 | 9,827,902.07 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 24,611,743.42 | 14,829,112.66 |

注：支付基金管理人汇丰晋信的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值X 1.50%/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>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,929,177.61 | 4,109,502.36 |

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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25%/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>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 | | | |
| | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C | 合计 |
| 交通银行 | 0.00 | 0.00 | 11.05 | 11.05 |
| 汇丰晋信 | 0.00 | 0.00 | 205,727.06 | 205,727.06 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 205,738.11 | 205,738.11 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C | 合计 |
| 交通银行 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 汇丰晋信 | 0.00 | 0.00 | 16,619.32 | 16,619.32 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 16,619.32 | 16,619.32 |

注：根据《关于汇丰晋信大盘股票型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及更新的《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书》，本基金自2023年11月13日起增设C类基金份额。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%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。A类、H类基金份额不计提销售服务费，C类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率为0.40%。其计算公式为：C类基金份额日销售服务费＝前一日C类基金资产净值X0.40%／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*

无。

*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<br>2024年01月01日至<br>2024年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023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 | 189,086,933.51 | 973,827.08 | 61,872,007.12 | 849,883.65 |

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*

无。

**7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

无。

### 7.4.12 期末（2024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

无。

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。

于2024年12月31日，本基金无债券投资（2023年12月31日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

*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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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2024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2024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。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年12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 | 189,086,933.51 | – | – | – | 189,086,933.51 |
| 结算备付金 | 955,260.88 | – | – | – | 955,260.88 |
| 存出保证金 | 731,225.55 | – | – | – | 731,225.55 |
| 交易性金融资产 | – | – | – | 2,131,923,533.95 | 2,131,923,533.95 |
| 应收申购款 | – | – | – | 395,751.17 | 395,751.17 |
| **资产总计** | 190,773,419.94 | – | – | 2,132,319,285.12 | 2,323,092,705.06 |
| **负债** | | | | | |
| 应付清算款 | – | – | – | 4,175,090.69 | 4,175,090.69 |
| 应付赎回款 | – | – | – | 1,298,914.07 | 1,298,914.07 |
| 应付管理人报酬 | – | – | – | 2,982,400.51 | 2,982,400.51 |
| 应付托管费 | – | – | – | 497,066.73 | 497,066.73 |
| 应付销售服务费 | – | – | – | 23,801.98 | 23,801.98 |
| 其他负债 | – | – | – | 1,015,455.77 | 1,015,455.77 |
| **负债总计** | – | – | – | 9,992,729.75 | 9,992,729.75 |
| 利率敏感度缺口 | 190,773,419.94 | – | – | 2,122,326,555.37 | 2,313,099,975.31 |

| 上年度末<br>2023年12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 | 61,872,007.12 | – | – | – | 61,872,007.12 |
| 结算备付金 | 2,157,455.37 | – | – | – | 2,157,455.37 |
| 存出保证金 | 623,232.05 | – | – | – | 623,232.05 |
| 交易性金融资产 | 59,928,276.92 | – | – | 1,847,686,110.40 | 1,907,614,387.32 |
| 应收申购款 | – | – | – | 3,246,043.03 | 3,246,043.03 |
| 资产总计 | 124,580,971.46 | – | – | 1,850,932,153.43 | 1,975,513,124.89 |
| **负债** | | | | | |
| **应付清算款** | – | – | – | 1,035,729.30 | 1,035,729.30 |
| 应付赎回款 | – | – | – | 735,231.91 | 735,231.91 |
| 应付管理人报酬 | – | – | – | 2,481,511.20 | 2,481,511.20 |
| 应付托管费 | – | – | – | 413,585.22 | 413,585.22 |
| 应付销售服务费 | – | – | – | 13,574.53 | 13,574.53 |
| 其他负债 | – | – | – | 1,806,902.16 | 1,806,902.16 |
| **负债总计** | – | – | – | 6,486,534.32 | 6,486,534.32 |
| 利率敏感度缺口 | 124,580,971.46 | – | – | 1,844,445,619.11 | 1,969,026,590.57 |

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

于2024年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2023年12月31日：3.04%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(ValueatRisk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年12月31日 | | 上年度末<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产－股票投资 | 2,131,923,533.95 | 92.17 | 1,847,686,110.40 | 93.84 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,131,923,533.95 | 92.17 | 1,847,686,110.40 | 93.84 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2024年12月31日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5% | 131,236,719.94 | 104,879,603.83 |
| | 2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5% | –131,236,719.94 | –104,879,603.83 |

### 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 2024年12月31日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 2,131,923,533.95 | 1,847,686,110.40 |
| 第二层次 | – | 59,928,276.92 |
| 第三层次 | – | – |
| 合计 | **2,131,923,533.95** | **1,907,614,387.32** |

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。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | – | – | – |
| 当期购买 | – | – | – |
| 当期出售／结算 | – | – | – |
| 转入第三层次 | – | 4,713.69 | 4,713.69 |
| 转出第三层次 | – | 2,677.41 | 2,677.41 |
| 当期利得或损失总额 | – | –2,036.28 | –2,036.28 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | – | –2,036.28 | –2,036.28 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | – | – | – |
| 期末余额 | – | – | – |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动－公允价值变动损益 | – | – | – |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | – | – | – |
| 当期购买 | – | – | – |
| 当期出售／结算 | – | – | – |
| 转入第三层次 | – | 62,961.62 | 62,961.62 |
| 转出第三层次 | – | 45,793.10 | 45,793.10 |
| 当期利得或损失总额 | – | –17,168.52 | –17,168.52 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | – | –17,168.52 | –17,168.52 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | – | – | – |
| 期末余额 | – | – | – |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动－公允价值变动损益 | – | – | – |

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：同）。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2023年度：同）。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

*7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明*

于2024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（2023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 | 2,131,923,533.95 | 91.77 |
| | 其中：股票 | 2,131,923,533.95 | 91.77 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 190,042,194.39 | 8.18 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,126,976.72 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 2,323,092,705.06 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| B | 采矿业 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| C | 制造业 | 1,712,714,088.95 | 74.04 |
| 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 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 84,369,757.50 | 3.65 |
| 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 | 222,777,977.50 | 9.63 |
| K | 房地产业 | 25,265,176.00 | 1.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| 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 | 2,131,923,533.95 | 92.17 |

**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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601233 | 桐昆股份 | 15,971,273 | 188,461,021.40 | 8.15 |
| 2 | 000807 | 云铝股份 | 10,017,097 | 135,531,322.41 | 5.86 |
| 3 | 600782 | 新钢股份 | 38,442,800 | 128,398,952.00 | 5.55 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 2,377,500 | 108,057,375.00 | 4.67 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 5,554,500 | 106,424,220.00 | 4.60 |
| 6 | 000338 | 潍柴动力 | 6,966,400 | 95,439,680.00 | 4.13 |
| 7 | 601688 | 华泰证券 | 5,145,250 | 90,504,947.50 | 3.91 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 5,425,300 | 89,408,944.00 | 3.87 |
| 9 | 000933 | 神火股份 | 4,929,900 | 83,315,310.00 | 3.60 |
| 10 | 601717 | 郑煤机 | 6,351,999 | 82,448,947.02 | 3.56 |
| 11 | 603035 | 常熟汽饰 | 5,380,995 | 77,432,518.05 | 3.35 |
| 12 | 000951 | 中国重汽 | 4,410,000 | 74,881,800.00 | 3.24 |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 1,009,038 | 71,994,861.30 | 3.11 |
| 14 | 601615 | 明阳智能 | 4,585,500 | 57,823,155.00 | 2.50 |
| 15 | 002078 | 太阳纸业 | 3,773,300 | 56,108,971.00 | 2.43 |
| 16 | 000589 | 贵州轮胎 | 10,655,000 | 53,594,650.00 | 2.32 |
| 17 | 603816 | 顾家家居 | 1,710,600 | 47,178,348.00 | 2.04 |
| 18 | 300373 | 扬杰科技 | 979,296 | 42,618,961.92 | 1.84 |
| 19 | 603599 | 广信股份 | 3,452,740 | 41,605,517.00 | 1.80 |
| 20 | 000725 | 京东方A | 9,147,300 | 40,156,647.00 | 1.74 |
| 21 | 002727 | 一心堂 | 2,703,700 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| 22 | 000921 | 海信家电 | 1,189,800 | 34,385,220.00 | 1.49 |
| 23 | 601111 | 中国国航 | 4,040,300 | 31,958,773.00 | 1.38 |

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 24 | 603056 | 德邦股份 | 2,054,050 | 29,434,536.50 | 1.27 |
| 25 | 603225 | 新凤鸣 | 2,607,000 | 29,015,910.00 | 1.25 |
| 26 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,222,300 | 26,413,903.00 | 1.14 |
| 27 | 600989 | 宝丰能源 | 1,552,000 | 26,135,680.00 | 1.13 |
| 28 | 000001 | 平安银行 | 2,209,300 | 25,848,810.00 | 1.12 |
| 29 | 600048 | 保利发展 | 2,851,600 | 25,265,176.00 | 1.09 |
| 30 | 603611 | 诺力股份 | 1,404,260 | 25,206,467.00 | 1.09 |
| 31 | 002299 | 圣农发展 | 1,727,000 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| 32 | 688059 | 华锐精密 | 519,028 | 23,200,551.60 | 1.00 |
| 33 | 600233 | 圆通速递 | 1,619,200 | 22,976,448.00 | 0.99 |
| 34 | 603558 | 健盛集团 | 1,993,100 | 21,445,756.00 | 0.93 |
| 35 | 600482 | 中国动力 | 786,500 | 19,245,655.00 | 0.83 |
| 36 | 000739 | 普洛药业 | 916,600 | 14,903,916.00 | 0.64 |
| 37 | 601899 | 紫金矿业 | 968,500 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| 38 | 603259 | 药明康德 | 217,000 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| 39 | 688678 | 福立旺 | 662,885 | 9,843,842.25 | 0.43 |
| 40 | 300260 | 新莱应材 | 312,300 | 8,460,207.00 | 0.37 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600782 | 新钢股份 | 194,352,695.00 | 9.87 |
| 2 | 601233 | 桐昆股份 | 179,915,371.51 | 9.14 |
| 3 | 601688 | 华泰证券 | 142,624,888.00 | 7.24 |
| 4 | 000807 | 云铝股份 | 129,242,723.15 | 6.56 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 106,762,880.38 | 5.42 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 105,040,888.50 | 5.33 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 104,209,057.40 | 5.29 |
| 8 | 000338 | 潍柴动力 | 102,369,861.00 | 5.20 |
| 9 | 601717 | 郑煤机 | 100,795,624.85 | 5.12 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 96,770,164.55 | 4.91 |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 89,135,879.73 | 4.53 |
| 12 | 002643 | 万润股份 | 89,122,690.00 | 4.53 |
| 13 | 000933 | 神火股份 | 86,742,696.20 | 4.41 |
| 14 | 601111 | 中国国航 | 85,768,892.00 | 4.36 |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 85,396,775.00 | 4.34 |
| 16 | 600754 | 锦江酒店 | 75,993,612.41 | 3.86 |
| 17 | 002384 | 东山精密 | 75,397,907.00 | 3.83 |
| 18 | 000589 | 贵州轮胎 | 72,847,626.46 | 3.70 |
| 19 | 300034 | 钢研高纳 | 71,714,545.96 | 3.64 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 71,170,927.00 | 3.61 |
| 21 | 000739 | 普洛药业 | 69,545,047.40 | 3.53 |
| 22 | 603225 | 新凤鸣 | 68,802,209.15 | 3.49 |
| 23 | 000951 | 中国重汽 | 67,805,040.53 | 3.44 |
| 24 | 300308 | 中际旭创 | 67,779,240.53 | 3.44 |
| 25 | 002727 | 一心堂 | 62,184,535.00 | 3.16 |

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 26 | 603588 | 高能环境 | 61,990,135.80 | 3.15 |
| 27 | 300136 | 信维通信 | 61,772,769.16 | 3.14 |
| 28 | 603259 | 药明康德 | 60,156,678.00 | 3.06 |
| 29 | 300498 | 温氏股份 | 58,763,068.56 | 2.98 |
| 30 | 600036 | 招商银行 | 57,924,649.00 | 2.94 |
| 31 | 601857 | 中国石油 | 56,811,994.14 | 2.89 |
| 32 | 603816 | 顾家家居 | 55,616,535.00 | 2.82 |
| 33 | 603035 | 常熟汽饰 | 55,518,116.09 | 2.82 |
| 34 | 688059 | 华锐精密 | 55,286,079.46 | 2.81 |
| 35 | 002078 | 太阳纸业 | 54,499,808.00 | 2.77 |
| 36 | 600482 | 中国动力 | 54,025,105.49 | 2.74 |
| 37 | 603939 | 益丰药房 | 52,856,364.92 | 2.68 |
| 38 | 603599 | 广信股份 | 50,749,646.40 | 2.58 |
| 39 | 601138 | 工业富联 | 50,474,487.73 | 2.56 |
| 40 | 000776 | 广发证券 | 48,745,639.48 | 2.48 |
| 41 | 603056 | 德邦股份 | 48,135,540.18 | 2.44 |
| 42 | 600887 | 伊利股份 | 46,532,421.66 | 2.36 |
| 43 | 600837 | 海通证券 | 46,491,549.63 | 2.36 |
| 44 | 688403 | 汇成股份 | 46,289,392.11 | 2.35 |
| 45 | 002402 | 和而泰 | 44,939,524.58 | 2.28 |
| 46 | 601882 | 海天精工 | 43,446,431.67 | 2.21 |
| 47 | 600761 | 安徽合力 | 42,877,504.81 | 2.18 |
| 48 | 603611 | 诺力股份 | 42,818,542.80 | 2.17 |
| 49 | 000002 | 万科A | 42,512,350.18 | 2.16 |
| 50 | 600233 | 圆通速递 | 42,069,552.68 | 2.14 |
| 51 | 600989 | 宝丰能源 | 40,402,522.00 | 2.05 |
| 52 | 000725 | 京东方A | 39,414,736.00 | 2.00 |

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601111 | 中国国航 | 221,461,159.83 | 11.25 |
| 2 | 002384 | 东山精密 | 195,668,603.00 | 9.94 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 180,203,454.10 | 9.15 |
| 4 | 600048 | 保利发展 | 176,050,643.02 | 8.94 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 147,712,998.00 | 7.50 |
| 6 | 300498 | 温氏股份 | 138,931,592.87 | 7.06 |
| 7 | 000100 | TCL科技 | 136,868,843.30 | 6.95 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 121,864,621.25 | 6.19 |
| 9 | 300373 | 扬杰科技 | 109,135,740.44 | 5.54 |
| 10 | 600754 | 锦江酒店 | 107,516,667.76 | 5.46 |
| 11 | 000002 | 万科A | 94,263,672.00 | 4.79 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 94,136,596.58 | 4.78 |
| 13 | 601138 | 工业富联 | 80,682,255.13 | 4.10 |
| 14 | 002643 | 万润股份 | 78,728,833.04 | 4.00 |
| 15 | 000776 | 广发证券 | 77,143,526.82 | 3.92 |
| 16 | 300034 | 钢研高纳 | 72,054,750.60 | 3.66 |
| 17 | 300308 | 中际旭创 | 70,544,320.40 | 3.58 |
| 18 | 600782 | 新钢股份 | 70,206,775.00 | 3.57 |
| 19 | 000059 | 华锦股份 | 66,341,555.87 | 3.37 |
| 20 | 000807 | 云铝股份 | 65,961,754.00 | 3.35 |
| 21 | 300136 | 信维通信 | 65,601,993.95 | 3.33 |
| 22 | 603236 | 移远通信 | 63,885,333.04 | 3.24 |
| 23 | 603588 | 高能环境 | 60,873,605.03 | 3.09 |
| 24 | 000739 | 普洛药业 | 60,284,342.00 | 3.06 |

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 25 | 002468 | 申通快递 | 56,757,939.00 | 2.88 |
| 26 | 601717 | 郑煤机 | 56,267,041.39 | 2.86 |
| 27 | 688403 | 汇成股份 | 54,369,580.03 | 2.76 |
| 28 | 002402 | 和而泰 | 54,323,968.50 | 2.76 |
| 29 | 600029 | 南方航空 | 54,010,782.82 | 2.74 |
| 30 | 601857 | 中国石油 | 52,588,621.00 | 2.67 |
| 31 | 600919 | 江苏银行 | 50,546,989.20 | 2.57 |
| 32 | 603259 | 药明康德 | 50,188,400.60 | 2.55 |
| 33 | 603939 | 益丰药房 | 48,388,318.62 | 2.46 |
| 34 | 600887 | 伊利股份 | 46,893,238.00 | 2.38 |
| 35 | 600837 | 海通证券 | 46,795,211.97 | 2.38 |
| 36 | 600761 | 安徽合力 | 45,517,378.43 | 2.31 |
| 37 | 603056 | 德邦股份 | 44,440,426.00 | 2.26 |
| 38 | 000001 | 平安银行 | 44,090,905.80 | 2.24 |
| 39 | 601117 | 中国化学 | 42,731,554.00 | 2.17 |
| 40 | 002531 | 天顺风能 | 41,483,014.69 | 2.11 |

注：本表"本期累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 4,997,879,736.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,965,521,849.05 |

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 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

无。

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 731,225.55 |
| 2 | 应收清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | – |
| 5 | 应收申购款 | 395,751.17 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,126,976.72 |

### 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。

**8.13 投资组合报告（供香港投资人参阅）**

| 投资组合<br>于2024/12/31 | *汇丰晋信大盘股票型证券投资基金* | | |
|---|---|---|---|
| | 持有数量 | 市值（人民币） | 市值占净值% |
| **股票投资** | | | |
| **上市股票** | | | |
| *A股* | | | |
| *中华人民共和国* | | | |
| 桐昆股份 | 15,971,273 | 188,461,021.40 | 8.15 |
| 云铝股份 | 10,017,097 | 135,531,322.41 | 5.86 |
| 新钢股份 | 38,442,800 | 128,398,952.00 | 5.55 |
| 格力电器 | 2,377,500 | 108,057,375.00 | 4.67 |
| 兴业银行 | 5,554,500 | 106,424,220.00 | 4.6 |
| 潍柴动力 | 6,966,400 | 95,439,680.00 | 4.13 |
| 华泰证券 | 5,145,250 | 90,504,947.50 | 3.91 |
| 三一重工 | 5,425,300 | 89,408,944.00 | 3.87 |
| 神火股份 | 4,929,900 | 83,315,310.00 | 3.6 |
| 郑煤机 | 6,351,999 | 82,448,947.02 | 3.56 |
| 常熟汽饰 | 5,380,995 | 77,432,518.05 | 3.35 |
| 中国重汽 | 4,410,000 | 74,881,800.00 | 3.24 |
| 万华化学 | 1,009,038 | 71,994,861.30 | 3.11 |
| 明阳智能 | 4,585,500 | 57,823,155.00 | 2.5 |
| 太阳纸业 | 3,773,300 | 56,108,971.00 | 2.43 |
| 贵州轮胎 | 10,655,000 | 53,594,650.00 | 2.32 |
| 顾家家居 | 1,710,600 | 47,178,348.00 | 2.04 |
| 扬杰科技 | 979,296 | 42,618,961.92 | 1.84 |
| 广信股份 | 3,452,740 | 41,605,517.00 | 1.8 |
| 京东方A | 9,147,300 | 40,156,647.00 | 1.74 |
| 一心堂 | 2,703,700 | 35,202,174.00 | 1.52 |
| 海信家电 | 1,189,800 | 34,385,220.00 | 1.49 |
| 中国国航 | 4,040,300 | 31,958,773.00 | 1.38 |
| 德邦股份 | 2,054,050 | 29,434,536.50 | 1.27 |
| 新凤鸣 | 2,607,000 | 29,015,910.00 | 1.25 |
| 华鲁恒升 | 1,222,300 | 26,413,903.00 | 1.14 |
| 宝丰能源 | 1,552,000 | 26,135,680.00 | 1.13 |
| 平安银行 | 2,209,300 | 25,848,810.00 | 1.12 |
| 保利发展 | 2,851,600 | 25,265,176.00 | 1.09 |

| 投资组合<br>于2024/12/31 | *汇丰晋信大盘股票型证券投资基金* | | |
|---|---|---|---|
| | 持有数量 | 市值（人民币） | 市值占净值% |
| 诺力股份 | 1,404,260 | 25,206,467.00 | 1.09 |
| 圣农发展 | 1,727,000 | 25,006,960.00 | 1.08 |
| 华锐精密 | 519,028 | 23,200,551.60 | 1 |
| 圆通速递 | 1,619,200 | 22,976,448.00 | 0.99 |
| 健盛集团 | 1,993,100 | 21,445,756.00 | 0.93 |
| 中国动力 | 786,500 | 19,245,655.00 | 0.83 |
| 普洛药业 | 916,600 | 14,903,916.00 | 0.64 |
| 紫金矿业 | 968,500 | 14,643,720.00 | 0.63 |
| 药明康德 | 217,000 | 11,943,680.00 | 0.52 |
| 福立旺 | 662,885 | 9,843,842.25 | 0.43 |
| 新莱应材 | 312,300 | 8,460,207.00 | 0.37 |
| | | | |
| **投资总计** | | | |
| 投资总成本：2,102,250,369.57人民币元 | | 2,131,923,533.95 | 92.17 |
| | | | |
| **其他净资产** | | 181,176,441.36 | 7.83 |
| **基金资产净值** | | 2,313,099,975.31 | 100.00 |

| 投资组合变动表 | 市值占净值% | |
|---|---|---|
| | 2024/12/31 | 2023/12/31 |
| **股票** | 92.17 | 93.84 |
| | | |
| **投资总计** | 92.17 | 93.84 |
| **其他净资产** | 7.83 | 6.16 |
| | | |
| 市值占净值% | 100.00 | 100.00 |

## §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

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 汇丰晋信大盘股票A | 40,831 | 13,144.14 | 274,665,784.07 | 51.18% | 262,022,445.51 | 48.82% |
| 汇丰晋信大盘股票H | 5 | 9,036,775.53 | 45,183,877.64 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 汇丰晋信大盘股票C | 86 | 196,456.94 | 16,616,321.40 | 98.35% | 278,975.11 | 1.65% |
| 合计 | 40,922 | 14,631.92 | 336,465,983.11 | 56.19% | 262,301,420.62 | 43.81% |

注：依据香港市场的特点，香港投资者持有的本基金H类别份额将由香港销售机构代表香港投资者名义持有，同时，香港销售机构以名义持有人的形式出现在注册登记机构的持有人名册中。基金管理人无法得知具体的投资者信息，此处本基金H类份额持有人户数为H类份额名义持有人户数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇丰晋信大盘股票A | 267,059.05 | 0.0498% |
| | 汇丰晋信大盘股票H | 0.00 | 0.0000% |
| | 汇丰晋信大盘股票C | 26,779.50 | 0.1585% |
| | 合计 | 293,838.55 | 0.0491% |

### 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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇丰晋信大盘股票A | 0 |
| | 汇丰晋信大盘股票H | 0 |
| | 汇丰晋信大盘股票C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 汇丰晋信大盘股票A | 10~50 |
| | 汇丰晋信大盘股票H | 0 |
| | 汇丰晋信大盘股票C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 汇丰晋信大盘股票A | 汇丰晋信大盘股票H | 汇丰晋信大盘股票C |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日（2009年06月24日）基金份额总额 | 2,885,554,241.41 | – | – |
| 本报告期期初基金份额总额 | 503,956,142.97 | 57,429,880.76 | 9,698,515.35 |
| 本报告期基金总申购份额 | 263,423,851.36 | – | 51,178,535.38 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 230,691,764.75 | 12,246,003.12 | 43,981,754.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | – | – | – |
| 本报告期期末基金份额总额 | 536,688,229.58 | 45,183,877.64 | 16,895,296.51 |

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

2024年7月6日，基金管理人发布公告，自2024年7月5日起，聘任何寒熙女士担任公司副总经理。

2024年7月20日，基金管理人发布公告，自2024年7月19日起，聘任周慧女士担任公司督察长，古韵女士不再担任公司督察长。

2024年7月22日，经公司股东会审议批准，聘任刘鹏飞先生、武旭先生担任公司董事，杨小勇先生、郭晋普先生不再担任公司董事；聘任姚伟先生担任公司监事，焦杨先生不再担任公司监事。

2024年7月22日，根据公司职工投票结果，聘任林琳女士、周韫女士担任公司职工代表监事，曹菁女士、侯玉琦先生不再担任公司职工代表监事。

2024年7月23日，经公司监事会审议批准，聘任姚伟先生担任公司监事会主席。

2024年7月27日，基金管理人发布公告，聘任刘鹏飞先生担任公司董事长。

2024年12月20日，闫湜女士不再担任本基金基金经理助理。

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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**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**

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于2015年4月18日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合夥)更换为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合夥)，并报中国证券监督管理委员会备案。

根据与普华永道中天会计师事务所(特殊普通合夥)签订的《审计业务约定书》，应实际支付2024年度审计费80000元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施1 | 内容 |
| --- | --- |
| 受到稽查或处罚等措施的主体 | 基金管理人及相关高级管理人员 |
| 受到稽查或处罚等措施的时间 | 2024年02月01日 |
| 采取稽查或处罚等措施的机构 | 中国证券监督管理委员会上海监管局 |
| 受到的具体措施类型 | 基金管理人被采取责令改正的行政监管措施，相关高级管理人员被采取出具警示函的行政监管措施 |
| 受到稽查或处罚等措施的原因 | 公司内部控制管理不完善 |
| 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，按要求及时完成整改，监管机构已验收通过整改结果，公司所有业务均正常开展 |
| 其他 | 无 |

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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 | |
| 川财证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 东方证券 | 1 | 386,265,096.99 | 3.88% | 228,216.02 | 3.23% | – |
| 光大证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 国金证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 华创证券 | 1 | 39,688,640.02 | 0.40% | 17,299.64 | 0.24% | – |
| 平安证券 | 1 | 54,712,138.40 | 0.55% | 23,847.06 | 0.34% | – |
| 山西证券 | 1 | 28,359,977.96 | 0.28% | 12,362.74 | 0.17% | – |
| 申万宏源 | 1 | 479,934,912.78 | 4.82% | 453,965.47 | 6.42% | – |
| 西南证券 | 1 | 70,409,889.19 | 0.71% | 30,690.18 | 0.43% | – |
| 兴业证券 | 1 | 271,433,596.64 | 2.72% | 256,743.06 | 3.63% | – |
| 银河证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 中银国际 | 1 | – | – | – | – | – |
| 财通证券 | 2 | 18,600,949.59 | 0.19% | 17,596.46 | 0.25% | – |
| 德邦证券 | 2 | 346,104,771.52 | 3.47% | 327,375.93 | 4.63% | – |
| 东方财富 | 2 | 38,076,396.88 | 0.38% | 16,591.60 | 0.23% | – |
| 东吴证券 | 2 | 314,279,330.98 | 3.15% | 259,743.50 | 3.67% | – |
| 方正证券 | 2 | 270,387,566.96 | 2.71% | 255,757.45 | 3.62% | – |
| 国海证券 | 2 | 318,351,872.17 | 3.20% | 237,454.16 | 3.36% | – |
| 国联证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 国盛证券 | 2 | 716,849,602.32 | 7.19% | 312,480.07 | 4.42% | – |
| 国泰君安 | 2 | 159,376,427.03 | 1.60% | 69,477.97 | 0.98% | – |
| 国投证券 | 2 | – | – | – | – | – |

| 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 | |
| 海通证券 | 2 | 265,091,778.95 | 2.66% | 250,754.87 | 3.55% | – |
| 华安证券 | 2 | 61,825,629.16 | 0.62% | 36,113.67 | 0.51% | – |
| 华福证券 | 2 | 2,035,376,094.01 | 20.43% | 1,149,952.01 | 16.26% | – |
| 华泰证券 | 2 | 544,059,747.48 | 5.46% | 514,637.66 | 7.28% | – |
| 华西证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 汇丰前海 | 2 | 144,577,753.89 | 1.45% | 136,757.50 | 1.93% | – |
| 开源证券 | 2 | 337,804,684.99 | 3.39% | 319,536.67 | 4.52% | – |
| 民生证券 | 2 | 618,166,961.51 | 6.20% | 458,883.65 | 6.49% | – |
| 太平洋证券 | 2 | 72,575,646.32 | 0.73% | 68,649.52 | 0.97% | – |
| 天风证券 | 2 | 61,654,632.93 | 0.62% | 58,319.86 | 0.82% | – |
| 西部证券 | 2 | 184,069,219.64 | 1.85% | 174,111.78 | 2.46% | – |
| 信达证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 野村东方 | 2 | – | – | – | – | – |
| 招商证券 | 2 | 88,440,831.80 | 0.89% | 83,656.99 | 1.18% | – |
| 浙商证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 中金公司 | 2 | – | – | – | – | – |
| 中泰证券 | 2 | 539,604,640.66 | 5.42% | 464,691.32 | 6.57% | – |
| 中信建投 | 2 | 39,543,546.07 | 0.40% | 27,208.55 | 0.38% | – |
| 中信证券 | 2 | 251,808,914.99 | 2.53% | 161,142.67 | 2.28% | – |
| 长江证券 | 3 | 466,726,662.46 | 4.68% | 241,319.65 | 3.41% | – |
| 东兴证券 | 3 | – | – | – | – | – |
| 广发证券 | 3 | 739,207,537.60 | 7.42% | 407,569.93 | 5.76% | – |

注： 1、 报告期内退租中信建投、长江证券交易单元；

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服务；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。

3、 根据中国证监会公告【2024】3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用，针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

4、 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《汇丰晋信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 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

无。

**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 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-01-22 |
| 2 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中信建投证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-15 |
| 3 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-29 |
| 4 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增利得基金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 | 2024-04-19 |
| 5 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-04-22 |
| 6 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增基煜基金为汇丰晋信大盘股票型证券投资基金C类份额代销机构的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-05-08 |
| 7 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说明书（2024年第1号） | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 8 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 9 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 10 | 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 | 2024-07-06 |
| 11 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第二季度报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-07-19 |
| 12 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-07-20 |
| 13 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增申万宏源证券、申万宏源西部证券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 | 2024-07-26 |

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 14 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于董事长变更公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-07-27 |
| 15 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年中期报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-08-31 |
| 16 | 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 | 2024-09-03 |
| 17 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增交通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 | 2024-09-05 |
| 18 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增工商银行为汇丰晋信大盘股票型证券投资基金C类份额代销机构的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-09-11 |
| 19 | 汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金经理变更公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-09-28 |
| 20 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增汇成基金为汇丰晋信大盘股票型证券投资基金C类份额代销机构的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-10-14 |
| 21 | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第三季度报告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-10-25 |
| 22 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在京东肯特瑞基金销售有限公司的交易限额的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-10-25 |
| 23 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中国人寿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 | 2024-11-11 |
| 24 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增腾安基金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 | 2024-11-15 |
| 25 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加中欧财富费率优惠的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-12-18 |
| 26 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中欧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 | 2024-12-18 |
| 27 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在普益基金的交易限额的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-12-31 |

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 28 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加普益基金费率优惠的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-12-31 |
| 29 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增普益基金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 | 2024-12-31 |
| 30 | 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 | 2024-12-31 |
| 31 | 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 | 2024-12-31 |
| 32 | 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 | 2024-12-31 |
| 33 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和托管费率并修改基金合同等法律文件的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-12-31 |

## §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净值比例达到或超过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

1) 中国证监会批准汇丰晋信大盘股票型证券投资基金设立的文件

2) 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同

3) 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书

4) 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金托管协议

5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则

6) 基金管理人业务资格批件和营业执照

7) 基金托管人业务资格批件和营业执照

8) 报告期内汇丰晋信大盘股票型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

9) 中国证监会要求的其他文件

### 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
二〇二五年三月三十一日