汇丰晋信大盘股票型证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 月 31 日

HSBC Jintrust Large Cap Equity Securities Investment Fund

31 December 2025 Fund Annual Report

Information for Hong Kong Investors

In the 31 December 2025 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 2026

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

2025 年 12 月 31 日基金年度報告

向香港投資者提供的資料

在 2025 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

2026 年 3 月 31 日

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

2025 年 12 月 31 日基金年度报告

向香港投资者提供的资料

在 2025 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

2026 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2026年03月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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2025年01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 4
1.2 目录 5
§2 基金简介 7
2.1 基金基本情况 7
2.2 基金产品说明 7
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 12
3.3 过去三年基金的利润分配情况 16
§4 管理人报告 16
4.1 基金管理人及基金经理情况 16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 18
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 19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
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 21
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
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 21
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 21
§6 审计报告 21
6.1 审计报告基本信息 22
6.2 审计报告的基本内容 22
§7 年度财务报表 23
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 25
7.3 净资产变动表 26
7.4 报表附注 27
§8 投资组合报告 53
8.1 期末基金资产组合情况 53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
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 54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
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 57
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 57

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 57
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 57
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
8.12 投资组合报告附注 57
8.13 投资组合报告（供香港投资人参阅） 57
§9 基金份额持有人信息 60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
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 61
§10 开放式基金份额变动 61
§11 重大事件揭示 62
11.1 基金份额持有人大会决议 62
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 62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
11.4 基金投资策略的改变 62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 63
11.8 其他重大事件 68
§12 影响投资者决策的其他重要信息 70
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 70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 70
§13 备查文件目录 70
13.1 备查文件目录 70
13.2 存放地点 70
13.3 查阅方式 71

§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	473,158,712.00 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 C	汇丰晋信大盘股票 H
下属分级基金的交易代码	540006	019243	960000
报告期末下属分级基金的份额总额	407,154,574.33 份	30,911,978.06 份	35,092,159.61 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 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。 2、行业配置策略 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。 3、股票资产投资策略 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（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年			2024年			2023年		
	汇丰晋信大盘股票A	汇丰晋信大盘股票C	汇丰晋信大盘股票H	汇丰晋信大盘股票A	汇丰晋信大盘股票C	汇丰晋信大盘股票H	汇丰晋信大盘股票A	汇丰晋信大盘股票C	汇丰晋信大盘股票H
本期已实现收益	422,457,078.76	12,538,425.05	14,789,988.52	126,678,409.74	6,925,358.19	4,216,449.73	47,298,663.72	-519,420.76	7,408,332.00
本期利润	642,087,025.31	17,228,294.14	22,491,838.83	251,132,759.39	6,637,350.66	7,807,222.65	-75,786,159.85	-1,758,137.74	-1,632,591.68
加权平均基金份额本期利润	1.3584	1.1066	0.5682	0.4286	0.3040	0.1498	-0.1890	-0.2157	-0.0254
本期加权平均净值利润	30.11%	24.20%	30.95%	11.38%	8.05%	9.83%	-4.91%	-5.90%	-1.61%

率									
本期基金份额净值增长率	35.59%	35.03%	35.44%	10.31%	9.84%	10.16%	-2.91%	-3.37%	-2.94%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末			2024年末			2023年末		
期末可供分配利润	1,718,427,451.41	129,082,045.77	59,837,578.92	1,634,298,357.08	51,119,882.53	55,640,754.02	1,344,036,130.50	25,845,488.88	62,033,561.06
期末可供分配基金份额利润	4.2206	4.1758	1.7052	3.0452	3.0257	1.2314	2.6670	2.6649	1.0802
期末	2,233,257,454.68	168,050,114.20	77,937,882.3	2,170,986,586.66	68,019,779.7	74,093,608.8	1,847,992,273.47	35,546,677.4	85,487,639.6

基金资产净值			6		6	9		4	6
期末基金份额净值	5.4850	5.4364	2.2209	4.0452	4.0260	1.6398	3.6670	3.6652	1.4886
3.1.3累计期末指标	2025年末			2024年末			2023年末		
基金份额累计净值增长率	481.36%	43.33%	122.09%	328.76%	6.14%	63.98%	288.67%	-3.37%	48.86%

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 净值表现

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	7.71%	0.88%	-0.20%	0.86%	7.91%	0.02%
过去六个月	31.49%	0.94%	15.88%	0.82%	15.61%	0.12%
过去一年	35.59%	0.98%	15.93%	0.87%	19.66%	0.11%
过去三年	45.23%	1.18%	17.73%	0.96%	27.50%	0.22%
过去五年	2.58%	1.24%	-9.86%	1.02%	12.44%	0.22%
自基金合同生效起至今	481.36%	1.36%	46.11%	1.25%	435.25%	0.11%

注：

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

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

过去一年指 2025 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去三年指 2023 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去五年指 2021 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

自基金合同生效起至今指 2009 年 6 月 24 日-2025 年 12 月 31 日

汇丰晋信大盘股票 C 净值表现

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	7.61%	0.88%	-0.20%	0.86%	7.81%	0.02%
过去六个月	31.21%	0.94%	15.88%	0.82%	15.33%	0.12%
过去一年	35.03%	0.98%	15.93%	0.87%	19.10%	0.11%
成立至今	43.33%	1.26%	26.26%	1.03%	17.07%	0.23%

注：

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

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

过去一年指 2025 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

成立至今指 2023 年 11 月 13 日-2025 年 12 月 31 日

汇丰晋信大盘股票 H 净值表现

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	7.69%	0.88%	-0.20%	0.86%	7.89%	0.02%
过去六个月	31.40%	0.94%	15.88%	0.82%	15.52%	0.12%
过去一年	35.44%	0.98%	15.93%	0.87%	19.51%	0.11%

过去三年	44.81%	1.18%	17.73%	0.96%	27.08%	0.22%
过去五年	2.25%	1.24%	-9.86%	1.02%	12.11%	0.22%
成立至今	122.09%	1.25%	21.28%	1.07%	100.81%	0.18%

注：

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

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

过去一年指 2025 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去三年指 2023 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

过去五年指 2021 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日

成立至今指 2015 年 12 月 30 日-2025 年 12 月 31 日

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

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。

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。

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。

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 2025 年 12 月 31 日，本基金 C 类份额运作未满五年。

本基金 C 类份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在上海。截止 2025 年 12 月 31 日，公司共管理 41 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自 2020 年 11 月 19 日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、汇丰晋信科

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、汇	2023-03-18	-	12 年	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

	丰晋信景气优选混合型证券投资基金基金经理				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、汇丰晋信景气优选混合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

2025 年是景气因子比较有效的一年，一方面 AI 为代表的产业趋势在持续加速，海外大厂的资本开支不断上修，国内电子半导体和通讯行业显著受益于这一产业趋势，有比较好的景气度和业绩释放。另一方面，受益于国际局势变化和弱势美元，黄金价格不断新高，带动了工业金属和小金属的价格上升。这两个方面构成了 2025 年的主要投资主线。对于本产品而言，基本上全年低配了科技板块，错过了这一轮 AI 产业趋势的加速阶段；有色板块，我们重仓了供给格局较好的电解铝板块。

2025 年的第二个特征对于大盘基金来说是个挑战，由于经济基本面和企业盈利处于低位阶段，同时市场的赚钱效应和流动性比较充足，小盘股和微盘股受益于风险偏好提升和流动性支持，在 2025 年有比较好的表现，而大盘股整体来看是比较分化的。在景气度的支持下，沪深 300 中的科技股的占比明显提升，但是金融和消费为代表的大盘股在 2025 年表现比较一般。在下半年尤其是四季度对本产品进行了较为显著的结构性调整，整体策略从上半年聚焦顺周期与制造板块，逐步转向四季度的均衡配置，降低对高波动周期股的依赖，提升金融与消费类资产的稳定性。

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 35.59%，同期业绩比较基准为 15.93%，本基金 A 类领先同期比较基准 19.66%；本基金 C 类本报告期内净值变化幅度为 35.03%，同期业绩比较基准为 15.93%，本基金 C 类领先同期比较基准 19.10%；本基金 H 类本报告期内净值变化幅度为 35.44%，同期业绩比较基准为 15.93%，本基金 H 类领先同期比较基准 19.51%。

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。基于产品定位，我们聚焦在大盘蓝筹中寻找投资机会。展望 2026 年，我们对于市场继续保持谨慎乐观，市场的结构性特征远远大于总量特征。我们依然会基于供给的强约束和需求的弱复苏假设去做行业配置，同时我们认为 2026 年资本市场的波动率会较 2025 年上升，整体的行业相对比较均衡，主要关注周期和制造以及部分消费行业的龙头公司。

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（2026）第 20490 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 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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 （二） 我们的意见 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
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。 按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇丰晋信大盘股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。
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。 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。 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。 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： （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。 （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。 （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。 （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。 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（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	叶尔甸　　段黄霖
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2026-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	218,470,057.02	189,086,933.51
结算备付金		1,379,221.81	955,260.88
存出保证金		521,498.55	731,225.55
交易性金融资产	7.4.7.2	2,243,567,078.37	2,131,923,533.95
其中：股票投资		2,243,567,078.37	2,131,923,533.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		22,465,554.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		334,627.20	395,751.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,486,738,037.12	2,323,092,705.06
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025年12月31日**	**上年度末 2024年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,175,090.69
应付赎回款		3,691,752.82	1,298,914.07
应付管理人报酬		2,480,472.40	2,982,400.51
应付托管费		413,412.07	497,066.73
应付销售服务费		52,871.61	23,801.98
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	854,076.98	1,015,455.77
负债合计		7,492,585.88	9,992,729.75

净资产：			
实收基金	7.4.7.7	452,406,447.66	572,040,981.68
未分配利润	7.4.7.8	2,026,839,003.58	1,741,058,993.63
净资产合计		2,479,245,451.24	2,313,099,975.31
负债和净资产总计		2,486,738,037.12	2,323,092,705.06

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额为473,158,712.00份，其中A类基金份额总额为407,154,574.33份，基金份额净值5.4850元；C类基金份额总额为30,911,978.06份，基金份额净值5.4364元；H类基金份额总额为35,092,159.61份，基金份额净值2.2209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：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
一、营业总收入		716,263,369.21	307,646,163.72
1.利息收入		774,874.75	1,036,593.63
其中：存款利息收入	7.4.7.9	774,874.75	1,036,593.63
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）		482,080,276.00	177,626,232.82
其中：股票投资收益	7.4.7.10	430,562,486.99	113,929,481.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	332,359.30	70,043.08
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	51,185,429.71	63,626,707.93
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	232,021,665.95	127,757,115.04
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	1,386,552.51	1,226,222.23
减：二、营业总支出		34,456,210.93	42,068,831.02
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	29,088,869.09	35,575,065.55
2．托管费	7.4.10.2.2	4,848,144.80	5,929,177.61
3．销售服务费	7.4.10.2.3	281,381.15	326,577.86
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		0.89	-
8．其他费用	7.4.7.18	237,815.00	238,010.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		681,807,158.28	265,577,332.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		681,807,158.28	265,577,332.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		681,807,158.28	265,577,332.70

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：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	572,040,981.68	1,741,058,993.63	2,313,099,975.31
二、本期期初净资产	572,040,981.68	1,741,058,993.63	2,313,099,975.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,634,534.02	285,780,009.95	166,145,475.93
（一）、综合收益总额	-	681,807,158.28	681,807,158.28
（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）	-119,634,534.02	-396,027,148.33	-515,661,682.35
其中：1.基金申购款	157,789,861.20	570,999,529.50	728,789,390.70
2.基金赎回款	-277,424,395.22	-967,026,677.83	-1,244,451,073.05
（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	452,406,447.66	2,026,839,003.58	2,479,245,451.24
项 目	**上年度可比期间 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	34,929,571.55	43,566,480.49	78,496,052.04

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
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

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(特殊普通合伙)(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2026年3月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信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2025年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决

于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的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%的征收率缴纳增

值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税 。根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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，暂不征收企业所得税。

(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，暂免征收个人所得税。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，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征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征收。

(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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	218,470,057.02	189,086,933.51
等于：本金	218,443,847.50	189,066,298.02
加：应计利息	26,209.52	20,635.49
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	218,470,057.02	189,086,933.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,981,872,248.04	-	2,243,567,078.37	261,694,830.33
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		1,981,872,248.04	-	2,243,567,078.37	261,694,830.33
项目		上年度末 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

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10,077.61	4,464.08
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	523,125.75	810,891.11
其中：交易所市场	523,125.75	810,891.11
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	320,000.00	200,000.00
其他应付	873.62	100.58
合计	854,076.98	1,015,455.77

7.4.7.7 实收基金

汇丰晋信大盘股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	536,688,229.58	536,688,229.58
本期申购	98,684,134.47	98,684,134.47
本期赎回（以“-”号填列）	-228,217,789.72	-228,217,789.72
本期末	407,154,574.33	407,154,574.33

汇丰晋信大盘股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,895,296.51	16,899,897.23
本期申购	59,089,721.37	59,105,726.73

本期赎回（以“-”号填列）	-45,073,039.82	-45,085,220.86
本期末	30,911,978.06	30,920,403.10

汇丰晋信大盘股票 H

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,183,877.64	18,452,854.87
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,091,718.03	-4,121,384.64
本期末	35,092,159.61	14,331,470.23

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

汇丰晋信大盘股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,749,536,363.54	-115,238,006.46	1,634,298,357.08
本期期初	1,749,536,363.54	-115,238,006.46	1,634,298,357.08
本期利润	422,457,078.76	219,629,946.55	642,087,025.31
本期基金份额交易产生的变动数	-453,565,990.89	3,283,488.85	-450,282,502.04
其中：基金申购款	344,465,173.64	-4,473,371.25	339,991,802.39
基金赎回款	-798,031,164.53	7,756,860.10	-790,274,304.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,718,427,451.41	107,675,428.94	1,826,102,880.35

汇丰晋信大盘股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,759,038.83	-3,639,156.30	51,119,882.53
本期期初	54,759,038.83	-3,639,156.30	51,119,882.53
本期利润	12,538,425.05	4,689,869.09	17,228,294.14
本期基金份额交易产生的变动数	61,784,581.89	6,996,952.54	68,781,534.43
其中：基金申购款	224,669,891.10	6,337,836.01	231,007,727.11
基金赎回款	-162,885,309.21	659,116.53	-162,226,192.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,082,045.77	8,047,665.33	137,129,711.10

汇丰晋信大盘股票 H

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	59,556,768.96	-3,916,014.94	55,640,754.02
本期期初	59,556,768.96	-3,916,014.94	55,640,754.02
本期利润	14,789,988.52	7,701,850.31	22,491,838.83
本期基金份额交易产生的变动数	-14,509,178.56	-17,002.16	-14,526,180.72
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-14,509,178.56	-17,002.16	-14,526,180.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,837,578.92	3,768,833.21	63,606,412.13

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	766,419.76	973,827.08
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	5,578.92	52,449.55
其他	2,876.07	10,317.00
合计	774,874.75	1,036,593.63

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2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	3,086,234,133.64	4,965,521,849.05
减：卖出股票成本总额	2,651,319,885.13	4,841,397,747.77
减：交易费用	4,351,761.52	10,194,619.47
买卖股票差价收入	430,562,486.99	113,929,481.81

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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,496.46	104,123.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	330,862.84	-34,080.00
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	332,359.30	70,043.08

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,749,035.20	60,000,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,963,461.56	59,695,680.00
减：应计利息总额	454,626.28	338,400.00
减：交易费用	84.52	-
买卖债券差价收入	330,862.84	-34,080.00

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	51,185,429.71	63,626,707.93
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	51,185,429.71	63,626,707.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	232,021,665.95	127,757,115.04
——股票投资	232,021,665.95	127,755,435.04
——债券投资	-	1,680.00
——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	232,021,665.95	127,757,115.04

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
基金赎回费收入	1,248,339.50	503,710.81
基金转换费收入	138,213.01	722,511.42
合计	1,386,552.51	1,226,222.23

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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	615.00	810.00
账户维护费	37,200.00	36,900.00
其他	-	300.00

合计	237,815.00	238,010.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

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

②汇丰银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

③恒生银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

④汇丰前海与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑤汇丰人寿与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

⑥汇丰保险与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31

	日		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	229,605,975.03	4.09%	144,577,753.89	1.45%
山西证券	37,206,482.00	0.66%	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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	100,085.54	4.09%	-	-
山西证券	16,219.57	0.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,088,869.09	35,575,065.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,813,414.77	10,963,322.13
应支付基金管理人的净管理费	20,275,454.32	24,611,743.42

注：自 2024 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 30 日，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×1.50%/当年天数。根据基金管理人汇丰晋信于 2024 年 12 月 31 日发布的《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》，自 2025 年 3 月 31 日起，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 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,848,144.80	5,929,177.61

注：自 2024 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 30 日，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。根据基金管理人汇丰晋信于 2024 年 12 月 31 日发布的《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》，自 2025 年 3 月 31 日起，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 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	汇丰晋信大盘股票 A	汇丰晋信大盘股票 C	汇丰晋信大盘股票 H	合计
交通银行	-	70.04	-	70.04
汇丰晋信	-	96,416.45	-	96,416.45
合计	-	96,486.49	-	96,486.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 C	汇丰晋信大盘股票 H	合计
交通银行	-	11.05	-	11.05
汇丰晋信	-	205,727.06	-	205,727.06
合计	-	205,738.11	-	205,738.11

注：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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	218,470,057.02	766,419.76	189,086,933.51	973,827.08

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

无。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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 2025 年 12 月 31 日，本基金无债券投资 (2024 年 12 月 31 日：同)。

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 2025 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 2025 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	218,470,057.02	-	-	-	218,470,057.02

结算备付金	1,379,221.81	-	-	-	1,379,221.81
存出保证金	521,498.55	-	-	-	521,498.55
交易性金融资产	-	-	-	2,243,567,078.37	2,243,567,078.37
应收清算款	-	-	-	22,465,554.17	22,465,554.17
应收申购款	-	-	-	334,627.20	334,627.20
资产总计	220,370,777.38	-	-	2,266,367,259.74	2,486,738,037.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,691,752.82	3,691,752.82
应付管理人报酬	-	-	-	2,480,472.40	2,480,472.40
应付托管费	-	-	-	413,412.07	413,412.07
应付销售服务费	-	-	-	52,871.61	52,871.61
其他负债	-	-	-	854,076.98	854,076.98
负债总计	-	-	-	7,492,585.88	7,492,585.88
利率敏感度缺口	220,370,777.38	-	-	2,258,874,673.86	2,479,245,451.24
上年度末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

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 2025 年 12 月 31 日,本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024 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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	2,243,567,078.37	90.49	2,131,923,533.95	92.17
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	2,243,567,078.37	90.49	2,131,923,533.95	92.17

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1.业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	108,204,593.27	131,236,719.94
	2.业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-108,204,593.27	-131,236,719.94

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	2,243,567,078.37	2,131,923,533.95
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,243,567,078.37	2,131,923,533.95

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	-	19,011.12	19,011.12
转出第三层次	-	23,161.04	23,161.04
当期利得或损失总额	-	4,149.92	4,149.92
其中：计入损益的利得或损失	-	4,149.92	4,149.92
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 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	-	-	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。于 2025 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(2024 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 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,243,567,078.37	90.22
	其中：股票	2,243,567,078.37	90.22
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	219,849,278.83	8.84
8	其他各项资产	23,321,679.92	0.94
9	合计	2,486,738,037.12	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	-	-
B	采矿业	48,367,099.00	1.95
C	制造业	1,615,411,207.95	65.16
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	65,950,542.84	2.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	57,517,423.00	2.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	359,191,415.58	14.49
K	房地产业	21,960.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	97,107,430.00	3.92
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	2,243,567,078.37	90.49

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	9,309,173	160,210,867.33	6.46
2	002078	太阳纸业	8,725,000	137,418,750.00	5.54
3	000933	神火股份	4,030,200	110,709,594.00	4.47
4	603816	顾家家居	3,579,100	110,021,534.00	4.44
5	601688	华泰证券	4,431,550	104,540,264.50	4.22
6	601677	明泰铝业	6,965,300	103,016,787.00	4.16
7	000951	中国重汽	5,953,000	100,605,700.00	4.06
8	300012	华测检测	7,166,600	97,107,430.00	3.92
9	601169	北京银行	17,677,696	96,873,774.08	3.91
10	000100	TCL科技	20,404,100	92,634,614.00	3.74
11	601166	兴业银行	4,259,400	89,702,964.00	3.62
12	002508	老板电器	4,204,800	81,362,880.00	3.28
13	000786	北新建材	2,826,542	70,578,753.74	2.85
14	000807	云铝股份	2,147,297	70,517,233.48	2.84
15	300979	华利集团	1,358,945	68,232,628.45	2.75
16	601601	中国太保	1,624,300	68,074,413.00	2.75
17	603939	益丰药房	3,036,397	65,950,542.84	2.66
18	603035	常熟汽饰	4,150,695	64,211,251.65	2.59
19	000725	京东方A	14,275,100	60,098,171.00	2.42
20	600309	万华化学	769,748	59,024,276.64	2.38
21	600258	首旅酒店	3,433,876	57,517,423.00	2.32
22	000921	海信家电	2,261,800	56,115,258.00	2.26
23	002572	索菲亚	3,878,100	52,780,941.00	2.13
24	603599	广信股份	4,311,696	49,498,270.08	2.00

25	000923	河钢资源	2,284,700	48,367,099.00	1.95
26	000589	贵州轮胎	6,543,500	33,895,330.00	1.37
27	603338	浙江鼎力	454,236	25,727,927.04	1.04
28	603345	安井食品	268,100	21,254,968.00	0.86
29	000651	格力电器	526,400	21,171,808.00	0.85
30	600782	新钢股份	5,334,700	20,698,636.00	0.83
31	001301	尚太科技	232,600	19,959,406.00	0.81
32	603558	健盛集团	1,304,498	14,649,512.54	0.59
33	603279	景津装备	653,000	11,016,110.00	0.44
34	600048	保利发展	3,600	21,960.00	0.00

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	600309	万华化学	115,901,495.00	5.01
2	000100	TCL科技	108,555,257.00	4.69
3	601169	北京银行	105,724,292.92	4.57
4	300012	华测检测	97,747,668.56	4.23
5	601677	明泰铝业	94,843,752.85	4.10
6	002475	立讯精密	91,534,277.00	3.96
7	601166	兴业银行	87,016,908.25	3.76
8	002078	太阳纸业	83,542,953.00	3.61
9	002508	老板电器	82,769,661.99	3.58
10	300979	华利集团	80,490,005.60	3.48
11	601601	中国太保	76,654,459.00	3.31
12	600809	山西汾酒	74,998,276.00	3.24
13	600048	保利发展	70,011,749.61	3.03
14	000786	北新建材	68,820,210.54	2.98
15	000725	京东方A	67,828,648.00	2.93
16	603939	益丰药房	67,230,887.26	2.91
17	603993	洛阳钼业	64,323,860.00	2.78
18	002572	索菲亚	63,611,726.62	2.75
19	000568	泸州老窖	60,010,433.43	2.59
20	603225	新凤鸣	59,891,751.22	2.59
21	000683	博源化工	56,403,233.80	2.44
22	600258	首旅酒店	56,395,919.04	2.44
23	603883	老百姓	55,743,967.02	2.41
24	603816	顾家家居	50,131,165.20	2.17
25	000951	中国重汽	46,863,266.00	2.03

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	000807	云铝股份	176,490,059.82	7.63
2	002475	立讯精密	153,149,951.00	6.62
3	600309	万华化学	135,843,733.40	5.87
4	600782	新钢股份	135,809,174.00	5.87
5	603225	新凤鸣	120,914,750.60	5.23
6	601717	中创智领	113,700,201.55	4.92
7	601166	兴业银行	112,097,153.00	4.85
8	000338	潍柴动力	106,415,471.00	4.60
9	600031	三一重工	101,323,896.50	4.38
10	601233	桐昆股份	100,105,739.20	4.33
11	603993	洛阳钼业	95,005,849.00	4.11
12	000651	格力电器	93,722,415.09	4.05
13	600809	山西汾酒	83,208,773.69	3.60
14	600048	保利发展	80,931,923.00	3.50
15	300014	亿纬锂能	70,532,857.77	3.05
16	603883	老百姓	67,854,295.98	2.93
17	002727	一心堂	61,590,951.00	2.66
18	600233	圆通速递	61,028,822.00	2.64
19	300373	扬杰科技	57,489,172.16	2.49
20	000568	泸州老窖	57,168,348.00	2.47
21	601111	中国国航	53,516,868.00	2.31
22	000683	博源化工	53,284,546.44	2.30
23	000933	神火股份	51,362,306.60	2.22
24	601615	明阳智能	51,066,599.44	2.21
25	000725	京东方A	49,153,334.00	2.12

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	2,530,941,763.60
卖出股票收入（成交）总额	3,086,234,133.64

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金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	521,498.55
2	应收清算款	22,465,554.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	334,627.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,321,679.92

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			
于 2025/12/31			
	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	9,309,173	160,210,867.33	6.46
太阳纸业	8,725,000	137,418,750.00	5.54
神火股份	4,030,200	110,709,594.00	4.47
顾家家居	3,579,100	110,021,534.00	4.44
华泰证券	4,431,550	104,540,264.50	4.22
明泰铝业	6,965,300	103,016,787.00	4.16
中国重汽	5,953,000	100,605,700.00	4.06

华测检测	7,166,600	97,107,430.00	3.92
北京银行	17,677,696	96,873,774.08	3.91
TCL科技	20,404,100	92,634,614.00	3.74
兴业银行	4,259,400	89,702,964.00	3.62
老板电器	4,204,800	81,362,880.00	3.28
北新建材	2,826,542	70,578,753.74	2.85
云铝股份	2,147,297	70,517,233.48	2.84
华利集团	1,358,945	68,232,628.45	2.75
中国太保	1,624,300	68,074,413.00	2.75
益丰药房	3,036,397	65,950,542.84	2.66
常熟汽饰	4,150,695	64,211,251.65	2.59
京东方A	14,275,100	60,098,171.00	2.42
万华化学	769,748	59,024,276.64	2.38
首旅酒店	3,433,876	57,517,423.00	2.32
海信家电	2,261,800	56,115,258.00	2.26
索菲亚	3,878,100	52,780,941.00	2.13
广信股份	4,311,696	49,498,270.08	2.00
河钢资源	2,284,700	48,367,099.00	1.95
贵州轮胎	6,543,500	33,895,330.00	1.37
浙江鼎力	454,236	25,727,927.04	1.04
安井食品	268,100	21,254,968.00	0.86
格力电器	526,400	21,171,808.00	0.85
新钢股份	5,334,700	20,698,636.00	0.83
尚太科技	232,600	19,959,406.00	0.81
健盛集团	1,304,498	14,649,512.54	0.59
景津装备	653,000	11,016,110.00	0.44
保利发展	3,600	21,960.00	0.00

投资总计			
投资总成本:1,981,872,248.04人民币元		2,243,567,078.37	90.49
其他净资产		235,678,372.87	9.51
基金资产净值		2,479,245,451.24	100.00

投资组合变动表				
				市值占净值%
			2025/12/31	**2024/12/31**
股票			90.49	92.17
投资总计			90.49	92.17
其他净资产			9.51	7.83
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	31,371	12,978.69	201,859,948.55	49.58%	205,294,625.78	50.42%
汇丰晋信大盘股票 C	883	35,007.90	29,383,206.01	95.05%	1,528,772.05	4.95%
汇丰晋信大盘	5	7,018,431.92	35,092,159.61	100.00%	0.00	0.00%

股票H						
合计	32,259	14,667.49	266,335,314.17	56.29%	206,823,397.83	43.71%

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	383,540.34	0.0942%
	汇丰晋信大盘股票C	0.00	0.0000%
	汇丰晋信大盘股票H	0.00	0.0000%
	合计	383,540.34	0.0811%

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C	0
	汇丰晋信大盘股票H	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C	0
	汇丰晋信大盘股票H	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C	汇丰晋信大盘股票H
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	536,688,229.58	16,895,296.51	45,183,877.64
本报告期基金总申购份额	98,684,134.47	59,089,721.37	-

减：本报告期基金总赎回份额	228,217,789.72	45,073,039.82	10,091,718.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	407,154,574.33	30,911,978.06	35,092,159.61

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内，孟羽任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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（特殊普通合伙）更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），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（特殊普通合伙）签订的《审计业务约定书》，应实际支付 2025 年度审计费 80,000 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未有受调查或处罚等情况发生。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券	2	1,216,605,978.81	21.66%	530,330.12	21.66%	-
西部证券	2	711,534,112.93	12.67%	310,160.32	12.67%	-
华创证券	1	689,483,156.93	12.27%	300,549.82	12.27%	-
中信建投	1	477,063,158.38	8.49%	207,948.67	8.49%	-
国盛证	2	351,545,455.76	6.26%	153,234.19	6.26%	-

券						
长江证券	2	313,107,090.90	5.57%	136,482.34	5.57%	-
国联民生	4	262,215,122.41	4.67%	114,299.47	4.67%	-
汇丰前海	2	229,605,975.03	4.09%	100,085.54	4.09%	-
东方财富	2	166,511,585.81	2.96%	72,585.46	2.96%	-
广发证券	3	134,488,610.00	2.39%	58,624.21	2.39%	-
中泰证券	2	134,010,595.78	2.39%	58,418.26	2.39%	-
中信证券	2	133,125,876.64	2.37%	58,038.25	2.37%	-
申万宏源	1	121,155,672.80	2.16%	52,817.81	2.16%	-
东吴证券	2	110,886,694.00	1.97%	48,336.78	1.97%	-
国金证券	1	101,835,229.80	1.81%	44,389.35	1.81%	-
国海证券	2	100,763,637.41	1.79%	43,923.73	1.79%	-
招商证券	2	98,021,055.90	1.75%	42,726.78	1.74%	-
野村东方	2	84,757,498.00	1.51%	36,946.71	1.51%	-
太平洋证券	2	74,145,137.36	1.32%	32,320.05	1.32%	-
浙商证券	2	69,034,918.59	1.23%	30,098.34	1.23%	-
山西证券	1	37,206,482.00	0.66%	16,219.57	0.66%	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：

1、报告期内退租国泰海通、川财证券、国投证券、国联民生交易单元；

2、选择证券公司参与证券交易的标准和程序

1）选择证券公司参与证券交易的标准

a. 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

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

c.具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	23,172,461.56	91.64%	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	2,112,668.00	8.36%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增宁波银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-01-21
2	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-01-22
3	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-01-25
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在中欧财富的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-02-07
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增泰信财富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	2025-03-06
6	汇丰晋信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况（2024 年度）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-03-31
7	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-03-31
8	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-03-31
9	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金托管协议	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-03-31
10	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说	本基金指定报刊、	2025-04-01

	明书（2025 年第 1 号）	指定互联网网站	
11	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	2025-04-01
12	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	2025-04-01
13	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-04-22
14	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增招商银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-05-08
15	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增联泰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	2025-05-20
16	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增创金启富为旗下部分开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-06-06
17	汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-06-24
18	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 2 号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-06-30
19	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	2025-06-30
20	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	2025-06-30
21	汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-07-15
22	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-07-21
23	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 3 号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-07-25
24	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	2025-07-25
25	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	2025-07-25
26	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增阳光人寿为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-08-01
27	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中信银行为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-08-01
28	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-08-29
29	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-09-20
30	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-10-28
31	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增嘉实财富为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-10-29

32	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增瑞银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	2025-10-31
33	汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-11-03
34	汇丰晋信基金管理有限公司关于提请直销投资者及时更新投资者分类资料并接受或重新接受风险承受能力调查的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-12-31
35	汇丰晋信基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-12-31
36	汇丰晋信基金管理有限公司关于完善客户身份信息的提示	本基金指定报刊、指定互联网网站	2025-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金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

二〇二六年三月三十一日