滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

2026 年中期報告

2026 年 06 月 30 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

報告送出日期:2026 年 08 月 31 日

PUBLIC

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

2026 年 6 月 30 日基金中期報告

向香港投資者提供的資料

在 2026 年 6 月 30 日基金中期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（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 8 月 31 日

PUBLIC

§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。本中期報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意。

基金託管人交通銀行股份有限公司根據本基金合同約定，於2026年08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說明書及其更新。

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

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

PUBLIC

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄 2
1.1 重要提示 2
1.2 目錄 3
§2 基金簡介 5
2.1 基金基本情況 5
2.2 基金產品說明 5
2.3 基金管理人和基金託管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相關資料 6
§3 主要財務指標和基金淨值表現 6
3.1 主要會計數據和財務指標 6
3.2 基金淨值表現 7
§4 管理人報告 11
4.1 基金管理人及基金經理情況 11
4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明 12
4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明 13
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 13
4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望 14
4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明 14
4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明 15
4.8 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 15
§5 託管人報告 15
5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明 15
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 15
5.3 託管人對本中期報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見 15
§6 半年度財務會計報告(未經審計) 15
6.1 資產負債表 15
6.2 利潤表 17
6.3 淨資產變動表 18
6.4 報表附注 19
§7 投資組合報告 38
7.1 期末基金資產組合情況 38
7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合 39
7.3 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 39
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動 40
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合 42
7.6 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 42
7.7 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 42
7.8 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 42
7.9 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 42
7.10 本基金投資股指期貨的投資政策 42
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明 42

PUBLIC

7.12 投資組合報告附注 43
7.13 投資組合報告（供香港投資人參閱）..... 44
§8 基金份額持有人信息 46
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構 46
8.2 盈利投資者數量占比 47
8.3 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況 47
8.4 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 47
§9 開放式基金份額變動 48
§10 重大事件揭示 48
10.1 基金份額持有人大會決議 48
10.2 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 48
10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟 48
10.4 基金投資策略的改變 48
10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況 49
10.6 管理人、託管人及相關從業人員受調查或處罰等情況 49
10.7 基金租用或者通過證券公司交易單元進行證券投資的相關情況 49
10.8 其他重大事件 53
§11 影響投資者決策的其他重要信息 53
11.1 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 54
11.2 影響投資者決策的其他重要信息 54
§12 備查文件目錄 54
12.1 備查文件目錄 54
12.2 存放地點 54
12.3 查閱方式 54

PUBLIC

§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	401,243,661.29 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 C	滙豐晉信大盤股票 H
下屬分級基金的交易代碼	540006	019243	960000
報告期末下屬分級基金的份額總額	331,604,800.87 份	37,014,303.67 份	32,624,556.75 份

注：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 基金產品說明

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 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。 2、行業配置策略 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。 3、股票資產投資策略 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

PUBLIC

	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》
登載基金中期報告的管理人互聯網網址	www.hsbcjt.cn
基金中期報告置備地點	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
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 主要財務指標和基金淨值表現

3.1 主要會計數據和財務指標

PUBLIC

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間數據和指標	報告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）		
	滙豐晉信大盤股票 A	滙豐晉信大盤股票 C	滙豐晉信大盤股票 H
本期已實現收益	278,047,399.20	20,249,919.22	10,096,067.35
本期利潤	-143,072,951.55	-15,378,867.99	-5,877,253.11
加權平均基金份額本期利潤	-0.3753	-0.5528	-0.1732
本期加權平均淨值利潤率	-6.63%	-9.91%	-7.57%
本期基金份額淨值增長率	-8.16%	-8.37%	-8.29%
3.1.2 期末數據和指標	報告期末（2026 年 06 月 30 日）		
期末可供分配利潤	1,338,795,224.46	147,349,542.44	53,127,057.93
期末可供分配基金份額利潤	4.0373	3.9809	1.6284
期末基金資產淨值	1,670,400,025.33	184,373,863.64	66,450,768.87
期末基金份額淨值	5.0373	4.9812	2.0368
3.1.3 累計期末指標	報告期末（2026 年 06 月 30 日）		
基金份額累計淨值增長率	433.91%	31.33%	103.68%

注：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 淨值表現

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	-9.87%	1.03%	10.72%	1.13%	-20.59%	-0.10%
過去六個月	-8.16%	1.12%	6.81%	1.02%	-14.97%	0.10%
過去一年	20.76%	1.04%	23.89%	0.92%	-3.13%	0.12%
過去三年	29.92%	1.21%	26.74%	1.00%	3.18%	0.21%
過去五年	-5.78%	1.21%	-4.04%	1.01%	-1.74%	0.20%
過去七年	51.95%	1.25%	27.42%	1.05%	24.53%	0.20%
過去十年	128.05%	1.20%	52.59%	1.03%	75.46%	0.17%
自基金合同生效起至今	433.91%	1.35%	56.33%	1.25%	377.58%	0.10%

PUBLIC

注：

過去三個月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去六個月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去三年指 2023 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去五年指 2021 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去七年指 2019 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去十年指 2016 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2009 年 6 月 24 日-2026 年 6 月 30 日

滙豐晉信大盤股票 C 淨值表現

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	-9.98%	1.03%	10.72%	1.13%	-20.70%	-0.10%
過去六個月	-8.37%	1.12%	6.81%	1.02%	-15.18%	0.10%
過去一年	20.22%	1.04%	23.89%	0.92%	-3.67%	0.12%
成立至今	31.33%	1.24%	35.05%	1.03%	-3.72%	0.21%

注：

過去三個月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去六個月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

成立至今指 2023 年 11 月 13 日-2026 年 6 月 30 日

滙豐晉信大盤股票 H 淨值表現

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	-9.99%	1.03%	10.72%	1.13%	-20.71%	-0.10%
過去六個月	-8.29%	1.12%	6.81%	1.02%	-15.10%	0.10%
過去一年	20.51%	1.04%	23.89%	0.92%	-3.38%	0.12%
過去三年	29.48%	1.21%	26.74%	1.00%	2.74%	0.21%
過去五年	-6.18%	1.21%	-4.04%	1.01%	-2.14%	0.20%
過去七年	51.01%	1.25%	27.42%	1.05%	23.59%	0.20%
過去十年	126.06%	1.20%	52.59%	1.03%	73.47%	0.17%
成立至今	103.68%	1.24%	29.66%	1.07%	74.02%	0.17%

注：

過去三個月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去六個月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

過去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

PUBLIC

過去三年指 2023 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日
過去五年指 2021 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日
過去七年指 2019 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日
過去十年指 2016 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日
成立至今指 2015 年 12 月 30 日-2026 年 6 月 30 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

注：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。

PUBLIC

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2026年6月30日)

注：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。

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2026年6月30日)

PUBLIC

注：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。

§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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 44 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

PUBLIC

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）、滙豐晉信綠色債券型證券投資基金（2024 年 12 月 11 日成立）、滙豐晉信景氣優選混合型證券投資基金（2025 年 5 月 28 日成立）、滙豐晉信港股通核心資產股票型發起式證券投資基金（2025 年 8 月 12 日成立）、滙豐晉信多元穩健配置 3 個月持有期混合型基金中基金(FOF)（2026 年 1 月 20 日成立）、滙豐晉信週期優選股票型證券投資基金（2026 年 3 月 11 日成立）、滙豐晉信港股精選股票型證券投資基金(QDII)（2026 年 4 月 30 日成立）和滙豐晉信慧泰債券型證券投資基金（2026 年 6 月 24 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	說明
		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、滙豐晉信景氣優選混合型證券投資基金基金經理	2023-03-18	-	12 年	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、滙豐晉信景氣優選混合型證券投資基金基金經理。

注：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說明

PUBLIC

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說明

4.3.1 公平交易制度的執行情況

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。

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，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。

4.3.2 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

2026 年上半年 A 股市場呈現明顯的價值與成長風格分化，核心驅動力是 AI 敘事的全面主導。從行業維度看，申萬 31 個一級行業的平均漲幅為負，中位數亦為負，其中電子與通信大幅上漲，其餘多數行業下跌。細分賽道的分化更為突出：存儲芯片指數、半導體設備板塊、光模塊(CPO)指數均錄得顯著上漲，與存儲漲價、國產算力及半導體設備景氣度上修的邏輯相呼應。寬基指數層面同樣呈現結構性特徵，科創 50 與創業板指漲幅居前，而滬深 300 漲幅有限，超額收益主要集中於 AI 權重股所在的科創與創業板。市場整體的賺錢效應偏弱：資金高度集中於 AI 板塊，其餘板塊資金流出明顯。價值與消費板塊普遍承壓，食品飲料、非銀金融、銀行、醫藥、家電均有不同程度下

PUBLIC

跌。不過，這些非 AI 板塊的疲軟更多源於前期的高基數與資金分流，而非基本面惡化。這種較高的持倉集中度對價值均衡策略構成階段性壓力，同時也蘊含均值回歸的可能。本報告期內，本基金主要倉位仍集中在消費、週期及製造業板塊，對於這些和 AI 不太相關的板塊，基本面其實並不是像上半年股價表現的那樣較為低迷，反而更多的行業是呈現的企穩的特徵，包括同比增速維持正增長，部分板塊的負增長也主要是去年上半年的相對高基數，雖然其基本面的變化銳度的確不如 AI 基本面的變化，但我們堅信當前時點消費復蘇與週期的上行邏輯更為清晰。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

本報告期內，本基金 A 類基金份額淨值增長率為-8.16%，同期業績比較基準收益率為 6.81%，淨值表現落後同期比較基準 14.97%；本基金 C 類基金份額淨值增長率為-8.37%，同期業績比較基準收益率為 6.81%，淨值表現落後同期比較基準 15.18%；本基金 H 類基金份額淨值增長率為-8.29%，同期業績比較基準收益率為 6.81%，淨值表現落後同期比較基準 15.10%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望未來市場演繹，我們認為在下游雲廠商的資本開支足夠快的時候，對於 AI 投資的擔憂最後會讓位於行業的 beta。但是現在可能是 AI 投資的分水嶺或者進入第二階段，使得相關的擔憂變成不得不面臨的課題。前期的高波動更多的是持倉過於集中的原因，但未來需要關注海外雲廠商資本開支的持續性，以及大模型能否在短期內找到下一個類似於編程的商業化場景。另一個需要關注的是格局和技術路線的變化，這個是科技製造業投資中需要去關注的。對於 AI 相關的電子週期品，我們的視角已延伸至未來兩年的供需格局。當前市場的上漲反映的是 2026 年的供需緊平衡，但我們更關注 2027 年和 2028 年“供給擴張”與“需求增長”之間的賽跑。對於非 AI 的投資，預計會回歸到基本面定價的有效性，而不是非黑即白式的標籤化投資，不管是製造、週期還是消費領域，均有望可以找到很好的投資機會。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。基於產品定位，我們聚焦在大盤藍籌中尋找投資機會。

4.6 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。

PUBLIC

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。

4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

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。

4.8 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

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、利潤分配等情況的說明

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 託管人對本中期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中期報告中財務指標、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 半年度財務會計報告(未經審計)

6.1 資產負債表

PUBLIC

會計主體：滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

報告截止日：2026 年 06 月 30 日

單位：人民幣元

資 產	附注號	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
資 產：			
貨幣資金	6.4.7.1	187,188,198.56	218,470,057.02
結算備付金		1,624,029.89	1,379,221.81
存出保證金		607,802.88	521,498.55
交易性金融資產	6.4.7.2	1,738,588,777.21	2,243,567,078.37
其中：股票投資		1,738,588,777.21	2,243,567,078.37
基金投資		-	-
債券投資		-	-
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
其他投資		-	-
衍生金融資產	6.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	6.4.7.4	-	-
應收清算款		-	22,465,554.17
應收股利		-	-
應收申購款		292,371.16	334,627.20
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.5	-	-
資產總計		1,928,301,179.70	2,486,738,037.12
負債和淨資產	**附注號**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
負 債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付清算款		-	-
應付贖回款		3,835,869.23	3,691,752.82
應付管理人報酬		2,000,846.89	2,480,472.40
應付託管費		333,474.46	413,412.07
應付銷售服務費		59,398.32	52,871.61
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-

PUBLIC

其他負債	6.4.7.6	846,932.96	854,076.98
負債合計		7,076,521.86	7,492,585.88
淨資產：			
實收基金	6.4.7.7	381,952,833.01	452,406,447.66
未分配利潤	6.4.7.8	1,539,271,824.83	2,026,839,003.58
淨資產合計		1,921,224,657.84	2,479,245,451.24
負債和淨資產總計		1,928,301,179.70	2,486,738,037.12

注：報告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份額總額為 401,243,661.29 份，其中 A 類基金份額總額為 331,604,800.87 份，基金份額淨值 5.0373 元；C 類基金份額總額為 37,014,303.67 份，基金份額淨值 4.9812 元；H 類基金份額總額為 32,624,556.75 份，基金份額淨值 2.0368 元。

6.2 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

單位：人民幣元

項 目	附注號	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、營業總收入		-147,289,671.64	91,805,872.78
1.利息收入		461,084.28	351,238.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	461,084.28	351,238.58
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）		324,058,372.15	105,658,834.73
其中：股票投資收益	6.4.7.10	287,110,298.86	84,783,930.43
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.11	987,719.08	332,359.30
資產支持證券投資收益	6.4.7.12	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	35,960,354.21	20,542,545.00
其他投資收益		-	-
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.16	-472,722,458.42	-14,690,356.67
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.17	913,330.35	486,156.14

PUBLIC

減：二、營業總支出		17,039,401.01	18,193,992.76
1.管理人報酬	6.4.10.2.1	14,238,775.19	15,375,009.21
2.託管費	6.4.10.2.2	2,373,129.13	2,562,501.46
3.銷售服務費	6.4.10.2.3	309,371.78	133,432.85
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		0.96	0.89
8.其他費用	6.4.7.18	118,123.95	123,048.35
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-164,329,072.65	73,611,880.02
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-164,329,072.65	73,611,880.02
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		-164,329,072.65	73,611,880.02

6.3 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

單位：人民幣元

項 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產	452,406,447.66	2,026,839,003.58	2,479,245,451.24
二、本期期初淨資產	452,406,447.66	2,026,839,003.58	2,479,245,451.24
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-70,453,614.65	-487,567,178.75	-558,020,793.40
（一）、綜合收益總額	-	-164,329,072.65	-164,329,072.65
（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）	-70,453,614.65	-323,238,106.10	-393,691,720.75
其中：1.基金申購款	77,520,988.88	359,270,699.88	436,791,688.76
2.基金贖回款	-147,974,603.53	-682,508,805.98	-830,483,409.51
（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	381,952,833.01	1,539,271,824.83	1,921,224,657.84
項 目	**上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日**		

PUBLIC

	實收基金	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產	572,040,981.68	1,741,058,993.63	2,313,099,975.31
二、本期期初淨資產	572,040,981.68	1,741,058,993.63	2,313,099,975.31
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-47,838,269.59	-79,444,616.54	-127,282,886.13
（一）、綜合收益總額	-	73,611,880.02	73,611,880.02
（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）	-47,838,269.59	-153,056,496.56	-200,894,766.15
其中：1.基金申購款	66,191,502.79	208,888,848.39	275,080,351.18
2.基金贖回款	-114,029,772.38	-361,945,344.95	-475,975,117.33
（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	524,202,712.09	1,661,614,377.09	2,185,817,089.18

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 6.1 至 6.4 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

6.4 報表附注

6.4.1 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說明書》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

PUBLIC

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說明書》，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x90%+同業存款利率x 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 2026 年 8 月 28 日批准報出。

6.4.2 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")、中國證券投資基金業協會(以下簡稱“中國基金業協會”)頒佈的《公開募集證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和中期報告>》、《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》和在財務報表附注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。

6.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本基金 2026 年上半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 2026 年 06 月 30 日的財務狀況以及 2026 年上半年度的經營成果和淨資產變動情況等有關信息。

6.4.4 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本基金財務報告所採用的會計政策、會計估計與上年度財務報告相一致。

6.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期未發生會計政策變更。

PUBLIC

6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期未發生會計估計變更。

6.4.5.3 差錯更正的說明

本基金在本報告期間無須說明的會計差錯更正。

6.4.6 稅項

根據財政部、國家稅務總局財稅[2002]128 號《關於開放式證券投資基金有關稅收問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]125 號《關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改徵增值稅試點的通知》、財稅[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》、財稅[2016]70 號《關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2016]140 號《關於明確金融房地產開發教育輔助服務等增值稅政策的通知》、財稅[2017]2 號《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》及其他相關財稅法規和實務操作，主要稅項列示如下：

(1)資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3%的徵收率繳納增值稅。對證券投資基金管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免徵增值稅，對金融同業往來利息收入亦免徵增值稅 。根據財政部、國家稅務總局公告 2025 年第 4 號《關於國債等債券利息收入增值稅政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已發行的國債、地方政府債券、金融債券(包含在 2025 年 8 月 8 日之後續發行的部分)的利息收入，繼續免徵增值稅直至債券到期。自 2025 年 8 月 8 日起，對在該日期之後(含當日)新發行的國債、地方政府債券、金融債券的利息收入，恢復徵收增值稅。資管產品管理人運營資管產品提供的貸款服務，以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，暫不徵收企業所得稅。

(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%的稅率計徵個人所得稅。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

PUBLIC

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。

6.4.7 重要財務報表項目的說明

6.4.7.1 貨幣資金

單位：人民幣元

項目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	187,188,198.56
等於：本金	187,168,830.27
加：應計利息	19,368.29
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	187,188,198.56

6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動
股票		1,949,616,405.30	-	1,738,588,777.21	- 211,027,628.09
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	-	-	-	-

PUBLIC

資產支持證券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合計	1,949,616,405.30	-	1,738,588,777.21	- 211,027,628.09

6.4.7.3 衍生金融資產/負債

無。

6.4.7.4 買入返售金融資產

6.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

無。

6.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

6.4.7.5 其他資產

無。

6.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2026 年 06 月 30 日
應付券商交易單元保證金	-
應付贖回費	14,139.92
應付證券出借違約金	-
應付交易費用	727,424.22
其中：交易所市場	727,424.22
銀行間市場	-
應付利息	-
預提費用	99,178.95
其他應付	6,189.87
合計	846,932.96

6.4.7.7 實收基金

滙豐晉信大盤股票 A

金額單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	407,154,574.33	407,154,574.33

PUBLIC

本期申購	50,455,836.37	50,455,836.37
本期贖回（以“-”號填列）	-126,005,609.83	-126,005,609.83
本期末	331,604,800.87	331,604,800.87

滙豐晉信大盤股票 C

金額單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	30,911,978.06	30,920,403.10
本期申購	27,057,910.10	27,065,152.51
本期贖回（以“-”號填列）	-20,955,584.49	-20,961,234.41
本期末	37,014,303.67	37,024,321.20

滙豐晉信大盤股票 H

金額單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份額（份）	賬面金額
上年度末	35,092,159.61	14,331,470.23
本期申購	-	-
本期贖回（以“-”號填列）	-2,467,602.86	-1,007,759.29
本期末	32,624,556.75	13,323,710.94

注：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。

6.4.7.8 未分配利潤

滙豐晉信大盤股票 A

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	1,718,427,451.41	107,675,428.94	1,826,102,880.35
本期期初	1,718,427,451.41	107,675,428.94	1,826,102,880.35
本期利潤	278,047,399.20	-421,120,350.75	-143,072,951.55
本期基金份額交易產生的變動數	-352,619,669.04	8,384,964.70	-344,234,704.34
其中：基金申購款	236,578,367.66	2,222,715.25	238,801,082.91
基金贖回款	-589,198,036.70	6,162,249.45	-583,035,787.25
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	1,643,855,181.57	-305,059,957.11	1,338,795,224.46

滙豐晉信大盤股票 C

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	129,082,045.77	8,047,665.33	137,129,711.10
本期期初	129,082,045.77	8,047,665.33	137,129,711.10

PUBLIC

本期利潤	20,249,919.22	-35,628,787.21	-15,378,867.99
本期基金份額交易產生的變動數	31,762,926.12	-6,164,226.79	25,598,699.33
其中：基金申購款	128,265,355.80	-7,795,738.83	120,469,616.97
基金贖回款	-96,502,429.68	1,631,512.04	-94,870,917.64
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	181,094,891.11	-33,745,348.67	147,349,542.44

滙豐晉信大盤股票 H

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	59,837,578.92	3,768,833.21	63,606,412.13
本期期初	59,837,578.92	3,768,833.21	63,606,412.13
本期利潤	10,096,067.35	-15,973,320.46	-5,877,253.11
本期基金份額交易產生的變動數	-4,670,959.75	68,858.66	-4,602,101.09
其中：基金申購款	-	-	-
基金贖回款	-4,670,959.75	68,858.66	-4,602,101.09
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	65,262,686.52	-12,135,628.59	53,127,057.93

6.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	451,619.49
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	3,452.71
其他	6,012.08
合計	461,084.28

6.4.7.10 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
賣出股票成交總額	1,984,668,622.51
減：賣出股票成本總額	1,694,742,415.67
減：交易費用	2,815,907.98
買賣股票差價收入	287,110,298.86

6.4.7.11 債券投資收益

6.4.7.11.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

PUBLIC

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
債券投資收益——利息收入	264.32
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	987,454.76
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	987,719.08

6.4.7.11.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	2,540,928.71
減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成本總額	1,553,100.00
減：應計利息總額	272.32
減：交易費用	101.63
買賣債券差價收入	987,454.76

6.4.7.11.3 債券投資收益——贖回差價收入

無。

6.4.7.11.4 債券投資收益——申購差價收入

無。

6.4.7.12 資產支持證券投資收益

無。

6.4.7.13 貴金屬投資收益

6.4.7.13.1 貴金屬投資收益項目構成

無。

6.4.7.13.2 貴金屬投資收益--買賣貴金屬差價收入

無。

6.4.7.13.3 貴金屬投資收益——贖回差價收入

無。

6.4.7.13.4 貴金屬投資收益——申購差價收入

無。

PUBLIC

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

無。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投資收益

無。

6.4.7.15 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投資產生的股利收益	35,960,354.21
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	35,960,354.21

6.4.7.16 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融資產	-472,722,458.42
——股票投資	-472,722,458.42
——債券投資	-
——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	-472,722,458.42

6.4.7.17 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金贖回費收入	772,240.38
基金轉換費收入	141,089.97

PUBLIC

合計	913,330.35

注：

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。

6.4.7.18 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
審計費用	39,671.58
信息披露費	59,507.37
證券出借違約金	-
匯劃手續費	345.00
賬戶維護費	18,600.00
合計	118,123.95

6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

6.4.8.1 或有事項

無。

6.4.8.2 資產負債表日後事項

無。

6.4.9 關聯方、關聯關係

6.4.9.1 本報告期存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況

無。

6.4.9.2 本報告期與基金發生關聯交易的各關聯方

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

PUBLIC

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
滙豐前海證券有限責任公司（"滙豐前海"）	見注釋①

注：①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。

下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

6.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

6.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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	86,364,965.74	2.37%	117,091,162.00	4.67%
山西證券	-	-	37,206,482.00	1.48%

6.4.10.1.2 權證交易

無。

6.4.10.1.3 債券交易

無。

6.4.10.1.4 債券回購交易

無。

6.4.10.1.5 應支付關聯方的傭金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 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	37,645.53	2.37%	-	-
山西證券	-	-	-	-
關聯方名稱	上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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	51,039.29	4.67%	51,039.29	9.91%
山西證券	16,219.57	1.48%	16,219.57	3.15%

PUBLIC

注：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。

6.4.10.2 關聯方報酬

6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
當期發生的基金應支付的管理費	14,238,775.19	15,375,009.21
其中：應支付銷售機構的客戶維護費	4,216,723.84	4,520,102.36
應支付基金管理人的淨管理費	10,022,051.35	10,854,906.85

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 30 日，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x1.50%/當年天數。根據基金管理人滙豐晉信於 2024 年 12 月 31 日發佈的《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》，自 2025 年 3 月 31 日起，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 1.20%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x1.20%/當年天數。

6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
當期發生的基金應支付的託管費	2,373,129.13	2,562,501.46

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 30 日，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x0.25%/當年天數。根據基金管理人滙豐晉信於 2024 年 12 月 31 日發佈的《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》，自 2025 年 3 月 31 日起，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 0.20%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x0.20%/當年天數。

PUBLIC

6.4.10.2.3 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 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 C	滙豐晉信大盤股票 H	合計
交通銀行	-	171.44	-	171.44
滙豐晉信	-	157,685.32	-	157,685.32
合計	-	157,856.76	-	157,856.76
獲得銷售服務費的各關聯方名稱	上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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 C	滙豐晉信大盤股票 H	合計
交通銀行	-	16.64	-	16.64
滙豐晉信	-	43,926.57	-	43,926.57
合計	-	43,943.21	-	43,943.21

注：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。

6.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

6.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況

6.4.10.4.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期間 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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	187,188,198.56	451,619.49	220,952,866.52	347,056.00

PUBLIC

注：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。

6.4.10.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

無。

6.4.10.7 其他關聯交易事項的說明

無。

6.4.11 利潤分配情況

無。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限證券

6.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

6.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	受限期	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量(單位:股)	期末成本總額	期末估值總額	備註
688808	聯訊儀器	2026年04月16日	6個月	首次公開發行限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

注：基金可使用以基金名義開設的股票賬戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。其中基金參與網下申購獲得的新股或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

6.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

6.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

6.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

6.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

PUBLIC

6.4.13 金融工具風險及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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 2026 年 6 月 30 日，本基金無債券投資（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 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。

針對兌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

PUBLIC

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 2026 年 06 月 30 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，因此賬面餘額即為未折現的合約到期現金流量。

6.4.13.3.1 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注 6.4.12。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 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的流動性受限資產的估值占基金資產淨值的比例為 0.01%。

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 2026 年 06 月 30 日，本基金組合資產中 7 個工作日可變現資產的賬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。

6.4.13.4 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。

PUBLIC

6.4.13.4.1 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、結算備付金和存出保證金等。

6.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計
資產					
貨幣資金	187,188,198.56	-	-	-	187,188,198.56
結算備付金	1,624,029.89	-	-	-	1,624,029.89
存出保證金	607,802.88	-	-	-	607,802.88
交易性金融資產	-	-	-	1,738,588,777.21	1,738,588,777.21
應收申購款	-	-	-	292,371.16	292,371.16
資產總計	189,420,031.33	-	-	1,738,881,148.37	1,928,301,179.70
負債					
應付贖回款	-	-	-	3,835,869.23	3,835,869.23
應付管理人報酬	-	-	-	2,000,846.89	2,000,846.89
應付託管費	-	-	-	333,474.46	333,474.46
應付銷售服務費	-	-	-	59,398.32	59,398.32
其他負債	-	-	-	846,932.96	846,932.96
負債總計	-	-	-	7,076,521.86	7,076,521.86
利率敏感度缺口	189,420,031.33	-	-	1,731,804,626.51	1,921,224,657.84
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	不計息	合計

PUBLIC

資產					
貨幣資金	218,470,057.02	-	-	-	218,470,057.02
結算備付金	1,379,221.81	-	-	-	1,379,221.81
存出保證金	521,498.55	-	-	-	521,498.55
交易性金融資產	-	-	-	2,243,567,078.37	2,243,567,078.37
應收清算款	-	-	-	22,465,554.17	22,465,554.17
應收申購款	-	-	-	334,627.20	334,627.20
資產總計	220,370,777.38	-	-	2,266,367,259.74	2,486,738,037.12
負債					
應付贖回款	-	-	-	3,691,752.82	3,691,752.82
應付管理人報酬	-	-	-	2,480,472.40	2,480,472.40
應付託管費	-	-	-	413,412.07	413,412.07
應付銷售服務費	-	-	-	52,871.61	52,871.61
其他負債	-	-	-	854,076.98	854,076.98
負債總計	-	-	-	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

注：表中所示為本基金資產及負債的賬面價值，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。

6.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

於 2026 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性債券投資(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市場利率的變動對於本基金淨資產無重大影響(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，

PUBLIC

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。

6.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	1,738,588,777.21	90.49	2,243,567,078.37	90.49
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	1,738,588,777.21	90.49	2,243,567,078.37	90.49

6.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	除業績比較基準(附注 6.4.1)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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.業績比較基準(附注 6.4.1)上升 5%	75,373,343.70	108,204,593.27
	2.業績比較基準(附注 6.4.1)下降 5%	-75,373,343.70	-108,204,593.27

6.4.14 公允價值

6.4.14.1 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

PUBLIC

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。

6.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一層次	1,738,330,531.42	2,243,567,078.37
第二層次	-	-
第三層次	258,245.79	-
合計	1,738,588,777.21	2,243,567,078.37

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的說明

於 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關說明

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，其賬面價值與公允價值相差很小。

6.4.15 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

截至資產負債表日本基金無需要說明的其他重要事項。

§7 投資組合報告

7.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

PUBLIC

序號	項目	金額	占基金總資產的比例(%)
1	權益投資	1,738,588,777.21	90.16
	其中：股票	1,738,588,777.21	90.16
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	188,812,228.45	9.79
8	其他各項資產	900,174.04	0.05
9	合計	1,928,301,179.70	100.00

7.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

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	-	-
B	採礦業	-	-
C	製造業	1,220,320,467.19	63.52
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	98,907,628.94	5.15
G	交通運輸、倉儲和郵政業	-	-
H	住宿和餐飲業	59,911,225.92	3.12
I	信息傳輸、軟體和信息技術服務業	-	-
J	金融業	285,740,589.16	14.87
K	房地產業	-	-
L	租賃和商務服務業	-	-
M	科學研究和技術服務業	73,708,866.00	3.84
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	1,738,588,777.21	90.49

7.3 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

PUBLIC

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	占基金資產淨值比例(%)
1	002078	太陽紙業	15,084,712	188,408,052.88	9.81
2	300979	華利集團	5,841,320	173,779,270.00	9.05
3	601677	明泰鋁業	4,877,200	80,961,520.00	4.21
4	603939	益豐藥房	4,490,897	80,746,328.06	4.20
5	000100	TCL 科技	13,749,300	80,020,926.00	4.17
6	000951	中國重汽	3,984,820	77,743,838.20	4.05
7	601688	華泰證券	3,726,350	76,837,337.00	4.00
8	000932	華菱鋼鐵	21,700,800	75,301,776.00	3.92
9	601601	中國太保	2,601,100	74,183,372.00	3.86
10	300012	華測檢測	5,318,100	73,708,866.00	3.84
11	603816	XD 顧家家	3,253,400	72,746,024.00	3.79
12	601166	興業銀行	4,109,596	68,054,909.76	3.54
13	601169	北京銀行	13,605,096	66,664,970.40	3.47
14	601233	桐昆股份	2,865,673	62,041,820.45	3.23
15	600258	首旅酒店	5,486,376	59,911,225.92	3.12
16	000425	徐工機械	6,388,900	51,686,201.00	2.69
17	300750	寧德時代	126,300	49,637,163.00	2.58
18	000933	神火股份	2,017,000	42,760,400.00	2.23
19	002508	老闆電器	2,708,076	39,592,071.12	2.06
20	603338	浙江鼎力	838,036	35,616,530.00	1.85
21	600690	海爾智家	1,609,400	32,847,854.00	1.71
22	002572	索菲亞	4,261,256	31,107,168.80	1.62
23	603035	常熟汽飾	2,822,495	29,974,896.90	1.56
24	000786	北新建材	1,350,249	24,426,004.41	1.27
25	002311	海大集團	475,900	21,229,899.00	1.11
26	603529	愛瑪科技	1,042,264	20,334,570.64	1.06
27	600887	伊利股份	791,500	18,964,340.00	0.99
28	603883	老百姓	1,657,053	18,161,300.88	0.95
29	002011	盾安環境	508,100	5,390,941.00	0.28
30	000039	中集集團	661,400	5,363,954.00	0.28
31	688808	聯訊儀器	163	258,245.79	0.01
32	300308	中際旭創	100	127,000.00	0.01

7.4 報告期內股票投資組合的重大變動

7.4.1 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（%）

PUBLIC

1	300979	華利集團	176,674,352.44	7.13
2	002078	太陽紙業	92,367,246.36	3.73
3	000932	華菱鋼鐵	87,144,489.00	3.51
4	000425	徐工機械	82,833,160.30	3.34
5	601166	興業銀行	78,786,484.60	3.18
6	300750	寧德時代	64,150,207.00	2.59
7	688036	傳音控股	63,909,976.93	2.58
8	601601	中國太保	59,581,715.40	2.40
9	600048	保利發展	58,813,968.00	2.37
10	002475	立訊精密	58,432,668.00	2.36
11	600258	首旅酒店	56,367,632.00	2.27
12	002311	海大集團	52,977,916.38	2.14
13	002572	索菲亞	51,031,234.46	2.06
14	000725	京東方Ａ	50,956,299.00	2.06
15	600809	山西汾酒	50,424,916.00	2.03
16	603529	愛瑪科技	45,771,111.20	1.85
17	603997	繼峰股份	39,515,605.00	1.59
18	002011	盾安環境	37,300,448.00	1.50
19	300679	電連技術	34,920,244.00	1.41
20	600690	海爾智家	33,898,294.12	1.37

注：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。

7.4.2 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	601233	桐昆股份	167,589,586.40	6.76
2	000725	京東方Ａ	127,103,286.00	5.13
3	000933	神火股份	91,965,651.60	3.71
4	002475	立訊精密	85,099,380.00	3.43
5	601166	興業銀行	77,936,585.00	3.14
6	688036	傳音控股	71,839,589.04	2.90
7	000807	雲鋁股份	70,699,286.24	2.85
8	601677	明泰鋁業	65,327,987.00	2.63
9	600309	萬華化學	62,861,788.09	2.54
10	603599	廣信股份	62,406,047.20	2.52
11	000921	海信家電	56,309,175.58	2.27
12	000923	河鋼資源	55,701,663.48	2.25
13	000951	中國重汽	54,896,315.12	2.21
14	300012	華測檢測	54,192,753.00	2.19
15	600048	保利發展	53,375,478.00	2.15

PUBLIC

16	000786	北新建材	50,831,196.00	2.05
17	601688	華泰證券	45,802,387.49	1.85
18	600809	山西汾酒	45,650,906.74	1.84
19	000100	TCL 科技	45,058,366.00	1.82
20	300679	電連技術	43,891,380.00	1.77

注：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。

7.4.3 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	1,662,486,572.93
賣出股票收入（成交）總額	1,984,668,622.51

注：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。

7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

無。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投資股指期貨的投資政策

無。

7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

PUBLIC

7.11.1 本期國債期貨投資政策

無。

7.11.2 本期國債期貨投資評價

無。

7.12 投資組合報告附注

7.12.1 本基金投資的前十名證券的發行主體本期受到監管部門立案調查或報告編制日前一年內受到公開譴責、處罰的情形說明

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。

7.12.2 基金投資的前十名股票超出基金合同約定的備選股票庫情況的說明

本基金投資的前十名股票中，沒有投資於超出基金合同約定的備選股票庫之外的股票。

7.12.3 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	607,802.88
2	應收清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	292,371.16
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	900,174.04

7.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

無。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

無。

7.12.6 投資組合報告附注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。

PUBLIC

7.13 投資組合報告（供香港投資人參閱）

PUBLIC

投資組合			
於 2026/06/30			
	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			
太陽紙業	15,084,712	188,408,052.88	9.81
華利集團	5,841,320	173,779,270.00	9.05
明泰鋁業	4,877,200	80,961,520.00	4.21
益豐藥房	4,490,897	80,746,328.06	4.20
TCL 科技	13,749,300	80,020,926.00	4.17
中國重汽	3,984,820	77,743,838.20	4.05
華泰證券	3,726,350	76,837,337.00	4.00
華菱鋼鐵	21,700,800	75,301,776.00	3.92
中國太保	2,601,100	74,183,372.00	3.86
華測檢測	5,318,100	73,708,866.00	3.84
XD 顧家家	3,253,400	72,746,024.00	3.79
興業銀行	4,109,596	68,054,909.76	3.54
北京銀行	13,605,096	66,664,970.40	3.47
桐昆股份	2,865,673	62,041,820.45	3.23
首旅酒店	5,486,376	59,911,225.92	3.12
徐工機械	6,388,900	51,686,201.00	2.69
寧德時代	126,300	49,637,163.00	2.58
神火股份	2,017,000	42,760,400.00	2.23
老闆電器	2,708,076	39,592,071.12	2.06
浙江鼎力	838,036	35,616,530.00	1.85
海爾智家	1,609,400	32,847,854.00	1.71
索菲亞	4,261,256	31,107,168.80	1.62
常熟汽飾	2,822,495	29,974,896.90	1.56
北新建材	1,350,249	24,426,004.41	1.27
海大集團	475,900	21,229,899.00	1.11
愛瑪科技	1,042,264	20,334,570.64	1.06

PUBLIC

伊利股份	791,500	18,964,340.00	0.99
老百姓	1,657,053	18,161,300.88	0.95
盾安環境	508,100	5,390,941.00	0.28
中集集團	661,400	5,363,954.00	0.28
聯訊儀器	163	258,245.79	0.01
中際旭創	100	127,000.00	0.01
投資總計			
投資總成本：1,949,616,405.30人民幣元		1,738,588,777.21	90.49
其他淨資產		182,635,880.63	9.51
基金資產淨值		1,921,224,657.84	100.00

投資組合變動表				
				市值占淨值%
			2026/06/30	**2025/06/30**
股票			90.49	91.43
投資總計			90.49	91.43
其他淨資產			9.51	8.57
市值占淨值%			100.00	100.00

§8 基金份額持有人信息

8.1 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	持有人	戶均持有的基	持有人結構

PUBLIC

別	戶數（戶）	金份額	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	27,161	12,208.86	160,690,200.75	48.46%	170,914,600.12	51.54%
滙豐晉信大盤股票 C	875	42,302.06	35,199,503.14	95.10%	1,814,800.53	4.90%
滙豐晉信大盤股票 H	4	8,156,139.19	32,624,556.75	100.00%	0.00	0.00%
合計	28,040	14,309.69	228,514,260.64	56.95%	172,729,400.65	43.05%

注：

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。

8.2 盈利投資者數量占比

項目	過去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投資者數量占比	94.01%

8.3 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	144,323.38	0.0435%
	滙豐晉信大盤股票 C	0.00	0.0000%
	滙豐晉信大盤股票 H	0.00	0.0000%
	合計	144,323.38	0.0360%

8.4 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 C	0
	滙豐晉信大盤股票 H	0
	合計	0
本基金基金經理持有本開放式	滙豐晉信大盤股票 A	10~50

PUBLIC

基金	滙豐晉信大盤股票 C	0
	滙豐晉信大盤股票 H	0
	合計	10~50

§9 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 C	滙豐晉信大盤股票 H
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	407,154,574.33	30,911,978.06	35,092,159.61
本報告期基金總申購份額	50,455,836.37	27,057,910.10	-
減：本報告期基金總贖回份額	126,005,609.83	20,955,584.49	2,467,602.86
本報告期基金拆分變動份額	-	-	-
本報告期期末基金份額總額	331,604,800.87	37,014,303.67	32,624,556.75

注：此處申購含紅利再投、轉換入份額，贖回含轉換出份額。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2026 年 4 月 25 日，基金管理人發佈公告，聘任吳堅雋先生擔任公司風控負責人。

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。

10.3 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。

10.4 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。

PUBLIC

10.5 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。本基金本報告期內未有改聘為其審計的會計師事務所的情況。

10.6 管理人、託管人及相關從業人員受調查或處罰等情況

10.6.1 管理人受調查或處罰等情況

本報告期內，本基金管理人未有受調查或處罰等情況發生。

10.6.2 管理人相關從業人員受調查或處罰等情況

本報告期內，本基金管理人相關從業人員未有受調查或處罰等情況發生。

10.6.3 託管人受調查或處罰等情況

本報告期內基金託管人的託管業務部門未受到調查或處罰等情況。

10.6.4 託管人相關從業人員受調查或處罰等情況

報告期內，本基金託管人相關從業人員未有受調查或處罰等情況發生。

10.7 基金租用或者通過證券公司交易單元進行證券投資的相關情況

10.7.1 基金租用或者通過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	
華創證券	1	587,829,583.20	16.12%	256,238.56	16.12%	-
西部證券	2	433,675,593.75	11.89%	189,041.66	11.89%	-
華福證券	2	389,745,684.51	10.69%	169,890.61	10.69%	-
廣發證券	3	383,498,436.89	10.52%	167,170.84	10.52%	-
中泰證券	2	231,945,411.92	6.36%	101,105.78	6.36%	-
國金證	1	218,697,564.30	6.00%	95,332.86	6.00%	-

PUBLIC

券						
國聯民生	2	213,783,111.72	5.86%	93,186.13	5.86%	-
中信建投	1	193,380,223.36	5.30%	84,294.35	5.30%	-
申萬宏源	1	192,130,078.35	5.27%	83,746.60	5.27%	-
東方證券	1	168,127,676.32	4.61%	73,281.90	4.61%	-
長江證券	2	138,170,402.12	3.79%	60,225.20	3.79%	-
財通證券	2	124,543,790.14	3.41%	54,287.57	3.41%	-
國海證券	2	124,081,251.90	3.40%	54,091.50	3.40%	-
中信證券	2	89,795,363.10	2.46%	39,139.97	2.46%	-
滙豐前海	2	86,364,965.74	2.37%	37,645.53	2.37%	-
招商證券	2	38,562,969.00	1.06%	16,809.92	1.06%	-
興業證券	1	32,684,916.00	0.90%	14,248.22	0.90%	-
華安證券	2	5,200.00	0.00%	2.27	0.00%	-
東興證券	3	-	-	-	-	-
東吳證券	2	-	-	-	-	-
東方財富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中銀國際	1	-	-	-	-	-
信達證券	2	-	-	-	-	-
光大證券	1	-	-	-	-	-
華泰證券	2	-	-	-	-	-
華西證券	2	-	-	-	-	-

PUBLIC

國投證券	1	-	-	-	-	-
國泰海通	2	-	-	-	-	-
國盛證券	2	-	-	-	-	-
天風證券	2	-	-	-	-	-
太平洋證券	2	-	-	-	-	-
山西證券	1	-	-	-	-	-
平安證券	1	-	-	-	-	-
開源證券	2	-	-	-	-	-
德邦證券	2	-	-	-	-	-
方正證券	2	-	-	-	-	-
浙商證券	2	-	-	-	-	-
西南證券	1	-	-	-	-	-
野村東方	2	-	-	-	-	-
銀河證券	1	-	-	-	-	-

注：

1、報告期內退租廣發證券交易單元；

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信息服務；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。

PUBLIC

（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。

10.7.2 基金租用或者通過證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		債券回購交易		權證交易		基金交易	
	成交金額	占當期債券成交總額的比例	成交金額	占當期債券回購成交總額的比例	成交金額	占當期權證成交總額的比例	成交金額	占當期基金成交總額的比例
華創證券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華福證券	-	-	-	-	-	-	-	-
廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國金證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國聯民生	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
申萬宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
東方證券	-	-	-	-	-	-	-	-
長江證券	-	-	-	-	-	-	-	-
財通證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國海證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信證券	-	-	-	-	-	-	-	-
滙豐前海	-	-	-	-	-	-	-	-
招商證券	2,540,928.71	100.00%	-	-	-	-	-	-
興業證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華安證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東興證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東吳證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東方財富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中銀國際	-	-	-	-	-	-	-	-
信達證券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華西證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國投證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
國盛證券	-	-	-	-	-	-	-	-
天風證券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋證券	-	-	-	-	-	-	-	-

PUBLIC

山西證券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安證券	-	-	-	-	-	-	-	-
開源證券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦證券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正證券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商證券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南證券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村東方	-	-	-	-	-	-	-	-
銀河證券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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 2025 年第四季度報告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-01-21
2	滙豐晉信基金管理有限公司關於調整旗下開放式基金在招商證券的交易限額的公告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-01-26
3	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（2025 年度）	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-03-31
4	滙豐晉信基金管理有限公司關於旗下基金 2025 年年度報告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-03-31
5	滙豐晉信基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度報告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-04-22
6	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	2026-04-25
7	滙豐晉信基金管理有限公司關於新增萬家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	2026-05-18
8	滙豐晉信基金管理有限公司關於新增易方達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	2026-06-03
9	滙豐晉信基金管理有限公司關於新增肯特瑞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	2026-06-25
10	滙豐晉信大盤股票型證券投資基金更新招募說明書（2026 年第 1 號）	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2026-06-30
11	滙豐晉信大盤股票型證券投資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	2026-06-30
12	滙豐晉信大盤股票型證券投資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	2026-06-30

§11 影響投資者決策的其他重要信息

PUBLIC

11.1 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。

11.2 影響投資者決策的其他重要信息

無。

§12 備查文件目錄

12.1 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說明書
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

12.2 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

12.3 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

二〇二六年八月三十一日

PUBLIC