滙豐晉信大盤股票型證券投資基金 2025 年中期報告

2025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

送出日期:2025年08月29日

滙豐晉信大盤股票型證券投資基金 2025年6月30日基金中期報告 向香港投資者提供的資料

在 2025 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

2025年8月29日

§1 重要提示及目錄

1.1 重要提示

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

基金託管人交通銀行股份有限公司根據本基金合同規定,於2025年08月28日復核 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,保證復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2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目錄

§1	重要提示及目錄	3
	1.1 重要提示	3
	1.2 目錄	4
§2	基金簡介	6
	2.1 基金基本情況	6
	2.2 基金產品說明	6
	2.3 基金管理人和基金託管人	7
	2.4 信息披露方式	8
	2.5 其他相關資料	8
§3	主要財務指標和基金淨值表現	8
	3.1 主要會計數據和財務指標	8
	3.2 基金淨值表現	9
§4	管理人報告	13
	4.1 基金管理人及基金經理情況	13
	4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明	15
	4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明	15
	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	16
	4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望	17
	4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明	17
	4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明	18
	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	18
§5	託管人報告	18
	5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明	18
	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	18
	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	18
§6	半年度財務會計報告(未經審計)	18
	6.1 資產負債表	18
	6.2 利潤表	20
	6.3 淨資產變動表	22
	6.4 報表附注	24
§7	投資組合報告	48
	7.1 期末基金資產組合情況	
	7.2 報告期末按行業分類的境內股票投資組合	
	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	50
	7.4 報告期內股票投資組合的重大變動	
	7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	
	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	
	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	
	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	
	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	
	7.10 本基金投資股指期貨的投資政策	
	7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	54
	7.12 投資組合報告附注	
	7.13 投資組合報告(供香港投資人參閱)	55

§8 基金份額持有人信息	57
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構	57
8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況	57
8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況	
§9 開放式基金份額變動	58
§10 重大事件揭示	59
10.1 基金份額持有人大會決議	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟	
10.4 基金投資策略的改變	59
10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況	59
10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況	60
10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況	60
10.8 其他重大事件	64
§11 影響投資者決策的其他重要信息	66
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	67
11.2 影響投資者決策的其他重要信息	67
§12 備查文件目錄	67
12.1 備查文件目錄	67
12.2 存放地點	67
12.3 杳閱方式	67

§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	滙豐晉信大盤別	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	1		
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	547,404,683.96份			
基金合同存續期	不定期			
下屬分級基金的基金簡稱	滙豐晉信大盤 股票A	滙豐晉信大盤 股票H	滙豐晉信大盤 股票C	
下屬分級基金的交易代碼	540006	960000	019243	
報告期末下屬分級基金的份額總額	498,935,310.5 7份	39,222,942.32 份	9,246,431.07 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

	通過投資於盈利預期持續穩定增長,在各行業中
机次口栅	具有領先地位的大盤藍籌型股票,在合理控制風險的
投資目標	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。
	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,
机次体吸	在投資決策中,本基金僅根據精選的各類證券的風險
投資策略	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

第6頁,共67頁

	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%。
	本基金屬於股票型基金產品,在開放式基金中,
	其預期風險和收益水平高於債券型基金和混合型基
風險收益特徵	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	姓名	周慧	方圓
露負責	聯繫電話	021-20376868	95559
人	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1
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》
登載基金中期報告正 文的管理人互聯網網 址	www.hsbcjt.cn
基金中期報告備置地點	滙豐晉信基金管理有限公司:中國(上海)自由貿易試驗區 世紀大道8號上海國金中心滙豐銀行大樓17樓;交通銀行股份 有限公司:中國(上海)長寧區仙霞路18號

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
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

金額單位:人民幣元

	報告期			
3.1.1 期間數據和指標	(2025年01月01日-2025年06月30日)			
3-1-1 分川可安江水/山门日/示	滙豐晉信大	滙豐晉信大	滙豐晉信大	
	盤股票A	盤股票H	盤股票C	
本期已實現收益	83,340,754.5 4	2,685,237.04	2,276,245.11	
本期利潤	72,718,815.5 7	2,339,693.40	-1,446,628.9 5	
加權平均基金份額本期利潤	0.1401	0.0559	-0.0889	
本期加權平均淨值利潤率	3.38%	3.33%	-2.16%	
本期基金份額淨值增長率	3.12%	3.07%	2.92%	
3.1.2 期末數據和指標	報告期末			
J•1•4 为门/下安XJ涿/□门日/示	(2	2025年06月30日])	

期末可供分配利潤	1,582,276,73	50,274,973.1	29,062,673.4
例 5	0.45	5	9
期末可供分配基金份額利潤	3.1713	1.2818	3.1431
期末基金資產淨值	2,081,212,04	66,293,425.7	38,311,622.3
州 // 至並負 座 // 恒	1.02	7	9
期末基金份額淨值	4.1713	1.6902	4.1434
2.1.2 国际出现一个任何		報告期末	
3.1.3 累計期末指標	(2025年06月30日)		
基金份額累計淨值增長率	342.12%	69.02%	9.24%

- 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

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
過去一個月	1.66%	0.58%	2.25%	0.52%	-0.59%	0.06%
過去三個月	-2.08%	1.19%	1.14%	0.99%	-3.22%	0.20%
過去六個月	3.12%	1.02%	0.04%	0.92%	3.08%	0.10%
過去一年	12.76%	1.39%	12.37%	1.25%	0.39%	0.14%
過去三年	-11.00%	1.22%	-10.91%	0.99%	-0.09%	0.23%
自基金合同 生效起至今	342.12%	1.37%	25.84%	1.26%	316.28%	0.11%

注:

過去一個月指2025年06月01日 - 2025年06月30日

過去三個月指2025年04月01日 - 2025年06月30日

過去六個月指2025年01月01日 - 2025年06月30日

過去一年指2024年07月01日 - 2025年06月30日

過去三年指2022年07月01日 - 2025年06月30日

自基金合同生效起至今指2009年06月24日 - 2025年06月30日

滙豐晉信大盤股票H

階段	份額淨值 增長率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較 基準收益 率③	業績比較 基準收益 率標準差 ④	1)-(3)	2-4
過去一個月	1.61%	0.58%	2.25%	0.52%	-0.64%	0.06%
過去三個月	-2.15%	1.19%	1.14%	0.99%	-3.29%	0.20%
過去六個月	3.07%	1.02%	0.04%	0.92%	3.03%	0.10%
過去一年	12.66%	1.39%	12.37%	1.25%	0.29%	0.14%
過去三年	-11.17%	1.22%	-10.91%	0.99%	-0.26%	0.23%
成立至今	69.02%	1.26%	4.67%	1.09%	64.35%	0.17%

注:

過去一個月指2025年06月01日 - 2025年06月30日

過去三個月指2025年04月01日 - 2025年06月30日

過去六個月指2025年01月01日 - 2025年06月30日

過去一年指2024年07月01日 - 2025年06月30日

過去三年指2022年07月01日 - 2025年06月30日

成立至今指2015年12月30日 - 2025年06月30日

滙豐晉信大盤股票C

階段	份額淨值 增長率①	份額淨值 增長率標 準差②	業績比較 基準收益 率③	業績比較 基準收益 率標準差 ④	1)-(3)	2-4
過去一個月	1.63%	0.58%	2.25%	0.52%	-0.62%	0.06%
過去三個月	-2.17%	1.19%	1.14%	0.99%	-3.31%	0.20%
過去六個月	2.92%	1.02%	0.04%	0.92%	2.88%	0.10%

第10頁,共67頁

過去一年	12.27%	1.39%	12.37%	1.25%	-0.10%	0.14%
成立至今	9.24%	1.35%	8.83%	1.09%	0.41%	0.26%

注:

過去一個月指2025年06月01日 - 2025年06月30日 過去三個月指2025年04月01日 - 2025年06月30日 過去六個月指2025年01月01日 - 2025年06月30日 過去一年指2024年07月01日 - 2025年06月30日 成立至今指2023年11月13日 - 2025年06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。

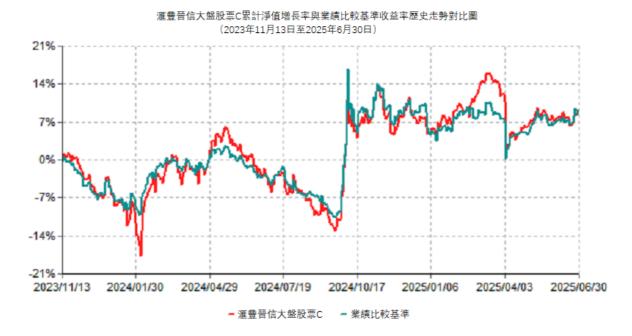
- 2.報告期內本基金的業績比較基準= 滬深300指數*90% + 同業存款利率*10%。
- 3.上述基金淨值增長率的計算已包含本基金所投資股票在報告期產生的股票紅利收

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。



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。



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。

§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2025年6月30日,公司共管理40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)、滙豐晉信港股涌精選股票型證券投資基金 (2019年3月20日成立)、滙豐晉信港股诵雙核策略混合型證券投資基金(2019年8月2日 成立)、滙豐晉信慧盈混合型證券投資基金(2020年7月30日成立)、滙豐晉信中小盤低 波動策略股票型證券投資基金(2020年8月13日成立)、滙豐晉信惠安純債63個月定期 開放債券型證券投資基金(2020年10月29日成立)、滙豐晉信創新先鋒股票型證券投資 基金(2021年3月16日成立)、滙豐晉信核心成長混合型證券投資基金(2021年5月24日 成立)、滙豐晉信醫療先鋒混合型證券投資基金(2021年7月12日成立)、滙豐晉信研 究精選混合型證券投資基金(2022年1月21日成立)、滙豐晉信慧悅混合型證券投資基 金(2022年3月3日成立)、滙豐晉信時代先鋒混合型證券投資基金(2022年6月8日成立)、 滙豐晉信豐盈債券型證券投資基金(2022年8月16日成立)、滙豐晉信策略優選混合型 證券投資基金(2022年9月14日成立)、滙豐晉信龍頭優勢混合型證券投資基金(2022 年9月27日成立)、滙豐晉信豐寧三個月定期開放債券型證券投資基金(2022年12月20 日成立)、滙豐晉信慧嘉債券型證券投資基金(2023年1月17日成立)、滙豐晉信中證 同業存單AAA指數7天持有期證券投資基金(2023年12月12日成立)、滙豐晉信慧鑫六 個月持有期債券型證券投資基金(2024年4月16日成立)、滙豐晉信養老目標日期2036 一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2024年6月12日成立)、滙豐晉信綠色債券型證券 投資基金(2024年12月11日成立)和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)。

4.1.2 基金經理(或基金經理小組)及基金經理助理簡介

ĺ			任本基金的基	證券	
	姓名	職務	金經理(助理)	從業	說明
			期限	年限	

第14頁, 共67頁

		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	-	11	閔良超先生,碩士研究生。 曾任平安證券股份有限公司研究員、滙豐晉信基金管理有限公司研究員、高級宏觀策略分析師、助理研究總監、研究副總監,現任滙豐晉信基金管理有限公司股票研究總監,滙豐晉信2026生命週期證券投資基金、滙豐晉信新動力混合型證券投資基金、滙豐晉信滬港深股票型證券投資基金、滙豐晉信滬港深股票型證券投資基金基金經理。

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

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 第15頁,共67頁 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

2025年上半年的市場呈現了比較強的韌性,雖然有關稅的擾動,但市場出現了較快的修復。從結構性的機會來說,上半年呈現了一些結構性的亮點和賺錢效應。從年初的機器人,到後來的部分新消費和創新藥,以及一直超預期的海外算力板塊,上游板塊中的黃金,均有不錯的表現。煤炭、房地產和食品飲料等板塊,由於比較承壓的基本面,上半年依然是下跌的。因此總結上半年市場呈現的兩個關鍵字是韌性和分化。上半年市場之所以具備很強的韌性,本質是由經濟週期決定的。在政策發力的情況下,經濟的很多領先指標已經開始回升,房地產的降幅已經明顯收窄,經濟基本面的風險已經得到了較大的緩釋,當前市場得到比較有韌性的支撐。同時由於目前PPI依然同比負增長,經濟相關的板塊的盈利尚未出現明顯的改善,上半年的投資機會呈現結構性特徵。本基金在上半年整體表現出韌性有餘而彈性不足,核心在於市場依然在交易杠鈴策略的兩端,尤其是部分高景氣板塊和小市值、微盤股。本產品聚焦在大盤股,同時也會關注小盤股的風險。基於性價比的原則,減倉了部分行業如金融板塊,加倉了電子行業,同時本產品更多地配置了內需相關的資產,開始佈局一些具備成本優勢和品牌優勢的公司,我們認為這些高質量公司有比較好的性價比。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

本報告期內,本基金A類淨值變化幅度為3.12%,同期業績比較基準為0.04%,本基金A類領先同期比較基準3.08%;本基金H類本報告期內淨值變化幅度為3.07%,同期業績比較基準為0.04%,本基金H類領先同期比較基準3.03%;本基金C類本報告期內淨值變化幅度為2.92%,同期業績比較基準為0.04%,本基金C類領先同期比較基準2.88%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

大盤基金專注於分析大盤股特有的競爭優勢,基金管理人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。

我們在2024年年報中論述了在2025年會期待部分行業供需結構的好轉,大多中游行業在過去幾年面臨的較大挑戰是供給產能的過剩,目前積極的信號在於很多行業已經開始縮減資本開支甚至降低開工率來應對價格的降低,近期各行業的產能過剩和"反內卷"得到了政府的重視,並且嘗試去解決當前的困局。從大的風格來看,過去幾年比較有效的杠鈴策略近期開始出現了一些波動。一方面,對於部分前期景氣行業,目前景氣度的持續性和較高的利潤率現狀,使得這塊的投資風險在逐漸增加。另一方面,對於中游行業,供給側的邏輯正在逐步兌現,尤其是有些行業正以市場化的方式減少新增產能,疊加行業的需求如果有所修復的話,有望看到價格和盈利的彈性,也是我們產品的核心配置方向。

對於中小市值,我們警惕存在交易過熱的風險,目前中證2000成分股的成交占比超過30%,這個在歷史上是非常高的水平,這個是由較好的市場交投情況來支撐的,同時是市場的景氣行業稀缺導致的,一旦這兩個條件其一發生變化,我們預計中小市值交易可能會出現過於擁擠的風險。基於本產品的定位,我們聚焦在大盤藍籌中尋找投資機會。2025年風格上看好大盤藍籌風格,我們認為部分優質公司的估值已經處於明顯低估的水平。

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。

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

會計主體:滙豐晉信大盤股票型證券投資基金

報告截止日:2025年06月30日

第18頁,共67頁

	H/177 H E	本期末	上年度末
資產	附注號	2025年06月30日	2024年12月31日
資產:			
貨幣資金	6.4.7.1	220,952,866.52	189,086,933.51
結算備付金		1,489,190.87	955,260.88
存出保證金		442,426.97	731,225.55
交易性金融資產	6.4.7.2	1,998,479,668.39	2,131,923,533.95
其中:股票投資		1,998,479,668.39	2,131,923,533.95
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		16,043,605.57	-
應收股利		-	-
應收申購款		161,814.87	395,751.17
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.5	-	1
資產總計		2,237,569,573.19	2,323,092,705.06
負債和淨資產	附注號	本期末	上年度末
只 例10/7	613 <u>7 T 20</u> 0	2025年06月30日	2024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		-	4,175,090.69

		•	
應付贖回款		48,272,789.29	1,298,914.07
應付管理人報酬		2,180,821.92	2,982,400.51
應付託管費		363,470.31	497,066.73
應付銷售服務費		13,761.02	23,801.98
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		527.35	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.6	921,114.12	1,015,455.77
負債合計		51,752,484.01	9,992,729.75
淨資產:			
實收基金	6.4.7.7	524,202,712.09	572,040,981.68
未分配利潤	6.4.7.8	1,661,614,377.09	1,741,058,993.63
淨資產合計		2,185,817,089.18	2,313,099,975.31
負債和淨資產總計	_	2,237,569,573.19	2,323,092,705.06

注:報告截止日2025年6月30日,基金份額總額為547,404,683.96份,其中A類基金份額總額為498,935,310.57份,基金份額淨值4.1713元;C類基金份額總額為9,246,431.07份,基金份額淨值4.1434元;H類基金份額總額為39,222,942.32份,基金份額淨值1.6902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:2025年01月01日至2025年06月30日

單位:人民幣元

		本期	上年度可比期間
項目	附注號	2025年01月01日至	2024年01月01日至202
		2025年06月30日	4年06月30日
一、營業總收入		91,805,872.78	58,897,218.83
1.利息收入		351,238.58	596,131.31
其中:存款利息收入	6.4.7.9	351,238.58	596,131.31
債券利息收入		-	-
資產支持證券利息			
收入		-	-

第20頁,共67頁

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)		105,658,834.73	96,564,298.58
其中:股票投資收益	6.4.7.10	84,783,930.43	67,205,155.81
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.11	332,359.30	70,043.08
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	20,542,545.00	29,289,099.69
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	-14,690,356.67	-38,547,636.19
4.滙兌收益(損失以"-"號 填列)		-	-
5.其他收入(損失以"-"號 填列)	6.4.7.17	486,156.14	284,425.13
減:二、營業總支出		18,193,992.76	20,927,765.95
1.管理人報酬	6.4.10.2.1	15,375,009.21	17,663,305.14
2.託管費	6.4.10.2.2	2,562,501.46	2,943,884.18
3.銷售服務費	6.4.10.2.3	133,432.85	180,703.44
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		0.89	-
8.其他費用	6.4.7.18	123,048.35	139,873.19

三、利潤總額(虧損總額以"-"號填列)	73,611,880.02	37,969,452.88
減:所得稅費用	1	-
四、淨利潤(淨虧損以"-"號填列)	73,611,880.02	37,969,452.88
五、其他綜合收益的稅後 淨額		-
六、綜合收益總額	73,611,880.02	37,969,452.88

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:2025年01月01日至2025年06月30日

單位:人民幣元

	本期				
項目	2025年01月01日至2025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	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		

第22頁,共67頁

(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 上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日 寅收基金 未分配利潤 淨資產合計 一、上期期末淨資 產 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 二、本期期初淨資 產 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期增減變動 額(減少以"-"號填 別) (一)、綜合收益 總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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 別) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 190,622,609.01 -261,317,649.85 (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				
刊調産生的淨資産				
受動 (沪資産減少 以 " " 端 域 列)				
以"、"號填列) 四、本期期末淨資産 524,202,712.09 1,661,614,377.09 2,185,817,089.18 上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日 實收基金 未分配利潤 淨資產合計 一、上期期末淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 二、本期期初淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期增減變動額 (減少以""號填 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 列) (一)、綜合收益 総額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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 109,862,573.40 275,538,034.65 385,400,608.05 產減少以""號填 70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	利潤產生的淨資產	-	-	-
四、本期期末淨資産 524,202,712.09 1,661,614,377.09 2,185,817,089.18 上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日 實收基金 未分配利潤 淨資産合計 一、上期期末淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 二・本期期初淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三・本期増減變動額(減少以"、"號填別) 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (二)、本期基金份額交易產生的淨資產變動數(淨資產減少以"、"號填別) 109,862,573.40 275,538,034.65 385,400,608.05 2.基金贖回款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產數の(淨資產減少	變動(淨資產減少			
正年度可比期間 1,661,614,377.09 2,185,817,089.18 上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日 實收基金 未分配利潤 浄資産合計 下、上期期末浄資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 下本期増減變動額(減少以、、、・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・	以"-"號填列)			
上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日 實收基金 未分配利潤 浄資産合計 一、上期期末浄資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 二、本期期初浄資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期増減變動額(減少以""號填列) 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 423,370,060.93 (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (二)、本期基金份額交易産生的浄資産變動數(浄資産減少以""號填列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基金份額持有人分配利潤産生的淨資產數(淨資產減少	四、本期期末淨資	524 202 712 00	1 661 614 277 00	2 105 017 000 10
項目2024年01月01日至2024年06月30日 實收基金未分配利潤淨資產合計一、上期期末淨資産537,111,410.131,431,915,180.441,969,026,590.57二、本期期初淨資産537,111,410.131,431,915,180.441,969,026,590.57三、本期増減變動額(減少以""號填列)109,862,573.40313,507,487.53423,370,060.93(一)、綜合收益總額- 37,969,452.8837,969,452.88(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)109,862,573.40275,538,034.65385,400,608.05基本費回款180,554,614.24466,163,643.66646,718,257.90次2.基金贖回款-70,692,040.84-190,625,609.01-261,317,649.85(三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產	產	324,202,712.09	1,001,014,377.09	2,185,817,089.18
實收基金 未分配利潤 淨資產合計 一、上期期末淨資 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 二、本期期初淨資 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期增減變動 額 (減少以"-"號填 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 列) (一)、綜合收益 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 次 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 次 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基金份額持有人分配 刊潤產生的淨資產 變動 (淨資產減少			上年度可比期間	
一、上期期末淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 □、本期期初淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 □、本期増減變動額(減少以"-"號填 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (二)、本期基金份額交易產生的淨資產變動數(淨資産減少以"-"號填列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 170,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產數(淨資產減少以,資產減少,一方人。261,317,649.85	項目	2024年	至01月01日至2024年06	月30日
 産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 □ 本期期初淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 □ 本期增減變動額 (減少以"-"號填 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 ② 基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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 一 本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產數(淨資產減少 		實收基金	未分配利潤	淨資產合計
 産 二、本期期初淨資産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期增減變動額(減少以"-"號填 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 列) (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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 	一、上期期末淨資	505 111 110 10	1 121 017 100 11	1 0 00 00 0 500 55
産 537,111,410.13 1,431,915,180.44 1,969,026,590.57 三、本期増減變動額(減少以"-"號填列) 109,862,573.40 313,507,487.53 423,370,060.93 (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 275,538,034.65 385,400,608.05 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	產	537,111,410.13	1,431,915,180.44	1,969,026,590.57
 産 三、本期増減變動 額(減少以"-"號填列) (一)、綜合收益總額 (二)、本期基金份額交易産生的淨資產變動數(淨資產變動數(淨資產減少以"-"號填列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 ②、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產減少 (三)、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產減少 	二、本期期初淨資	527 111 410 12	1 421 015 100 44	1.060.006.500.57
額(減少以"-"號填列) (一)、綜合收益總額 - 37,969,452.88 (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) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	產	537,111,410.13	1,431,915,180.44	1,969,026,390.37
列) (一)、綜合收益 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 109,862,573.40 275,538,034.65 385,400,608.05 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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 - - -	三、本期增減變動			
(一)、綜合收益 總額 - 37,969,452.88 37,969,452.88 (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) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	額(減少以"-"號填	109,862,573.40	313,507,487.53	423,370,060.93
總額 (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) 其中:1.基金申購款	列)			
(二)、本期基金 份額交易産生的淨 資産變動數(淨資 産減少以"-"號填 列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基 金份額持有人分配 利潤産生的淨資產 變動(淨資產減少	(一)、綜合收益		27.060.452.00	27.060.452.00
(分額交易産生的淨 資産變動數(淨資 産減少以"-"號填 列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (三)、本期向基 金份額持有人分配 利潤産生的淨資産 變動(淨資産減少	總額	-	37,969,452.88	37,969,452.88
資產變動數 (淨資	(二)、本期基金			
產減少以"-"號填 列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	份額交易產生的淨			
列) 其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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 - - -	資產變動數(淨資	109,862,573.40	275,538,034.65	385,400,608.05
其中:1.基金申購款 180,554,614.24 466,163,643.66 646,718,257.90 2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	產減少以"-"號填			
2.基金贖回 款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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	列)			
款 -70,692,040.84 -190,625,609.01 -261,317,649.85 (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 -<	其中:1.基金申購款	180,554,614.24	466,163,643.66	646,718,257.90
(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	2.基金贖回	70 (02 040 04	100 (05 (00 01	261 217 640 05
金份額持有人分配 利潤產生的淨資產	款	-70,692,040.84	-190,625,609.01	-261,317,649.85
利潤產生的淨資產	(三)、本期向基			
變動(淨資產減少	金份額持有人分配			
	利潤產生的淨資產	-	-	-
h two mile independents	變動(淨資產減少			
以"-"號填列)	以"-"號填列)			
四、本期期末淨資 646,973,983.53 1,745,422,667.97 2,392,396,651.50	四、本期期末淨資	646,973,983.53	1,745,422,667.97	2,392,396,651.50

產			
報表附注為財務報表的	 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(特殊普诵合夥)(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,《滙豐晉信大船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×90%+同業存款利率×10%。本財務報表由本基金的基金管理人滙豐晉信基金管理有限公司於2025年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《企業會計準則一基本準則》、各項具體會計準則、《資產管理產品相關會計處理規定》及其他相關規定(以下合稱"企業會計準則")、中國證監會頒佈的《證券投資基金信息披露XBRL模板第3號<年度報告和中期報告>》、中國證券投資基金業協會(以下簡稱"中國基金業協會")頒佈的《證券投資基金會計核算業務指引》、《滙豐晉信大盤股票型證券投資基金基金合同》和在財務報表附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2025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2025年06月30日的財務狀況以及2025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。

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。

第25頁,共67頁

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征增值稅試點的通知》、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。對資管產品在2018年1月1日前運營過程中發生的增值稅應稅行為,未繳納增值稅的,不再繳納;已繳納增值稅的,已納稅額從資管產品管理人以後月份的增值稅應納稅額中抵減。對證券投資基金管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免征增值稅,對國債、地方政府債以及金融同業往來利息收入亦免征增值稅。資管產品管理人運營資管產品提供的貸款服務,以2018年1月1日起產生的利息及利息性質的收入為銷售額。
- (2)對基金從證券市場中取得的收入,包括買賣股票、債券的差價收入,股票的股息、 紅利收入,債券的利息收入及其他收入,暫不徵收企業所得稅。
- (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%的稅率計征個人所得稅。對於香港市場投資者通過基金互認持有的基金類別,對基金取得的企業債券利息收入,應由發行債券的企業在向該內地基金分配利息時按照7%的稅率代扣代繳所得稅。對

基金從上市公司取得的股息紅利所得,應由內地上市公司向該內地基金分配股息紅利時按照10%的稅率代扣代繳所得稅。

- (4)基金賣出股票按0.1%的稅率繳納股票交易印花稅,買入股票不徵收股票交易印花稅。根據財政部、國家稅務總局公告2023年第39號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》,自2023年8月28日起,證券交易印花稅實施減半徵收。
- (5)本基金的城市維護建設稅、教育費附加和地方教育附加等稅費按照實際繳納增值 稅額的適用比例計算繳納。

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
垻日 	2025年06月30日
活期存款	220,952,866.52
等於:本金	220,933,467.97
加:應計利息	19,398.55
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	220,952,866.52

6.4.7.2 交易性金融資產

		本期末				
項目		2025年06月30日				
		成本	應計利息	公允價值	公允價值變動	
股票	<u> </u>	1,983,496,860.6	_	1,998,479,668.3	14,982,807.71	
ルメン	1	8		9	14,702,007.71	
貴金	金屬投資-金交					
所責	黄金合約	_	-	-	-	
焦	交易所市場	-	-	-	1	
債券	銀行間市場	-	-	-	1	
7),	合計	-	-	-	1	
資產	全支持證券	-	-	-	-	
基金	臣	-	-	-	-	
其他	也	-	-	-	-	
	合計	1,983,496,860.6 8	-	1,998,479,668.3 9	14,982,807.71	

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 2025年06月30日
應付券商交易單元保證金	-

第28頁,共67頁

應付贖回費	181,638.52
應付證券出借違約金	-
應付交易費用	515,036.11
其中:交易所市場	515,036.11
銀行間市場	-
應付利息	-
預提費用	224,138.35
其他應付	301.14
合計	921,114.12

6.4.7.7 實收基金

6.4.7.7.1 滙豐晉信大盤股票A

金額單位:人民幣元

項目	本期		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
(滙豐晉信大盤股票A)	基金份額(份)	賬面金額	
上年度末	536,688,229.58	536,688,229.58	
本期申購	51,596,550.23	51,596,550.23	
本期贖回(以"-"號填列)	-89,349,469.24	-89,349,469.24	
本期末	498,935,310.57	498,935,310.57	

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。

6.4.7.7.2 滙豐晉信大盤股票H

金額單位:人民幣元

項目	本期		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
(滙豐晉信大盤股票H)	基金份額(份)	賬面金額	
上年度末	45,183,877.64	18,452,854.87	
本期申購	-	-	
本期贖回(以"-"號填列)	-5,960,935.32	-2,434,402.25	
本期末	39,222,942.32	16,018,452.62	

6.4.7.7.3 滙豐晉信大盤股票C

金額單位:人民幣元

T苦口	本期		
項目	2025年01月01日至2025年06月30日		
(滙豐晉信大盤股票C)	基金份額(份)	賬面金額	
上年度末	16,895,296.51	16,899,897.23	
本期申購	14,590,950.72	14,594,952.56	
本期贖回(以"-"號填列)	-22,239,816.16	-22,245,900.89	
本期末	9,246,431.07	9,248,948.90	

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

6.4.7.8.1 滙豐晉信大盤股票A

單位:人民幣元

項目 (滙豐晉信大盤股票A)	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	1,749,536,363.54	-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
本期利潤	83,340,754.54	-10,621,938.97	72,718,815.57
本期基金份額交易產 生的變動數	-126,082,971.50	1,342,529.30	-124,740,442.20
其中:基金申購款	171,414,642.11	-9,923,646.77	161,490,995.34
基金贖回款	-297,497,613.61	11,266,176.07	-286,231,437.54
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	1,706,794,146.58	-124,517,416.13	1,582,276,730.45

6.4.7.8.2 滙豐晉信大盤股票H

單位:人民幣元

項目 (滙豐晉信大盤股票H)	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	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

第30頁,共67頁

本期利潤	2,685,237.04	-345,543.64	2,339,693.40
本期基金份額交易產 生的變動數	-8,013,167.97	307,693.70	-7,705,474.27
其中:基金申購款	1	1	1
基金贖回款	-8,013,167.97	307,693.70	-7,705,474.27
本期已分配利潤	-	-	1
本期末	54,228,838.03	-3,953,864.88	50,274,973.15

6.4.7.8.3 滙豐晉信大盤股票C

單位:人民幣元

項目 (滙豐晉信大盤股票C)	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	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
本期利潤	2,276,245.11	-3,722,874.06	-1,446,628.95
本期基金份額交易產 生的變動數	-25,661,285.71	5,050,705.62	-20,610,580.09
其中:基金申購款	48,158,777.87	-760,924.82	47,397,853.05
基金贖回款	-73,820,063.58	5,811,630.44	-68,008,433.14
本期已分配利潤	1	1	1
本期末	31,373,998.23	-2,311,324.74	29,062,673.49

6.4.7.9 存款利息收入

TZ 口	本期	
順 目	2025年01月01日至2025年06月30日	
活期存款利息收入	347,056.00	
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	2,872.99	
其他	1,309.59	
合計	351,238.58	

第31頁,共67頁

6.4.7.10 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位:人民幣元

百日	本期		
項目	2025年01月01日至2025年06月30日		
賣出股票成交總額	1,356,856,763.75		
減:賣出股票成本總額	1,270,140,277.84		
減:交易費用	1,932,555.48		
買賣股票差價收入	84,783,930.43		

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

項目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
債券投資收益——利息收入	1,496.46	
債券投資收益——買賣債券(債轉股 及債券到期兌付)差價收入	330,862.84	
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	332,359.30	

6.4.7.11.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

項目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
賣出債券(債轉股 及債券到期兌付) 成交總額	25,749,035.20
減:賣出債券(債 轉股及債券到期兌 付)成本總額	24,963,461.56

減:應計利息總額	454,626.28
減:交易費用	84.52
買賣債券差價收入	330,862.84

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。

- 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

項目	本期	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
股票投資產生的股利收益	20,542,545.00	
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	20,542,545.00	

6.4.7.16 公允價值變動收益

單位:人民幣元

百日夕紐	本期
項目名稱	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融資產	-14,690,356.67
——股票投資	-14,690,356.67
——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	-14,690,356.67

6.4.7.17 其他收入

單位:人民幣元

項目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
基金贖回費收入	426,282.95	
基金轉換費收入	59,873.19	

第34頁,共67頁

合計	486,156.14
----	------------

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

TZ 口	本期
項目	2025年01月01日至2025年06月30日
審計費用	44,630.98
信息披露費	59,507.37
證券出借違約金	1
匯劃手續費	310.00
賬戶維護費	18,600.00
合計	123,048.35

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 關聯方關係

第35頁,共67頁

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	
交通銀行股份有限公司("交通銀行")	基金託管人、基金銷售機構	
山西證券股份有限公司("山西證券")	見注釋①	
滙豐前海證券有限責任公司("滙豐前海")	見注釋②	

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

②滙豐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

	本期		上年度可比期間	
關聯方名 稱	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金額	占當期		占當期
		股票成	成交金額	股票成
		交總額		交總額
		的比例		的比例
滙豐前海	117,091,162.00	4.67%	144,577,753.89	2.63%
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

	本期						
	2025年01月01日至2025年06月30日						
關聯方名 稱	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%			
		上年度	可比期間				
	2024年01月01日至2024年06月30日						
關聯方名 稱	當期傭金	占當期 傭金總 量的比 例	期末應付傭金餘額	占期末應 付傭金總 額的比例			
滙豐前海	136,757.50	2.67%	136,757.50	6.68%			
山西證券	-	-	-	-			

注:

- 1. 上述傭金參考市場價格經本基金的基金管理人與對方協商確定,以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取的證管費和經手費的淨額列示。
- 2. 該類傭金協議的服務範圍還包括傭金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場信息服務等。根據中國證監會公告[2024]3號《公開募集證券投資基金證券交易費用管理規定》,自2024年7月1日起,針對被動股票型基金,不再通過交易傭金支付研究服務、流動性服務等其他費用,針對其他類型基金可以通過交易傭金支付研究服務費用,但不再通過交易傭金支付研究服務之外的其他費用。

6.4.10.2 關聯方報酬

6.4.10.2.1 基金管理費

	本期	上年度可比期間
項目	2025年01月01日至20	2024年01月01日至20
	25年06月30日	24年06月30日
當期發生的基金應支付的管理費	15,375,009.21	17,663,305.14
其中:應支付銷售機構的客戶維護費	4,520,102.36	5,578,526.14
應支付基金管理人的淨管理費	10,854,906.85	12,084,779.00

注:自2024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×1.50%/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×1.20%/當年天數。

6.4.10.2.2 基金託管費

單位:人民幣元

	本期	上年度可比期間
項目	2025年01月01日至2025	2024年01月01日至2024
	年06月30日	年06月30日
當期發生的基金應支付的託管費	2,562,501.46	2,943,884.18

注:自2024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:日托管費=前一日基金資產淨值×0.25%/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:日托管費=前一日基金資產淨值×0.20%/當年天數。

6.4.10.2.3 銷售服務費

獲得銷售	本期
服務費的	2025年01月01日至2025年06月30日
各關聯方	當期發生的基金應支付的銷售服務費

名稱	滙豐晉信大盤股票 A	滙豐晉信大盤股票 H	滙豐晉信大盤股票 C	合計		
交通銀行	0.00	0.00	16.64	16.64		
滙豐晉信	0.00	0.00	43,926.57	43,926.57		
合計	0.00	0.00	43,943.21	43,943.21		
獲得銷售 服務費的	2	上年度可比期間 2024年01月01日至2024年06月30日				
各關聯方	岩田	期發生的基金應支付	的銷售服務費			
名稱	滙豐晉信大盤股票 A	滙豐晉信大盤股票 H	滙豐晉信大盤股票 C	合計		
交通銀行	0.00	0.00	0.00	0.00		
滙豐晉信	0.00	0.00	164,936.07	164,936.0 7		
合計	0.00	0.00	164,936.07	164,936.0 7		

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

關聯方名 本期	上年度可比期間
---------	---------

稱	2025年01月01日至	至2025年06月30日	2024年01月01日至2024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	220,952,866.52	347,056.00	219,511,019.92	561,526.33	

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——固定淨值型貨幣市場基金之外的基金

無。

6.4.12 期末(2025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.	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
3014 58	鈞崴 電子	2025- 01-02	6 個 月	首次 公開 發行 限售	10.40	34.11	701	7,29 0.40	23,91 1.11	-

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

第40頁,共67頁

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。

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。

第41頁, 共67頁

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2025年6月30日,本基金無債券投資(2024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2025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2025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0.0011%。

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2025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。

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、存出保證金和債券投資等。

6.4.13.4.1.1 利率風險敞口

本期末 2025年0 6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	220,952,866.52	-	-	-	220,952,866.52
結算備 付金	1,489,190.87	-	-	-	1,489,190.87
存出保 證金	442,426.97	-	-	-	442,426.97
交易性 金融資産	-	1	1	1,998,479,668.39	1,998,479,668.39
應收清 算款	-	-	-	16,043,605.57	16,043,605.57
應收申 購款	-	-	-	161,814.87	161,814.87
資產總 計	222,884,484.36	-	1	2,014,685,088.83	2,237,569,573.19
負債					
應付贖 回款	-	-	-	48,272,789.29	48,272,789.29
應付管 理人報酬	-	-	-	2,180,821.92	2,180,821.92
應付託 管費	-	-	-	363,470.31	363,470.31
應付銷 售服務 費	-	-	-	13,761.02	13,761.02
應交稅 費	-	-	-	527.35	527.35
其他負 債	-	-	-	921,114.12	921,114.12
負債總計	-	-	-	51,752,484.01	51,752,484.01
利率敏 感度缺口	222,884,484.36	-	-	1,962,932,604.82	2,185,817,089.18
上年度末	1年以內	1-5年	5年以上	不計息	合計

第44頁,共67頁

2024年1					
2月31日					
次玄:					
資產					
貨幣資	189,086,933.51	-	-	-	189,086,933.51
金					
結算備	955,260.88	-	-	-	955,260.88
付金					
存出保	731,225.55	_	_	_	731,225.55
證金					731,223.33
交易性					
金融資	-	-	-	2,131,923,533.95	2,131,923,533.95
產					
應收申				395,751.17	205 751 17
購款	-	-	-	393,731.17	395,751.17
資產總	100 772 410 04			2 122 210 205 12	2 222 002 505 06
計	190,773,419.94	-	-	2,132,319,285.12	2,323,092,705.06
負債					
應付清					
算款	-	-	-	4,175,090.69	4,175,090.69
應付贖					
回款	-	-	-	1,298,914.07	1,298,914.07
應付管					
理人報	_	_	_	2,982,400.51	2,982,400.51
酬				2,5 02, 10 0.0 1	2,2 02, 100101
應付託					
管費	-	-	-	497,066.73	497,066.73
應付銷					
應內弱 售服務				23,801.98	23,801.98
費	-	_	-	23,001.98	23,001.98
其他負 債	-	-	-	1,015,455.77	1,015,455.77
負債總	-	-	-	9,992,729.75	9,992,729.75
計					
利率敏					
感度缺	190,773,419.94	-	-	2,122,326,555.37	2,313,099,975.31

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2025年6月30日,本基金未持有交易性債券投資(2024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(2024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,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(Value at Risk)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

	本期末		上年度末		
	2025年06月30日	\exists	2024年12月31日		
項目		占基金		占基金	
· K L	公允價值	資產淨	公允價值	資產淨	
	4. 人。	值比例		值比例	
		(%)		(%)	
交易性金融資	1,998,479,668.39	91.43	2,131,923,533.95	92.17	

第46頁, 共67頁

產-股票投資				
交易性金融資				
產-基金投資	1	1	1	1
交易性金融資				
產-債券投資	-	-	-	-
交易性金融資				
產-貴金屬投	-	-	-	-
資				
衍生金融資產				
-權證投資	1	1	1	1
其他	-	-	-	1
合計	1,998,479,668.39	91.43	2,131,923,533.95	92.17

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)			
	们例黑股爱里可爱到	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日		
	1.業績比較基準(附注6. 4.1)上升5%	111,298,761.23	131,236,719.94		
	2.業績比較基準(附注6. 4.1)下降5%	-111,298,761.23	-131,236,719.94		

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

第47頁, 共67頁

6.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位:人民幣元

八分便佐社是红田化属的豆为	本期末	上年度末
公允價值計量結果所屬的層次	2025年06月30日	2024年12月31日
第一層次	1,998,455,757.28	2,131,923,533.95
第二層次	-	-
第三層次	23,911.11	-
合計	1,998,479,668.39	2,131,923,533.95

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2025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(2024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

序號	項目	金額	占基金總資產的比 例(%)
			1列(%)

1	權益投資	1,998,479,668.39	89.31
	其中:股票	1,998,479,668.39	89.31
2	基金投資	1	1
3	固定收益投資	1	1
	其中:債券	1	1
	資產支持證券	1	1
4	貴金屬投資	1	-
5	金融衍生品投資	1	1
6	買入返售金融資產	1	1
	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	222,442,057.39	9.94
8	其他各項資產	16,647,847.41	0.74
9	合計	2,237,569,573.19	100.00

7.2 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

代碼	行業類別	公允價值(元)	占基金資產淨值比 例(%)
A	農、林、牧、漁業	-	-
В	採礦業	80,070,484.00	3.66
С	製造業	1,650,533,786.89	75.51
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	-	-
Е	建築業	-	-
F	批發和零售業	1	-
G	交通運輸、倉儲和郵政業	72,467,911.00	3.32
Н	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟體和信息技術服務業	-	-
J	金融業	111,988,389.50	5.12
K	房地產業	50,999,220.00	2.33
L	租賃和商務服務業	-	-
M	科學研究和技術服務業	32,419,877.00	1.48

N	水利、環境和公共設施管理業	-	-
О	居民服務、修理和其他服務業	-	1
P	教育	-	1
Q	衛生和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	-	1
S	綜合	-	-
	合計	1,998,479,668.39	91.43

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

				3227	<u>т., Усмира</u>
序號	股票代碼	股票名稱	數量(股)	公允價值(元)	占基金資 產淨值比 例(%)
1	601233	桐昆股份	15,068,573	159,726,873.80	7.31
2	601688	華泰證券	6,287,950	111,988,389.50	5.12
3	000807	雲鋁股份	6,366,397	101,735,024.06	4.65
4	002475	立訊精密	2,740,200	95,057,538.00	4.35
5	603816	顧家家居	3,579,100	91,338,632.00	4.18
6	000933	神火股份	5,346,100	88,959,104.00	4.07
7	000100	TCL科技	20,523,200	88,865,456.00	4.07
8	000725	京東方A	22,067,900	88,050,921.00	4.03
9	600309	萬華化學	1,582,038	85,841,381.88	3.93
10	603225	新鳳鳴	7,687,800	81,875,070.00	3.75
11	603993	洛陽鉬業	8,992,800	75,719,376.00	3.46
12	603035	常熟汽飾	5,462,495	72,651,183.50	3.32
13	000651	格力電器	1,517,300	68,157,116.00	3.12
14	000951	中國重汽	3,701,700	65,075,886.00	2.98
15	600782	新鋼股份	18,376,400	65,052,456.00	2.98
16	600031	三一重工	2,845,500	51,076,725.00	2.34
17	600048	保利發展	6,296,200	50,999,220.00	2.33
18	002078	太陽紙業	3,780,200	50,881,492.00	2.33

19	601111	中國國航	6,336,400	49,994,196.00	2.29
20	000589	貴州輪胎	10,655,000	48,693,350.00	2.23
21	601615	明陽智能	3,714,200	42,676,158.00	1.95
22	601717	中創智領	2,330,999	38,741,203.38	1.77
23	603599	廣信股份	3,569,040	38,081,656.80	1.74
24	000683	博源化工	7,489,000	35,872,310.00	1.64
25	000921	海信家電	1,393,200	35,805,240.00	1.64
26	300012	華測檢測	2,773,300	32,419,877.00	1.48
27	000338	濰柴動力	1,893,700	29,125,106.00	1.33
28	300373	揚傑科技	455,296	23,629,862.40	1.08
29	001301	尚太科技	470,200	22,926,952.00	1.05
30	688006	杭可科技	1,167,927	22,774,576.50	1.04
31	600233	圓通速遞	1,743,500	22,473,715.00	1.03
32	603558	健盛集團	2,399,298	21,857,604.78	1.00
33	000568	瀘州老窖	185,600	21,047,040.00	0.96
34	603801	志邦家居	1,541,172	14,933,956.68	0.68
35	002683	廣東宏大	128,200	4,351,108.00	0.20
36	301458	鈞崴電子	701	23,911.11	0.00

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

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	占期初基金 資產淨值比 例(%)
1	002475	立訊精密	91,534,277.00	3.96
2	000100	TCL科技	89,443,799.00	3.87
3	603993	洛陽鉬業	64,323,860.00	2.78
4	600309	萬華化學	62,150,504.00	2.69
5	000725	京東方A	61,072,806.00	2.64
6	000568	瀘州老窖	60,010,433.43	2.59

		1	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	r
7	603225	新鳳鳴	59,891,751.22	2.59
8	000683	博源化工	56,403,233.80	2.44
9	603883	老百姓	55,743,967.02	2.41
10	603816	顧家家居	50,131,165.20	2.17
11	600048	保利發展	48,055,823.00	2.08
12	600809	山西汾酒	44,342,372.00	1.92
13	300012	華測檢測	32,102,033.00	1.39
14	688006	杭可科技	25,295,098.94	1.09
15	000858	五糧液	24,050,253.00	1.04
16	001301	尚太科技	22,380,592.00	0.97
17	600233	圓通速遞	22,303,943.00	0.96
18	000933	神火股份	22,266,019.00	0.96
19	688016	心脈醫療	21,208,325.84	0.92
20	601111	中國國航	20,241,903.00	0.88

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

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	601166	興業銀行	112,097,153.00	4.85
2	600782	新鋼股份	82,793,967.00	3.58
3	000338	維柴動力	77,395,404.00	3.35
4	603883	老百姓	67,854,295.98	2.93
5	002727	一心堂	61,590,951.00	2.66
6	000807	雲鋁股份	59,458,451.00	2.57
7	601717	中創智領	58,771,589.55	2.54
8	600809	山西汾酒	49,672,048.00	2.15
9	600031	三一重工	42,227,022.00	1.83

10	000651	格力電器	38,575,692.00	1.67
11	603611	諾力股份	38,117,587.04	1.65
12	688059	華銳精密	35,017,141.10	1.51
13	000568	瀘州老窖	33,420,380.00	1.44
14	600426	華魯恒升	29,621,744.28	1.28
15	603056	德邦股份	28,724,749.00	1.24
16	300373	揚傑科技	26,197,557.90	1.13
17	600989	寶豐能源	25,905,458.00	1.12
18	000001	平安銀行	25,234,139.00	1.09
19	002299	聖農發展	24,105,561.00	1.04
20	600309	萬華化學	24,090,114.40	1.04

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	1,151,386,768.95
賣出股票收入(成交)總額	1,356,856,763.75

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
- 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 本報告期末,本基金投資的前十名證券的發行主體除華泰證券股份有限公司(代碼:601688)(以下簡稱"華泰證券")外,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。

本基金持有的"華泰證券(代碼:601688)"的發行主體華泰證券股份有限公司,因部分自營業務合規風控把關不到位、對部分客戶適當性管理及督促義務履行不到位、從業人員資質管理不到位以及跟投業務內部控制不完善,2024年4月19日,中國證券監督管理委員會江蘇監管局對華泰證券採取責令改正的監管措施。

截至目前,本基金對華泰證券股份有限公司的投資決策流程符合本公司規定,本基金管理人會緊密跟蹤並及時採取相應投資決策。

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

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	442,426.97
2	應收清算款	16,043,605.57
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	161,814.87

第54頁, 共67頁

6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	16,647,847.41

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况的說明

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。

7.13 投資組合報告(供香港投資人參閱)

投資組合			
於 2025/06/30			
	<i>滙豐晉</i>	信大盤股票型證券投資	基金
	持有數量	市值(人民幣)	市值占淨值%
股票投資			
上市股票			
A股 中華人民共和國			
桐昆股份	15,068,573	159,726,873.80	7.31
華泰證券	6,287,950	111,988,389.50	5.12
雲鋁股份	6,366,397	101,735,024.06	4.65
立訊精密	2,740,200	95,057,538.00	4.35
顧家家居	3,579,100	91,338,632.00	4.18
神火股份	5,346,100	88,959,104.00	4.07
TCL科技	20,523,200	88,865,456.00	4.07
京東方A	22,067,900	88,050,921.00	4.03
萬華化學	1,582,038	85,841,381.88	3.93
新鳳鳴	7,687,800	81,875,070.00	3.75
洛陽鉬業	8,992,800	75,719,376.00	3.46
常熟汽飾	5,462,495	72,651,183.50	3.32
格力電器	1,517,300	68,157,116.00	3.12
中國重汽	3,701,700	65,075,886.00	2.98
新鋼股份	18,376,400	65,052,456.00	2.98

第55頁,共67頁

三一重工	2,845,500	51,076,725.00	2.34
保利發展	6,296,200	50,999,220.00	2.33
太陽紙業	3,780,200	50,881,492.00	2.33
中國國航	6,336,400	49,994,196.00	2.29
貴州輪胎	10,655,000	48,693,350.00	2.23
明陽智能	3,714,200	42,676,158.00	1.95
中創智領	2,330,999	38,741,203.38	1.77
廣信股份	3,569,040	38,081,656.80	1.74
博源化工	7,489,000	35,872,310.00	1.64
海信家電	1,393,200	35,805,240.00	1.64
華測檢測	2,773,300	32,419,877.00	1.48
維柴動力	1,893,700	29,125,106.00	1.33
揚傑科技	455,296	23,629,862.40	1.08
尚太科技	470,200	22,926,952.00	1.05
杭可科技	1,167,927	22,774,576.50	1.04
圓通速遞	1,743,500	22,473,715.00	1.03
健盛集團	2,399,298	21,857,604.78	1.00
瀘州老窖	185,600	21,047,040.00	0.96
志邦家居	1,541,172	14,933,956.68	0.68
廣東宏大	128,200	4,351,108.00	0.20
鈞崴電子	701	23,911.11	0.00
投資總計			
投資總成本:1,983,496,			
860.68人民幣元		<u>1,998,479,668.39</u>	91.43
600.00人区带儿			
其他淨資產		187,337,420.79	8.57
基金資產淨值		2,185,817,089.18	100.00

投資組合變動表		
		市值占淨值%
	2025/06/30	2024/06/30
股票	<u>91.43</u>	<u>90.70</u>
投資總計	<u>91.43</u>	<u>90.70</u>
其他淨資產	<u>8.57</u>	<u>9.30</u>
市值占淨值%	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

§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

	持		持有人結構			
	有		機構投資者		個人投資者	
級別	人戶數戶	戶均持有的 基金份額	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	37, 425	13,331.60	252,256,243.74	50.5 6%	246,679,066.83	49.44%
滙豐 晉信 大盤 股票H	5	7,844,588.46	39,222,942.32	100.0	0.00	0.00%
滙豐 晉信 大盤 股票C	856	10,801.91	7,737,097.42	83.6 8%	1,509,333.65	16.32%
合計	38, 286	14,297.78	299,216,283.48	54.6 6%	248,188,400.48	45.34%

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 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

T石口	//\Seath Lil	持有份額總數	占基金總份額比
惧日 	份額級別	(份)	例

	滙豐晉信大盤 股票A	390,974.85	0.0784%
基金管理人所有從業人員持有本基金	滙豐晉信大盤 股票H	0.00	0.0000%
月	滙豐晉信大盤 股票C	0.00	0.0000%
	合計	390,974.85	0.0714%

8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

項目	份額級別	持有基金份額總量的數量區 間(萬份)
	滙豐晉信大盤股票 A	0
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	滙豐晉信大盤股票 H	0
基金	滙豐晉信大盤股票 C	0
	合計	0
	滙豐晉信大盤股票 A	10~50
本基金基金經理持有本開放式基	滙豐晉信大盤股票 H	0
金	滙豐晉信大盤股票 C	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	滙豐晉信大盤股票	滙豐晉信大盤股票
	A	Н	С
基金合同生效日(2			
009年06月24日)基	2,885,554,241.41	-	-
金份額總額			

第58頁,共67頁

本報告期期初基金 份額總額	536,688,229.58	45,183,877.64	16,895,296.51
本報告期基金總申 購份額	51,596,550.23	1	14,590,950.72
減:本報告期基金 總贖回份額	89,349,469.24	5,960,935.32	22,239,816.16
本報告期基金拆分 變動份額	-	-	-
本報告期期末基金 份額總額	498,935,310.57	39,222,942.32	9,246,431.07

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

2025年1月25日,基金管理人發佈公告,自2025年1月24日起,張毅傑先生不再擔任公司副總經理。

本報告期內,本公司高級管理人員未發生不能正常履行職責的情況。

本報告期內基金託管人的專門基金託管部門無重大人事變動。

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。

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。

第59頁,共67頁

10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

10.6.1 管理人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內,基金管理人及其高級管理人員未有受監管部門稽查或處罰的情形發生。

10.6.2 託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員未受到任何稽查或處罰。

10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

10.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及傭金支付情況

	交	股票交易		應支付該券商的伽	東 金	
券商 名稱	易單元數量	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	備註
川財 證券	1	-	-	-	-	-
東方證券	1	-	-	-	-	-
光大 證券	1	-	-	-	-	-
國金 證券	1	28,551,169.60	1.14%	12,445.23	1.14%	-
華創 證券	1	380,735,033.31	15.18%	165,964.40	15.18%	-
平安 證券	1	-	-	-	-	-
山西 證券	1	37,206,482.00	1.48%	16,219.57	1.48%	-
申萬	1	-	-	-	-	-

宏源						
西南證券	1	-	-	-	-	-
興業證券	1	-	-	-	-	-
銀河證券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中銀國際	1	-	-	-	-	-
財通 證券	2	-	-	-	-	-
長江證券	2	193,128,054.90	7.70%	84,183.24	7.70%	-
德邦 證券	2	-	-	-	-	-
東方財富	2	103,532,655.81	4.13%	45,133.40	4.13%	-
東吳 證券	2	-	1	-	-	-
方正 證券	2	-	-	-	-	-
國海 證券	2	100,763,637.41	4.02%	43,923.73	4.02%	-
國盛 證券	2	256,152,594.76	10.21%	111,653.88	10.21%	-
國泰 海通	4	-	-	-	-	-
國投 證券	2	-	-	-	-	-
華安	2	-	-	-	-	-

證券						
華福證券	2	877,626,594.88	34.99%	382,565.76	34.99%	-
華泰 證券	2	-	-	-	-	-
華西證券	2	-	-	-	-	-
滙豐 前海	2	117,091,162.00	4.67%	51,039.29	4.67%	1
開源 證券	2	-	1	1	-	-
國聯 民生 證券	4	171,353,131.81	6.83%	74,690.06	6.83%	-
太平 洋證 券	2	1	-1	1	-	1
天風 證券	2	-	-	-	-	-
西部 證券	2	172,995,245.63	6.90%	75,408.83	6.90%	-
信達 證券	2	-	-	-	-	-
野村東方	2	-	-	-	-	-
招商 證券	2	-	-	-	-	-
浙商 證券	2	69,034,918.59	2.75%	30,098.34	2.75%	-
中金公司	2	-	1	1	-	-
中泰	2	-	-	-	-	-

證券						
中信證券	2	-	1	1	1	ı
東興證券	3	-	-	-	-	-
廣發 證券	3	-	-	1	-	-

注:

- 1、報告期內退租川財證券交易單元
- 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、個股份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。
- (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

	債券ろ	交易	債券回	購交易	權證交易基金交易			交易
券商名稱	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
川財證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東方證券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國金證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華創證券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安證券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西證券	-	-	-	-	-	-	-	-

第63頁,共67頁

西南超拳	F . 164-13	<u> </u>	1					1	1
 興業證券 自用のでは、 日本のでは、 日本のでは	申萬宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
銀河證券		-	-	-	-	-	-	-	-
中福建模		-	-	-	-	-	-	-	-
中戦		-	-	-	-	-	-	-	-
財通證券	中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
長江寇券	中銀國際	-	-	-	-	-	-	-	-
使邦證券	財通證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東方財富 2,112,668.0 8.36%	長江證券	-	-	-	-	-	-	-	-
東吳證券	德邦證券	-	1	1	ı	1	1	-	-
万正證券	東方財富		8.36%	1	1	1	1	1	1
國海證券	東吳證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國家海通 - <td>方正證券</td> <td>_</td> <td></td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>	方正證券	_		-	-	-	-	-	-
國教海通	國海證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國权證券 - <td>國盛證券</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>	國盛證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華安證券 - <td>國泰海通</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>	國泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
華福證券 - <td>國投證券</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>	國投證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華 茂	華安證券	-	-	-	-	-	-	-	-
華西證券	華福證券	-	-	-	-	-	-	-	-
 滙豐前海 一	華泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
開源證券 - - - - - - 國聯民生證券 23,172,461. 56 91.64% - - - - - - 太平洋證券 - - - - - - - - 天風證券 - - - - - - - - 西部證券 - - - - - - - - 野村東方 - - - - - - - - 招商證券 - - - - - - - - 中金公司 - - - - - - - - 中信證券 - - - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - - - -	華西證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國聯民生證券 23,172,461. 56 91.64% - <td>滙豐前海</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td>	滙豐前海	-	-	-	-	-	-	-	-
券 56 91.64% - <	開源證券	-	-	-	-	-	-	-	-
天風證券 - - - - - - 西部證券 - - - - - - 信達證券 - - - - - - 野村東方 - - - - - - - 招商證券 - - - - - - - - 財商證券 - - - - - - - - 中泰證券 - - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - - -			91.64%	-	-	-	-	-	-
西部證券	太平洋證券	-	-	-	-	-	-	-	-
信達證券	天風證券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村東方 -	西部證券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商證券 -	信達證券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商證券 - - - - - - 中金公司 - - - - - - 中泰證券 - - - - - - - 中信證券 - - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - - -	野村東方	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司 - - - - - - 中泰證券 - - - - - - - 中信證券 - - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - -	招商證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰證券 - - - - - - 中信證券 - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - -	浙商證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信證券 - - - - - - - - 東興證券 - - - - - - - - - - -	中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
東興證券	中泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
	中信證券	-	-	-	-	-	-	-	-
廣發證券	東興證券	-	-	-	-	-	-	-	-
	廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-

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 關於新增寧波銀行為旗下部 分開放式基金代銷機構的公 告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-01-21
2	滙豐晉信基金管理有限公司 旗下部分基金2024年第四季 度報告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-01-22
3	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	2025-01-25
4	滙豐晉信基金管理有限公司 關於調整旗下開放式基金在 中歐財富的交易限額的公告	本基金指定報刊、指定互聯 網網站	2025-02-07
5	滙豐晉信基金管理有限公司 關於新增泰信財富為滙豐晉 信大盤股票型證券投資基金 C類份額代銷機構的公告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-03-06
6	滙豐晉信基金管理有限公司 旗下公募基金通過證券公司 交易及傭金支付情況(2024 年度)	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-03-31
7	滙豐晉信基金管理有限公司 旗下部分基金2024年年度報 告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-03-31
8	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金基金合同	本基金指定報刊、指定互聯 網網站	2025-03-31
9	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金託管協議	本基金指定報刊、指定互聯 網網站	2025-03-31
10	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金更新招募說明書(202 5年第1號)	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-04-01
11	滙豐晉信大盤股票型證券投	本基金指定報刊、指定互聯	2025-04-01

	資基金基金產品資料概要更 新A類份額	網網站	
12	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金基金產品資料概要更 新C類份額	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-04-01
13	滙豐晉信基金管理有限公司 旗下部分基金2025年第1季 度報告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-04-22
14	滙豐晉信基金管理有限公司 關於新增招商銀行為旗下部 分開放式基金代銷機構的公 告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-05-08
15	滙豐晉信基金管理有限公司 關於新增聯泰基金為旗下部 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	2025-05-20
16	滙豐晉信基金管理有限公司 關於新增創金啟富為旗下部 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	2025-06-06
17	滙豐晉信基金管理有限公司 關於提醒投資者防範金融詐 騙的公告	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-06-24
18	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金更新招募說明書(202 5年第2號)	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-06-30
19	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金基金產品資料概要更 新A類份額	本基金指定報刊、指定互聯網網站	2025-06-30
20	滙豐晉信大盤股票型證券投 資基金基金產品資料概要更 新C類份額	本基金指定報刊、指定互聯 網網站	2025-06-30

§11 影響投資者決策的其他重要信息

第66頁,共67頁

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二〇二五年八月二十九日