

# 汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	43
§9 开放式基金份额变动 .....	44
§10 重大事件揭示 .....	44
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
§12 备查文件目录 .....	47
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信惠安纯债63个月定开债券
基金主代码	009748
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年10月29日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,000,060,654.98份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求为投资者获取稳健的收益。</p>
投资策略	<p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略 在封闭期内，本基金采用买入并持有策略构建投资组合，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下，本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于基金份额持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>（二）开放期投资策略 开放期内，基金规模将随</p>

	着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周慧	朱萍
	联系电话	021-20376868	021-31888888
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-20376888	95528
传真		021-20376999	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	上海市中山东一路12号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		杨小勇	张为忠

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn

基金中期报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼；上海浦东发展银行股份有限公司：上海市博成路1388号浦银中心A栋。
------------	---

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	76,793,645.09
本期利润	76,793,645.09
加权平均基金份额本期利润	0.0192
本期加权平均净值利润率	1.86%
本期基金份额净值增长率	1.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	100,401,568.82
期末可供分配基金份额利润	0.0251
期末基金资产净值	4,100,462,223.80
期末基金份额净值	1.0251
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	14.29%

注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期

公允价值变动收益；由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.31%	0.01%	0.31%	0.01%	0.00%	0.00%
过去三个月	0.95%	0.01%	0.93%	0.01%	0.02%	0.00%
过去六个月	1.88%	0.01%	1.87%	0.01%	0.01%	0.00%
过去一年	3.75%	0.01%	3.76%	0.01%	-0.01%	0.00%
过去三年	11.71%	0.01%	11.26%	0.01%	0.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.29%	0.01%	13.78%	0.01%	0.51%	0.00%

注：

过去一个月指2024年6月1日-2024年6月30日

过去三个月指2024年4月1日-2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日-2024年6月30日

过去一年指2023年7月1日-2024年6月30日

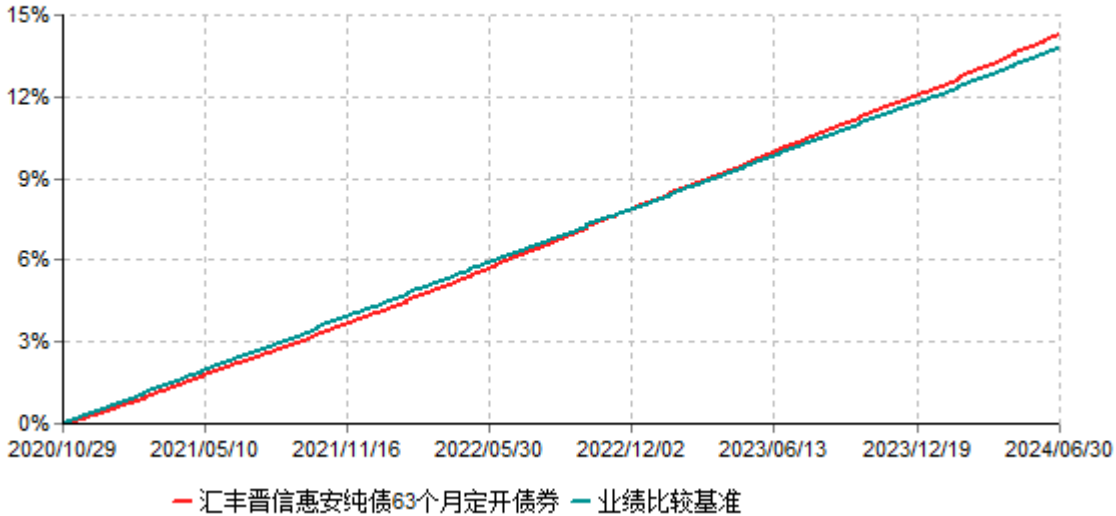
过去三年指2021年7月1日-2024年6月30日

自基金合同生效起至今指2020年10月29日-2024年6月30日

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



汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年10月29日-2024年06月30日)



注：

- 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。本基金在开放期内持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制。
- 按照基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月或每个封闭期开始后3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止2021年4月29日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
- 报告期内本基金的业绩比较基准 = 封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2024年6月30日，公司共管理38只开放式基金：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金（2006年5月23日成立）、汇丰晋信

龙腾混合型证券投资基金（2006年9月27日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007年4月9日成立）、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金（2008年7月23日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自2020年11月19日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009年6月24日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009年12月11日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010年6月8日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010年12月8日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011年7月27日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011年11月2日成立）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（2012年8月1日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014年11月26日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015年2月11日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015年9月30日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016年3月11日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016年11月10日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017年6月2日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018年11月14日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019年3月20日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金(2019年8月2日成立)、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020年7月30日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020年8月13日成立）、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金（2020年10月29日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021年3月16日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021年5月24日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021年7月12日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022年1月21日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022年3月3日成立）、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金（2022年6月8日成立）、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金（2022年8月16日成立）、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金（2022年9月14日成立）、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金（2022年9月27日成立）、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金（2022年12月20日成立）、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金（2023年1月17日成立）、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（2023年12月12日成立）、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金（2024年4月16日成立）和汇丰晋信养老目标日期2036一年持有期混合型基金中基金(FOF)（2024年6月12日成立）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
傅煜清	汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金以及汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理	2022-10-20	-	7.5	傅煜清女士，硕士研究生。曾任上海国际货币经纪有限责任公司债券经纪人，加拿大皇家银行信用分析员，汇丰晋信基金管理有限公司信用分析员、基金经理助理。现任汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金以及汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。
蔡若林	公募固收投资副总监、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧	2020-10-29	-	13	蔡若林先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理策略分析师、助理研究员、固定收益信用分析师、汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。现任公募固收投资副总监、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信

	嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金基金经理				丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
闫滢	汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理	2023-12-23	-	11	闫滢女士，硕士研究生。曾任易方达基金管理有限公司信用研究员、富国基金管理有限公司基金经理助理、万家基金管理有限公司基金经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司基金经理助理。

- 注：1.蔡若林先生任职日期为本基金基金合同生效日的日期；  
 2.傅煜清女士任职日期为本基金管理人公告傅煜清女士担任本基金基金经理的日期；  
 3.闫滢女士任职日期为本基金管理人公告闫滢女士担任本基金基金经理助理的日期；  
 4.2024年8月24日，基金管理人发布公告，蔡若林先生不再担任本基金基金经理；  
 5.证券从业年限是证券投资相关的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，中国经济逐步复苏，在复杂多变的国际环境和国内改革发展任务中稳步前行。面对全球经济复苏的不确定性，政府出台了一系列宏观调控措施，推动经济高质量发展。国内生产总值保持了稳定增长，消费服务底部企稳，出口较为强劲，投资也展现出较强的韧性。

总量方面，2024年上半年国内生产总值同比增长5.0%，第二季度GDP同比增长4.7%，较一季度同比增速回落0.6个百分点。结构方面，我国经济高质量发展持续推进，新质生产力发展取得积极成效。具体来看，生产方面，全国规模以上工业增加值同比稳定增长，虽然6月单月有所回落，但是仍然高于市场预期，上半年工业企业利润同比增长3.5%，企业盈利有所改善。消费方面，1-6月社消总额同比增长3.7%，6月单月同比增长2%，低于市场预期。这主要受价格促销影响，但随着促销效应的逐步消退，社消增速有望逐步企稳回升。信贷增长方面，上半年社融增速有所放缓，从年初同比增速9.5%逐步下降到8.1%，信贷增长较弱不排除有央行对于资金空转监管的影响。通胀方面，PPI总体下降

幅度收窄，价格逐步温和修复，但是未来PPI环比增长仍有赖于需求的持续恢复。CPI总体平稳，但是今年以来核心CPI持续偏弱。财政方面，2024年上半年财政支出增速较缓，主要受到税收和卖地收入的拖累，尤其是增值税和企业所得税。从结构上看，地方财政面临较大压力，公共财政支出累计同比2%，但是政府性基金支出累计同比下滑17.6%。在基建方面，尽管一般公共预算对基建的支持保持韧性，但受制于卖地收入和发债进度，实物工作量相关指标表现偏弱。下半年地方政府债发行大概率提速，财政对于经济的支持力度有望加强。

货币市场方面，今年上半年资金利率水平平稳下行，银行间流动性较为充裕，二季度之后资金供给结构上有所变化，非银资金供给边际增多，总体呈现量多价稳的态势。三季度来看，货币政策仍将保持稳健，为完成全年经济增长目标提供支持。对于债券投资者来说，今年年初以来债券市场整体收益率下行较快，具体来看，上半年中债新综合全价指数上涨2.42%，中债信用债指数上涨1.49%，中债金融债指数上涨1.4%，中债国债指数上涨3.02%。

基金操作上，主要运用久期和杠杆策略，维持基金杠杆为主要目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金单位净值增长率为1.88%，同期业绩比较基准为1.87%，净值表现领先业绩比较基准0.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月结束的政治局会议继续强调“坚定不移完成全年经济社会发展目标任务”。从上半年的情况来看，尽管存在一些困难和挑战，如有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱以及风险隐患较多，但经济回升向好、长期向好的基本趋势没有改变。在高质量发展的过程中，下半年逆周期调控力度可能加大，同时积极的财政政策和稳健的货币政策都将对经济发展起到支撑作用。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引，结合本基金基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司特设估值委员会作为公司基金估值的主要决策机关。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规以及基金估值运作等方面的专业胜任能力，估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。基

金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的证券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金于2024年06月19日实施分红，根据基金相关法律法规和基金合同的要求，每10份基金份额派发现金红利0.150元，其中现金形式的分红金额为60,000,688.38元，红利再投资形式的分红金额为218.24元，利润分配共计60,000,906.62元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇丰晋信基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	398,728.61	569,554.56
结算备付金		15,219,355.97	11,443,930.40
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	6,427,666,681.96	6,366,270,074.54
其中：债券投资		6,427,666,681.96	6,366,270,074.54
资产支持证券 投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-



其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,443,284,766.54	6,378,283,559.50
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		2024年06月30日	2023年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,342,001,228.19	2,293,706,754.41
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		508,025.34	522,923.14
应付托管费		169,341.78	174,307.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	143,947.43	210,307.15
负债合计		2,342,822,542.74	2,294,614,292.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	4,000,060,654.98	4,000,060,441.90
未分配利润	6.4.7.9	100,401,568.82	83,608,825.19
净资产合计		4,100,462,223.80	4,083,669,267.09
负债和净资产总计		6,443,284,766.54	6,378,283,559.50

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额4,000,060,654.98份，基金份额净值1.0251元。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		104,601,373.96	104,191,595.34
1.利息收入		104,601,373.96	104,191,595.34
其中：存款利息收入	6.4.7.10	107,546.54	127,986.49
债券利息收入		104,493,827.42	104,063,608.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		27,807,728.87	30,172,071.89
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,071,492.93	3,039,712.72

2.托管费	6.4.10.2.2	1,023,830.93	1,013,237.58
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		23,621,890.71	26,028,993.65
其中：卖出回购金融资产支出		23,621,890.71	26,028,993.65
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	90,514.30	90,127.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,793,645.09	74,019,523.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76,793,645.09	74,019,523.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		76,793,645.09	74,019,523.45

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,000,060,441.90	83,608,825.19	4,083,669,267.09
二、本期期初净资产	4,000,060,441.90	83,608,825.19	4,083,669,267.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	213.08	16,792,743.63	16,792,956.71

(一)、综合收益总额	-	76,793,645.09	76,793,645.09
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	213.08	5.16	218.24
其中: 1.基金申购款	213.08	5.16	218.24
2.基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-60,000,906.62	-60,000,906.62
四、本期期末净资产	4,000,060,654.98	100,401,568.82	4,100,462,223.80
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,000,060,005.19	63,164,943.00	4,063,224,948.19
二、本期期初净资产	4,000,060,005.19	63,164,943.00	4,063,224,948.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	216.47	10,018,566.49	10,018,782.96
(一)、综合收益总额	-	74,019,523.45	74,019,523.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	216.47	3.07	219.54

列)			
其中：1.基金申购款	216.47	3.07	219.54
2.基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-64,000,960.03	-64,000,960.03
四、本期期末净资产	4,000,060,221.66	73,183,509.49	4,073,243,731.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

李选进

苑忠磊

杨洋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2020]第986号《关于准予汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,000,059,450.92元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0923号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2020年10月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,000,059,482.79份基金份额，其中认购资金利息折合31.87份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起 63 个日历月的期间。

本基金第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日（含），结束之日为基金合同生效日所对应的第 63 个日历月的月度对日的前一日（含）。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日（含），结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第 63 个日历月的月度对日的前一日（含），依此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券(国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资股票，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。本基金在开放期内持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率(税后)+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2024年8月30日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	398,728.61
等于：本金	398,691.79
加：应计利息	36.82
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	398,728.61

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

无。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。



**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	1,223,506,000.00	-1,308,591.63	22,004,098.88	-	1,244,201,507.25
	银行间市场	5,060,000,000.00	5,364,562.70	118,100,612.01	-	5,183,465,174.71
	小计	6,283,506,000.00	4,055,971.07	140,104,710.89	-	6,427,666,681.96
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		6,283,506,000.00	4,055,971.07	140,104,710.89	-	6,427,666,681.96

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	59,884.31
其中：交易所市场	-
银行间市场	59,884.31
应付利息	-
预提费用	84,063.12
合计	143,947.43

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,000,060,441.90	4,000,060,441.90
本期申购	213.08	213.08
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,000,060,654.98	4,000,060,654.98

注：申购含红利再投份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,608,825.19	-	83,608,825.19
本期期初	83,608,825.19	-	83,608,825.19
本期利润	76,793,645.09	-	76,793,645.09
本期基金份额交易产生的变动数	5.16	-	5.16
其中：基金申购款	5.16	-	5.16
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-60,000,906.62	-	-60,000,906.62

本期末	100,401,568.82	-	100,401,568.82
-----	----------------	---	----------------

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,833.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	104,712.91
其他	-
合计	107,546.54

**6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入**

无。

**6.4.7.12 债券投资收益**

**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

**6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.18 其他收入**

无。

**6.4.7.19 信用减值损失**

无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,951.18
银行间债券账户维护费	9,000.00
合计	90,514.30

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司("汇丰晋信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司("浦发银行")	基金托管人
汇丰银行(中国)有限公司("汇丰银行")	见注释①

注：①汇丰银行与本基金管理人的股东-汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,071,492.93	3,039,712.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	25.29	23.86
应支付基金管理人的净管理费	3,071,467.64	3,039,688.86

注：支付基金管理人汇丰晋信的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$ 。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,023,830.93	1,013,237.58

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
汇丰银行	-	-	-	-	200,000,000.00	10,191.78
浦发银行	-	-	-	-	924,000,000.00	44,742.19
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
汇丰银行	-	-	-	-	1,603,600,000.00	1,229,984.66
浦发银行	-	-	-	-	31,919,100,000.00	1,867,166.13

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	398,728.61	2,833.63	83,380.56	2,067.86

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024-06-19	2024-06-19	0.150	60,000,688.38	218.24	60,000,906.62	-
合计			0.150	60,000,688.38	218.24	60,000,906.62	-

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,593,583,592.23元，是以如下债券作为质押：



金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200315	20进出15	2024-07-02	102.43	5,105,000	522,889,519.33
200315	20进出15	2024-07-01	102.43	11,562,000	1,184,260,259.06
合计				16,667,000	1,707,149,778.39

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额748,417,635.96元，于2024年7月11日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浦发银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	2,439,819.48
合计	-	2,439,819.48

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	6,427,666,681.96	6,363,830,255.06
合计	6,427,666,681.96	6,363,830,255.06

注：1.未评级债券为政策性金融债。

2.于2024年6月30日，本基金持有的按长期信用评级列示的债券投资均处于减值第一阶段。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

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

于2024年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有2,342,001,228.19元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年06月30日，本基金无流动性受限资产。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，因此固定利率类金融工具的利率变动对本基金的基金资产净值无重大影响，浮动利率类金融工具使本基金面临现金流量利率风险。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
----------------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

资产							
货币资金	398,728.61	-	-	-	-	-	398,728.61
结算备付金	15,219,355.97	-	-	-	-	-	15,219,355.97
债权投资	-	-	-	6,427,666,681.96	-	-	6,427,666,681.96
资产总计	15,618,084.58	-	-	6,427,666,681.96	-	-	6,443,284,766.54
负债							
卖出回购金融资产款	2,342,001,228.19	-	-	-	-	-	2,342,001,228.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	508,025.34	508,025.34
应付托管费	-	-	-	-	-	169,341.78	169,341.78
其他负债	-	-	-	-	-	143,947.43	143,947.43
负债总计	2,342,001,228.19	-	-	-	-	821,314.55	2,342,822,542.74
利率敏感度缺口	-2,326,383,143.61	-	-	6,427,666,681.96	-	-821,314.55	4,100,462,223.80
上年度末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	569,554.56	-	-	-	-	-	569,554.56
结算备付金	11,443,930.40	-	-	-	-	-	11,443,930.40
债权投资	-	-	2,439,819.48	6,363,830,255.06	-	-	6,366,270,074.54
资产总计	12,013,484.96	-	2,439,819.48	6,363,830,255.06	-	-	6,378,283,559.50
负债							
卖出回购金融	2,293,706,754.41	-	-	-	-	-	2,293,706,754.41

资产款							
应付管理人报酬		-	-	-	-	522,923.14	522,923.14
应付托管费		-	-	-	-	174,307.71	174,307.71
其他负债		-	-	-	-	210,307.15	210,307.15
负债总计	2,293,706,754.41		-	-	-	907,538.00	2,294,614,292.41
利率敏感度缺口	-2,281,693,269.45		-	2,439,819.48	6,363,830,255.06	-	-907,538.00

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金采用持有至到期策略投资于固定利率类的固定收益品种，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**

**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

于2024年6月30日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：同)。

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

无。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2024年6月30日		2023年12月31日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
债权投资	6,427,666,681.96	6,556,702,497.89	6,366,270,074.54	6,483,022,152.35

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理

标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2024年6月30日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### §7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,427,666,681.96	99.76
	其中：债券	6,427,666,681.96	99.76
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,618,084.58	0.24
8	其他各项资产	-	-
9	合计	6,443,284,766.54	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。



**7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**  
无。

**7.4 报告期内股票投资组合的重大变动**

**7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**  
无。

**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**  
无。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**  
无。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,427,666,681.96	156.75
	其中：政策性金融债	6,427,666,681.96	156.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,427,666,681.96	156.75

注：本基金采用摊余成本法核算，公允价值部分均以摊余成本列示。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	200315	20进出15	35,300,000	3,615,670,917.20	88.18
2	160405	16农发05	6,700,000	679,813,446.36	16.58
3	018018	国开2101	6,111,220	618,433,125.14	15.08
4	108904	农发2102	4,122,020	420,548,404.66	10.26
5	200408	20农发08	2,300,000	236,168,942.99	5.76

注：本基金采用摊余成本法核算，公允价值部分均以摊余成本列示。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**  
无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 本期国债期货投资政策**  
无。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**  
无。

**7.12 投资组合报告附注**

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

**7.12.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情况。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

无。

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

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

**§8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
224	17,857,413.64	3,999,996,000.00	100.00%	64,654.98	0.00%

注：由于小数点后保留位数限制的原因，期末个人投资者持有本基金份额合计总数占基金总份额比例显示为零。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	26,212.98	0.0007%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年10月29日)基金份额总额	4,000,059,482.79
本报告期期初基金份额总额	4,000,060,441.90
本报告期基金总申购份额	213.08
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,000,060,654.98

注：此处申购含红利再投份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本公司高级管理人员无重大人事变动，未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。自本基金募集以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）一直为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内无新增加的交易单元

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

a. 实力雄厚，信誉良好；

b. 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好,过去三年未有任何违规经营记录；

- c.公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供研究服务支持;
  - d.公司内部管理规范,研究流程严谨清晰,能满足基金操作的高度保密要求;
  - e.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。
- 2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序 基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核,并根据考核结果选择交易单元:
- a.研究报告的数量和质量;
  - b.提供研究服务的主动性;
  - c.资讯提供的及时性及便利性;
  - d.其他可评价的考核标准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	14,931,922,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-01-22
2	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-03-29
3	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-04-08
4	汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-18

5	汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书（2024年第1号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28
6	汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	本基金指定报刊、指定互联网网站	2024-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101 - 20240630	999,999,000.00	0.00	0.00	999,999,000.00	25.00%
	2	20240101 - 20240630	1,699,999,000.00	0.00	0.00	1,699,999,000.00	42.50%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，可能引起巨额赎回导致的流动性风险，本基金管理人会根据份额持有人的结构和特点，保持关注申赎动向，根据可能产生的流动性风险，对本基金的投资组合及时作出相应调整，目前单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况对本基金流动性影响有限。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金注册的文件
- （二）《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请募集注册汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金之法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇二四年八月三十一日