

汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二六年二月四日

清算报告公告日:二〇二六年二月十日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2022 年 8 月 8 日《关于准予汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2022】1738 号文)注册募集,于 2023 年 1 月 17 日起成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)的有关规定,基金合同生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,在基金管理人履行适当程序后,基金合同自动终止,无需召开基金份额持有人大会,但应依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

截至 2026 年 1 月 7 日日终且登记机构完成该开放日的申购赎回业务申请确认后,汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元,已触发本基金基金合同约定终止的情形。根据《基金合同》有关约定,汇丰晋信基金管理有限公司应依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止基金合同,且无需召开基金份额持有人大会。

本基金自 2026 年 1 月 8 日起进入清算期,由基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 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 基金产品概况	4
§ 3 基金运作情况	6
§ 4 财务会计报告(经审计)	7
§ 5 清盘事项说明	8
§ 5.1 清算费用	8
§ 5.2 资产处置情况	8
§ 5.3 负债清偿情况	9
§ 5.4 清算期间的剩余资产分配情况	9
§ 5.5 基金财产清算报告的告知安排	9
§ 6 备查文件目录	10
§ 6.1 备查文件目录	10
§ 6.2 存放地点	10
§ 6.3 查阅方式	10

§ 2 基金产品概况

基金名称	汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信慧嘉债券
基金主代码	016651
基金代码	A类份额 016651/C类份额 016652
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年1月17日
最后运作日(2026年1月7日)基金份额	9,379,927.64份
投资目标	在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
主要投资策略	<p>(一) 资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在债券、股票及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>(二) 债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>(三) 国债期货投资策略 基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>(四) 信用衍生品投资策略 本基金将根据风险管理的原则，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，在信用衍生品投资中根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品的投资，以管理投资组合信用风险敞口为主要目的。</p> <p>(五) 股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。</p> <p>(六) 港股通标的股票投资策略 港股通标的股票投资策略方面，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将优先把基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。</p>
业绩比较基准	中债-新综合全价(总值)指数收益率*85% + 沪深300指数收益率*15%

风险收益特征	本基金属于债券型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金若投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2022 年 8 月 8 日《关于准予汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2022】1738 号文)注册募集,于 2023 年 1 月 17 日起成立,成立募集份额合计 744,754,600.15 份。基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《关于汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金自 2026 年 1 月 8 日起停止办理申购、赎回、定期定额投资、转换等业务且不再恢复。本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费和 C 类基金份额的销售服务费。

§ 4 财务会计报告(经审计)

基金最后运作日资产负债表

会计主体: 汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金

报告截止日: 2026 年 1 月 7 日(基金最后运作日)

单位: 人民币元

资产	本期末 2026 年 1 月 7 日(基金最后运作日)
资产:	
货币资金	2, 277, 487. 13
结算备付金	494, 109. 04
存出保证金	9, 206. 91
交易性金融资产	9, 257, 913. 42
其中: 债券投资	9, 257, 913. 42
应收证券清算款	202, 171. 92
资产总计	12, 240, 888. 42
负债和净资产	本期末 2026 年 1 月 7 日(基金最后运作日)
负债:	
应付赎回款	2, 460, 430. 07
应付管理人报酬	1, 671. 00
应付托管费	417. 75
应付销售服务费	319. 20
应交税费	12. 27
其他负债	140, 291. 98
负债合计	2, 603, 142. 27
净资产:	
实收基金	9, 379, 927. 64
未分配利润	257, 818. 51
净资产合计	9, 637, 746. 15
负债和净资产总计	12, 240, 888. 42

注: 1、 报告截止日 2026 年 1 月 7 日(基金最后运作日), 基金份额总额为 9, 379, 927. 64 份, 其中 A 类基金份额总额为 5, 669, 328. 31 份, 基金份额净值 1. 0316 元; C 类基金份额总额为 3, 710, 599. 33 份, 基金份额净值 1. 0211 元。

2、 本清算报表是按照财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同》的有关规定以清算基础编制的。由于报告性质所致, 本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§ 5 清盘事项说明

自 2026 年 1 月 8 日至 2026 年 2 月 4 日止为清算期间。基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算, 全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

§ 5.1 清算费用

按照《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定, 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

§ 5.2 资产处置情况

本基金最后运作日货币资金为人民币 2,277,487.13 元, 其中应计利息为 477.18 元。为保护基金份额持有人利益, 加快清算速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付上述货币资金应计利息部分。

本基金最后运作日持有的债券投资估值金额为人民币 9,257,913.42 元, 已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日结算备付金为人民币 494,109.04 元, 其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 481,366.79 元, 应计结算备付金利息为人民币 79.56 元; 存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 12,660.65 元, 应计结算备付金利息为人民币 2.04 元。上述存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算备付金本金部分 152,996.60 元已于 2026 年 1 月 12 日划入银行存款, 剩余本金 341,030.84 元将于 2026 年 2 月 9 日资金返还时全部划入银行存款。为保护基金份额持有人利益, 加快清算速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付上述结算备付金产生的应计利息部分。

本基金最后运作日存出保证金为人民币 9,206.91 元, 其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 7,418.13 元, 应计存出保证金利息为人民币 1.35 元; 存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 1,787.09 元, 应计存出保证金利息为人民币 0.34 元。上述存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的存出保证金本金部分已于清算期间全部划入银行存款。为保护基金份额持有人利益, 加快清算速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付上述存出保证金应计利息部分。

本基金最后运作日持有的应收证券清算款为 202,171.92 元, 已于清算期间全部划入银行存款。

§ 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,460,430.07 元, 该款项已于清算期间支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,671.00 元, 该款项已于清算期间支付。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 417.75 元, 该款项已于清算期间支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 319.20 元, 该款项已于清算期间支付。

本基金最后运作日应交税费为人民币 12.27 元, 该款项已于清算期间上缴税务机关。

本基金最后运作日其他负债为人民币 140,291.98 元, 为应付交易费用、应付审计费和应付信息披露费, 该款项已于清算期间支付。

§ 5.4 清算期间的剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 1 月 7 日基金净资产	9,637,746.15
加: 清算期间 (2026 年 1 月 8 日至 2026 年 2 月 4 日) 净收益	10,400.30
减: 净赎回金额	148,765.73
二、清算截止日 2026 年 2 月 4 日基金净资产	9,499,380.72

注: 清算截止日至资产支付日前一日产生的货币资金、结算备付金及存出保证金的利息归基金份额持有人所有, 为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异), 供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金期间孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

§ 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核, 在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后, 报上海证监局备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件目录

§ 6.1 备查文件目录

- 1、《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金财务报表及审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金清算报告>的法律意见》

§ 6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

§ 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日:二〇二六年二月四日

清算报告公告日:二〇二六年二月十日