

汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28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2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40

§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 盈利投资者数量占比	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.4 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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	43
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信港股通双核混合
基金主代码	007291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 08 月 02 日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	904,934,786.81 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金致力于捕捉股票、债券市场不同阶段的投资机会，对于股票投资部分，主要投资于优质的港股通标的股票，基于汇丰“profitability-valuation”选股模型，筛选出低估值、高盈利的股票，严格遵守投资纪律，在债券投资上，遵循稳健投资的原则，以追求超越业绩基准的长期投资收益。
投资策略	本基金的双核策略指的是以下两个核心策略： 1) 在资产配置上借鉴汇丰经验，采用基于多因素分析的大类资产配置策略，实现资产合理配置。 2) 在个股选择上采用汇丰集团在海外市场成功运作的“估值-盈利个股精选策略”，筛选低估值、高盈利的股票。 1、大类资产配置策略 本基金将上市公司作为一个整体考虑，如果整体上市公司的业绩预期改善、投资者的风险偏好增强、无风险利率下降，则预期股市看涨，应采取加仓的策略；反之亦然。 2、股票投资策略 本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和技术，依据港股通投资的具体特征，将运用“Profitability-Valuation”（盈利-估值）投资策略作为本基金股票资产的主要投资策略。 该策略的目标是就特定盈利能力水平的股票中，选取估值低于市场平均值的股票。我们相信，如果盈利能力是可持续的，那么这些股票应该会均值回归，从而增加我们产生超额收益的机会。

	3、债券投资策略 本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益。 4、权证投资策略 本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。 5、资产支持证券投资策略 本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。
业绩比较基准	中证港股通综合指数收益率*70%+中债新综合指数*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益风险水平的投资品种。 本基金投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票，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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周慧	张姗
	联系电话	021-20376868	400-61-95555
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.c n	zhangshan_1027@cmbc hina.com
客户服务电话		021-20376888	400-61-95555
传真		021-20376999	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸 易试验区世纪大道 8	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	号上海国金中心汇丰 银行大楼 17 楼	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	刘鹏飞	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金中期报告置备地点	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；招商银行股份有限公司：深圳 市深南大道 7088 号招商银行大厦

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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-51,883,310.87
本期利润	-632,268,562.56
加权平均基金份额本期利润	-0.5051
本期加权平均净值利润率	-29.98%
本期基金份额净值增长率	-29.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	183,428,556.67
期末可供分配基金份额利润	0.2027
期末基金资产净值	1,140,302,329.61
期末基金份额净值	1.2601
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	26.01%

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；

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
过去三个月	-17.94%	1.79%	-6.08%	0.77%	-11.86%	1.02%
过去六个月	-29.97%	1.66%	-10.06%	0.84%	-19.91%	0.82%
过去一年	-14.12%	1.46%	-5.46%	0.78%	-8.66%	0.68%
过去三年	24.99%	1.49%	12.32%	0.93%	12.67%	0.56%
过去五年	-29.22%	1.85%	-9.30%	0.98%	-19.92%	0.87%
自基金合同生效起至今	26.01%	1.81%	2.87%	0.96%	23.14%	0.85%

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去三年指 2023 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去五年指 2021 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2019 年 8 月 2 日-2026 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

汇丰晋信港股通双核混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年08月02日-2026年06月30日)



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 50%-95%（其中，港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%）。权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。
2. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至 2020 年 2 月 2 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
3. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证港股通综合指数收益率*70%+中债新综合指数*30%。
4. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证港股通综合指数成份股在报告期产生的股票红利收益。本基金业绩比较基准中的中债新综合指数为中债新综合全价（总值）指数，是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中。

§ 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 44 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)、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(2023 年 12 月 12 日成立)、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金(2024 年 4 月 16 日成立)、汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2024 年 6 月 12 日成立)、汇丰晋信绿色债券型证券投资基金(2024 年 12 月 11 日成立)、汇丰晋信景气优选混合型证券投资基金(2025 年 5 月 28 日成立)、汇丰晋信港股通核心资产股票型发起式证券投资基金(2025 年 8 月 12 日成立)、汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)(2026 年 1 月 20 日成立)、汇丰晋信周期优选股票型证券投资基金(2026 年 3 月 11 日成立)、汇丰晋信港股精选股票型证券投资基金(QDII)(2026 年 4 月 30 日成立)和汇丰晋信慧泰债券型证券投资基金(2026 年 6 月 24 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		
郑小兵	汇丰晋信中小	2024-09-14	-	8 年	郑小兵先生，

	盘股票型证券投资基金、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金和汇丰晋信周期优选股票型证券投资基金基金经理				硕士研究生。曾任天风证券股份有限公司石油化工分析师、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员，现任汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金和汇丰晋信周期优选股票型证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	--	--

- 注：
- 1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。
- 2、证券从业年限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合规守信情况的说明

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，或者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

2026 年上半年，港股呈现震荡下行趋势，恒生指数下跌 10.73%，表现欠佳。从行业表现来看，电子、银行、煤炭等行业涨幅居前，而国防军工、消费者服务、商贸零售等行业表现落后。

在基金的投资运作方面，本基金产品上半年基本维持高仓位运行，执行“杠铃型”策略，同时也增配了互联网仓位，作为杠铃杆；目前杠铃两端主要以互联网和航空为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为-29.97%，同期业绩比较基准收益率为-10.06%，净值表现落后同期比较基准 19.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们坚定看好国内经济稳步复苏。因此，我们在组合上希望基于宏观及中观视角，主动调整组合 β ；基于资产属性及行业景气驱动视角，配置风险回报比高且行业间相关性较弱的板块；基于公司基本面研究视角，优选个股。

我们关注两条投资主线：

1. 关注增长超预期的机会：受益于经营杠杆弹性大、前期降本增效优，部分行业利润率有望持续提升；同时部分公司新技术/产品有所突破以迎接下一轮的收入扩张机会，有望开启收入的二次增长曲线。我们相对看好互联网的投资机会。

2. 关注内需增长的机会：关注国内经济企稳回升，消费回暖的投资机会。我们相对看好航空板块的投资机会。航空在经历了上半年美伊冲突影响后，当前弹性合适，往后看，国内宏观需求和油价均有望迎来改善。

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，本基金暂不进行利润分配。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	117,260,775.89	144,689,192.42
结算备付金		7,669,005.54	9,305,233.11
存出保证金		132,910.75	148,915.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,078,337,933.56	2,200,369,989.72
其中：股票投资		1,078,337,933.56	2,200,369,989.72
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	-	-
应收清算款		31,779,438.37	-
应收股利		3,335,356.49	70.70
应收申购款		57,543.66	6,952,460.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,238,572,964.26	2,361,465,862.31
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
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		-	-
应付清算款		-	4,902,531.28
应付赎回款		95,526,187.78	5,810,308.56
应付管理人报酬		1,308,633.73	2,264,096.72
应付托管费		218,105.63	377,349.46
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	6.4.7.6	1,217,707.51	995,481.90
负债合计		98,270,634.65	14,349,767.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	904,934,786.81	1,304,280,600.18
未分配利润	6.4.7.8	235,367,542.80	1,042,835,494.21
净资产合计		1,140,302,329.61	2,347,116,094.39
负债和净资产总计		1,238,572,964.26	2,361,465,862.31

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 904,934,786.81 份，基金份额净值 1.2601 元。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-617,266,017.56	186,675,361.78
1. 利息收入		319,302.95	121,883.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	319,302.95	121,883.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-39,643,043.48	120,456,787.91
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-46,594,370.24	117,345,460.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	811.38	-467.41
资产支持证券 投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,950,515.38	3,111,794.74
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填	6.4.7.16	-580,385,251.69	65,496,656.76

列)			
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. 17	2, 442, 974. 66	600, 033. 52
减：二、营业总支出		15, 002, 545. 00	5, 376, 132. 50
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	12, 704, 123. 57	4, 509, 288. 64
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 117, 353. 91	751, 548. 07
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	181, 067. 52	115, 295. 79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-632, 268, 562. 56	181, 299, 229. 28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-632, 268, 562. 56	181, 299, 229. 28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-632, 268, 562. 56	181, 299, 229. 28

6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	1, 304, 280, 600. 18	1, 042, 835, 494. 21	2, 347, 116, 094. 39
二、本期期初净资产	1, 304, 280, 600. 18	1, 042, 835, 494. 21	2, 347, 116, 094. 39
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-399, 345, 813. 37	-807, 467, 951. 41	-1, 206, 813, 764. 78
（一）、综合收益总额	-	-632, 268, 562. 56	-632, 268, 562. 56
（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）	-399, 345, 813. 37	-175, 199, 388. 85	-574, 545, 202. 22

其中：1. 基金申购款	457,402,128.63	346,355,311.41	803,757,440.04
2. 基金赎回款	-856,747,942.00	-521,554,700.26	-1,378,302,642.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	904,934,786.81	235,367,542.80	1,140,302,329.61
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 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	331,987,039.39	53,261,553.63	385,248,593.02
二、本期期初净资产	331,987,039.39	53,261,553.63	385,248,593.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	432,690,961.74	304,018,650.60	736,709,612.34
（一）、综合收益总额	-	181,299,229.28	181,299,229.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	432,690,961.74	122,719,421.32	555,410,383.06
其中：1. 基金申购款	634,825,800.49	194,257,291.31	829,083,091.80
2. 基金赎回款	-202,134,838.75	-71,537,869.99	-273,672,708.74
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	764,678,001.13	357,280,204.23	1,121,958,205.36

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	张薇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金(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”)证监许可[2019]427 号《关于准予汇丰晋信港股通双核策略混合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《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放

式基金，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 280,534,560.23 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(2019)第 0437 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 280,630,289.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 95,729.38 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 50%-95%(其中，港股通标的股票投资比例不低于非现金资产的 80%)，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证港股通综合指数收益率×70%+中债新综合指数×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集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>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信港股通双核策略混合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 2026 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限

责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册,H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	117,260,775.89
等于: 本金	117,251,900.64
加: 应计利息	8,875.25
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	117,260,775.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,484,011,66 6.48	-	1,078,337,93 3.56	- 405,673,732.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,484,011,66 6.48	-	1,078,337,93 3.56	405,673,732. 92

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 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	210,766.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	905,725.96
其中：交易所市场	905,725.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
其他应付	6,995.85
合计	1,217,707.51

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,304,280,600.18	1,304,280,600.18
本期申购	457,402,128.63	457,402,128.63
本期赎回（以“-”号填列）	-856,747,942.00	-856,747,942.00
本期末	904,934,786.81	904,934,786.81

6.4.7.8 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	368,016,537.55	674,818,956.66	1,042,835,494.21
本期期初	368,016,537.55	674,818,956.66	1,042,835,494.21
本期利润	-51,883,310.87	-580,385,251.69	-632,268,562.56
本期基金份额交易产生的变动数	-132,704,670.01	-42,494,718.84	-175,199,388.85
其中：基金申购款	147,793,501.76	198,561,809.65	346,355,311.41
基金赎回款	-280,498,171.77	-241,056,528.49	-521,554,700.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	183,428,556.67	51,938,986.13	235,367,542.80

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	238,397.47
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	33,623.09
其他	47,282.39
合计	319,302.95

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,445,931,071.59
减：卖出股票成本总额	2,485,952,109.60
减：交易费用	6,573,332.23
买卖股票差价收入	-46,594,370.24

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	968.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-157.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	811.38

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,358,695.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,299,942.00
减：应计利息总额	58,910.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-157.00

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,950,515.38
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,950,515.38

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-580,385,251.69
——股票投资	-580,385,251.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-580,385,251.69

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	2,442,974.66
合计	2,442,974.66

注：对于持有基金份额少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有基金份额不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75%计入基金财产；对于持有基金份额不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50%计入基金财产；对于持有基金份额不少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	8,041.27
账户维护费	9,000.00
证券组合费	69,806.70
合计	181,067.52

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、关联关系

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,704,123.57	4,509,288.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,557,205.29	1,389,518.19
应支付基金管理人的净管理费	10,146,918.28	3,119,770.45

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 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,117,353.91	751,548.07

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

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

无。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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
	招商银行	117,260,775.89	238,397.47	125,893,496.64

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

无。

6.4.12 期末（2026 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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2026 年 06 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2026 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	117,260,775.89	-	-	-	117,260,775.89
结算备付金	7,669,005.54	-	-	-	7,669,005.54
存出保证金	132,910.75	-	-	-	132,910.75
交易性金融资产	-	-	-	1,078,337,933.56	1,078,337,933.56
应收清算款	-	-	-	31,779,438.37	31,779,438.37
应收股利	-	-	-	3,335,356.49	3,335,356.49
应收申购款	-	-	-	57,543.66	57,543.66
资产总计	125,062,692.18	-	-	1,113,510,272.08	1,238,572,964.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	95,526,187.78	95,526,187.78
应付管理人报酬	-	-	-	1,308,633.73	1,308,633.73
应付托管费	-	-	-	218,105.63	218,105.63
其他负债	-	-	-	1,217,707.51	1,217,707.51
负债总计	-	-	-	98,270,634.65	98,270,634.65
利率敏感度缺口	125,062,692.18	-	-	1,015,239,637.43	1,140,302,329.61
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	144,689,192.42	-	-	-	144,689,192.42
结算备付金	9,305,233.11	-	-	-	9,305,233.11
存出保证金	148,915.91	-	-	-	148,915.91
交易性金融资产	-	-	-	2,200,369,989.72	2,200,369,989.72
应收股利	-	-	-	70.70	70.70
应收申购款	-	-	-	6,952,460.45	6,952,460.45
资产总计	154,143,341.44	-	-	2,207,322,520.87	2,361,465,862.31
负债					
应付清算款	-	-	-	4,902,531.28	4,902,531.28
应付赎回款	-	-	-	5,810,308.56	5,810,308.56
应付管理人报酬	-	-	-	2,264,096.72	2,264,096.72
应付托管费	-	-	-	377,349.46	377,349.46
其他负债	-	-	-	995,481.90	995,481.90
负债总计	-	-	-	14,349,767.92	14,349,767.92
利率敏感度缺口	154,143,341.44	-	-	2,192,972,752.95	2,347,116,094.39

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2025 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	895,565,072.33	-	895,565,072.33
应收股利	-	3,335,356.49	-	3,335,356.49
资产合计	-	898,900,428.82	-	898,900,428.82
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	898,900,428.82	-	898,900,428.82
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,971,453,879.70	-	1,971,453,879.70
应收股利	-	70.70	-	70.70
资产合计	-	1,971,453,950.40	-	1,971,453,950.40
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,971,453,950.40	-	1,971,453,950.40

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 港币升值 50 个基点	4,494,502.14	233.35
	2. 港币贬值 50 个基点	-4,494,502.14	-233.35

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产的 50%-95%(其中，港股通标的股票投资比例不低于非现金资产的 80%)，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,078,337,933.56	94.57	2,200,369,989.72	93.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,078,337,933.56	94.57	2,200,369,989.72	93.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	82,056,978.64	150,459,728.00
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-82,056,978.64	-150,459,728.00

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,078,337,933.56	2,200,369,989.72
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,078,337,933.56	2,200,369,989.72

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 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(2025 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和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	1,078,337,933.56	87.06

	其中：股票	1, 078, 337, 933. 56	87. 06
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付 金合计	124, 929, 781. 43	10. 09
8	其他各项资产	35, 305, 249. 27	2. 85
9	合计	1, 238, 572, 964. 26	100. 00

注：权益投资中未通过沪港通机制投资香港股票；通过深港通机制投资香港股票金额 895,565,072.33 元，占基金资产净值的比例为 78.54%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	48, 048, 169. 30	4. 21
C	制造业	134, 724, 691. 93	11. 81
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮 政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务 业	—	—
N	水利、环境和公共设 施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其 他服务业	—	—

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	182,772,861.23	16.03

注：上表按行业分类的股票投资组合仅包括在上海证券交易所和深圳证券交易所上市交易的股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	167,107,903.30	14.65
工业	336,608,988.66	29.52
信息技术	135,121,538.67	11.85
通讯业务	256,726,641.70	22.51
合计	895,565,072.33	78.54

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	01055	中国南方航空股份	38,290,863	112,743,023.51	9.89
2	00753	中国国航	30,513,728	112,371,441.45	9.85
3	00670	中国东方航空股份	40,622,966	111,494,523.70	9.78
4	09988	阿里巴巴—W	1,180,225	95,179,088.75	8.35
5	01024	快手—W	2,528,677	91,365,348.19	8.01
6	00700	腾讯控股	223,596	83,469,010.63	7.32
7	09911	赤子城科技	12,488,239	81,892,282.88	7.18
8	002531	天顺风能	9,236,027	77,859,707.61	6.83
9	02331	李宁	5,626,007	71,928,814.55	6.31
10	00285	比亚迪电子	3,755,249	68,233,122.18	5.98
11	03800	协鑫科技	111,611,000	66,888,416.49	5.87

12	603988	中电电机	3, 505, 856	56, 864, 984. 3 2	4. 99
13	000923	河钢资源	3, 871, 730	48, 048, 169. 3 0	4. 21

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金 额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	00670	中国东方航空股 份	197, 614, 083. 33	8. 42
2	01055	中国南方航空股 份	175, 523, 414. 64	7. 48
3	00285	比亚迪电子	165, 782, 705. 84	7. 06
4	00753	中国国航	158, 796, 985. 40	6. 77
5	03800	协鑫科技	134, 536, 444. 07	5. 73
6	01024	快手－W	120, 170, 927. 18	5. 12
7	09988	阿里巴巴－W	108, 683, 674. 37	4. 63
8	000923	河钢资源	101, 573, 909. 13	4. 33
9	09911	赤子城科技	99, 066, 396. 57	4. 22
10	002531	天顺风能	97, 893, 151. 49	4. 17
11	600963	岳阳林纸	93, 043, 811. 66	3. 96
12	03690	美团－W	85, 965, 792. 35	3. 66
13	00700	腾讯控股	79, 420, 098. 71	3. 38
14	02331	李宁	72, 438, 740. 54	3. 09
15	02333	长城汽车	44, 109, 856. 30	1. 88
16	02313	申洲国际	39, 070, 914. 83	1. 66
17	02319	蒙牛乳业	37, 650, 421. 25	1. 60
18	603988	中电电机	33, 880, 274. 00	1. 44
19	00551	裕元集团	29, 374, 900. 59	1. 25
20	01208	五矿资源	27, 219, 939. 78	1. 16

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金 额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	002531	天顺风能	214, 859, 952. 36	9. 15
2	00670	中国东方航空股 份	200, 651, 868. 06	8. 55

3	02319	蒙牛乳业	184,557,107.81	7.86
4	01138	中远海能	183,220,202.32	7.81
5	01055	中国南方航空股份	169,551,728.82	7.22
6	00753	中国国航	154,984,523.59	6.60
7	00013	和黄医药	117,883,449.62	5.02
8	09988	阿里巴巴-W	117,613,172.52	5.01
9	02333	长城汽车	112,017,747.13	4.77
10	02331	李宁	111,720,125.14	4.76
11	00551	裕元集团	102,363,995.84	4.36
12	02313	申洲国际	101,190,487.85	4.31
13	01024	快手-W	93,844,140.40	4.00
14	03690	美团-W	82,897,789.70	3.53
15	00390	中国中铁	81,027,438.48	3.45
16	00700	腾讯控股	80,597,204.78	3.43
17	00285	比亚迪电子	75,832,898.57	3.23
18	600963	岳阳林纸	73,473,497.70	3.13
19	603988	中电电机	41,221,190.00	1.76
20	02555	茶百道	39,577,525.26	1.69

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,944,305,305.13
卖出股票收入（成交）总额	2,445,931,071.59

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	132,910.75
2	应收清算款	31,779,438.37
3	应收股利	3,335,356.49
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,543.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,305,249.27

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
8,421	107,461.68	737,365,402.03	81.48%	167,569,384.78	18.52%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	41.71%

8.3 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	445,805.42	0.0493%

8.4 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、基金投资和研究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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 08 月 02 日）基金份额总额	280,630,289.61
本报告期期初基金份额总额	1,304,280,600.18
本报告期基金总申购份额	457,402,128.63
减：本报告期基金总赎回份额	856,747,942.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	904,934,786.81

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

2026 年 4 月 25 日，基金管理人发布公告，聘任吴坚隽先生担任公司风控负责人。

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

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。自本基金成立以来，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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未有受调查或处罚等情况发生。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未有受调查或处罚等情况发生。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
兴业证券	2	1,681,435,607.59	38.30%	836,468.32	38.89%	-
东方证券	2	1,280,601,475.70	29.17%	615,190.87	28.60%	-
国联民生	2	964,920,649.85	21.98%	467,488.42	21.74%	-
广发证券	2	412,887,129.69	9.40%	206,444.10	9.60%	-
天风证券	2	50,391,513.89	1.15%	25,195.83	1.17%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内无增加的交易单元；
- 2、选择证券公司参与证券交易的标准和程序
- 1) 选择证券公司参与证券交易的标准
- a. 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- b. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- c. 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- 2) 选择证券公司参与证券交易的程序
- (1) 本公司投资部根据上述评价标准对证券公司进行评估，经公司督察长和风控会审议批准后，可被选择成为提供证券交易服务的公司。

(2) 公司与被选中提供证券交易服务的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用或者通过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
兴业证券	8,599,727.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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2025年第四季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-01-21
2	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在招商证券的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-01-26
3	汇丰晋信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-03-31
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金2025年年度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-03-31
5	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-04-22

	2026 年第一季度报告		
6	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-04-25
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增万家财富为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-05-18
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增易方达财富为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-03
9	汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-30
10	汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金产品资料概要更新	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-30

§ 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	20260601 - 20260601 ； 20260603 - 20260630	135,763,056.70	68,338,319.36	0.00	204,101,376.06	22.55%
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							

赎回，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港股通双核策略混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信港股通双核策略混合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
二〇二六年八月三十一日