

# 汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金

## 2025年第2季度报告

2025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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2025年07月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年07月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年04月01日起至2025年06月30日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 汇丰晋信慧嘉债券                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 016651                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2023年01月17日                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 33,814,854.43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。                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略       | （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。（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。（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 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |               |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|                 | <p>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。（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。（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。（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          | <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |               |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇丰晋信慧嘉债券A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 汇丰晋信慧嘉债券C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 016651                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 016652        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 26,618,873.46份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 7,195,980.97份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2025年04月01日 - 2025年06月30日) |              |
|----------------|--------------------------------|--------------|
|                | 汇丰晋信慧嘉债券A                      | 汇丰晋信慧嘉债券C    |
| 1.本期已实现收益      | 677,797.44                     | 228,595.50   |
| 2.本期利润         | 375,098.25                     | 131,558.74   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0136                         | 0.0112       |
| 4.期末基金资产净值     | 27,601,704.02                  | 7,399,843.38 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0369                         | 1.0283       |

注：①本期已实现收益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、基金转换费等），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

汇丰晋信慧嘉债券A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | 1.33%  | 0.14%     | 1.09%      | 0.13%         | 0.24%  | 0.01%  |
| 过去六个月      | 0.40%  | 0.16%     | -0.11%     | 0.14%         | 0.51%  | 0.02%  |
| 过去一年       | 1.67%  | 0.17%     | 4.06%      | 0.19%         | -2.39% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.69%  | 0.13%     | 5.24%      | 0.16%         | -1.55% | -0.03% |

注：

过去三个月指 2025 年 04 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

过去六个月指 2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

过去一年指 2024 年 07 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2023 年 01 月 17 日 - 2025 年 06 月 30 日

汇丰晋信慧嘉债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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      | 1.24% | 0.14% | 1.09%  | 0.13% | 0.15%  | 0.01%  |
| 过去六个月      | 0.22% | 0.16% | -0.11% | 0.14% | 0.33%  | 0.02%  |
| 过去一年       | 1.33% | 0.17% | 4.06%  | 0.19% | -2.73% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.83% | 0.13% | 5.24%  | 0.16% | -2.41% | -0.03% |

注：

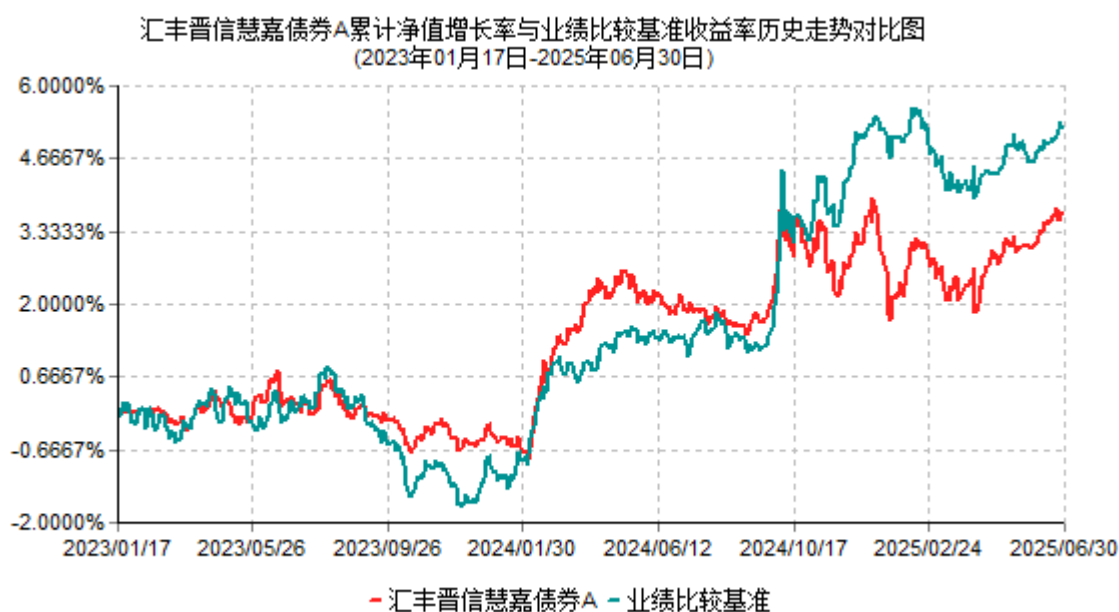
过去三个月指 2025 年 04 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

过去六个月指 2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

过去一年指 2024 年 07 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2023 年 01 月 17 日 - 2025 年 06 月 30 日

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：

1. 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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 2023 年 7 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
3. 本基金业绩比较基准：中债新综合全价（总值）指数收益率\*85% + 沪深 300 指数收益率\*15%。
4. 本基金业绩比较基准中的中债新综合全价（总值）指数收益率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。

5. 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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。



- 注：
- 1. 按照基金合同的约定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、可交换债券、可转换债券等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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 2023 年 7 月 16 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
  - 3. 本基金业绩比较基准：中债新综合全价（总值）指数收益率\*85% + 沪深 300 指数收益率\*15%。
  - 4. 本基金业绩比较基准中的中债新综合全价（总值）指数收益率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。
  - 5. 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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明           |
|----|----------|-------------|------|--------|--------------|
|    |          | 任职日期        | 离任日期 |        |              |
| 刘洋 | 汇丰晋信丰宁三个 | 2024-09-28  | -    | 8      | 刘洋先生，博士研究生。曾 |

|    |                                                                                                                                                                |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 月定期开放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、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理 |            |   |      | 任青岛银行股份有限公司固收交易员，长江养老保险股份有限公司固收交易员，交银理财有限责任公司投资经理，上海浦银安盛资产管理有限公司投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司总经理办公室业务经理、投资经理，现任汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金和汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理。 |
| 吴刘 | 汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资部总监兼汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和                                       | 2024-09-28 | - | 10.5 | 吴刘先生，硕士研究生。曾任中汇信息技术（上海）有限公司职员、交通银行股份有限公司投资经理、中信银行股份有限公司投资经理、信银理财有限责任公司固收投资条线团队负责人及条线总经理助理，现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资部总监兼汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六                                                                                                      |



|  |                     |  |  |  |                                                                     |
|--|---------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------|
|  | 汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理 |  |  |  | 个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年二季度以来，外部环境波动较大，美国对全球加征对等关税，随后开启广泛的贸易谈判，市场美联储对降息节奏的预期亦有反复。中东局势的稳定性也影响了商品价格和风险偏好。边际来看，外部环境有所改善，市场情绪趋于积极，但中长期来看外部的潜在不确定性仍有待落地。

国内方面，经济数据边际走弱。需求端，5月社会消费品零售总额同比上涨6.4%，较3月上升0.5pct。1-5月固定资产投资累计同比增速3.7%，较1-3月累计同比减少0.5pct，制造业、房地产和基建投资增速均有回落。出口增速回落明显，5月份出口额同比上涨4.8%，而3月份由于抢出口效应增速达12.3%。生产端，5月工业增加值同比增速上涨5.8%，较3月减少1.9pct。6月PMI指数为49.7，滑至荣枯线以下。

通胀方面，5月，CPI同比增速维持在-0.1%，扣除食品和能源价格，核心CPI较3月小幅提升0.1pct至0.6%，PPI同比增速为-3.3%（3月值为-2.5%），通胀数据整体仍维持低位。

政策层面，4月，美国宣布加征关税后，我国进行了快速反制，并围绕扩内需、稳就业等方面出台了相关政策。5月，央行、金监总局、证监会再度联合召开发布会，明确对资本市场的呵护态度，且央行会上宣布推出一揽子货币政策措施，降准50bp、降息10bp。5月20日，六家国有大行和招商银行公示了下调人民币存款挂牌利率，不同期限下调5-25BP不等。6月，中国证监会表示将推出进一步深化科创板改革的“1+6”政策措施，在科创板设置科创成长层，并且重启未盈利企业适用科创板第五套标准上市。国家发展改革委举行6月份新闻发布会，有关“两新”政策实施进展，明确按照既定工作安排，将在7月下达今年第三批消费品以旧换新资金。总体来看，各类支持性政策的及时出台，维护经济和市场的稳定。

多方面综合影响下，二季度债券市场表现较好，期间中债新综合全价指数上涨1.06%，中债信用债指数上涨0.50%，中债金融债指数上涨0.49%，中债国债指数上涨1.11%；权益和转债市场在4月初大幅调整后，开始回升，并稳步上扬。沪深300指数上涨1.25%，上证50指数上涨1.74%，创业板指数上涨2.34%，中证转债指数上涨3.77%。

本季度，本基金操作方面，含权资产仓位总体较为平稳，4月初市场调整进行了适当加仓。5月份市场步入震荡，相应下调了仓位。6月份，市场突破上行，本基金顺势加仓，增强本基金净值弹性，配置主要以金融、有色板块为主，搭配自下而上选股。转债方面，重视把握优质大盘底仓品种的确定性机会。纯债部分，以保持流动性为主，久期变动不大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为1.33%，同期业绩比较基准收益率为1.09%；本基金C类基金份额净值增长率为1.24%，同期业绩比较基准收益率为1.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 3,318,118.02  | 7.67         |
|    | 其中：股票             | 3,318,118.02  | 7.67         |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 38,827,808.36 | 89.74        |
|    | 其中：债券             | 38,827,808.36 | 89.74        |
|    | 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      | 833,597.38    | 1.93         |
| 8  | 其他资产              | 288,073.15    | 0.67         |
| 9  | 合计                | 43,267,596.91 | 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167,434.02元，占基金资产净值的比例为0.48%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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              | 361,401.00   | 1.03 |
| C | 制造业              | 568,764.00   | 1.62 |
| 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              | 1,760,893.00 | 5.03 |
| K | 房地产业             | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业         | 459,626.00   | 1.31 |
| 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               | 3,150,684.00 | 9.00 |

5.2.2 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)  | 占基金资产净值比例(%) |
|------|------------|--------------|
| 原材料  | 167,434.02 | 0.48         |
| 合计   | 167,434.02 | 0.48         |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净 |
|---|------|------|-------|---------|--------|
|---|------|------|-------|---------|--------|

| 号  |        |      |        |            | 值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------|
| 1  | 601398 | 工商银行 | 66,300 | 503,217.00 | 1.44   |
| 2  | 601988 | 中国银行 | 89,200 | 501,304.00 | 1.43   |
| 3  | 605196 | 华通线缆 | 17,000 | 299,370.00 | 0.86   |
| 4  | 600782 | 新钢股份 | 76,100 | 269,394.00 | 0.77   |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 18,600 | 258,168.00 | 0.74   |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 52,800 | 250,800.00 | 0.72   |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 10,600 | 247,404.00 | 0.71   |
| 8  | 600547 | 山东黄金 | 5,700  | 182,001.00 | 0.52   |
| 9  | 601899 | 紫金矿业 | 9,200  | 179,400.00 | 0.51   |
| 10 | H01818 | 招金矿业 | 9,000  | 167,434.02 | 0.48   |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 25,901,525.76 | 74.00        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,440,013.70 | 29.83        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,440,013.70 | 29.83        |
| 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） | 2,486,268.90  | 7.10         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 38,827,808.36 | 110.93       |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 230305 | 23进出05 | 100,000 | 10,440,013.70 | 29.83        |
| 2  | 019766 | 25国债01 | 74,000  | 7,432,614.74  | 21.24        |
| 3  | 019773 | 25国债08 | 68,000  | 6,821,012.93  | 19.49        |
| 4  | 019776 | 25特国02 | 54,000  | 5,438,075.18  | 15.54        |

|   |        |        |        |              |       |
|---|--------|--------|--------|--------------|-------|
| 5 | 019723 | 23国债20 | 50,000 | 5,095,846.58 | 14.56 |
|---|--------|--------|--------|--------------|-------|

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细  
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策  
无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
无。

5.10.3 本期国债期货投资评价  
无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 1 | 存出保证金   | 14,167.32  |
| 2 | 应收证券清算款 | 272,905.83 |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | -          |
| 5 | 应收申购款   | 1,000.00   |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 288,073.15 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 127049 | 希望转2 | 1,302,453.92 | 3.72         |
| 2  | 118034 | 晶能转债 | 414,698.74   | 1.18         |
| 3  | 110093 | 神马转债 | 385,260.61   | 1.10         |

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**5.11.6 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。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

|                               | 汇丰晋信慧嘉债券A     | 汇丰晋信慧嘉债券C     |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 28,278,900.94 | 15,697,756.96 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 366,569.88    | 12,084,717.11 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 2,026,597.36  | 20,586,493.10 |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 26,618,873.46 | 7,195,980.97  |

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**



## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金注册的文件
- （二）《汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《汇丰晋信慧嘉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慧嘉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

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及  
其余备查文件存放在基金管理人处。

### 9.2 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。

### 9.3 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

2025年07月21日