

# 汇丰晋信货币市场基金

## 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: 交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....                               | 7  |
| 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.....                                 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                         | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....               | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                  | 15 |
| 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.....              | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....              | 16 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                 | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                  | 17 |
| 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.....        | 17 |
| §5 托管人报告.....                                 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                   | 17 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....  | 18 |
| 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.....        | 18 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                       | 18 |
| 6.1 资产负债表.....                                | 18 |
| 6.2 利润表.....                                  | 20 |
| 6.3 净资产变动表.....                               | 21 |
| 6.4 报表附注.....                                 | 23 |
| §7 投资组合报告.....                                | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                           | 49 |
| 7.2 债券回购融资情况.....                             | 49 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                         | 49 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....          | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                     | 50 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 51 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....       | 52 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....   | 52 |
| 7.9 投资组合报告附注.....                             | 52 |
| §8 基金份额持有人信息.....                             | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                    | 53 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                   | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                 | 54 |

|   |    |
|---|----|
| 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.....   | 54 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                      | 55 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 55 |
| 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 .....  | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 56 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 56 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 56 |
| 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.....      | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 57 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....             | 58 |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 58 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 60 |
| 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..... | 60 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 60 |
| §12 备查文件目录.....                         | 60 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 60 |
| 12.2 存放地点 .....                         | 60 |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 61 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |             |
|-----------------|--------------------|--------------------|-------------|
| 基金名称            | 汇丰晋信货币市场基金         |                    |             |
| 基金简称            | 汇丰晋信货币             |                    |             |
| 基金主代码           | 540011             |                    |             |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |             |
| 基金合同生效日         | 2011年11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           | 交通银行股份有限公司         |                    |             |
| 报告期末基金份额总额      | 18,601,699,917.77份 |                    |             |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇丰晋信货币A            | 汇丰晋信货币B            | 汇丰晋信货币C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 540011             | 541011             | 018782      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 117,801,237.35份    | 18,483,406,862.57份 | 491,817.85份 |

注：本基金自2023年7月17日起增加C类份额。

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。   |
| 投资策略 | <p>1.整体资产配置策略</p> <p>整体资产配置策略主要包括两个方面：1) 根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断；2) 根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。</p> <p>2.类属配置策略</p> <p>基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。</p> <p>3.个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。</p> <p>4.回购策略</p> <p>1) 息差放大策略：该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。</p> <p>2) 逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>5.流动性管理策略</p> <p>由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金将紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。</p> |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后）   |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。  |

### 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                       | 交通银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 周慧                                 | 方圆                    |
|         | 联系电话 | 021-20376868                       | 95559                 |
|         | 电子邮箱 | compliance@hsbcjt.cn               | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话  |      | 021-20376888                       | 95559                 |
| 传真      |      | 021-20376999                       | 021-62701216          |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码  | 200120                             | 200336          |
| 法定代表人 | 杨小勇                                | 任德奇             |

**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；交通银行股份有限公司：中国（上海）长宁区仙霞路18号 |

**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<br>(2024年01月01日-2024年06月30日) |                |          |
|---------------|----------------------------------|----------------|----------|
|               | 汇丰晋信货币A                          | 汇丰晋信货币B        | 汇丰晋信货币C  |
| 本期已实现收益       | 1,011,177.46                     | 164,116,183.82 | 2,329.67 |
| 本期利润          | 1,011,177.4                      | 164,116,183.8  | 2,329.67 |

|                      |                       |                   |            |
|----------------------|-----------------------|-------------------|------------|
|                      | 6                     | 2                 |            |
| 本期净值收益率              | 0.7778%               | 0.8984%           | 0.8986%    |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2024年06月30日) |                   |            |
| 期末基金资产净值             | 117,801,237.35        | 18,483,406,862.57 | 491,817.85 |
| 期末基金份额净值             | 1.0000                | 1.0000            | 1.0000     |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2024年06月30日) |                   |            |
| 累计净值收益率              | 34.1697%              | 38.3158%          | 1.7796%    |

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，由于按摊余成本法核算的货币市场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本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

③2024年3月8日起，本基金A级、C级基金份额收益分配由“每日分配、按月支付”变更为“每日分配、按日支付”。本基金B级基金份额收益分配按“每日分配、按月支付”。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信货币A

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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      | 0.1141%  | 0.0008%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0031%  | 0.0008% |
| 过去三个月      | 0.3579%  | 0.0008%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.0213%  | 0.0008% |
| 过去六个月      | 0.7778%  | 0.0008%     | 0.6732%    | 0.0000%       | 0.1046%  | 0.0008% |
| 过去一年       | 1.6205%  | 0.0009%     | 1.3537%    | 0.0000%       | 0.2668%  | 0.0009% |
| 过去三年       | 4.9697%  | 0.0011%     | 4.0537%    | 0.0000%       | 0.9160%  | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.1697% | 0.0027%     | 17.1932%   | 0.0001%       | 16.9765% | 0.0026% |



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2011年11月2日－2024年6月30日

汇丰晋信货币B

| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③      | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.1338%      | 0.0008%             | 0.1110%            | 0.0000%                   | 0.0228%  | 0.0008% |
| 过去三个月          | 0.4178%      | 0.0008%             | 0.3366%            | 0.0000%                   | 0.0812%  | 0.0008% |
| 过去六个月          | 0.8984%      | 0.0008%             | 0.6732%            | 0.0000%                   | 0.2252%  | 0.0008% |
| 过去一年           | 1.8651%      | 0.0009%             | 1.3537%            | 0.0000%                   | 0.5114%  | 0.0009% |
| 过去三年           | 5.7278%      | 0.0011%             | 4.0537%            | 0.0000%                   | 1.6741%  | 0.0011% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 38.3158%     | 0.0027%             | 17.1932%           | 0.0001%                   | 21.1226% | 0.0026% |

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2011年11月2日－2024年6月30日

汇丰晋信货币C

| 阶段    | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1338%      | 0.0008%             | 0.1110%            | 0.0000%                   | 0.0228% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 0.4178%      | 0.0008%             | 0.3366%            | 0.0000%                   | 0.0812% | 0.0008% |

|       |         |         |         |         |         |         |
|-------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去六个月 | 0.8986% | 0.0008% | 0.6732% | 0.0000% | 0.2254% | 0.0008% |
| 成立至今  | 1.7796% | 0.0009% | 1.2945% | 0.0000% | 0.4851% | 0.0009% |

注：

过去一个月指2024年6月1日－2024年6月30日

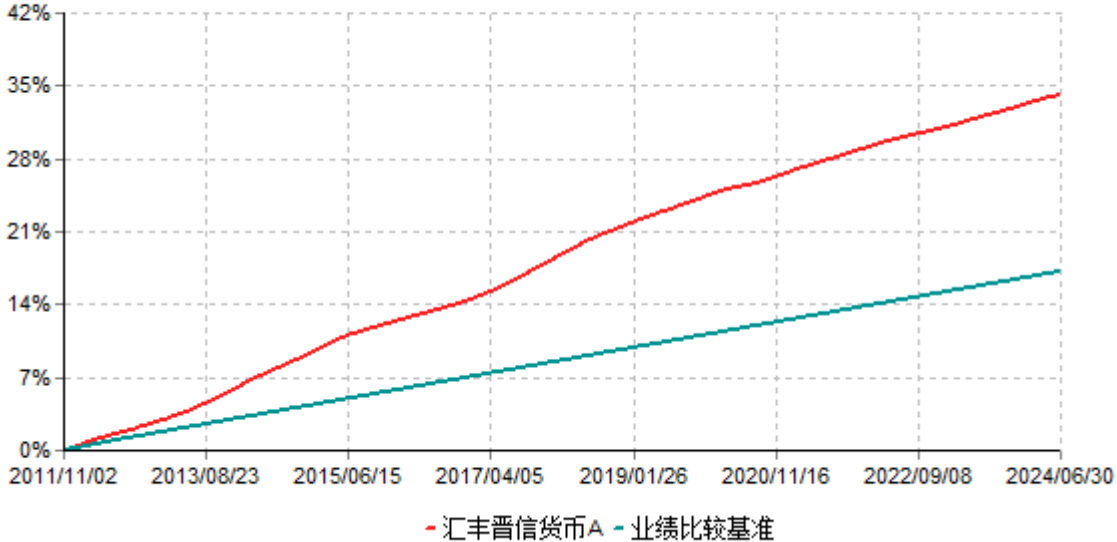
过去三个月指2024年4月1日－2024年6月30日

过去六个月指2024年1月1日－2024年6月30日

成立至今指2023年7月17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收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2011年11月02日-2024年06月30日)

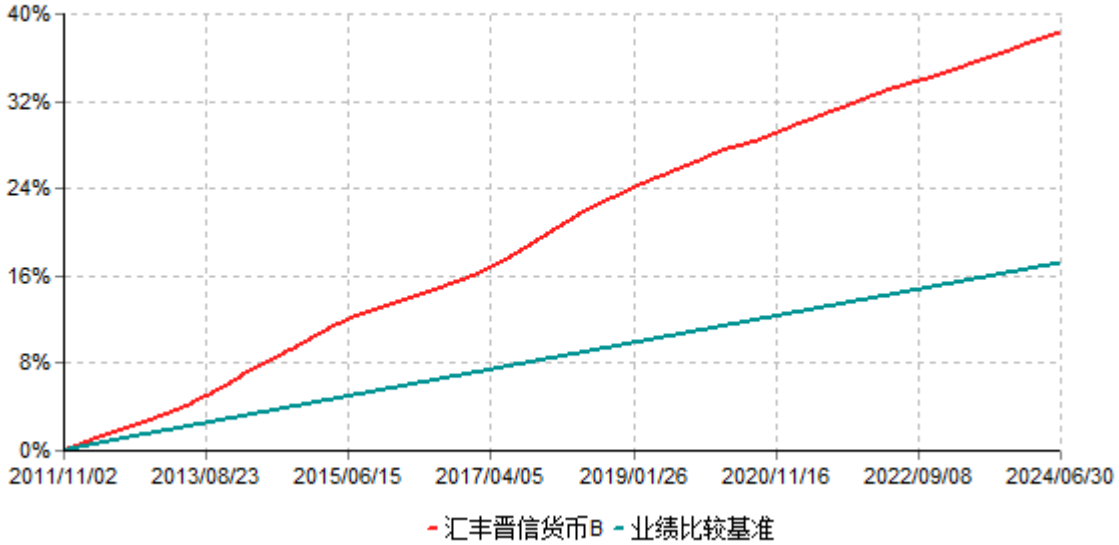


注：

1.按照基金合同的约定，本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大量存单、期限在1年以内（含1年）的债券回购、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止2012年5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。

2.报告期内本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

汇丰晋信货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2011年11月02日-2024年06月30日)

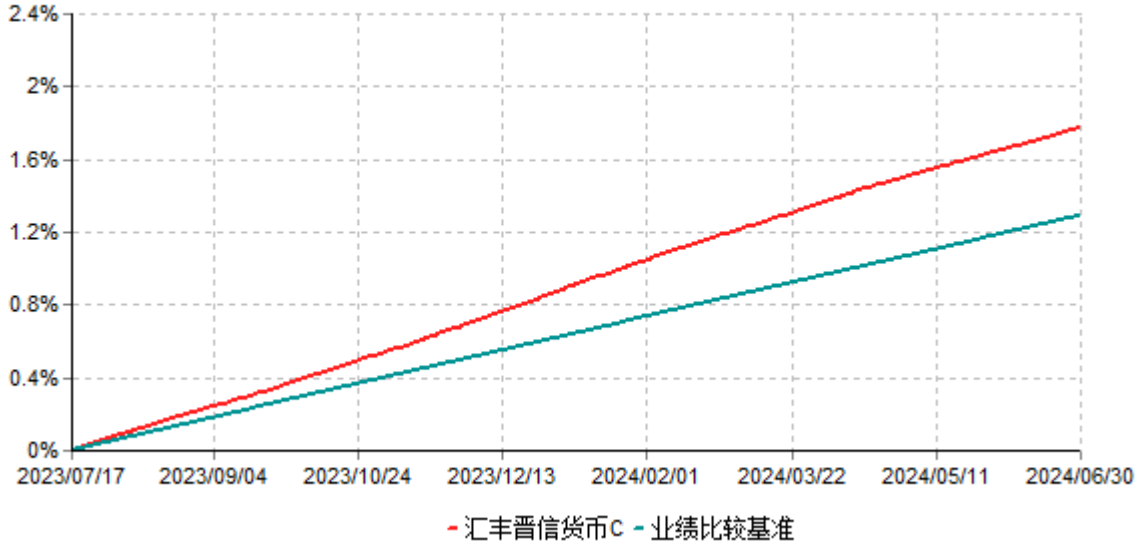


注：

1.按照基金合同的约定，本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内（含1年）的债券回购、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止2012年5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。

2.报告期内本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

汇丰晋信货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年07月17日-2024年06月30日)



注：

- 1.按照基金合同的约定，本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内（含1年）的债券回购、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
- 2.报告期内本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。
- 3.本基金自2023年7月17日起增加C类份额。

## §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

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 |        |               |
| 李媛媛 | 货币资产投资总监、 | 2011-11-12      | -    | 19     | 李媛媛女士, 硕士研究生。 |

|     |   |            |   |     |  |
|-----|---|------------|---|-----|--|
|     | 汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金基金经理  |            |   |     | 曾任广东发展银行上海分行国际部交易员、法国巴黎银行（中国）有限公司资金部交易员、比利时富通银行上海分行环球市场部交易员、汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、投资部固定收益副总监、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。现任货币资产投资总监、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金基金经理。                             |
| 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 | 2021-02-18 | - | 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。 |
| 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. 李媛媛女士、傅煜清女士任职日期为本基金管理人公告李媛媛女士、傅煜清女士担任本基金基金经理的日期；闫湜女士任职日期为本基金管理人公告闫湜女士担任本基金基金经理助理的日期；

2. 证券从业年限为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年上半年在经济基本面偏弱、资金面稳定及配置需求较强的共同影响下，债券收益率大幅下行。

上半年GDP同比增速实现5%，其中二季度GDP同比增速4.7%，明显较一季度的5.3%放缓，宏观经济依然处于弱复苏态势。5、6月PMI重回荣枯线之下；受到房地产投资走弱的持续拖累，二季度固定资产投资同比增速逐月走弱，位于历史较低水平；工业增加值及消费表现持续弱化，需求整体不足的情况依然存在。

一季度权益市场表现偏弱，地方政府债发行偏慢导致供给缺位，资金面相对稳定，在机构的欠配需求推动下，长端和超长端利率快速下行。4月央行多次提示长端风险后市场转为相对谨慎，5月地产新政密集出台带来预期扰动。而经济数据不断验证尚未出现强复苏态势，且在“金融挤水分”背景下信贷数据走弱，跨季资金面平稳，债市再度走强。

回顾2024年上半年货币基金的操作，本基金的总体原则是在管理好流动性的前提下，根据市场变化，抓住关键时机选择合适的资产配置比例。上半年来看，本基金在季末流动性波动的时候灵活地在各品种间切换，并在维持收益相对稳定的同时寻求组合安全性及流动性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值收益率为0.7778%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%，本基金A类领先同期比较基准为0.1046%；本基金B类净值收益率为0.8984%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%，本基金B类领先同期比较基准为0.2252%；本基金C类份额净值收益率为0.8986%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%，本基金C类领先同期业绩比较基准0.2254%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行一些降息操作以后，对市场的呵护明显增加，新的货币政策框架逐步建立有助于有效引导预期，减少资金利率的波动。新一轮的存款降息，资产荒的逻辑延续，基本



面和资金面依然对债市表现有利。考虑到全年经济增长5%的目标，后续需要更多的政策支持，地方政府债发行节奏可能会加快，需要密切关注供给压力的变化。目前银行间市场流动性的供需格局发生了很大的变化，非银已经成为不可忽视的力量，密切关注以理财为代表的非银规模的增长，防止由于负反馈带来的流动性风险。

#### 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

本基金本报告期已按本基金《基金合同》的约定：

1、基金收益分配方式为红利再投资，每日进行收益分配；

2、2024年3月8日起，本基金A级、C级基金份额收益分配由“每日分配、按月支付”变更为“每日分配、按日支付”。本基金B级基金份额收益分配按“每日分配、按月支付”。本基金本报告期内向份额持有人分配利润：165,129,690.95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，托管人在汇丰晋信货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

**5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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并经托管人复核审查的有关汇丰晋信货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、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：汇丰晋信货币市场基金

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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 1,438,244,738.44   | 931,774,344.76      |
| 结算备付金      |         | 587,546,819.62     | 867,486,049.85      |
| 存出保证金      |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 11,206,423,484.47  | 9,618,614,629.70    |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 11,206,423,484.47  | 9,618,614,629.70    |
| 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    | 4,528,344,521.75           | 4,673,534,478.40            |
| 应收清算款         |            | 40,856,702.51              | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 944,020,856.51             | 1,327,374,703.94            |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 18,745,437,123.30          | 17,418,784,206.65           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <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     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 136,096,608.77             | 1,388,307,126.29            |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 4,721,709.67               | 3,463,166.28                |
| 应付托管费         |            | 1,686,324.85               | 1,236,845.14                |
| 应付销售服务费       |            | 191,737.23                 | 156,840.02                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 76,489.15                  | 103,760.22                  |
| 应付利润          |            | 742,896.16                 | 949,237.37                  |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 221,439.70                 | 351,204.19                  |
| 负债合计          |            | 143,737,205.53             | 1,394,568,179.51            |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 18,601,699,917.77          | 16,024,216,027.14           |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | -                          | -                           |

|          |  |                   |                   |
|----------|--|-------------------|-------------------|
| 净资产合计    |  | 18,601,699,917.77 | 16,024,216,027.14 |
| 负债和净资产总计 |  | 18,745,437,123.30 | 17,418,784,206.65 |

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额18,601,699,917.77份，其中A类基金份额总额117,801,237.35份，B类基金份额总额18,483,406,862.57份，C类基金份额总额491,817.85份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

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<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至202<br>3年06月30日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>       |          | 201,555,541.67                    | 141,093,769.40                         |
| 1.利息收入               |          | 66,201,972.73                     | 46,759,518.88                          |
| 其中：存款利息收入            | 6.4.7.9  | 17,644,499.14                     | 10,227,294.80                          |
| 债券利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入       |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入       |          | 48,557,473.59                     | 36,532,224.08                          |
| 其他利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列） |          | 135,353,568.94                    | 94,334,250.52                          |
| 其中：股票投资收益            | 6.4.7.10 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益               |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益               | 6.4.7.11 | 135,353,568.94                    | 94,334,250.52                          |
| 资产支持证券投资<br>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 | -                                 | -                                      |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 其他投资收益                     |            | -              | -              |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)      | 6.4.7.16   | -              | -              |
| 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   | -              | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 36,425,850.72  | 24,717,429.79  |
| 1.管理人报酬                    | 6.4.10.2.1 | 25,882,870.43  | 17,447,084.69  |
| 2.托管费                      | 6.4.10.2.2 | 9,243,882.20   | 6,231,101.71   |
| 3.销售服务费                    | 6.4.10.2.3 | 1,079,041.72   | 800,708.32     |
| 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                    |            | 65,855.25      | 69,195.49      |
| 8.其他费用                     | 6.4.7.18   | 154,201.12     | 169,339.58     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 165,129,690.95 | 116,376,339.61 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 165,129,690.95 | 116,376,339.61 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 165,129,690.95 | 116,376,339.61 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

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                                | 16,024,216,027.14       | -               | 16,024,216,027.14  |
| 二、本期期初净资产                                | 16,024,216,027.14       | -               | 16,024,216,027.14  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 2,577,483,890.63        | -               | 2,577,483,890.63   |
| （一）、综合收益总额                               | -                       | 165,129,690.95  | 165,129,690.95     |
| （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）      | 2,577,483,890.63        | -               | 2,577,483,890.63   |
| 其中：1.基金申购款                               | 54,725,707,340.14       | -               | 54,725,707,340.14  |
| 2.基金赎回款                                  | -52,148,223,449.51      | -               | -52,148,223,449.51 |
| （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） | -                       | -165,129,690.95 | -165,129,690.95    |
| 四、本期期末净资产                                | 18,601,699,917.77       | -               | 18,601,699,917.77  |
| 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                                | 9,561,766,719.06        | -               | 9,561,766,719.06   |
| 二、本期期初净资产                                | 9,561,766,719.06        | -               | 9,561,766,719.06   |

|  |                    |                 |                    |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|
| 产  |                    |                 |                    |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 2,983,623,200.08   | -               | 2,983,623,200.08   |
| （一）、综合收益总额                               | -                  | 116,376,339.61  | 116,376,339.61     |
| （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）      | 2,983,623,200.08   | -               | 2,983,623,200.08   |
| 其中：1.基金申购款                               | 24,732,221,539.22  | -               | 24,732,221,539.22  |
| 2.基金赎回款                                  | -21,748,598,339.14 | -               | -21,748,598,339.14 |
| （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） | -                  | -116,376,339.61 | -116,376,339.61    |
| 四、本期期末净资产                                | 12,545,389,919.14  | -               | 12,545,389,919.14  |

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

汇丰晋信货币市场基金(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[2011]第1135号《关于核准汇丰晋信货币市场基金募集的批复》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《汇丰晋信货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，

首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,154,780,815.38元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原"毕马威华振会计师事务所有限公司")KPMG-B(2011)CRNo.0072予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信货币市场基金基金合同》于2011年11月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,155,014,222.80份基金份额，其中认购资金利息折合233,407.42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，基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《汇丰晋信货币市场基金基金合同》和《汇丰晋信货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据单个基金账户内基金份额余额，将基金份额分为不同的级别，并依据不同级别的基金份额收取不同的销售服务费。在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的本基金份额超过500万份(包含500万份)时，本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额升级为B类基金份额，并于升级当日适用B类的相关费率。单个基金账户内保留的本基金份额低于50万份(不含50万份)，本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额降级为A类基金份额，并于降级当日适用A类基金份额的相关费率。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和B类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。根据《关于汇丰晋信货币市场基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及更新的《汇丰晋信货币市场基金招募说明书》，自2023年7月17日起，本基金新增C类基金份额，该类的投资者认(申)购本基金的金额或销售方式等与A类或B类不同。本基金原有的A类基金份额与B类基金份额收费模式不变。由于基金费用收取方式的不同，本基金A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的、具有良好流动性的金融工具，主要包括现金、期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)。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》、《汇丰晋信货币市场基金基金合同》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6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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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<br>2024年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 1,257,231,171.64   |
| 等于：本金        | 1,255,477,955.59   |
| 加：应计利息       | 1,753,216.05       |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 定期存款         | 181,013,566.80     |
| 等于：本金        | 180,000,000.00     |
| 加：应计利息       | 1,013,566.80       |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  |
| 存款期限1-3个月    | 150,785,833.06     |
| 存款期限3个月以上    | 30,227,733.74      |
| 其他存款         | -                  |
| 等于：本金        | -                  |
| 加：应计利息       | -                  |
| 减：坏账准备       | -                  |

|    |                  |
|----|------------------|
| 合计 | 1,438,244,738.44 |
|----|------------------|

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024年06月30日    |                       |              |        |
|--------|-------|-----------------------|-----------------------|--------------|--------|
|        |       | 按实际利率计算的账面价值          | 影子定价                  | 偏离金额         | 偏离度(%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                     | -                     | -            | -      |
|        | 银行间市场 | 11,206,423,484.<br>47 | 11,214,080,457.<br>87 | 7,656,973.40 | 0.0412 |
|        | 合计    | 11,206,423,484.<br>47 | 11,214,080,457.<br>87 | 7,656,973.40 | 0.0412 |
| 资产支持证券 |       | -                     | -                     | -            | -      |
| 合计     |       | 11,206,423,484.<br>47 | 11,214,080,457.<br>87 | 7,656,973.40 | 0.0412 |

注：

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
- 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

**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**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 3,728,540,954.76   | -         |
| 银行间市场 | 799,803,566.99     | -         |
| 合计    | 4,528,344,521.75   | -         |

**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<br>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      | 85,134.48          |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | 85,134.48          |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 136,305.22         |
| 合计          | 221,439.70         |

**6.4.7.7 实收基金**

**6.4.7.7.1 汇丰晋信货币A**

金额单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币A) | 本期<br>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            | 158,748,615.88                | 158,748,615.88  |
| 本期申购            | 328,501,083.83                | 328,501,083.83  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -369,448,462.36               | -369,448,462.36 |
| 本期末             | 117,801,237.35                | 117,801,237.35  |

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入；赎回含转换出、级别调整出份额。

**6.4.7.7.2 汇丰晋信货币B**

金额单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币B) | 本期<br>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            | 15,865,454,164.08             | 15,865,454,164.08  |
| 本期申购            | 54,396,004,328.15             | 54,396,004,328.15  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -51,778,051,629.66            | -51,778,051,629.66 |
| 本期末             | 18,483,406,862.57             | 18,483,406,862.57  |

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入；赎回含转换出、级别调整出份额。

### 6.4.7.7.3 汇丰晋信货币C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币C) | 本期<br>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            | 13,247.18                     | 13,247.18    |
| 本期申购            | 1,201,928.16                  | 1,201,928.16 |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -723,357.49                   | -723,357.49  |
| 本期末             | 491,817.85                    | 491,817.85   |

注：申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 汇丰晋信货币A

单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币A) | 已实现部分        | 未实现部分 | 未分配利润合计      |
|-----------------|--------------|-------|--------------|
| 上年度末            | -            | -     | -            |
| 本期期初            | -            | -     | -            |
| 本期利润            | 1,011,177.46 | -     | 1,011,177.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -            | -     | -            |
| 其中：基金申购款        | -            | -     | -            |

|         |               |   |               |
|---------|---------------|---|---------------|
| 基金赎回款   | -             | - | -             |
| 本期已分配利润 | -1,011,177.46 | - | -1,011,177.46 |
| 本期末     | -             | - | -             |

**6.4.7.8.2 汇丰晋信货币B**

单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币B) | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|-----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末            | -               | -     | -               |
| 本期期初            | -               | -     | -               |
| 本期利润            | 164,116,183.82  | -     | 164,116,183.82  |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -               | -     | -               |
| 其中：基金申购款        | -               | -     | -               |
| 基金赎回款           | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润         | -164,116,183.82 | -     | -164,116,183.82 |
| 本期末             | -               | -     | -               |

**6.4.7.8.3 汇丰晋信货币C**

单位：人民币元

| 项目<br>(汇丰晋信货币C) | 已实现部分     | 未实现部分 | 未分配利润合计   |
|-----------------|-----------|-------|-----------|
| 上年度末            | -         | -     | -         |
| 本期期初            | -         | -     | -         |
| 本期利润            | 2,329.67  | -     | 2,329.67  |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -         | -     | -         |
| 其中：基金申购款        | -         | -     | -         |
| 基金赎回款           | -         | -     | -         |
| 本期已分配利润         | -2,329.67 | -     | -2,329.67 |
| 本期末             | -         | -     | -         |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 8,938,165.08                  |
| 定期存款利息收入  | 4,651,982.20                  |
| 其他存款利息收入  | -                             |
| 结算备付金利息收入 | 4,054,351.86                  |
| 其他        | -                             |
| 合计        | 17,644,499.14                 |

**6.4.7.10 股票投资收益**

无。

**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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 132,491,644.71                |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,861,924.23                  |
| 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                           | 135,353,568.94                |

**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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付） | 27,102,119,796.40             |

|                        |                   |
|------------------------|-------------------|
| 成交总额                   |                   |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 26,987,604,714.19 |
| 减：应计利息总额               | 111,653,157.98    |
| 减：交易费用                 | -                 |
| 买卖债券差价收入               | 2,861,924.23      |

**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**

无。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.17 其他收入**

无。

**6.4.7.18 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       | 67,332.88               |
| 信息披露费      | 59,672.34               |
| 证券出借违约金    | -                       |
| 汇划手续费      | 8,595.90                |
| 银行间债券账户维护费 | 9,000.00                |
| 上清所账户维护费   | 9,600.00                |
| 合计         | 154,201.12              |

**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 |
| 交通银行股份有限公司("交通银行")   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 山西证券股份有限公司("山西证券")   | 见注释①                |
| 汇丰银行(中国)有限公司("汇丰银行") | 见注释②                |
| 恒生银行(中国)有限公司("恒生银行") | 见注释③                |
| 汇丰保险经纪有限公司("汇丰保险")   | 见注释④                |

注:

① 山西证券与本基金管理人的股东-山西信托共同受山西金融投资控股集团有限公司控制。

② 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。

③ 恒生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。

④ 汇丰保险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<br>2024年01月01日至20<br>24年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 25,882,870.43                     | 17,447,084.69                          |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 3,477,985.70                      | 2,130,006.27                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 22,404,884.73                     | 15,317,078.42                          |

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0.28%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 X 0.28% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,243,882.20                      | 6,231,101.71                           |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 0.10% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |         |         |          |
|----------------------------|-------------------------------|---------|---------|----------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |         |         |          |
|                            | 汇丰晋信货币A                       | 汇丰晋信货币B | 汇丰晋信货币C | 合计       |
| 交通银行                       | 1,541.49                      | 47.14   | 0.00    | 1,588.63 |

|                |                                    |            |         |            |
|----------------|------------------------------------|------------|---------|------------|
| 汇丰银行           | 117,427.32                         | 338,261.39 | 0.00    | 455,688.71 |
| 恒生银行           | 11,393.06                          | 0.00       | 0.00    | 11,393.06  |
| 山西证券           | 18.20                              | 0.00       | 0.00    | 18.20      |
| 汇丰保险           | 54.78                              | 10.66      | 0.00    | 65.44      |
| 汇丰晋信           | 166.97                             | 513,048.14 | 0.00    | 513,215.11 |
| 合计             | 130,601.82                         | 851,367.33 | 0.00    | 981,969.15 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |            |         |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |            |         |            |
|                | 汇丰晋信货币A                            | 汇丰晋信货币B    | 汇丰晋信货币C | 合计         |
| 交通银行           | 2,179.79                           | 25.24      | 0.00    | 2,205.03   |
| 汇丰银行           | 143,319.70                         | 227,279.78 | 0.00    | 370,599.48 |
| 恒生银行           | 6,847.95                           | 0.00       | 0.00    | 6,847.95   |
| 山西证券           | 18.10                              | 0.00       | 0.00    | 18.10      |
| 汇丰保险           | 0.00                               | 0.00       | 0.00    | 0.00       |
| 汇丰晋信           | 1,074.07                           | 370,502.56 | 0.00    | 371,576.63 |
| 合计             | 153,439.61                         | 597,807.58 | 0.00    | 751,247.19 |

注：根据《关于汇丰晋信货币市场基金增加C级基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》以及更新的《汇丰晋信货币市场基金招募说明书》，本基金自2023年7月17日起增设C类基金份额。支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇丰晋信，再由汇丰晋信计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.01%和0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日A/B/C类基金份额的基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}$$

**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<br>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                  | 债券交易金额 |     | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                               | 基金买入   | 基金卖 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |

|                                    |                |      |       |      |       |      |
|------------------------------------|----------------|------|-------|------|-------|------|
| 名称                                 |                | 出    |       |      |       |      |
| 汇丰银行                               | 49,691,150.00  | -    | -     | -    | -     | -    |
| 交通银行                               | 198,093,121.89 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 恒生银行                               | -              | -    | -     | -    | -     | -    |
| 山西证券                               | 80,478,613.33  | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>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                               | 197,019,170.00 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 交通银行                               | 177,970,737.81 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 恒生银行                               | 302,732,320.00 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 山西证券                               | 281,477,522.32 | -    | -     | -    | -     | -    |

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

汇丰晋信货币A

份额单位：份

|                             |                                   |  |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 项目                          | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
| 基金合同生效日（2011年11月02日）持有的基金份额 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期初持有的基金份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额                | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |

|                     |       |       |
|---------------------|-------|-------|
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00  | 0.00  |
| 报告期末持有的基金份额         | 0.00  | 0.00  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 0.00% |

汇丰晋信货币B

份额单位：份

| 项目                          | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2011年11月02日）持有的基金份额 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期初持有的基金份额                 | 23,545,889.74                     | 23,110,719.78                          |
| 报告期间申购/买入总份额                | 222,047.80                        | 216,611.42                             |
| 报告期间因拆分变动份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额                 | 23,767,937.54                     | 23,327,331.20                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 0.13%                             | 0.19%                                  |

汇丰晋信货币C

份额单位：份

| 项目                          | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2011年11月02日）持有的基金份额 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期初持有的基金份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额                | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 0.00                              | 0.00                                   |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

**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**

**汇丰晋信货币A**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金A类份额。

**汇丰晋信货币B**

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2024年06月30日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 交通银行  | 708,507,530.56     | 3.83%            | 1,264,889,069.99    | 7.97%            |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

**汇丰晋信货币C**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金C类份额。

**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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 交通银行  | 5,478,948.84                  | 197,345.07 | 304,375,595.85                     | 456,949.54 |

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存

于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2024年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2023年12月31日：同)。

**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**

(1)于2024年6月30日，本基金持有15,400,000张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币1,528,106,991.26元，占基金净资产的比例为8.22%(2023年6月30日，本基金持有4,600,000张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币456,890,913.48元，占基金净资产的比例为3.64%)。

(2)于2024年6月30日，本基金持有300,000张汇丰银行的同业存单，账面价值为人民币29,924,278.90元，占基金净资产的比例为0.16% (于2023年6月30日，本基金持有4,000,000张汇丰银行的同业存单，账面价值为人民币397,145,608.69元，占基金净资产的比例为3.17%)。

(3)于2024年6月30日，本基金持有300,000张恒生银行的同业存单，账面价值为人民币29,982,508.87元，占基金净资产的比例为0.16% (于2023年6月30日，本基金持有3,100,000张恒生银行的同业存单，账面价值为人民币304,217,109.08元，占基金净资产的比例为2.42%)。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金**

汇丰晋信货币A

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,015,610.85     | -                 | -4,433.39    | 1,011,177.46 | -  |

汇丰晋信货币B

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 164,318,110.52   | -                 | -201,926.70  | 164,116,183.82 | -  |

汇丰晋信货币C

单位：人民币元

| 已按再投资形式 | 直接通过应付 | 应付利润 | 本期利润 | 备注 |
|---------|--------|------|------|----|
|         |        |      |      |    |



|          |         |       |          |   |
|----------|---------|-------|----------|---|
| 转实收基金    | 赎回款转出金额 | 本年变动  | 分配合计     |   |
| 2,310.79 | -       | 18.88 | 2,329.67 | - |

**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**

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。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管人交通银行；其他定期存款存放在具有基金托管资格的中国银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的10%。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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,220,009,487.45   | 1,376,775,503.50    |
| 合计     | 1,220,009,487.45   | 1,376,775,503.50    |

注：未评级债券为政策性金融债、短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

|       | 2024年06月30日      | 2023年12月31日      |
|-------|------------------|------------------|
| A-1   | -                | -                |
| A-1以下 | -                | -                |
| 未评级   | 9,668,527,430.32 | 7,358,540,094.84 |
| 合计    | 9,668,527,430.32 | 7,358,540,094.84 |

#### 6.4.13.2.3 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 112,699,537.91     | 102,624,657.96      |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 205,187,028.79     | 780,674,373.40      |
| 合计     | 317,886,566.70     | 883,299,031.36      |

注：未评级债券为政策性金融债、中期票据。

#### 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。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。于2024年06月30日，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为44%，本基金投资组合的平均剩余期限为68天，平均剩余存续期为68天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为22.02%。

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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

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10%。于2024年06月30日，本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为3.75%。

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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年<br>06月30<br>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                       | 1,408,017,004.70  | -                | 30,227,733.74    | -    | -    | -              | 1,438,244,738.44  |
| 结算备付金                      | 587,546,819.62    | -                | -                | -    | -    | -              | 587,546,819.62    |
| 交易性金融资产                    | 3,746,314,455.85  | 2,520,507,490.06 | 4,939,601,538.56 | -    | -    | -              | 11,206,423,484.47 |
| 买入返售金融资产                   | 4,528,344,521.75  | -                | -                | -    | -    | -              | 4,528,344,521.75  |
| 应收清算款                      | -                 | -                | -                | -    | -    | 40,856,702.51  | 40,856,702.51     |
| 应收申购款                      | -                 | -                | -                | -    | -    | 944,020,856.51 | 944,020,856.51    |
| 资产总计                       | 10,270,222,801.92 | 2,520,507,490.06 | 4,969,829,272.30 | -    | -    | 984,877,559.02 | 18,745,437,123.30 |
| 负债                         |                   |                  |                  |      |      |                |                   |
| 应付清算款                      | -                 | -                | -                | -    | -    | 136,096,608.77 | 136,096,608.77    |

|                             |                   |                  |                  |      |      |                  |                   |
|-----------------------------|-------------------|------------------|------------------|------|------|------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬                     | -                 | -                | -                | -    | -    | 4,721,709.67     | 4,721,709.67      |
| 应付托管费                       | -                 | -                | -                | -    | -    | 1,686,324.85     | 1,686,324.85      |
| 应付销售服务费                     | -                 | -                | -                | -    | -    | 191,737.23       | 191,737.23        |
| 应交税费                        | -                 | -                | -                | -    | -    | 76,489.15        | 76,489.15         |
| 应付利润                        | -                 | -                | -                | -    | -    | 742,896.16       | 742,896.16        |
| 其他负债                        | -                 | -                | -                | -    | -    | 221,439.70       | 221,439.70        |
| 负债总计                        | -                 | -                | -                | -    | -    | 143,737,205.53   | 143,737,205.53    |
| 利率敏感度缺口                     | 10,270,222,801.92 | 2,520,507,490.06 | 4,969,829,272.30 | -    | -    | 841,140,353.49   | 18,601,699,917.77 |
| 上年度末<br>2023年<br>12月31<br>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                        | 801,138,447.15    | 40,339,689.52    | 90,296,208.09    | -    | -    | -                | 931,774,344.76    |
| 结算备付金                       | 867,486,049.85    | -                | -                | -    | -    | -                | 867,486,049.85    |
| 交易性金融资产                     | 1,996,013,452.52  | 4,381,785,998.89 | 3,240,815,178.29 | -    | -    | -                | 9,618,614,629.70  |
| 买入返售金融资产                    | 4,673,534,478.40  | -                | -                | -    | -    | -                | 4,673,534,478.40  |
| 应收申购款                       | -                 | -                | -                | -    | -    | 1,327,374,703.94 | 1,327,374,703.94  |
| 资产总计                        | 8,338,172,427.92  | 4,422,125,688.41 | 3,331,111,386.38 | -    | -    | 1,327,374,703.94 | 17,418,784,206.65 |
| 负债                          |                   |                  |                  |      |      |                  |                   |
| 应付清算款                       | -                 | -                | -                | -    | -    | 1,388,307,126.29 | 1,388,307,126.29  |

|         |                  |                  |                  |   |   |                  |                   |
|---------|------------------|------------------|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | -                | -                | -                | - | - | 3,463,166.28     | 3,463,166.28      |
| 应付托管费   | -                | -                | -                | - | - | 1,236,845.14     | 1,236,845.14      |
| 应付销售服务费 | -                | -                | -                | - | - | 156,840.02       | 156,840.02        |
| 应交税费    | -                | -                | -                | - | - | 103,760.22       | 103,760.22        |
| 应付利润    | -                | -                | -                | - | - | 949,237.37       | 949,237.37        |
| 其他负债    | -                | -                | -                | - | - | 351,204.19       | 351,204.19        |
| 负债总计    | -                | -                | -                | - | - | 1,394,568,179.51 | 1,394,568,179.51  |
| 利率敏感度缺口 | 8,338,172,427.92 | 4,422,125,688.41 | 3,331,111,386.38 | - | - | -67,193,475.57   | 16,024,216,027.14 |

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**

| 假设 | 除市场利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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2024年06月30日              | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 1.市场利率上升25个基点      | -7,961,982.62                   | -4,936,241.42       |
|    | 2.市场利率下降25个基点      | 7,982,223.31                    | 4,943,961.64        |

**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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 11,206,423,484.47  | 9,618,614,629.70    |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 11,206,423,484.47  | 9,618,614,629.70    |

###### 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 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  | 固定收益投资            | 11,206,423,484.47 | 59.78        |
|    | 其中：债券             | 11,206,423,484.47 | 59.78        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 4,528,344,521.75  | 24.16        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,025,791,558.06  | 10.81        |
| 4  | 其他各项资产            | 984,877,559.02    | 5.25         |
| 5  | 合计                | 18,745,437,123.30 | 100.00       |

**7.2 债券回购融资情况**

无。

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明**

无。

**7.3 基金投资组合平均剩余期限**

**7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况**

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 68 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 76 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 46 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明  
无。

**7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例**

| 序号 | 平均剩余期限               | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|----|----------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30天以内                | 53.75              | 0.73               |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 11.70              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60天(含)—90天           | 3.43               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)—120天          | 2.94               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 23.77              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
|    | 合计                   | 95.58              | 0.73               |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明  
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               | 224,711,261.04    | 1.21  |
|    | 其中：政策性金融债          | 224,711,261.04    | 1.21  |
| 4  | 企业债券               | -                 | -     |
| 5  | 企业短期融资券            | 1,169,730,062.45  | 6.29  |
| 6  | 中期票据               | 143,454,730.66    | 0.77  |
| 7  | 同业存单               | 9,668,527,430.32  | 51.98 |
| 8  | 其他                 | -                 | -     |
| 9  | 合计                 | 11,206,423,484.47 | 60.24 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                 | -     |

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 债券数量(张)   | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112405076 | 24建设银行CD076 | 5,000,000 | 499,823,829.39 | 2.69         |
| 2  | 112406166 | 24交通银行CD166 | 2,900,000 | 287,883,548.90 | 1.55         |
| 3  | 112304020 | 23中国银行CD020 | 2,600,000 | 259,752,663.77 | 1.40         |
| 4  | 112304047 | 23中国银行CD047 | 2,500,000 | 248,462,186.15 | 1.34         |
| 5  | 112304021 | 23中国银行CD021 | 2,000,000 | 199,809,369.67 | 1.07         |
| 6  | 112304032 | 23中国银行CD032 | 2,000,000 | 199,681,649.08 | 1.07         |
| 7  | 112403132 | 24农业银行CD132 | 2,000,000 | 198,437,993.62 | 1.07         |
| 8  | 112406035 | 24交通银行CD035 | 2,000,000 | 197,508,516.14 | 1.06         |
| 9  | 112405123 | 24建设银行CD123 | 2,000,000 | 196,522,423.27 | 1.06         |

|    |           |                 |           |                    |      |
|----|-----------|-----------------|-----------|--------------------|------|
| 10 | 112304025 | 23中国银行CD0<br>25 | 1,900,000 | 189,696,675.2<br>6 | 1.02 |
|----|-----------|-----------------|-----------|--------------------|------|

**7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离**

| 项目                           | 偏离情况    |
|------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.0590% |
| 报告期内偏离度的最低值                  | 0.0180% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0381% |

注：以上数据按交易日统计。

**报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明**

无。

**报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明**

无。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

无。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1 基金计价方法说明**

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

**7.9.2 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。**

**7.9.3 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 | -  |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 2 | 应收清算款 | 40,856,702.51  |
| 3 | 应收利息  | -              |
| 4 | 应收申购款 | 944,020,856.51 |
| 5 | 其他应收款 | -              |
| 6 | 待摊费用  | -              |
| 7 | 其他    | -              |
| 8 | 合计    | 984,877,559.02 |

**7.9.4 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

| 份额级别    | 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  |
| 汇丰晋信货币A | 2,072    | 56,853.88      | 22.00             | 0.00%  | 117,801,215.35 | 100.00% |
| 汇丰晋信货币B | 149      | 124,049,710.49 | 18,382,279,360.54 | 99.45% | 101,127,502.03 | 0.55%   |
| 汇丰晋信货币C | 55       | 8,942.14       | 0.00              | 0.00%  | 491,817.85     | 100.00% |
| 合计      | 2,276    | 8,172,978.87   | 18,382,279,382.54 | 98.82% | 219,420,535.23 | 1.18%   |

注：由于小数点后保留位数限制的原因，期末汇丰晋信货币基金A机构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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况**

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份)          | 占总份额比例 |
|----|-------|------------------|--------|
| 1  | 其他机构  | 1,150,837,749.87 | 6.19%  |
| 2  | 其他机构  | 1,102,451,972.15 | 5.93%  |
| 3  | 其他机构  | 902,632,699.12   | 4.85%  |
| 4  | 其他机构  | 831,782,240.59   | 4.47%  |
| 5  | 其他机构  | 796,318,600.50   | 4.28%  |
| 6  | 其他机构  | 764,233,860.42   | 4.11%  |
| 7  | 其他机构  | 738,462,807.81   | 3.97%  |
| 8  | 银行类机构 | 709,266,773.03   | 3.81%  |
| 9  | 银行类机构 | 600,052,977.71   | 3.23%  |
| 10 | 其他机构  | 579,404,229.80   | 3.11%  |

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目               | 份额级别    | 持有份额总数<br>(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 | 汇丰晋信货币A | 703,016.93    | 0.5968%  |
|                  | 汇丰晋信货币B | 1,000,000.00  | 0.0054%  |
|                  | 汇丰晋信货币C | 111,807.25    | 22.7335% |
|                  | 合计      | 1,814,824.18  | 0.0098%  |

**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             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间<br>(万份) |
|----------------|---------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资 | 汇丰晋信货币A | 0                     |

|                  |         |       |
|------------------|---------|-------|
| 和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇丰晋信货币B | 0     |
|                  | 汇丰晋信货币C | 0     |
|                  | 合计      | 0     |
| 本基金基金经理持有本开放式基金  | 汇丰晋信货币A | 10~50 |
|                  | 汇丰晋信货币B | 0     |
|                  | 汇丰晋信货币C | 10~50 |
|                  | 合计      | 10~50 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 汇丰晋信货币A        | 汇丰晋信货币B           | 汇丰晋信货币C      |
|----------------------------|----------------|-------------------|--------------|
| 基金合同生效日(2011年11月02日)基金份额总额 | 665,979,996.74 | 489,034,226.06    | -            |
| 本报告期期初基金份额总额               | 158,748,615.88 | 15,865,454,164.08 | 13,247.18    |
| 本报告期基金总申购份额                | 328,501,083.83 | 54,396,004,328.15 | 1,201,928.16 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 369,448,462.36 | 51,778,051,629.66 | 723,357.49   |
| 本报告期期末基金份额总额               | 117,801,237.35 | 18,483,406,862.57 | 491,817.85   |

注：总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额；总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

### §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

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于2015年4月18日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），并报中国证券监督管理委员会备案。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。

### 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 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：

- 1、报告期内无新增的交易单元；
  - 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 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|-----|------|--------|------|------|
|-----|------|--------|------|------|

| 称    | 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 | -    | -            | 325,382,880,000.00 | 96.91%         | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | 10,364,026,000.00  | 3.09%          | -    | -            | -    | -            |

**10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况**

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

**10.9 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  | 关于汇丰晋信货币市场基金于2024年春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告             | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-01-26 |
| 3  | 关于汇丰晋信货币市场基金A级份额暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告                  | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-06 |
| 4  | 汇丰晋信基金管理有限公司关于汇丰晋信货币市场基金A级、C级基金份额变更收益分配原则并修订基金合同及托管协议的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-06 |
| 5  | 汇丰晋信基金管理有限公司汇丰晋信货币市场基金取消自动升降级业务并调整B级基金份额交易限额与最低持有份额的公告   | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-06 |

|    |  |                 |            |
|----|--|-----------------|------------|
| 6  | 汇丰晋信货币市场基金基金合同                               | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-06 |
| 7  | 汇丰晋信货币市场基金托管协议                               | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-06 |
| 8  | 汇丰晋信货币市场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 | 2024-03-11 |
| 9  | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新A类份额                     | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-11 |
| 10 | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新B类份额                     | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-11 |
| 11 | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新C类份额                     | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-11 |
| 12 | 关于汇丰晋信货币市场基金A类份额在盈米基金渠道暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-15 |
| 13 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增盈米基金为汇丰晋信货币市场基金C类份额代销机构的公告   | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-15 |
| 14 | 关于汇丰晋信货币市场基金于2024年清明假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-03-25 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 | 2024-04-22 |
| 17 | 关于汇丰晋信货币市场基金于2024年五一假期前暂停申购、转换转入及定期定额投       | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-04-23 |

|    |                             |                 |            |
|----|-----------------------------|-----------------|------------|
|    | 资业务的公告                      |                 |            |
| 18 | 汇丰晋信货币市场基金更新招募说明书（2024年第2号） | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 19 | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新A类份额    | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 20 | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新B类份额    | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2024-06-28 |
| 21 | 汇丰晋信货币市场基金基金产品资料概要更新C类份额    | 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**  
无。

**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

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信货币市场基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信货币市场基金基金合同
- 3) 汇丰晋信货币市场基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信货币市场基金托管协议
- 5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 6) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8) 报告期内汇丰晋信货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告
- 9) 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