

# 汇丰晋信货币市场基金

## 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示 .....1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介.....5

2.1 基金基本情况 .....5

2.2 基金产品说明 .....5

2.3 基金管理人和基金托管人 .....6

2.4 信息披露方式 .....6

2.5 其他相关资料 .....6

§ 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 .....7

§ 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 .....17

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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 18        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 18        |
| 6.2 利润表                                 | 19        |
| 6.3 净资产变动表                              | 21        |
| 6.4 报表附注                                | 22        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>51</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 51        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 51        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 52        |
| 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         | 52        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 52        |
| 7.6 期末按公允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      | 53        |
| 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      | 53        |
| 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  | 54        |
| 7.9 投资组合报告附注                            | 54        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息</b>                    | <b>55</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 55        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况                  | 55        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 55        |
| 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 .....   | 56        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>56</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>56</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 57        |
| 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 .....   | 57        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 57        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 57        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 57        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 57        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 57        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....              | 59        |
| 10.9 其他重大事件 .....                        | 59        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>60</b> |
| 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        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 60        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 60        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 60        |

§ 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<br>额总额          | 28,457,241,121.01 份 |                         |                     |                    |
| 基金合同存续期                 | 不定期                 |                         |                     |                    |
| 下属分级基金的<br>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            | 汇丰晋信货币 D           |
| 下属分级基金的<br>交易代码         | 540011              | 541011                  | 018782              | 021907             |
| 报告期末下属分<br>级基金的份额总<br>额 | 92,056,584.07<br>份  | 28,216,635,815.<br>08 份 | 119,325,826.56<br>份 | 29,222,895.30<br>份 |

注：本基金自 2023 年 7 月 17 日起增加 C 类份额，自 2024 年 7 月 22 日起增加 D 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，优先选择央票、短期国债等高信用等级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，本基金会紧密关注申购/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   |      | 刘鹏飞                                    | 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》                                                                           |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.hsbcjt.cn                                                                     |
| 基金中期报告置备地点        | 汇丰晋信基金管理有限公司：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼； 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（2026 年 01 月 01 日-2026 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       | 汇丰晋信货币 D      |
| 本期已实现收益       | 417,797.13                             | 153,613,838.98    | 473,464.19     | 128,528.63    |
| 本期利润          | 417,797.13                             | 153,613,838.98    | 473,464.19     | 128,528.63    |
| 本期净值收益率       | 0.4393%                                | 0.5590%           | 0.5590%        | 0.4840%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2026 年 06 月 30 日）                 |                   |                |               |
| 期末基金资产净值      | 92,056,584.07                          | 28,216,635,815.08 | 119,325,826.56 | 29,222,895.30 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                 | 1.0000            | 1.0000         | 1.0000        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2026 年 06 月 30 日）                 |                   |                |               |
| 累计净值收益率       | 37.0913%                               | 42.0076%          | 4.4963%        | 2.2791%       |

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。

③本基金自 2023 年 7 月 17 日起增加 C 类份额,自 2024 年 7 月 22 日起增加 D 类份额。

④本基金 A 级、C 级、D 级基金份额收益分配按“每日分配、按日支付”。

⑤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 净值表现

| 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     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.2118%  | 0.0007%     | 0.3366%    | 0.0000%       | -0.1248% | 0.0007% |
| 过去六个月 | 0.4393%  | 0.0006%     | 0.6695%    | 0.0000%       | -0.2302% | 0.0006% |
| 过去一年  | 0.9187%  | 0.0005%     | 1.3500%    | 0.0000%       | -0.4313% | 0.0005% |

|            |          |         |          |         |          |         |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 过去三年       | 3.8333%  | 0.0010% | 4.0537%  | 0.0000% | -0.2204% | 0.0010% |
| 过去五年       | 7.2555%  | 0.0012% | 6.7537%  | 0.0000% | 0.5018%  | 0.0012% |
| 过去七年       | 11.3918% | 0.0015% | 9.4574%  | 0.0000% | 1.9344%  | 0.0015% |
| 过去十年       | 20.9498% | 0.0023% | 13.5074% | 0.0000% | 7.4424%  | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.0913% | 0.0028% | 19.8932% | 0.0001% | 17.1981% | 0.0027% |

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去三年指 2023 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去五年指 2021 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去七年指 2019 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去十年指 2016 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2011 年 11 月 2 日-2026 年 6 月 30 日

汇丰晋信货币 B 净值表现

| 阶段         | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.2718%      | 0.0007%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.0648% | 0.0007% |
| 过去六个月      | 0.5590%      | 0.0006%             | 0.6695%        | 0.0000%               | -0.1105% | 0.0006% |
| 过去一年       | 1.1614%      | 0.0005%             | 1.3500%        | 0.0000%               | -0.1886% | 0.0005% |
| 过去三年       | 4.5840%      | 0.0010%             | 4.0537%        | 0.0000%               | 0.5303%  | 0.0010% |
| 过去五年       | 8.5498%      | 0.0012%             | 6.7537%        | 0.0000%               | 1.7961%  | 0.0012% |
| 过去七年       | 13.2787%     | 0.0015%             | 9.4574%        | 0.0000%               | 3.8213%  | 0.0015% |
| 过去十年       | 23.8904%     | 0.0023%             | 13.5074%       | 0.0000%               | 10.3830% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.0076%     | 0.0028%             | 19.8932%       | 0.0001%               | 22.1144% | 0.0027% |

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去三年指 2023 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去五年指 2021 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去七年指 2019 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去十年指 2016 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2011 年 11 月 2 日-2026 年 6 月 30 日

汇丰晋信货币 C 净值表现

| 阶段 | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差 | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------------|----------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|--------------|----------------|----------------|----------------|-----|-----|

|       |         | ②       |         | 准差④     |          |         |
|-------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.2718% | 0.0007% | 0.3366% | 0.0000% | -0.0648% | 0.0007% |
| 过去六个月 | 0.5590% | 0.0006% | 0.6695% | 0.0000% | -0.1105% | 0.0006% |
| 过去一年  | 1.1614% | 0.0005% | 1.3500% | 0.0000% | -0.1886% | 0.0005% |
| 成立至今  | 4.4963% | 0.0010% | 3.9945% | 0.0000% | 0.5018%  | 0.0010% |

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

成立至今指 2023 年 7 月 17 日-2026 年 6 月 30 日

汇丰晋信货币 D 净值表现

| 阶段    | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③      | ②－④     |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.2341%      | 0.0007%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.1025% | 0.0007% |
| 过去六个月 | 0.4840%      | 0.0006%             | 0.6695%        | 0.0000%               | -0.1855% | 0.0006% |
| 过去一年  | 1.0055%      | 0.0006%             | 1.3500%        | 0.0000%               | -0.3445% | 0.0006% |
| 成立至今  | 2.2791%      | 0.0008%             | 2.6223%        | 0.0000%               | -0.3432% | 0.0008% |

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去六个月指 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

过去一年指 2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

成立至今指 2024 年 7 月 22 日-2026 年 6 月 30 日

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值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

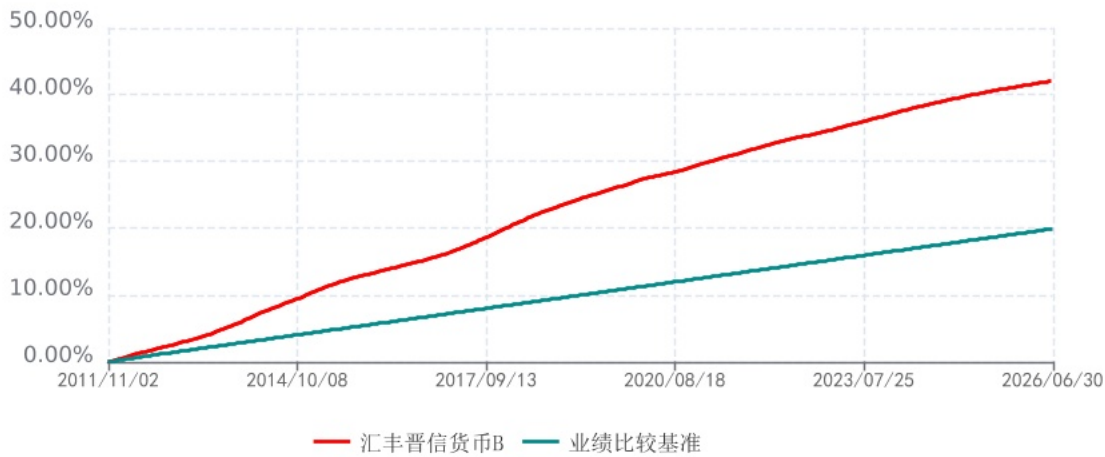
(2011年11月02日-2026年06月30日)



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-2026年06月30日)

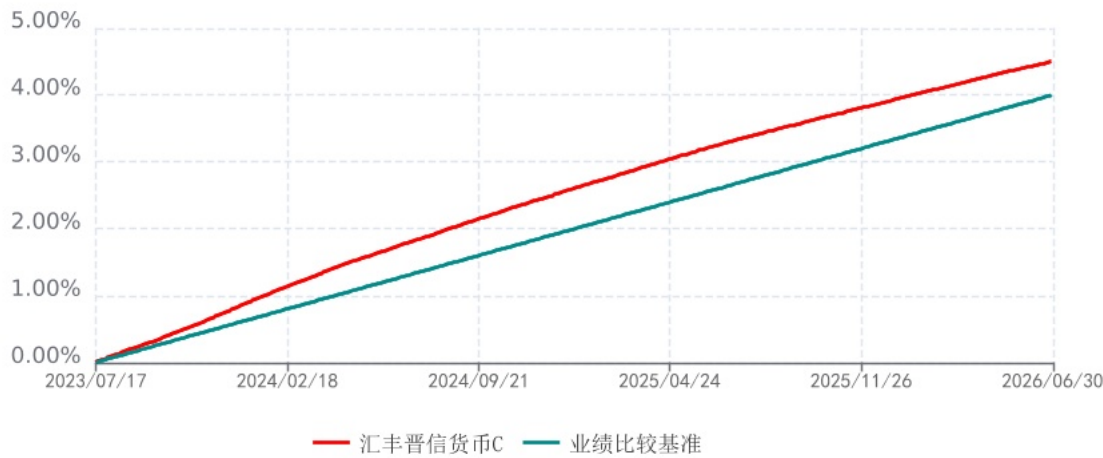


注：

- 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-2026年06月30日)

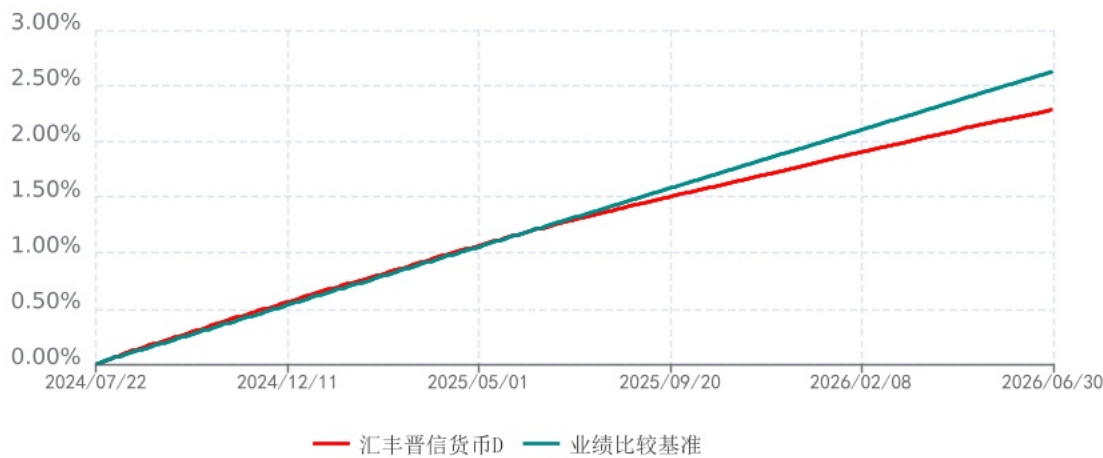


注：

- 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。

汇丰晋信货币D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年07月22日-2026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 2024 年 7 月 22 日起增加 D 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 44 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自 2020 年 11 月 19 日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011 年 7 月 27 日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 日成立）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014 年 11 月 26 日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015 年 9 月 30 日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016 年 3 月 11 日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016 年 11 月 10 日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017 年 6 月 2 日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018 年 11 月 14 日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019 年 3 月 20 日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019 年 8 月 2 日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020 年 7 月 30 日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020 年 8 月 13 日成立）、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金（2020 年 10 月 29 日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021 年 3 月 16 日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021 年 5 月 24 日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021 年 7 月 12 日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022 年 1 月 21 日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022 年 3 月 3 日

成立)、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金(2022 年 6 月 8 日成立)、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金(2022 年 8 月 16 日成立)、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金(2022 年 9 月 14 日成立)、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金(2022 年 9 月 27 日成立)、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金(2022 年 12 月 20 日成立)、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(2023 年 12 月 12 日成立)、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金(2024 年 4 月 16 日成立)、汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2024 年 6 月 12 日成立)、汇丰晋信绿色债券型证券投资基金(2024 年 12 月 11 日成立)、汇丰晋信景气优选混合型证券投资基金(2025 年 5 月 28 日成立)、汇丰晋信港股通核心资产股票型发起式证券投资基金(2025 年 8 月 12 日成立)、汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)(2026 年 1 月 20 日成立)、汇丰晋信周期优选股票型证券投资基金(2026 年 3 月 11 日成立)、汇丰晋信港股精选股票型证券投资基金(QDII)(2026 年 4 月 30 日成立)和汇丰晋信慧泰债券型证券投资基金(2026 年 6 月 24 日成立)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                                  | 任本基金的基金经理（助理）<br>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<br>总监、汇丰晋<br>信货币市场基<br>金基金经理 | 2011-11-12          | -    | 21 年   | 李媛媛女士，<br>硕士研究生。<br>曾任广东发展<br>银行上海分行<br>国际部交易<br>员、法国巴黎<br>银行（中国）<br>有限公司资金<br>部交易员、比<br>利时富通银行<br>上海分行环球<br>市场部交易<br>员、汇丰晋信<br>基金管理有限<br>公司投资经<br>理、投资部固<br>定收益副总<br>监、汇丰晋信<br>平稳增利债券<br>型证券投资基<br>金、汇丰晋信<br>慧悦混合型证<br>券投资基金基<br>金经理。现任<br>货币资产投资 |

|     |                                                                                                                                                       |            |   |       |                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                                                       |            |   |       | 总监、汇丰晋信货币市场基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                |
| 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、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放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 | 2021-02-18 | - | 9.5 年 | 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、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金以及汇丰晋信绿色债券型证券投资基金基金经理。 |
| 闫湜  | 汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定                                                                                                                            | 2024-12-21 | - | 13 年  | 闫湜女士，硕士研究生。曾任易方达基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                          |

|  |                          |  |  |  |                                                                                                                                                                          |
|--|--------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 期开放债券型<br>证券投资基金<br>基金经理 |  |  |  | 信用研究员、<br>富国基金管理<br>有限公司基金<br>经理助理、万<br>家基金管理有<br>限公司基金经<br>理助理，汇丰<br>晋信基金管理<br>有限公司基金<br>经理助理。现<br>任汇丰晋信货<br>币市场基金、<br>汇丰晋信惠安<br>纯债 63 个月<br>定期开放债券<br>型证券投资基金<br>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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交

易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年经济基本面呈现“总量降速、结构分化”的特征，债券市场收益率震荡下行。

一季度 GDP 同比增速实现 5.0%，而二季度 GDP 增速回落至 4.3%，上半年整体增速较去年有所放缓，经济内生动力偏弱。

2026 年上半年固定资产投资累计同比下降 5.7%，其中地产投资跌幅扩大到-18%，依然是最主要拖累项。基建投资增速也在 6 月转负（-2.4%），和上半年政府债发行节奏偏慢有关。制造业投资增速 5-6 月为负，新动能对制造业投资支撑有限；上半年社会消费品零售总额同比持续走弱，5 月增速落入负区间，6 月小幅回升但幅度有限；在 AI 产业需求带动下上半年我国出口累计同比增速达到 17.6%，短期内依然有支撑；上半年规模以上工业增加值累计同比增速 5.4%，主要通过高新制造业的拉动；制造业 PMI 3-6 月持续在扩张区间，但依然呈现生产强于需求特征。整体而言，新经济的扩张较难完全对冲传统领域的变化，需求不足的问题依然存在。

2026 年上半年债券收益率先下后上，年初以来权益市场较强持续压制债券表现，1 月下旬起在流动性宽松预期下收益率不断下行，2-3 月受海外不确定性、通胀预期、经济数据等多种因素影响债市较为震荡，随后 4 月起在信贷需求疲弱叠加政府债发行节奏偏慢的背景下，银行间流动性自发式宽松，长端收益率快速下行，5 月下旬央行开始逐步引导资金面回归中性，债市收益率跟随流动性收紧有所调整。截至 6 月 30 日，10 年期国债较年初下行 12BP 至 1.73%。

回顾 2026 年上半年货币基金的操作，本基金的总体原则是在保障组合流动性安全的前提下，根据市场变化动态调整投资策略，优化资产配置以实现收益的增厚。2026 年上半年，本基金根据市场情况及时调整久期，并且在月末、季末等时点提前调整组合的流动性资产配置，在提升收益的前提下保障组合流动性安全。

#### 4.4.2 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 0.4393%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，本基金 A 类落后同期比较基准 0.2302%；本基金 B 类基金份额净值增长率为 0.5590%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，本基金 B 类落后同期比较基准 0.1105%；本基金 C 类基金份额

净值增长率为 0.5590%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，本基金 C 类落后同期比较基准 0.1105%；本基金 D 类基金份额净值增长率为 0.4840%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，本基金 D 类落后同期比较基准 0.1855%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

鉴于今年的经济增长目标变为区间，对经济增速的诉求有一定弹性。下半年逆周期调节政策或更重视精准支持，基建投资可能是有效抓手。政治局会议提到“实施好更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，货币政策依然可能会在“支持性”基调下精准调节，整体环境依然有利于债市表现。

在经济弱复苏的情况下，预计货币政策依然会保持“支持性”定调。政府债供给加大可能给资金面带来部分压力，但央行通过隔夜逆回购等工具在关键时点对于资金面的调节更为精准，资金面的波动性或有所下降。

#### 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、本基金 A 级、C 级、D 级基金份额收益分配按“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：154,633,628.93 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，基金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遵规守信、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：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         |                         |                          |
| 货币资金    | 6.4.7.1 | 11,865,942,438.89       | 7,695,500,721.32         |
| 结算备付金   |         | 94,393,153.10           | 224,843,302.59           |
| 存出保证金   |         | 26,742.91               | —                        |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 12,352,813,180.64       | 13,672,603,206.81        |
| 其中：股票投资 |         | —                       | —                        |
| 基金投资    |         | —                       | —                        |
| 债券投资    |         | 12,352,813,180.64       | 13,672,603,206.81        |
| 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 | 6,984,597,497.47        | 7,236,798,399.92         |
| 应收清算款     |         | -                       | 150,060,753.49           |
| 应收股利      |         | -                       | -                        |
| 应收申购款     |         | -                       | 1,028.94                 |
| 递延所得税资产   |         | -                       | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                       | -                        |
| 资产总计      |         | 31,297,773,013.01       | 28,979,807,413.07        |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| 负 债:      |         |                         |                          |
| 短期借款      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融负债   |         | -                       | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |         | -                       | -                        |
| 应付清算款     |         | 2,829,406,713.79        | 732,203,949.98           |
| 应付赎回款     |         | 138,435.33              | 19,869.10                |
| 应付管理人报酬   |         | 6,733,946.54            | 5,929,057.42             |
| 应付托管费     |         | 2,404,980.90            | 2,117,520.52             |
| 应付销售服务费   |         | 262,306.01              | 235,781.43               |
| 应付投资顾问费   |         | -                       | -                        |
| 应交税费      |         | 97,019.59               | 40,771.72                |
| 应付利润      |         | 841,074.06              | 1,041,836.45             |
| 递延所得税负债   |         | -                       | -                        |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 647,415.78              | 725,780.02               |
| 负债合计      |         | 2,840,531,892.00        | 742,314,566.64           |
| 净资产:      |         |                         |                          |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 28,457,241,121.01       | 28,237,492,846.43        |
| 未分配利润     | 6.4.7.8 | -                       | -                        |
| 净资产合计     |         | 28,457,241,121.01       | 28,237,492,846.43        |
| 负债和净资产总计  |         | 31,297,773,013.01       | 28,979,807,413.07        |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 28,457,241,121.01 份，其中 A 类基金份额总额 92,056,584.07 份，B 类基金份额总额 28,216,635,815.08 份，C 类基金份额总额 119,325,826.56 份，D 类基金份额总额 29,222,895.30 份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

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

单位：人民币元

|     |     |    |         |
|-----|-----|----|---------|
| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|

|                                 |            | 2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|---------------------------------|------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                  |            | 208,713,328.81                        | 189,541,194.17                        |
| 1. 利息收入                         |            | 96,550,191.26                         | 68,821,918.90                         |
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.7.9    | 68,340,655.29                         | 30,085,248.96                         |
| 债券利息收入                          |            | —                                     | —                                     |
| 资产支持证券<br>利息收入                  |            | —                                     | —                                     |
| 买入返售金融<br>资产收入                  |            | 28,209,535.97                         | 38,736,669.94                         |
| 其他利息收入                          |            | —                                     | —                                     |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列）           |            | 112,163,137.55                        | 120,719,275.27                        |
| 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   | 112,163,137.55                        | 120,719,275.27                        |
| 资产支持证券<br>投资收益                  | 6.4.7.12   | —                                     | —                                     |
| 贵金属投资收<br>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<br>（损失以“-”号填<br>列）  | 6.4.7.16   | —                                     | —                                     |
| 4. 汇兑收益（损失以<br>“-”号填列）          |            | —                                     | —                                     |
| 5. 其他收入（损失以<br>“-”号填列）          | 6.4.7.17   | —                                     | —                                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 54,079,699.88                         | 41,597,401.10                         |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 38,596,751.76                         | 29,634,946.18                         |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 13,784,554.17                         | 10,583,909.38                         |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 1,511,752.47                          | 1,219,481.43                          |
| 4. 投资顾问费                        |            | —                                     | —                                     |
| 5. 利息支出                         |            | —                                     | —                                     |
| 其中：卖出回购金融<br>资产支出               |            | —                                     | —                                     |
| 6. 信用减值损失                       |            | —                                     | —                                     |
| 7. 税金及附加                        |            | 63,903.13                             | 35,025.07                             |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.18   | 122,738.35                            | 124,039.04                            |
| <b>三、利润总额（亏损<br/>总额以“-”号填列）</b> |            | 154,633,628.93                        | 147,943,793.07                        |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 154,633,628.93 | 147,943,793.07 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -              | -              |
| 六、综合收益总额          |  | 154,633,628.93 | 147,943,793.07 |

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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                                      | 本期                                 |                 |                    |
|------------------------------------------|------------------------------------|-----------------|--------------------|
|                                          | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                 |                    |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 28,237,492,846.43                  | -               | 28,237,492,846.43  |
| 二、本期期初净资产                                | 28,237,492,846.43                  | -               | 28,237,492,846.43  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 219,748,274.58                     | -               | 219,748,274.58     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 154,633,628.93  | 154,633,628.93     |
| （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）      | 219,748,274.58                     | -               | 219,748,274.58     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 82,586,590,100.39                  | -               | 82,586,590,100.39  |
| 2. 基金赎回款                                 | -82,366,841,825.81                 | -               | -82,366,841,825.81 |
| （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） | -                                  | -154,633,628.93 | -154,633,628.93    |
| 四、本期期末净资产                                | 28,457,241,121.01                  | -               | 28,457,241,121.01  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间                            |                 |                    |
|                                          | 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |                 |                    |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 21,680,162,992.96                  | -               | 21,680,162,992.96  |
| 二、本期期初净资产                                | 21,680,162,992.96                  | -               | 21,680,162,992.96  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 1,623,908,036.53                   | -               | 1,623,908,036.53   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 147,943,793.07  | 147,943,793.07     |
| （二）、本期基金份额                               | 1,623,908,036.53                   | -               | 1,623,908,036.53   |

|                                          |                    |                 |                    |
|------------------------------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| 交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）                |                    |                 |                    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 65,201,069,550.83  | -               | 65,201,069,550.83  |
| 2. 基金赎回款                                 | -63,577,161,514.30 | -               | -63,577,161,514.30 |
| （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） | -                  | -147,943,793.07 | -147,943,793.07    |
| 四、本期期末净资产                                | 23,304,071,029.49  | -               | 23,304,071,029.49  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 李选进      | 苑忠磊       | 张薇      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信货币市场基金(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)CR No. 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《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。根据《关于汇丰晋信货币市场基金增加 D 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 2024 年 7 月 22 日起，本基金新增 D 类基金份额，本基金原有的 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 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、C 类基金份额和 D 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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信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 2026 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号

《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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>2026 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 6,851,260,660.25        |
| 等于：本金          | 6,849,058,254.31        |
| 加：应计利息         | 2,202,405.94            |
| 减：坏账准备         | -                       |
| 定期存款           | 5,014,681,778.64        |
| 等于：本金          | 5,000,000,000.00        |
| 加：应计利息         | 14,681,778.64           |
| 减：坏账准备         | -                       |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       |
| 存款期限 1-3 个月    | 801,122,833.46          |
| 存款期限 3 个月以上    | 4,213,558,945.18        |
| 其他存款           | -                       |
| 等于：本金          | -                       |
| 加：应计利息         | -                       |
| 减：坏账准备         | -                       |
| 合计             | 11,865,942,438.89       |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |                   |              |         |
|--------|-------|-------------------------|-------------------|--------------|---------|
|        |       | 按实际利率计<br>算的账面价值        | 影子定价              | 偏离金额         | 偏离度 (%) |
| 债券     | 交易所市场 | 468,927,799.41          | 467,962,824.68    | -964,974.73  | -0.0034 |
|        | 银行间市场 | 11,883,885,381.23       | 11,890,840,645.60 | 6,955,264.37 | 0.0244  |
|        | 合计    | 12,352,813,180.64       | 12,358,803,470.28 | 5,990,289.64 | 0.0211  |
| 资产支持证券 |       | -                       | -                 | -            | -       |
| 合计     |       | 12,352,813,180.64       | 12,358,803,470.28 | 5,990,289.64 | 0.0211  |

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 2026 年 06 月 30 日 |           |
|-------|----------------------|-----------|
|       | 账面余额                 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 6,984,597,497.47     | -         |
| 银行间市场 | -                    | -         |
| 合计    | 6,984,597,497.47     | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                |
| 应付赎回费       | 1,957.96         |
| 应付证券出借违约金   | -                |
| 应付交易费用      | 36,570.00        |
| 其中：交易所市场    | -                |
| 银行间市场       | 36,570.00        |
| 应付利息        | -                |
| 预提费用        | 113,438.35       |
| 其他应付        | 495,449.47       |
| 合计          | 647,415.78       |

6.4.7.7 实收基金

汇丰晋信货币 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                                 |                |
|---------------|------------------------------------|----------------|
|               | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 上年度末          | 104,028,297.85                     | 104,028,297.85 |
| 本期申购          | 26,581,157.19                      | 26,581,157.19  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -38,552,870.97                     | -38,552,870.97 |
| 本期末           | 92,056,584.07                      | 92,056,584.07  |

汇丰晋信货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                                 |                    |
|---------------|------------------------------------|--------------------|
|               | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                    |
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额               |
| 上年度末          | 28,086,635,614.91                  | 28,086,635,614.91  |
| 本期申购          | 81,698,435,503.50                  | 81,698,435,503.50  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -81,568,435,303.33                 | -81,568,435,303.33 |
| 本期末           | 28,216,635,815.08                  | 28,216,635,815.08  |

汇丰晋信货币 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                                 |                 |
|---------------|------------------------------------|-----------------|
|               | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额            |
| 上年度末          | 30,802,491.94                      | 30,802,491.94   |
| 本期申购          | 778,780,101.45                     | 778,780,101.45  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -690,256,766.83                    | -690,256,766.83 |
| 本期末           | 119,325,826.56                     | 119,325,826.56  |

汇丰晋信货币 D

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                                 |                |
|---------------|------------------------------------|----------------|
|               | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 上年度末          | 16,026,441.73                      | 16,026,441.73  |
| 本期申购          | 82,793,338.25                      | 82,793,338.25  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -69,596,884.68                     | -69,596,884.68 |
| 本期末           | 29,222,895.30                      | 29,222,895.30  |

注：申购含红利再投、转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

汇丰晋信货币 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分 | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 上年度末           | -           | -     | -           |
| 本期期初           | -           | -     | -           |
| 本期利润           | 417,797.13  | -     | 417,797.13  |
| 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        | -417,797.13 | -     | -417,797.13 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

汇丰晋信货币 B

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | -               | -     | -               |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 153,613,838.98  | -     | 153,613,838.98  |
| 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        | -153,613,838.98 | -     | -153,613,838.98 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

汇丰晋信货币 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分 | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|-------|------------|
| 上年度末           | -          | -     | -          |
| 本期期初           | -          | -     | -          |
| 本期利润           | 473,464.19 | -     | 473,464.19 |
| 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  | -473,464.19 | - | -473,464.19 |
| 本期末      | -           | - | -           |

汇丰晋信货币 D

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分 | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 上年度末           | -           | -     | -           |
| 本期期初           | -           | -     | -           |
| 本期利润           | 128,528.63  | -     | 128,528.63  |
| 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        | -128,528.63 | -     | -128,528.63 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 40,355,028.24                            |
| 定期存款利息收入  | 26,874,584.04                            |
| 其他存款利息收入  | -                                        |
| 结算备付金利息收入 | 346,487.08                               |
| 其他        | 764,555.93                               |
| 合计        | 68,340,655.29                            |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 109,402,059.76                           |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,761,077.79                             |
| 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                           | 112,163,137.55                           |

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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 17,807,741,800.61                        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 17,733,149,702.28                        |
| 减：应计利息总额               | 71,832,520.54                            |
| 减：交易费用                 | -1,500.00                                |
| 买卖债券差价收入               | 2,761,077.79                             |

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                                 |
|---------|------------------------------------|
|         | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
| 审计费用    | 44,630.98                          |
| 信息披露费   | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 账户维护费   | 18,600.00                          |
| 合计      | 122,738.35                         |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 汇丰晋信基金管理有限公司（“汇丰晋信”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 38,596,751.76                               | 29,634,946.18                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 5,200,517.40                                | 4,351,586.68                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 33,396,234.36                               | 25,283,359.50                                    |

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×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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 13,784,554.17                               | 10,583,909.38                                    |

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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 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<br>A                                   | 汇丰晋信货币<br>B  | 汇丰晋信货币<br>C | 汇丰晋信货币<br>D | 合计           |
| 交通银行           | 1,049.01                                      | 575.21       | -           | -           | 1,624.22     |
| 汇丰银行           | 69,183.03                                     | 511,331.96   | -           | -           | 580,514.99   |
| 恒生银行           | 12,488.53                                     | -            | -           | -           | 12,488.53    |
| 山西证券           | 3.60                                          | -            | -           | -           | 3.60         |
| 汇丰保险           | 16.29                                         | -            | 4,173.37    | -           | 4,189.66     |
| 汇丰晋信           | 5.43                                          | 767,150.88   | -           | -           | 767,156.31   |
| 合计             | 82,745.89                                     | 1,279,058.05 | 4,173.37    | -           | 1,365,977.31 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 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<br>A                                   | 汇丰晋信货币<br>B  | 汇丰晋信货币<br>C | 汇丰晋信货币<br>D | 合计           |
| 交通银行           | 759.23                                        | 1,105.50     | -           | -           | 1,864.73     |
| 汇丰银行           | 95,297.73                                     | 441,311.05   | -           | -           | 536,608.78   |
| 恒生银行           | 11,622.86                                     | 148.07       | -           | -           | 11,770.93    |
| 山西证券           | 18.10                                         | -            | -           | -           | 18.10        |
| 汇丰保险           | 26.98                                         | -            | 578.83      | -           | 605.81       |
| 汇丰晋信           | 5.43                                          | 549,811.08   | -           | -           | 549,816.51   |
| 合计             | 107,730.33                                    | 992,375.70   | 578.83      | -           | 1,100,684.86 |

注：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、C 类基金份额和 D 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、C 类基金份额和 D 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%、0.01% 和 0.16%。

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A/B/C/D 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日      |                  |      |       |      |       |      |
|--------------------------------------------|------------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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                                       | 80,748,038.77    | -    | -     | -    | -     | -    |
| 交通银行                                       | 841,323,550.00   | -    | -     | -    | -     | -    |
| 恒生银行                                       | 1,249,777,380.00 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |                  |      |       |      |       |      |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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                                       | -                | -    | -     | -    | -     | -    |
| 交通银行                                       | 394,595,750.00   | -    | -     | -    | -     | -    |
| 恒生银行                                       | 396,379,800.00   | -    | -     | -    | -     | -    |

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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>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<br>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<br>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>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>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                      | 24,269,633.05                               | 23,953,356.77                                    |
| 报告期间申购/买入总份额                     | 138,336.38                                  | 171,905.07                                       |
| 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                      | 24,407,969.43                               | 24,125,261.84                                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 0.09%                                       | 0.10%                                            |

汇丰晋信货币 C

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>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 D

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年<br>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  
无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                                    |              | 上年度可比期间                               |               |
|-------|---------------------------------------|--------------|---------------------------------------|---------------|
|       | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月<br>30 日 |              | 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月<br>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  | 1,064,467.15                          | 2,145,029.57 | 678,451,347.60                        | 13,600,409.86 |

注：本基金的部分活期银行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。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 18,500,000.00 张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币 1,840,896,559.80 元，占基金净资产的比例为 6.47%(于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 22,200,000 张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币 2,209,440,628.29 元，占基金净资产的比例为 9.48%)。

(2)于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 7,100,000.00 张恒生银行的同业存单，账面价值为人民币 704,994,584.61 元，占基金净资产的比例为 2.48%(于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 2,500,000 张恒生银行的同业存单，账面价值为人民币 248,744,775.49 元，占基金净资产的比例为 1.07%)。

6.4.11 利润分配情况

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 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动  | 本期利润分配合计   | 备注 |
|------------------|---------------|-----------|------------|----|
| 418,450.60       | 389.27        | -1,042.74 | 417,797.13 | -  |

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 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动    | 本期利润分配合计       | 备注 |
|------------------|---------------|-------------|----------------|----|
| 140,063,558.70   | 13,752,608.47 | -202,328.19 | 153,613,838.98 | -  |

汇丰晋信货币 C

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付赎回款<br>转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|----------|------------|----|
| 470,660.39       | 413.14            | 2,390.66 | 473,464.19 | -  |

汇丰晋信货币 D

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付赎回款<br>转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|----------|------------|----|
| 127,719.35       | 591.40            | 217.88   | 128,528.63 | -  |

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的部分活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行；其他活期存款和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、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司和中国建设银行股份有限公司，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>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,196,907,168.29        | 624,933,708.22           |
| 合计     | 1,196,907,168.29        | 624,933,708.22           |

注：未评级债券为政策性金融债和短期融资券。

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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |

|     |                  |                   |
|-----|------------------|-------------------|
| 未评级 | 7,955,425,604.70 | 11,478,085,582.73 |
| 合计  | 7,955,425,604.70 | 11,478,085,582.73 |

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>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 1,387,577,849.41        | 98,207,346.38            |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,812,902,558.24        | 1,471,376,569.48         |
| 合计     | 3,200,480,407.65        | 1,569,583,915.86         |

注：未评级债券为政策性金融债、中期票据和企业债。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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 2026 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 52.29%，本基金投资组合的平均剩余期限为 64 天，平均剩余存续期为 82 天。

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 2026 年 06 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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>2026 年 06<br>月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|

| 资产      |                      |                      |                      |                  |   |   |                       |
|---------|----------------------|----------------------|----------------------|------------------|---|---|-----------------------|
| 货币资金    | 7, 151, 989, 160. 25 | 1, 907, 711, 917. 78 | 2, 806, 241, 360. 86 | -                | - | - | 11, 865, 942, 438. 89 |
| 结算备付金   | 94, 393, 153. 10     | -                    | -                    | -                | - | - | 94, 393, 153. 10      |
| 存出保证金   | 26, 742. 91          | -                    | -                    | -                | - | - | 26, 742. 91           |
| 交易性金融资产 | 4, 348, 459, 894. 46 | 2, 438, 068, 950. 46 | 5, 476, 189, 475. 42 | 90, 094, 860. 30 | - | - | 12, 3                 |

|              |                       |                      |                      |                   |   |   |                                                                              |
|--------------|-----------------------|----------------------|----------------------|-------------------|---|---|------------------------------------------------------------------------------|
|              |                       |                      |                      |                   |   |   | 5<br>2<br>,<br>8<br>1<br>3<br>,<br>1<br>8<br>0<br>.<br>6<br>4                |
| 买入返售金<br>融资产 | 6,984,597,4<br>97.47  | -                    | -                    | -                 | - | - | 6<br>,<br>9<br>8<br>4<br>,<br>5<br>9<br>7<br>,<br>4<br>9<br>7<br>.<br>4<br>7 |
| 资产总计         | 18,579,466,<br>448.19 | 4,345,78<br>0,868.24 | 8,282,430,8<br>36.28 | 90,094,8<br>60.30 | - | - | 3<br>1<br>,<br>2<br>9<br>7<br>,<br>7<br>3<br>,<br>0<br>1<br>3<br>.           |

|             |   |   |   |   |   |                          |                                                                              |
|-------------|---|---|---|---|---|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------|
|             |   |   |   |   |   |                          | 0<br>1                                                                       |
| 负债          |   |   |   |   |   |                          |                                                                              |
| 应付清算款       | - | - | - | - | - | 2, 829, 40<br>6, 713. 79 | 2<br>,<br>8<br>2<br>9<br>,<br>4<br>0<br>6<br>,<br>7<br>1<br>3<br>.<br>7<br>9 |
| 应付赎回款       | - | - | - | - | - | 138, 435.<br>33          | 1<br>3<br>8<br>,<br>4<br>3<br>5<br>.<br>3<br>3                               |
| 应付管理人<br>报酬 | - | - | - | - | - | 6, 733, 94<br>6. 54      | 6<br>,<br>7<br>3<br>3<br>3<br>,<br>9<br>4<br>6<br>.<br>5<br>4                |
| 应付托管费       | - | - | - | - | - | 2, 404, 98<br>0. 90      | 2<br>,<br>4                                                                  |

|             |   |   |   |   |   |                 |                                                |
|-------------|---|---|---|---|---|-----------------|------------------------------------------------|
|             |   |   |   |   |   |                 | 0<br>4<br>,<br>9<br>8<br>0<br>.<br>9<br>0      |
| 应付销售服<br>务费 | - | - | - | - | - | 262, 306.<br>01 | 2<br>6<br>2<br>,<br>3<br>0<br>6<br>.<br>0<br>1 |
| 应交税费        | - | - | - | - | - | 97, 019.5<br>9  | 9<br>7<br>,<br>0<br>1<br>9<br>.<br>5<br>9      |
| 应付利润        | - | - | - | - | - | 841, 074.<br>06 | 8<br>4<br>1<br>,<br>0<br>7<br>4<br>.<br>0<br>6 |
| 其他负债        | - | - | - | - | - | 647, 415.<br>78 | 6<br>4<br>7<br>,<br>4<br>1                     |

|                             |                   |                  |                  |               |       |                       |                                                                              |
|-----------------------------|-------------------|------------------|------------------|---------------|-------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------|
|                             |                   |                  |                  |               |       |                       | 5<br>·<br>7<br>8                                                             |
| 负债总计                        | -                 | -                | -                | -             | -     | 2,840,531,892.00      | 2<br>,<br>8<br>4<br>0<br>,<br>5<br>3<br>1<br>,<br>8<br>9<br>2<br>·<br>0<br>0 |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 18,579,466,448.19 | 4,345,780,868.24 | 8,282,430,836.28 | 90,094,860.30 | -     | -<br>2,840,531,892.00 | 2<br>,<br>4<br>5<br>7<br>,<br>2<br>4<br>1<br>,<br>1<br>2<br>1<br>·<br>0<br>1 |
| 上年度末<br>2025 年 12<br>月 31 日 | 1 个月以内            | 1-3 个月           | 3 个月-1 年         | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息                   | 合<br>计                                                                       |
| 资产                          |                   |                  |                  |               |       |                       |                                                                              |
| 货币资金                        | 5,642,362,096.31  | 1,402,568,777.97 | 650,569,847.04   | -             | -     | -                     | 7<br>,<br>6                                                                  |

|             |                      |                      |                      |   |   |   |                                                                                   |
|-------------|----------------------|----------------------|----------------------|---|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------|
|             |                      |                      |                      |   |   |   | 9<br>5<br>,<br>5<br>0<br>0<br>,<br>7<br>2<br>1<br>.<br>3<br>2                     |
| 结算备付金       | 224,843,302<br>.59   | -                    | -                    | - | - | - | 2<br>2<br>4<br>,<br>8<br>4<br>4<br>3<br>,<br>3<br>0<br>2<br>.<br>5<br>9           |
| 交易性金融<br>资产 | 1,661,266,0<br>72.07 | 3,829,34<br>9,534.05 | 8,181,987,6<br>00.69 | - | - | - | 1<br>3<br>,<br>6<br>7<br>2<br>,<br>6<br>0<br>3<br>,<br>2<br>0<br>6<br>.<br>8<br>1 |

|              |                   |                  |                  |   |   |                |                  |
|--------------|-------------------|------------------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 买入返售金<br>融资产 | 7,236,798,399.92  | -                | -                | - | - | -              | 7,236,798,399.92 |
| 应收清算款        | -                 | -                | -                | - | - | 150,060,753.49 | 150,060,753.49   |
| 应收申购款        | -                 | -                | -                | - | - | 1,028.94       | 1,028.94         |
| 资产总计         | 14,765,269,870.89 | 5,231,918,312.02 | 8,832,557,447.73 | - | - | 150,061,782.43 | 28,979           |

|         |   |   |   |   |   |                   |                                                                    |
|---------|---|---|---|---|---|-------------------|--------------------------------------------------------------------|
|         |   |   |   |   |   |                   | ，<br>8<br>0<br>7<br>，<br>4<br>1<br>3<br>·<br>0<br>7                |
| 负债      |   |   |   |   |   |                   |                                                                    |
| 应付清算款   | - | - | - | - | - | 732, 203, 949. 98 | 7<br>3<br>2<br>，<br>2<br>0<br>3<br>，<br>9<br>4<br>9<br>·<br>9<br>8 |
| 应付赎回款   | - | - | - | - | - | 19, 869. 10       | 1<br>9<br>，<br>8<br>6<br>9<br>·<br>1<br>0                          |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 5, 929, 057. 42   | 5<br>，<br>9<br>2<br>9<br>，<br>0<br>5<br>7                          |

|             |   |   |   |   |   |                     |                                                          |
|-------------|---|---|---|---|---|---------------------|----------------------------------------------------------|
|             |   |   |   |   |   |                     | ·<br>4<br>2                                              |
| 应付托管费       | - | - | - | - | - | 2, 117, 52<br>0. 52 | 2<br>,<br>1<br>1<br>7<br>,<br>5<br>2<br>0<br>·<br>5<br>2 |
| 应付销售服<br>务费 | - | - | - | - | - | 235, 781.<br>43     | 2<br>3<br>5<br>,<br>7<br>8<br>1<br>·<br>4<br>3           |
| 应交税费        | - | - | - | - | - | 40, 771. 7<br>2     | 4<br>0<br>,<br>7<br>7<br>1<br>·<br>7<br>2                |
| 应付利润        | - | - | - | - | - | 1, 041, 83<br>6. 45 | 1<br>,<br>0<br>4<br>1<br>,<br>8<br>3<br>6<br>·           |

|             |                   |                  |                  |   |   |                     |                                                                                   |
|-------------|-------------------|------------------|------------------|---|---|---------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|
|             |                   |                  |                  |   |   |                     | 4<br>5                                                                            |
| 其他负债        | -                 | -                | -                | - | - | 725,780.02          | 7<br>2<br>5<br>,<br>7<br>8<br>0<br>.<br>0<br>2                                    |
| 负债总计        | -                 | -                | -                | - | - | 742,314,566.64      | 7<br>4<br>2<br>,<br>3<br>1<br>4<br>,<br>5<br>6<br>6<br>.<br>6<br>4                |
| 利率敏感度<br>缺口 | 14,765,269,870.89 | 5,231,918,312.02 | 8,832,557,447.73 | - | - | -<br>592,252,784.21 | 2<br>8<br>,<br>2<br>3<br>7<br>,<br>4<br>9<br>2<br>,<br>8<br>4<br>6<br>.<br>4<br>3 |

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>2026 年 06 月 30 日         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 市场利率上升 25 个基点   | -8,120,244.53                   | -10,102,799.65           |
|    | 2. 市场利率下降 25 个基点   | 8,142,516.62                    | 10,123,697.49            |

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>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 12,352,813,180.64       | 13,672,603,206.81        |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 12,352,813,180.64       | 13,672,603,206.81        |

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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，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<br>(%) |
|----|-----------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 固定收益投资                | 12,352,813,180.64 | 39.47            |
|    | 其中：债券                 | 12,352,813,180.64 | 39.47            |
|    | 资产支持证券                | -                 | -                |
| 2  | 买入返售金融资产              | 6,984,597,497.47  | 22.32            |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                 | -                |
| 3  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 11,960,335,591.99 | 38.21            |
| 4  | 其他各项资产                | 26,742.91         | 0.00             |
| 5  | 合计                    | 31,297,773,013.01 | 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    | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 82 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 49 |

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(天数)             | 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                 | 64.82               | 9.94                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.79                | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 12.29               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.14                | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 6.09                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.18                | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 3.90                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天（含）      | 22.68               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 109.78              | 9.94                |

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<br>(%) |
|----|----------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 国家债券                 | -                 | -                |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -                |
| 3  | 金融债券                 | 1,645,761,064.77  | 5.78             |
|    | 其中：政策性金融债            | 1,332,413,729.80  | 4.68             |
| 4  | 企业债券                 | 869,227,101.92    | 3.05             |
| 5  | 企业短期融资券              | 1,196,907,168.29  | 4.21             |
| 6  | 中期票据                 | 685,492,240.96    | 2.41             |
| 7  | 同业存单                 | 7,955,425,604.70  | 27.96            |
| 8  | 其他                   | -                 | -                |
| 9  | 合计                   | 12,352,813,180.64 | 43.41            |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 600,190,876.38    | 2.11             |

7.6 期末按公允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<br>比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 250214    | 25 国开 14      | 5,100,000 | 510,096,016.08 | 1.79             |
| 2  | 09250409  | 25 农发清发 09    | 4,500,000 | 450,369,173.84 | 1.58             |
| 3  | 112522027 | 25 邮储银行 CD027 | 4,000,000 | 399,717,772.22 | 1.40             |
| 4  | 112522029 | 25 邮储银行 CD029 | 3,100,000 | 309,725,069.58 | 1.09             |
| 5  | 112504050 | 25 中国银行 CD050 | 3,000,000 | 299,692,273.07 | 1.05             |
| 6  | 112691571 | 26 恒生银行 CD007 | 3,000,000 | 299,463,482.68 | 1.05             |
| 7  | 112692945 | 26 东亚银行 CD010 | 3,000,000 | 297,784,884.25 | 1.05             |
| 8  | 112504040 | 25 中国银行 CD040 | 2,700,000 | 269,832,676.57 | 0.95             |
| 9  | 112506157 | 25 交通银行 CD157 | 2,500,000 | 249,932,778.95 | 0.88             |
| 10 | 112504046 | 25 中国银行 CD046 | 2,500,000 | 249,777,361.66 | 0.88             |

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                      | 0.0397% |
| 报告期内偏离度的最低值                      | 0.0076% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值           | 0.0243% |

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

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

7.9.3 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 | 26,742.91 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收利息  | -         |
| 4  | 应收申购款 | -         |
| 5  | 其他应收款 | -         |
| 6  | 待摊费用  | -         |
| 7  | 其他    | -         |
| 8  | 合计    | 26,742.91 |

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<br>(户) | 户均持有的<br>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 | 2,039        | 45,147.91      | 20,356.27         | 0.02%  | 92,036,227.80  | 99.98%  |
| 汇丰晋信货币 B | 167          | 168,961.891.11 | 28,122,877,126.89 | 99.67% | 93,758,688.19  | 0.33%   |
| 汇丰晋信货币 C | 1,868        | 63,878.92      | 0.00              | 0.00%  | 119,325,826.56 | 100.00% |
| 汇丰晋信货币 D | 26,302       | 1,111.05       | 29,220,710.82     | 99.99% | 2,184.48       | 0.01%   |
| 合计       | 30,376       | 936,833.06     | 28,152,118,193.98 | 98.93% | 305,122,927.03 | 1.07%   |

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  | 2,397,029,026.44 | 8.42%  |
| 2  | 其他机构  | 2,094,074,693.43 | 7.36%  |
| 3  | 其他机构  | 1,565,614,084.27 | 5.50%  |
| 4  | 其他机构  | 1,506,586,442.78 | 5.29%  |
| 5  | 其他机构  | 1,346,672,847.50 | 4.73%  |
| 6  | 其他机构  | 1,328,986,000.45 | 4.67%  |
| 7  | 其他机构  | 1,200,477,943.19 | 4.22%  |
| 8  | 其他机构  | 1,194,072,600.95 | 4.20%  |
| 9  | 其他机构  | 1,152,984,875.55 | 4.05%  |
| 10 | 其他机构  | 1,092,715,704.41 | 3.84%  |

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（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 | 301.02     | 0.0003% |
|                  | 汇丰晋信货币 B | 0.00       | 0.0000% |
|                  | 汇丰晋信货币 C | 274,509.20 | 0.2301% |
|                  | 汇丰晋信货币 D | 0.00       | 0.0000% |
|                  | 合计       | 274,810.22 | 0.0010% |

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇丰晋信货币 A | 0                     |
|                                | 汇丰晋信货币 B | 0                     |
|                                | 汇丰晋信货币 C | 0                     |
|                                | 汇丰晋信货币 D | 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 | 0                     |
|                                | 汇丰晋信货币 B | 0                     |
|                                | 汇丰晋信货币 C | 10~50                 |
|                                | 汇丰晋信货币 D | 0                     |
|                                | 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       | 汇丰晋信货币 D      |
|--------------------------------------|----------------|-------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(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                         | 104,028,297.85 | 28,086,635,614.91 | 30,802,491.94  | 16,026,441.73 |
| 本报告期基金总申购份额                          | 26,581,157.19  | 81,698,435,503.50 | 778,780,101.45 | 82,793,338.25 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                        | 38,552,870.97  | 81,568,435,303.33 | 690,256,766.83 | 69,596,884.68 |
| 本报告期期末基金份额总额                         | 92,056,584.07  | 28,216,635,815.08 | 119,325,826.56 | 29,222,895.30 |

注：总申购份额含红利再投、转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 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

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

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未有受调查或处罚等情况发生。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

#### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

#### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 申万宏源 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰海通 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 申万宏源 | 542,871,726.28 | 100.00%      | 236,288,369.00   | 97.24%         | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -              | -            | 6,703,356,000.00 | 2.76%          | -    | -            | -    | -            |
| 国泰海通 | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |

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 2025 年第四季度报告                 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-01-21 |
| 2  | 汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在招商证券的交易限额的公告            | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-01-26 |
| 3  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）    | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-03-31 |
| 4  | 汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告                   | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-03-31 |
| 5  | 关于汇丰晋信货币市场基金于 2026 年劳动节假期前暂停申购、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 | 2026-04-22 |
| 6  | 汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告                 | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-04-22 |
| 7  | 汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                      | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-04-25 |
| 8  | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增万家财富为旗下开放式基金代销机构的公告             | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-05-18 |
| 9  | 汇丰晋信货币市场基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）                  | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-06-30 |
| 10 | 汇丰晋信货币市场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 | 2026-06-30 |

|    |                           |                 |            |
|----|---------------------------|-----------------|------------|
| 11 | 汇丰晋信货币市场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 | 2026-06-30 |
| 12 | 汇丰晋信货币市场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 | 2026-06-30 |
| 13 | 汇丰晋信货币市场基金产品资料概要更新（D 类份额） | 本基金指定报刊、指定互联网网站 | 2026-06-30 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况  
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

二〇二六年八月三十一日