

# 汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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:2024年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	019017
基金运作方式	契约型开放式，每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置7天的最短持有期限
基金合同生效日	2023年12月12日
报告期末基金份额总额	400,946,299.17份
投资目标	本基金主要投资于同业存单，通过指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的证券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差

	<p>进一步扩大。本基金运作过程中，如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、资产配置策略 本基金主要以标的指数的成份券和备选成份券为基础，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的80%。</p> <p>2、同业存单投资策略 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。</p> <p>4、债券投资策略 本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略，力求获取高于业绩比较基准的回报。未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为同业存单指数基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>
<p>基金管理人</p>	<p>汇丰晋信基金管理有限公司</p>

基金托管人	交通银行股份有限公司
-------	------------

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	2,231,996.02
2.本期利润	1,720,753.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036
4.期末基金资产净值	407,545,563.95
5.期末基金份额净值	1.0165

注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

②上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	0.01%	0.47%	0.01%	-0.10%	0.00%
过去六个月	0.91%	0.01%	1.08%	0.01%	-0.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.65%	0.01%	1.95%	0.01%	-0.30%	0.00%

注：

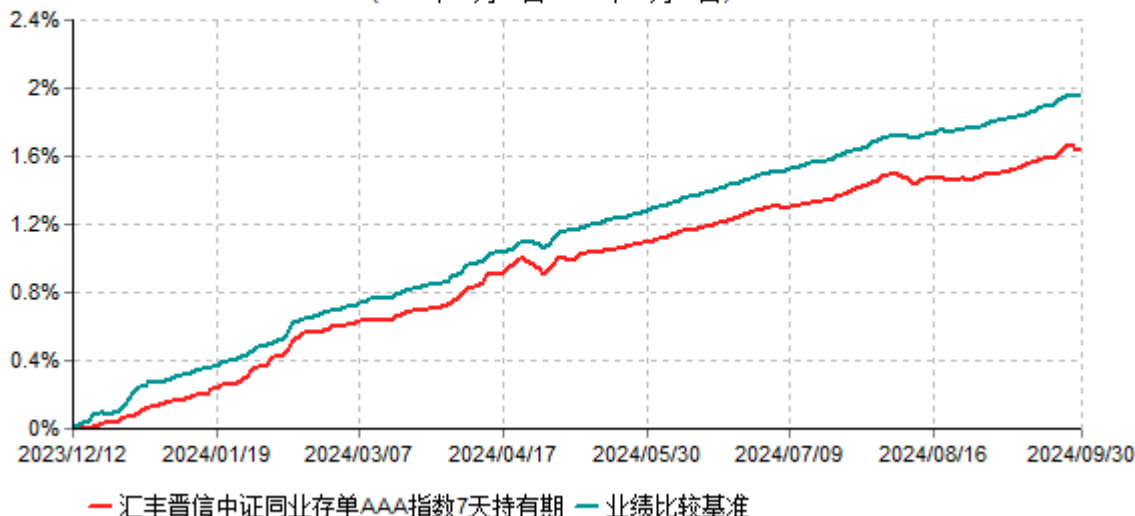
过去三个月指2024年7月1日-2024年9月30日

过去六个月指2024年4月1日-2024年9月30日

自基金合同生效起至今指2023年12月12日-2024年9月30日

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年12月12日-2024年09月30日)



注

- 1.本基金的基金合同于2023年12月12日生效,截至2024年9月30日基金合同生效未满1年。
- 2.按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- 3.本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至2024年6月12日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
- 4.报告期内本基金的业绩比较基准=中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AA指数7天持有期	2024-05-11	-	7	刘洋先生,博士研究生。曾任青岛银行股份有限公司固收交易员,长江养老保险股份有限公司固收交易员,交银理财有限责任公司投

	证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理				资经理，上海浦银安盛资产管理有限公司投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司总经理办公室业务经理、投资经理，现任汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信慧嘉债券型证券投资基金和汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金基金经理。
傅煜清	汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金以及汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理	2023-12-12	-	7.5	傅煜清女士，硕士研究生。曾任上海国际货币经纪有限责任公司债券经纪人，加拿大皇家银行信用分析员，汇丰晋信基金管理有限公司信用分析员、基金经理助理。现任汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金、汇丰晋信货币市场基金、汇丰晋信惠安纯债63个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金以及汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。
蔡若林	公募固收投资副总监、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金、汇丰晋信平稳增利中短债债	2023-12-12	2024-08-24	13	蔡若林先生，硕士研究生。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理策略分析师、助理研究员、固定收益信用分析师、基金经理助理、公募

	券型证券投资基金、 汇丰晋信惠安纯债6 3个月定期开放债券 型证券投资基金、汇 丰晋信慧悦混合型 证券投资基金、汇丰 晋信丰盈债券型证 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、汇丰晋信慧 嘉债券型证券投资 基金、汇丰晋信中证 同业存单AAA指数7 天持有期证券投资 基金和汇丰晋信慧 鑫六个月持有期债 券型证券投资基金 基金经理			固收投资副总监、汇丰晋信 慧盈混合型证券投资基金 基金、汇丰晋信2016生命周 期开放式证券投资基金、汇 丰晋信平稳增利中短债债 券型证券投资基金、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 丰晋信慧悦混合型证券投 资基金、汇丰晋信丰盈债券 型证券投资基金、汇丰晋信 丰宁三个月定期开放债券 型证券投资基金、汇丰晋信 慧嘉债券型证券投资基金、 汇丰晋信中证同业存单AA A指数7天持有期证券投资 基金和汇丰晋信慧鑫六个 月持有期债券型证券投资 基金基金经理。
--	--	--	--	---

- 注：1. 傅煜清女士，蔡若林先生任职日期为本基金基金合同生效的日期；
2. 刘洋先生任职日期为本基金管理人公告刘洋先生担任本基金基金经理的日期；
3. 蔡若林先生离任日期为本基金管理人公告蔡若林先生不再担任本基金基金经理的日期；
4. 证券从业年限是证券投资相关的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度，高质量发展继续成为宏观基本面主要增长动力，总量和高频数据在经济复苏阶段存在一定的波动。在央行支持性货币政策叠加机构投资者负债端成本持续下降等驱动因素下，债券收益率震荡下行创新低。但其间受央行对国债收益率引导、大型商业银行集中卖出国债、重要会议召开等影响，三季度债券收益率出现较大幅度波动。

合理充裕的流动性环境、债券类资产相对欠配的主逻辑短期内改变的概率不大，因此债券收益率大幅上行的风险相对可控。短端资产受流动性影响较大，当前流动性环境有利于同业存单等短端资产的稳定。三季度以来产品保持中枢附近久期配置，在持仓资产方面主要以大型国有银行和优质全国性股份制银行发行的同业存单、以及利率债为主，以提升资产流动性和安全性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值收益率为0.37%，同期业绩比较基准收益率为0.47%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明



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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	491,252,394.79	96.74
	其中：债券	491,252,394.79	96.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,550,966.80	3.26
8	其他资产	990.80	0.00
9	合计	507,804,352.39	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	25,468,358.63	6.25
	其中：政策性金融债	25,468,358.63	6.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,739,652.46	7.54
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	435,044,383.70	106.75
9	其他	-	-
10	合计	491,252,394.79	120.54

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	112411057	24平安银行CD057	400,000	39,602,826.30	9.72
2	112420120	24广发银行CD120	400,000	39,578,335.12	9.71
3	112407002	24招商银行CD002	300,000	29,845,474.92	7.32
4	112409047	24浦发银行CD047	300,000	29,803,670.82	7.31
5	112404051	24中国银行CD051	300,000	29,766,312.53	7.30

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	990.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	990.80

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

投资组合报告中，由于四舍五入原因，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差；由于小数点后保留位数限制原因，市值占净值比例可能显示为零。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	589,150,661.94
报告期期间基金总申购份额	149,736,902.29
减：报告期期间基金总赎回份额	337,941,265.06
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	400,946,299.17

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金注册的文件

（二）《汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》

(三) 《汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》

(四) 关于申请募集注册汇丰晋信中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金之法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

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

## 9.2 存放地点

地点为管理人地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

2024年10月25日