

# 汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

### 2011 年 6 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：二〇一一年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	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.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	19
7	投资组合报告.....	35
7.1	期末基金资产组合情况.....	35
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	36
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	37

7.9	投资组合报告附注.....	37
8	基金份额持有人信息.....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	38
9	开放式基金份额变动.....	38
10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	39
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	41
11	备查文件目录.....	44
11.1	备查文件目录.....	44
11.2	存放地点.....	44
11.3	查阅方式.....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信平稳增利债券	
交易代码	540005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年12月3日	
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	77,182,710.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信平稳增利债券A类	汇丰晋信平稳增利债券C类
下属分级基金的交易代码	540005	541005
报告期末下属分级基金的份额总额	77,124,209.86份	58,500.99份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势，自上而下进行宏观分析，自下而上精选个券，在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下，获取债券的利息收入及价差收益。通过参与股票一级市场投资，获取新股发行收益，为投资者谋取稳定的当期收益与较高的长期投资回报。</p>
投资策略	<p>本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在对企业债券进行信用评级的基础上，综合考量企业债券（含公司债、企业短期融资券）的信用评级以及包括其它券种在内的债券流动性、供求关系、收益率水平等因素，自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套利操作、新股认购等策略，提高投资组合收益。</p>
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率

风险收益特征	本基金属于债券型基金产品，在开放式基金中，风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币基金和中短债基金，属于中低风险的产品。
--------	---

### 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	古韵	张咏东
	联系电话	021-38789898	021-32169999
	电子邮箱	melody.y.gu@hsbcjt.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		021-38789998	95559
传真		021-68881925	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区富城路99号 震旦大厦35楼	上海市浦东新区银城中路 188号
办公地址		上海市浦东新区富城路99号 震旦大厦35楼	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		杨小勇	胡怀邦

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼； 交通银行股份有限公司：上海市浦东新区银城中路188号。

注：

### 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	上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35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 (2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)	
	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	汇丰晋信平稳增利债券 C 类
本期已实现收益	1,005,448.15	56.49
本期利润	871,644.32	-211.15
加权平均基金份额本期利润	0.0082	-0.0053
本期加权平均净值利润率	0.83%	-0.53%
本期基金份额净值增长率	0.68%	-0.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2011 年 6 月 30 日)	
	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	汇丰晋信平稳增利债券 C 类
期末可供分配利润	-233,113.91	-206.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0030	-0.0035
期末基金资产净值	76,891,095.95	58,294.55
期末基金份额净值	0.9970	0.9965
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2011 年 6 月 30 日)	
	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	汇丰晋信平稳增利债券 C 类
基金份额累计净值增长率	0.21%	-0.35%

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）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

④本基金自 2011 年 6 月 7 日起分级为 AC 类。

#### 3.2 基金净值表现

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

汇丰晋信平稳增利债券 A 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	-0.70%	0.07%	-0.14%	0.06%	-0.56%	0.01%
过去三个月	0.48%	0.10%	0.53%	0.04%	-0.05%	0.06%
过去六个月	0.68%	0.11%	1.33%	0.04%	-0.65%	0.07%
过去一年	-0.15%	0.12%	0.40%	0.06%	-0.55%	0.06%
自基金成立起至今	0.21%	0.12%	5.30%	0.06%	-5.09%	0.06%

汇丰晋信平稳增利债券 C 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金成立起至今	-0.35%	0.11%	-0.24%	0.05%	-0.11%	0.06%

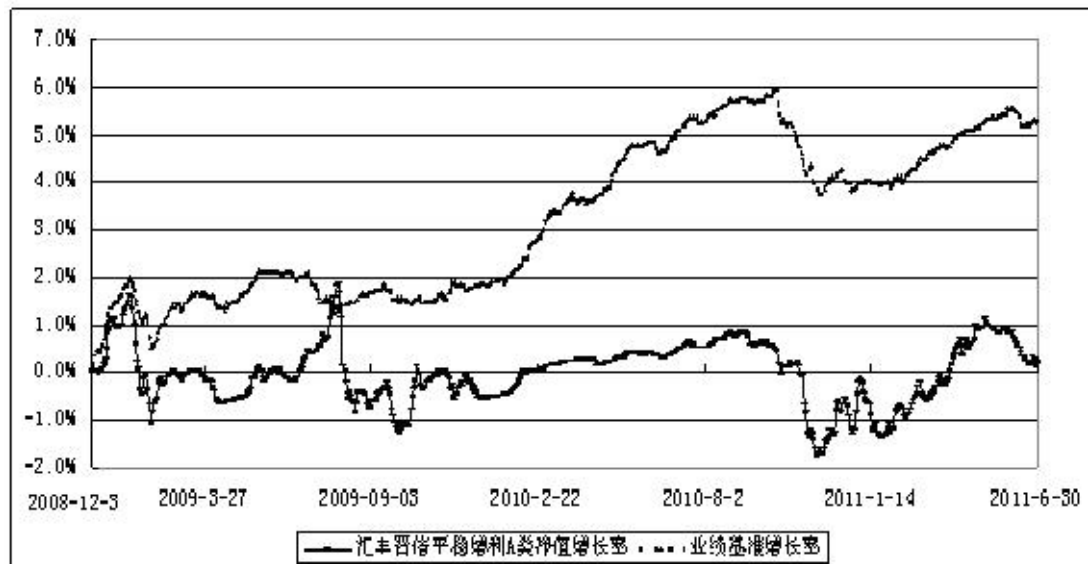
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008 年 12 月 3 日至 2011 年 6 月 30 日)

汇丰晋信平稳增利债券 A 类



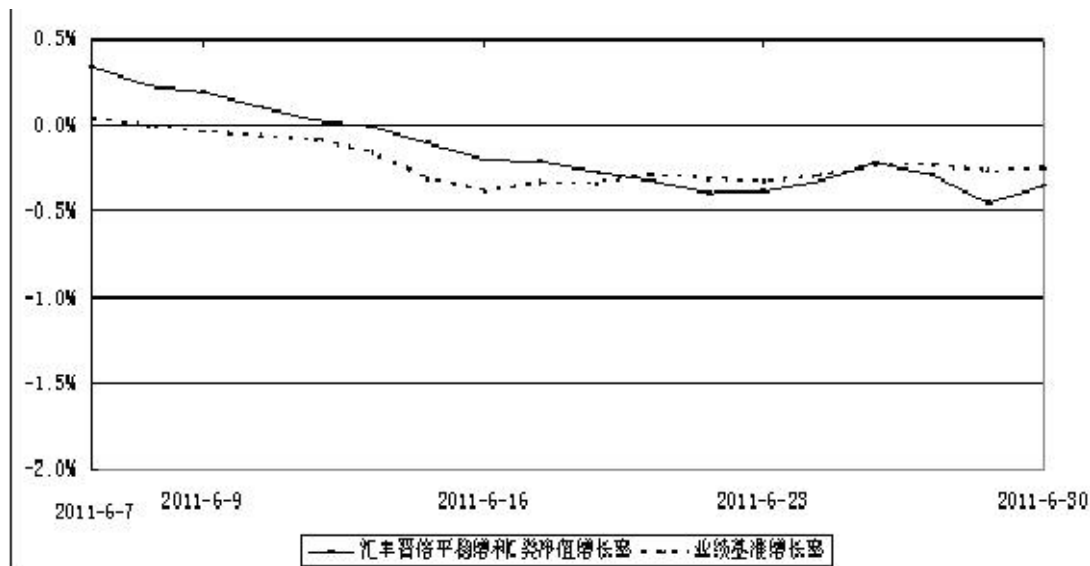
注：1. 按照基金合同的约定，本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种，包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等，投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的



5%。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过 6 个月内完成建仓，截止 2009 年 6 月 3 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 = 中信标普全债指数收益率。

汇丰晋信平稳增利债券 C 类



注：1. 按照基金合同的约定，本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种，包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等，投资比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过 6 个月内完成建仓，截止 2009 年 6 月 3 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 = 中信标普全债指数收益率。

## 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。公司由山西信托有限责任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 2011 年 6 月 30 日，公司共管理 9 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）、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金（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)、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金(2008 年 12 月 3 日成立)、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)和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)。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟小婧	本基金经理	2010-10-20	-	5 年	钟小婧女士, 中国人民大学经济学学士, 英国诺丁汉大学金融与投资学硕士, 具备基金从业资格。曾任生命人寿保险股份有限公司投资经理和联泰大都会人寿保险有限公司投资经理, 汇丰晋信基金管理有限公司高级固定收益研究员。现任本基金基金经理。

注: 1. 任职日期是本基金管理人公告钟小婧女士担任本基金基金经理的日期;  
2. 证券从业年限是证券投资相关的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

2011 年上半年度, 本基金严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易, 未发现本基金有重大违反公平交易制度的投资行为。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本公司旗下的其他投资组合的投资风格不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，宏观经济整体上呈现增速回落、通胀上升的‘类滞胀’特征，在经济基本面对债市利多与通胀对债市利空的博弈之下，投资者情绪较为纠结，债市表现以震荡为主，收益率曲线平坦化。在此背景下，资金面成为主导债市走势的决定性因素，上半年央行先后两次加息、六次上调存款准备金率，导致流动性逐渐趋紧，特别是适逢节假日、银行考核等关键时点，资金面的波动尤为明显，对债市造成阶段性冲击，带动债券收益率出现相应波动。

一季度，债券市场整体经历了先跌后涨的震荡行情，短端收益率降幅较大，中长端收益率在震荡中小幅下降。1月初，随着年末效应的消除，债券收益率明显回落，但临近月底资金面再度紧张，收益率出现反弹，央票利率一度出现了长短期倒挂现象。进入2月，债市震荡加剧，虽然资金面有所缓解，但央行早于预期的加息令投资者心态转向谨慎，债市出现明显调整，临近月末，中东北非动荡加剧导致全球股市下跌，债券市场受避险买盘推动再次上涨。3月份，由于经济数据低于预期及日本突发大地震，市场避险情绪上升，推动中长期债券进一步走强，同时资金面表现得非常宽裕，尽管临近季末且央行再次提高准备金率，回购利率仍然维持低位，临近月底，由于担心3月份CPI创新高并引发央行再度加息，收益率略有反弹。

二季度，紧缩政策的累积效应逐渐显现，流动性明显趋紧，债券收益率震荡上行，并且收益率曲线呈现明显的平坦化特征。4月，尽管央行在月初加息，并在下旬上调存款准备金率，但流动性仍然相对宽松，对债券市场的实质冲击十分有限，债市整体上保持平稳。进入5月，受到再次上调存款准备金率及财政存款季节性回流等因素的影响，资金面明显趋紧，货币市场利率维持高位，而由于经济下滑的预期增强，国内外资本市场剧烈波动，避险情绪

升温，中长期债券得到基本面的支撑，收益率基本稳定。6 月，由于银行面临半年度考核，使得本已紧张的资金面雪上加霜，货币市场利率大幅飚升，债券市场也出现明显调整，各类型、各期限债券均出现不同程度下跌，由于短期收益率的上升幅度远大于中长期收益率，导致收益率曲线极度平坦化。

由于债市的短期波动较难把握，我们在上半年的债券投资中采取了重票息、轻资本利得的防御性策略，保持偏短久期以控制利率风险，同时增加信用债配置比例来提高基金组合的持有期收益。根据资金利率的变化，将富余资金以逆回购方式滚动融出。同时积极参与可转债一级市场申购和二级市场交易性机会，也取得了较好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，平稳增利债券型证券投资基金 A 类份额净值为 0.9970，本报告期内净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准增长率为 1.33%；平稳增利债券型证券投资基金 C 类份额净值为 0.9965 元，本报告期内净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准增长率为-0.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增速回落已成定局，只是回落程度有待观察，我们预计国内经济软着陆的概率较大，全年增速不会太差。通胀水平将见顶回落，但回落的速度较慢，对全年通胀水平的预期将面临上调。在经济增长好于预期而通胀回落慢于预期的现实背景下，货币政策的基调仍将偏紧，原先对下半年政策开始放松的乐观预期将会落空，特别是在三季度，如果物价不能得到有效控制，不排除央行再次加息或上调准备金率的可能性。

基于以上对经济形势和政策取向的分析，我们也开始修正对债券市场的判断，整体上将更加谨慎。特别是在三季度，虽然 CPI 有所下降，但仍将维持在 5%以上的较高水平，并且在债券供给加大的同时资金面仍然偏紧，供需格局对债市不利，再加上流动性的冲击导致机构投资者面临持续的降杠杆压力，因此债券市场难有行情。进入四季度，随着 CPI 进一步回落、紧缩政策进入尾声、年末财政存款投放推动资金面再度宽裕等正面因素的不断出现，投资者情绪将转向乐观，债市可能迎来较好的阶段性投资机会。

#### 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，根据中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和和风险控制部以及其他相关部门的配合下开展工作，其中：

##### 一、基金运营部

1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。

2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。

3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。

##### 二、基金投资部

基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。

##### 三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

#### 四、风险控制部

根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

#### 五、督察长

监督和检查公司关于估值各项工作的贯彻和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。

1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下，应及时修订本估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经过本公司管理委员会的批准后方可实施。

2. 如果基金准备采用新投资策略或投资新品种或者有其他重大或突发性相关估值事项发生时，应召开临时会议，或者投资品种估值小组成员列席参加公司风控委员会会议，通过公司风控委员会会议讨论并通过上述估值事项。

本基金的基金管理人目前没有进行与估值相关的任何定价服务方面的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，A类基金可供分配收益为-233113.91元，C类基金可供分配收益为-206.44元。根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期末A、C类基金均不进行利润分配。

### 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

2011年上半年度，基金托管人在汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2011 年上半年度，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平稳增利债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、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：汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1 6.4.10.5	43,488.78	162,529.96
结算备付金	6.4.10.5	1,297,424.29	4,707,767.68
存出保证金		76,377.09	7,414.62
交易性金融资产	6.4.7.2	74,286,919.36	90,719,523.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资	6.4.7.2	74,286,919.36	90,719,523.99
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,947,547.23	11,115,187.51

应收利息	6.4.7.5	769,696.69	1,030,236.43
应收股利		-	-
应收申购款		25,734.69	1,526,553.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		78,447,188.13	109,269,214.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		960,390.60	352,123.11
应付管理人报酬		47,008.96	58,601.09
应付托管费		15,669.66	19,533.73
应付销售服务费	6.4.10.2.3	7.41	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	1,069.50
应交税费		265,718.20	265,718.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,002.80	420,605.63
负债合计		1,497,797.63	1,117,651.26
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	77,182,710.85	109,206,137.10
未分配利润	6.4.7.10	-233,320.35	-1,054,574.23
所有者权益合计		76,949,390.50	108,151,562.87
负债和所有者权益总计		78,447,188.13	109,269,214.13

注:报告截止日2011年6月30日,A类基金份额净值0.9970元,基金份额77,124,209.86份,C类基金份额净值0.9950元,基金份额58,500.99份。

## 6.2 利润表

会计主体: 汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

本报告期: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元

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



		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>1,519,867.50</b>	<b>3,151,050.51</b>
1.利息收入		1,562,863.95	2,195,088.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	82,772.07	158,412.22
债券利息收入		1,462,731.57	2,019,699.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,360.31	16,977.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-111,048.62	949,239.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	221,432.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-111,048.62	727,807.68
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-134,071.47	-134,513.94
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	202,123.64	141,235.88
<b>减：二、费用</b>		<b>648,434.33</b>	<b>1,185,651.22</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	315,065.24	702,972.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	105,021.70	234,324.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7.41	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,809.15	19,744.58
5. 利息支出		4,744.44	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,744.44	-
6. 其他费用	6.4.7.19	217,786.39	228,609.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		<b>871,433.17</b>	<b>1,965,399.29</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		<b>871,433.17</b>	<b>1,965,399.29</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	109,206,137.10	-1,054,574.23	108,151,562.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	871,433.17	871,433.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,023,426.25	-50,179.29	-32,073,605.54
其中：1. 基金申购款	780,160,468.89	-3,760,806.59	776,399,662.30
2. 基金赎回款	-812,183,895.14	3,710,627.30	-808,473,267.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	77,182,710.85	-233,320.35	76,949,390.50
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	298,510,315.78	-1,431,106.20	297,079,209.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,965,399.29	1,965,399.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-117,385,001.06	115,881.05	-117,269,120.01
其中：1. 基金申购款	446,631,634.26	1,031,827.14	447,663,461.40
2. 基金赎回款	-564,016,635.32	-915,946.09	-564,932,581.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	181,125,314.72	650,174.14	181,775,488.86

注：报告附注为财务报表的组成部分。

报告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：

基金管理公司负责人：杨小勇，主管会计工作负责人：李选进，会计机构负责人：杨洋

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金(以下简称“汇丰晋信增利基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]1156 号文)的批准,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》及其配套规则和《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2008 年 12 月 3 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,944,833,772.60 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的比例范围为:国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等,投资比例不低于基金资产的 80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票,权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证,本基金持有股票余额合计不超过基金资产的 20%。本基金业绩比较基准为:中信标普全债指数。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期内,本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与 2010 年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

本基金在本报告期无重大会计差错发生。

#### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，自 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50% 计算个人所得税。

(5) 自 2005 年 1 月 24 日起，基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起，该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，调整证券（股票）交易印花税税率，由 0.3% 降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，证券交易印花税改为单边征收，即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1% 的税率征收。

(6) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	43,488.78
定期存款	-
其他存款	-
合计	43,488.78

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		-	-	-
债券	交易所市场	54,839,118.44	54,466,919.36	-372,199.08
	银行间市场	20,090,000.00	19,820,000.00	-270,000.00
	合计	74,929,118.44	74,286,919.36	-642,199.08
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		74,929,118.44	74,286,919.36	-642,199.08

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有任何衍生金融资产或负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	1,530.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,858.35
应收债券利息	765,711.25
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	597.05
其他	-
合计	769,696.69

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本报告期末，本基金无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	727.91
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	208,274.89
银行手续费	-
合计	209,002.80

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 汇丰晋信平稳增利债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	780,100,467.90	780,100,467.90
本期赎回（以“-”号填列）	-812,182,395.14	-812,182,395.14
本期末	77,124,209.86	77,124,209.86

##### 汇丰晋信平稳增利债券 C 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	60,000.99	60,000.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,500.00	-1,500.00
本期末	58,500.99	58,500.99

注：

- 1 此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。
- 2 本基金自 2011 年 6 月 7 日起分级为 AC 类。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 汇丰晋信平稳增利债券 A 类

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	-1,016,884.50	-37,689.73	-1,054,574.23
本期利润	1,005,448.15	-133,803.83	871,644.32
本期基金份额交易产生的变动数	128,015.68	-178,199.68	-50,184.00
其中：基金申购款	-6,844,424.57	3,083,618.97	-3,760,805.60
基金赎回款	6,972,440.25	-3,261,818.65	3,710,621.60

本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,579.33	-349,693.24	-233,113.91

**汇丰晋信平稳增利债券 C 类**

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	-	-	-
本期利润	56.49	-267.64	-211.15
本期基金份额交易产生的变动数	2.46	2.25	4.71
其中：基金申购款	2.40	-3.39	-0.99
基金赎回款	0.06	5.64	5.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58.95	-265.39	-206.44

注：本基金自 2011 年 6 月 7 日起分级为 AC 类。

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,475.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,178.55
其他	27,117.71
合计	82,772.07

**6.4.7.12 股票投资收益**

本报告期内，本基金未进行股票投资，股票投资收益为零。

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	190,872,716.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188,300,828.89
减：应收利息总额	2,682,936.34
债券投资收益	-111,048.62

**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**

本报告期内，本基金未投资衍生金融产品，衍生工具收益为零。

**6.4.7.15 股利收益**



本报告期内，本基金股利收益为零。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-134,071.47
——股票投资	-
——债券投资	-134,071.47
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-134,071.47

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	200,216.56
转出基金补偿收入	1,907.08
合计	202,123.64

注：本基金赎回费的 25% 归入基金资产；基金之间的转换费由转出基金的赎回费和转换手续费两部分组成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	5,109.15
银行间市场交易费用	700.00
合计	5,809.15

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	178,522.11
银行汇款费用	511.50
银行间市场债券账户维护费	9,000.00

合计	217,786.39
----	------------

**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**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**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	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人

**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**

本报告期内以及上半年可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本报告期内以及上半年可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本报告期内以及上半年可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本报告期内以及上半年可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本报告期内以及上半年可比期间，本基金没有应支付关联方的佣金。

**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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	315,065.24	702,972.92
其中：支付销售机构的客户	78,360.24	176,209.62

维护费		
-----	--	--

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	105,021.70	234,324.30

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

#### 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		
	2011年1月1日至2011年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	汇丰晋信平稳增利债券 C 类	合计
交通银行	-	7.01	7.01
汇丰晋信直销	-	0.40	0.40
合计	-	7.41	7.41

注：本基金自 2011 年 6 月 7 日起分级为 AC 类。

C 类基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期间，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人均未投资本基金。

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

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	43,488.78	20,475.81	6,108,569.70	43,690.32

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2011 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 1,297,424.29 元（2010 年 6 月 30 日：人民币 16,696,619.71 元）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中德证券	002360	同德化工	网上发行	500	11,990.00

注：本报告期内，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

2011 上半年度本基金 A、C 类均未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2011 年 6 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

本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金未持有暂时停牌股票。

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

本报告期末，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

#### 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

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险  
流动性风险  
市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、风险管理部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

##### 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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期信用债券投资。

##### 6.4.13.2.2 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 2011 年 6 月 30 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
AAA	19,732,852.10	16,505,780.00
AAA 以下	25,072,127.26	12,349,843.99
未评级	0.00	0.00
合计	44,804,979.36	28,855,623.99

注：上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级

规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级（含）以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。
BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口：

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 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							
银行存款	43,488.78	-	-	-	-	-	43,488.78
结算备 付金	1,297,424.29	-	-	-	-	-	1,297,424.29
存出保 证金	-	-	-	-	-	76,377.09	76,377.09
交易性 金融资 产	-	13,311,864.00	26,263,038.10	31,230,162.26	3,481,855.00	-	74,286,919.36
应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	1,947,547.23	1,947,547.23
应收利 息	-	-	-	-	-	769,696.69	769,696.69
应收申 购款	25,734.69	-	-	-	-	-	25,734.69
资产总 计	1,366,647.76	13,311,864.00	26,263,038.10	31,230,162.26	3,481,855.00	2,793,621.01	78,447,188.13
负债							
应付赎 回款	-	-	-	-	-	960,390.60	960,390.60
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	47,008.96	47,008.96
应付托 管费	-	-	-	-	-	15,669.66	15,669.66
应付销	-	-	-	-	-	7.41	7.41

售服务费							
应交税费	-	-	-	-	-	265,718.20	265,718.20
其他负债	-	-	-	-	-	209,002.80	209,002.80
负债总计	-	-	-	-	-	1,497,797.63	1,497,797.63
利率敏感度缺口	1,366,647.76	13,311,864.00	26,263,038.10	31,230,162.26	3,481,855.00	1,295,823.38	76,949,390.50
上年度末2010年12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	合计
资产							
银行存款	162,529.96	-	-	-	-	-	162,529.96
结算备付金	4,707,767.68	-	-	-	-	-	4,707,767.68
存出保证金	-	-	-	-	-	7,414.62	7,414.62
交易性金融资产	-	24,860,000.00	9,774,000.00	45,449,038.94	10,636,485.05	-	90,719,523.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,115,187.51	11,115,187.51
应收利息	-	-	-	-	-	1,030,236.43	1,030,236.43
应收申购款	1,526,553.94	-	-	-	-	-	1,526,553.94
资产总计	6,396,851.58	24,860,000.00	9,774,000.00	45,449,038.94	10,636,485.05	12,152,838.56	109,269,214.13
负债							



应付赎回款	-	-	-	-	-	352,123.11	352,123.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	58,601.09	58,601.09
应付托管费	-	-	-	-	-	19,533.73	19,533.73
应交税费	-	-	-	-	-	265,718.20	265,718.20
其他负债	-	-	-	-	-	420,605.63	420,605.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,069.50	1,069.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,117,651.26	1,117,651.26
利率敏感度缺口	6,396,851.58	24,860,000.00	9,774,000.00	45,449,038.94	10,636,485.05	11,035,187.30	108,151,562.87

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照金融资产及金融负债的重新定价日或剩余到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析为除市场利率以外的其他市场变量保持不变，该计算结果为基于本基金报表每日资产组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假设所有期限的利率以相同幅度变动25个基点，其他市场变量保持不变。		
	此项影响不考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加520,792.65	增加549,876.22
	市场利率上升25个基点	减少520,792.65	减少549,876.22

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇

汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中债券投资比例为基金资产净值的 96.54%，无股票及衍生金融资产。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	74,286,919.36	96.54	90,719,523.99	83.88
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	74,286,919.36	96.54	90,719,523.99	83.88

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于固定收益类交易品种，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

假设	除业绩比较基准（见附注6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	业绩比较基准上升5%	无影响	无影响
	业绩比较基准下降5%	无影响	无影响

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

在本报告期末，本基金未发生有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	74,286,919.36	94.70
	其中：债券	74,286,919.36	94.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,340,913.07	1.71
6	其他各项资产	2,819,355.70	3.59
7	合计	78,447,188.13	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票交易；

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票交易；

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	-
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期内未进行股票交易；

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,661,940.00	12.56
2	央行票据	9,773,000.00	12.70
3	金融债券	10,047,000.00	13.06
	其中：政策性金融债	10,047,000.00	13.06
4	企业债券	30,410,409.36	39.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	14,394,570.00	18.71
8	其他	-	-
9	合计	74,286,919.36	96.54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	090407	09 农发 07	100,000	10,047,000.00	13.06
2	1001047	10 央票 47	100,000	9,773,000.00	12.70
3	010203	02 国债(3)	75,000	7,415,250.00	9.64
4	113001	中行转债	55,000	5,806,900.00	7.55
5	112016	09 宏润债	52,849	5,432,877.20	7.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名中其他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。

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

#### 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	76,377.09
2	应收证券清算款	1,947,547.23
3	应收股利	-
4	应收利息	769,696.69
5	应收申购款	25,734.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,819,355.70

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	5,806,900.00	7.55
2	113002	工行转债	3,080,220.00	4.00

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇丰晋信平稳增利债券 A 类	2,441	31,595.33	2,342,743.69	3.04%	74,781,466.17	96.96%
汇丰晋信平稳增利债券 C 类	5	11,700.20	-	-	58,500.99	100.00%
合计	2,446	31,554.67	2,342,743.69	3.04%	74,839,967.16	96.96%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	893.88	0.0012%
	汇丰晋信平稳增利债券 C 类	2,510.23	4.2909%
	合计	3,404.11	0.0044%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇丰晋信平稳增利债券 A 类	汇丰晋信平稳增利债券 C 类
基金合同生效日(2008 年 12 月 3 日)基金份额总额	1,944,833,772.60	-
本报告期期初基金份额总额	109,206,137.10	-
本报告期基金总申购份额	780,100,467.90	60,000.99

减：本报告期基金总赎回份额	812,182,395.14	1,500
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	77,124,209.86	58,500.99

## 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

2011 年 5 月 11 日，经股东会审议批准，Mark McCombe 先生不再担任本公司董事，由 John Flint 先生继任本公司董事；李选进先生不再担任本公司董事，由 Joanna Munro 女士继任本公司董事。

2011 年 7 月 23 日，基金管理人发布公告，经公司董事会审议通过，并报中国证监会核准，聘任王立荣先生担任本公司副总经理。

报告期内，本公司高级管理人员和基金经理未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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、基金财产、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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。自本基金募集以来，毕马威华振会计师事务所有限公司一直为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
合计	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金未新增券商交易单元；

2、上述交易单元均与汇丰晋信动态策略证券投资基金合并使用；

3、本基金交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

a. 实力雄厚，信誉良好；

b. 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好，过去三年未有任何违规经营记录；

c. 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

d. 公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；

e. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：

a. 研究报告的数量和质量；



- b.提供研究服务的主动性;
- c.资讯提供的及时性及便利性;
- d.其他可评价的考核标准。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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
申银万国	254,021,764.30	79.26%	66,900,000.00	100.00%	-	-
中信证券	66,457,582.83	20.74%	-	-	-	-
合计	320,479,347.13	100.00%	66,900,000.00	100.00%	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-04
2	关于通过交通银行调整基金定期定额投资起点金额进行调整的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-06
3	汇丰晋信关于旗下基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-06
4	汇丰晋信平稳增利基金更新招募说明书（2011年第1号）	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-17
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于在建设银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-20
6	汇丰晋信2010年第4季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-21
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于在农业银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-01-27
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于在华夏银	本基金选定的信息	2011-02-14

	行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	披露报纸、管理人网站	
9	汇丰晋信基金管理有限公司关于在光大银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-02-21
10	汇丰晋信基金管理有限公司关于在民生银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-01
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于在中国银行开通汇丰晋信旗下四只开放式基金转换、定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-04
12	汇丰晋信基金管理有限公司关于在平安银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-07
13	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券网上交易方式定期定额投资基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-09
14	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过建设银行调整基金定期定额投资起点金额的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-11
15	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中信证券股份有限公司为旗下四只开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-14
16	汇丰晋信基金2010年度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-28
17	汇丰晋信基金管理有限公司关于在中信建投证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-03-30
18	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金继续通过工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-01
19	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行?盈基金2011”网上银行基金申购4折优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-02
20	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金继续参加华夏银行开展定期定额申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-02
21	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金持有的上海汽车和华域汽车股票采用收盘价进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-07
22	汇丰晋信基金2011年第1季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-22

23	汇丰晋信基金管理有限公司关于在温州银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-22
24	汇丰晋信基金管理有限公司关于在海通证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-22
25	汇丰晋信基金管理有限公司关于在中信证券开通汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-04-22
26	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过上海农村商业银行开办汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-10
27	汇丰晋信关于新增上海农村商业银行为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-10
28	汇丰晋信关于旗下基金参加上海农村商业银行网上银行、定期定额投资基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-10
29	汇丰晋信基金管理有限公司关于在上海农村商业银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-20
30	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增渤海银行股份有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-27
31	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过渤海银行开办汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-05-27
32	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过中信建投证券调整基金定期定额投资起点金额的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-01
33	汇丰晋信基金管理有限公司关于汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金增加C类基金份额类别并修改基金合同的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-07
34	新增广发证券为平稳增利基金C类代销机构	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-15
35	关于新增华泰联合证券为汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金C类基金份额代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-20
36	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加渤海银行个人网上银行、定期定额投资基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-24
37	汇丰晋信基金管理有限公司关于开通工商银行/光大银行/平安银行借记卡电子交易的	本基金选定的信息披露报纸、管理人	2011-06-30

	公告	网站	
38	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2011-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金合同
- (3) 汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金招募说明书
- (4) 汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金托管协议
- (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) 报告期内汇丰晋信平稳增利债券型证券投资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

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区富城路 99 号震旦大厦 35 楼本基金管理人办公地址。

### 11.3 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：021-38789998  
 公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司  
 二〇一一年八月二十四日