

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：二〇一二年八月二十八日

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 2012 年 8 月 27 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 2012 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..... | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 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..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 18 |
| 7 投资组合报告..... | 32 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 32 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 33 |
| 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..... | 34 |
| 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..... | 36 |

| | |
|---------------------------------------|----|
| 7.9 投资组合报告附注..... | 37 |
| 8 基金份额持有人信息..... | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 38 |
| 9 开放式基金份额变动..... | 38 |
| 10 重大事件揭示..... | 38 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 38 |
| 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..... | 39 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 39 |
| 10.8 其他重大事件..... | 41 |
| 11 备查文件目录..... | 42 |
| 11.1 备查文件目录..... | 42 |
| 11.2 存放地点..... | 42 |
| 11.3 查阅方式..... | 42 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇丰晋信龙腾股票 |
| 基金主代码 | 540002 |
| 交易代码 | 540002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年9月27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 | 1,334,847,129.07份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过精选受益于中国经济持续高速增长而呈现出可持续竞争优势、未来良好成长性以及持续盈利增长潜力的上市公司，追求超越基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。 |
| 投资策略 | <p>1. 适度调整的资产配置策略</p> <p>本基金奉行“注重成长、精选个股、长期投资”的投资理念和“自下而上”的股票精选策略。在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2. 以成长指标为核心的股票筛选策略</p> <p>本基金在明确的成长性评估体系基础上，对初选股票给予全面的成长性分析，成长性指标包括：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率（P/E）、净资产收益率（ROE）等。同时，再通过严格的基本面分析（CFROI（投资现金回报率）指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析）和公司实地调研，最终挑选出具有可持续竞争优势，未来有良好成长性和盈利持续增长潜力的上市公司。</p> |
| 业绩比较基准 | $75\% \times \text{新华富时600成长指数收益率} + 25\% \times \text{1年期银行定期存}$ |

| | |
|--------|--------------------------------------|
| | 款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益较高的基金产品。 |

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（2012年1月1日至2012年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -161,172,013.81 |
| 本期利润 | 16,544,396.30 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0120 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.02% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.85% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 228,471,111.34 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1712 |
| 期末基金资产净值 | 1,563,318,240.41 |
| 期末基金份额净值 | 1.1712 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2012年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 102.92% |

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。

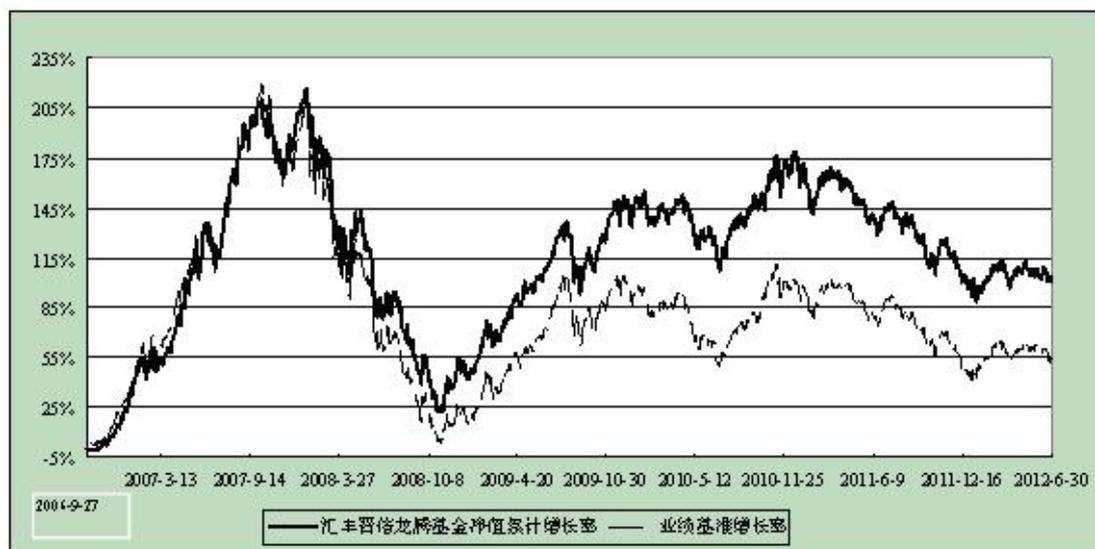
3.2 基金净值表现

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 | 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 | -2.47% | 0.89% | -4.50% | 0.87% | 2.03% | 0.02% |
| 过去三个月 | 2.32% | 0.96% | 1.84% | 0.88% | 0.48% | 0.08% |
| 过去六个月 | 0.86% | 1.19% | 5.21% | 1.10% | -4.35% | 0.09% |
| 过去一年 | -15.88% | 1.15% | -14.13% | 1.08% | -1.75% | 0.07% |
| 过去三年 | -4.02% | 1.31% | -10.24% | 1.21% | 6.22% | 0.10% |
| 自基金成立起至今 | 102.92% | 1.68% | 54.47% | 1.57% | 48.45% | 0.11% |

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

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金
 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
 (2006 年 9 月 27 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中现金或到期日在一年期以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2007 年 3 月 27 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 本基金的业绩比较基准 = 75%×富时中国 A600 成长指数收益率+25%×1 年期银行定期存款利率（税后）。

3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率（75%×富时中国 A600 成长指数收益率+25%×1 年期银行定期存款利率（税后））的计算未包含富时中国 A600 成长指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4. 2010 年 12 月 16 日，新华富时 600 成长指数正式更名为富时中国 A600 成长指数。

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 2012 年 6 月 30 日，公司共管理 11 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）、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）和汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 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 | | |
| 林彤彤 | 副总经理、 首席投资 官、本基金 基金经理 | 2006-09-27 | - | 14 年 | 林彤彤先生，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员，基金安信、基金安久、基金安顺、基金安瑞的基金经理，投资部总监助理兼基金安信基金经理、汇丰晋信大盘股票型开放式证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信基金副总经理、首席投资官、本基金基金经理。 |
| 廖志峰 | 本基金基金 经理、汇丰 晋信中小盘 股票型开放 式证券投资 基金经理 | 2010-03-03 | - | 10 年 | 廖志峰先生，香港大学工商管理硕士，具备基金从业资格。曾任上海国禾投资有限公司研究员，2005 年 10 月起任汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员。现任本基金基金经理、汇丰晋信中小盘股票型开放式证券投资基金基金经理。 |

注：1. 任职日期为本基金基金合同生效日或本基金管理人公告廖志峰先生担任本基金基金经理的日期；

2. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，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。

2012 年上半年度，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，所有投资组合未参与交易所公开竞价同日反向交易。

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

2012 年上半年末，沪深 300 指数收于 2461 点，半年涨幅为 4.94%，其间，各行业分化十分明显。受金融改革利好政策不断驱动，非银行金融板块涨幅位居第一；房地产，建筑等板块也因政策预期改善和基本面趋暖而涨幅居前；食品饮料，医药等消费类板块在二季度后期市场转弱时也表现不俗，重新获得市场青睐。从跌幅来看，通信，电力设备，煤炭等景气度下降的行业位居跌幅前列，显示投资者对经济预期重新从乐观转向悲观。回顾上半年的具体操作，龙腾基金延续了一直以来的精选个股策略，在行业配置上加大了对非银行金融、医药，食品饮料、家电等行业的投资力度，规避了煤炭，钢铁等周期股的下跌风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012 年上半年龙腾基金单位净值比 2011 年末上涨 0.86%，业绩比较基准上涨 5.21%，净值表现落后比较基准 4.35%。

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 2012 年下半年，在政府“稳增长”的政策基调下，伴随着积极的财政政策和稳健的货币政策，以及各项鼓励民间投资和加快推进关键领域改革等措施的陆续出台，预计下半年经济运行趋势将逐步趋稳，企业盈利下滑趋势也将逐步缓和，在市场估值处于低位区域的状态下，市场运行趋势也将逐步好转。

从经济运行态势来看，当前中国经济季度 GDP 同比增速已经连续 5 个季度回落，如果忽略 2011 年 1 季度的小幅反弹，本轮经济增速下滑所持续的时间已经超过了 10 个季度，从持续时间上来看已经超过 2008 年金融危机期间曾经出现的连续 7 个季度的调整周期。从政策角度来看，考虑到当前全社会工业企业产品库存仍处于较高水平，以及国内外需求总体仍然处于疲弱状态，如果没有一定的“稳增长”措施，经济仍可能存在一定的下行压力，由此将会带来较大的企业盈利压力和就业压力，因此，政府在近期反复强调下半年政府工作将把“稳

增长”放在更加突出的位置。但是，“稳增长”最有效的途径是培育新的经济增长点，单纯依靠政府投资已经难以推动经济持续增长。因此即使未来经济增速出现快速回落，政府出台单一的以政府投资为主的经济刺激计划的可能性并不大，取而代之的更可能是结合扩大政府投资（中西部投资，基础设施投资等），鼓励民间投资，以及鼓励新兴产业，鼓励消费，推动节能减排等一系列结构转型政策相配套的综合性的经济扩张计划。从近期政府的频繁表态来看，预计下半年在放松政府管制，鼓励民营投资，积极推进经济结构调整，深化财税，金融，医疗，教育文化等关键领域改革等方面将会有更多更加积极的政策出台。

从行业和个股选择上来看，当前中国经济转型的中长期趋势决定了市场正在逐步从过去的“齐涨共跌”转向“结构分化”。那些符合中国经济转型方向，符合社会需求变化趋势的行业或个股，才能够最大程度分享中国经济的未来增长成果；相反，那些单纯依靠规模产能扩张，单纯依靠投资出口拉动的行业或个股，将面临行业重新洗牌的风险与挑战。因此，在行业选择上，我们将继续坚持看好“消费”和“新兴产业”的投资主线，看好医药、食品饮料、医药、家电、高端装备、TMT 等行业的投资机会；在个股选择上，将继续秉承“自下而上，集中持股”的策略，争取最大程度分享那些具备显著竞争优势的优质成长股的持续成长性机会，并为基金持有人创造持续而稳定的投资回报。

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、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

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，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

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

2012 年上半年度，基金托管人在汇丰晋信龙腾股票型开放式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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信龙腾股票型开放式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

2012 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龙腾股票型开放式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：汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 6.4.10.5 | 50,543,738.97 | 84,234,960.95 |
| 结算备付金 | 6.4.10.5 | 213,600,372.47 | 73,782,112.85 |
| 存出保证金 | | 1,250,000.00 | 1,353,913.63 |
| 交易性金融资产 | 6.47.2 | 1,293,574,672.58 | 1,446,843,251.10 |
| 其中：股票投资 | | 1,293,574,672.58 | 1,446,843,251.10 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | | 21,922,095.32 | 28,524,539.71 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 104,322.30 | 63,302.79 |
| 应收股利 | | 403,332.57 | - |
| 应收申购款 | | 141,755.33 | 13,270,365.33 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,581,540,289.54 | 1,648,072,446.36 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
| 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 | | 7,388,377.46 | - |
| 应付赎回款 | | 5,870,569.00 | 137,098.61 |
| 应付管理人报酬 | | 1,948,211.01 | 2,113,167.81 |
| 应付托管费 | | 324,701.86 | 352,194.64 |
| 应付销售服务费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,213,118.63 | 779,554.09 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 1,477,071.17 | 1,740,309.32 |
| 负债合计 | | 18,222,049.13 | 5,122,324.47 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,334,847,129.07 | 1,414,815,712.64 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 228,471,111.34 | 228,134,409.25 |
| 所有者权益合计 | | 1,563,318,240.41 | 1,642,950,121.89 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,581,540,289.54 | 1,648,072,446.36 |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1712 元，基金份额总额 1,334,847,129.07 份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|---------------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 35,219,422.03 | -185,347,150.95 |
| 1.利息收入 | | 1,529,644.00 | 1,690,241.92 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,529,644.00 | 1,690,241.92 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -144,131,095.02 | 77,327,840.44 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -152,343,373.12 | 67,855,848.03 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | 8,212,278.10 | 9,471,992.41 |
| 3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列） | 6.4.7.16 | 177,716,410.11 | -265,116,153.93 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|------------------------|
| 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 | 104,462.94 | 750,920.62 |
| 减：二、费用 | | 18,675,025.73 | 22,328,412.33 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 12,106,047.62 | 13,657,610.76 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,017,674.64 | 2,276,268.45 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 4,328,226.27 | 6,142,313.55 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 223,077.20 | 252,219.57 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 16,544,396.30 | -207,675,563.28 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 16,544,396.30 | -207,675,563.28 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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） | 1,414,815,712.64 | 228,134,409.25 | 1,642,950,121.89 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 16,544,396.30 | 16,544,396.30 |
| 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） | -79,968,583.57 | -16,207,694.21 | -96,176,277.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 36,964,073.15 | 6,137,050.50 | 43,101,123.65 |
| 2. 基金赎回款 | -116,932,656.72 | -22,344,744.71 | -139,277,401.43 |
| 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 | 1,334,847,129.07 | 228,471,111.34 | 1,563,318,240.41 |

| 项目 | 上年度可比期间 | | |
|--|---------------------------------|------------------|-------------------|
| | 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 |
| 金净值) | | | |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,140,713,989.35 | 1,156,090,916.71 | 2,296,804,906.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -207,675,563.28 | -207,675,563.28 |
| 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） | 321,933,940.67 | 119,293,489.10 | 441,227,429.77 |
| 其中：1. 基金申购款 | 861,946,200.37 | 580,497,108.65 | 1,442,443,309.02 |
| 2. 基金赎回款 | -540,012,259.70 | -461,203,619.55 | -1,001,215,879.25 |
| 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） | - | -493,886,971.92 | -493,886,971.92 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,462,647,930.02 | 573,821,870.61 | 2,036,469,800.63 |

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

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于同意汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]157 号文)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《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2006 年 9 月 27 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 1,436,388,715.89 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、《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金招募说明书》的有关

规定,本基金的投资范围为:股票(A股及监管机构允许投资的其他种类的其他市场的股票)、债券(包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债等)、短期金融工具(包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、银行存款、短期融资券等)、现金资产、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产 60%-95%;除股票以外的其他资产 5%-40%,其中现金或到期日在一年期以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:75%×新华富时 600 成长指标收益率+25%×1 年期银行定期存款利率(税后)。

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(2006)、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》、《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同》和中国证监会基金部通知[2010]5 号文《证券投资基金信息披露 XBRL 模版第 3 号年度报告和半年度报告》以及中国证监会允许的如会计报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报告符合企业会计准则(2006)的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值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

本报告期内,本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与 2011 年年度财务报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期内,本基金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 股和股权按 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 2012 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 50,543,738.97 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 50,543,738.97 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

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

| | | 2012年6月30日 | | |
|--------|-------|------------------|------------------|----------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,359,248,870.48 | 1,293,574,672.58 | -65,674,197.90 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,359,248,870.48 | 1,293,574,672.58 | -65,674,197.90 |

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 2012年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 7,337.99 |
| 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 | 96,296.62 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 687.69 |
| 其他 | - |
| 合计 | 104,322.30 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,213,118.63 |

| | |
|-------------|--------------|
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,213,118.63 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 1,250,000.00 |
| 应付赎回费 | 13,248.47 |
| 应付后端申购费 | - |
| 债券利息税 | - |
| 预提费用 | 213,822.70 |
| 银行手续费 | - |
| 合计 | 1,477,071.17 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,414,815,712.64 | 1,414,815,712.64 |
| 本期申购 | 36,964,073.15 | 36,964,073.15 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -116,932,656.72 | -116,932,656.72 |
| 本期末 | 1,334,847,129.07 | 1,334,847,129.07 |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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 | 888,227,151.79 | -660,092,742.54 | 228,134,409.25 |
| 本期利润 | -161,172,013.81 | 177,716,410.11 | 16,544,396.30 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -45,761,900.89 | 29,554,206.68 | -16,207,694.21 |
| 其中：基金申购款 | 20,226,198.00 | -14,089,147.50 | 6,137,050.50 |
| 基金赎回款 | -65,988,098.89 | 43,643,354.18 | -22,344,744.71 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 681,293,237.09 | -452,822,125.75 | 228,471,111.34 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 206,870.43 |

| | |
|-----------|--------------|
| 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 | 1,321,194.96 |
| 其他 | 1,578.61 |
| 合计 | 1,529,644.00 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,479,101,155.05 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,631,444,528.17 |
| 买卖股票差价收入 | -152,343,373.12 |

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内，本基金未进行债券投资，债券投资收益为零。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,212,278.10 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 8,212,278.10 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 177,716,410.11 |
| ——股票投资 | 177,716,410.11 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | 177,716,410.11 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 104,137.71 |
| 转出基金补偿收入 | 325.23 |
| 合计 | 104,462.94 |

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 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 4,328,226.27 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 4,328,226.27 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 审计费用 | 64,644.58 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 银行汇款费用 | 254.50 |
| 银行间债券账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 223,077.20 |

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 |
| 山西证券股份有限公司（“山西证券”） | 见注释① |

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省国信投资(集团)公司控

制。

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 山西证券 | 105,921,076.86 | 3.82% | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|------------|-----------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 山西证券 | 86,061.26 | 3.69% | 86,061.26 | 7.09% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 山西证券 | - | - | - | - |

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用山西证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券和权证交易的同时，还从山西证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-----------------|----------------------|--|----------------------|--|
| | 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 2011年1月1日至2011年6月30日 | |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,106,047.62 | | 13,657,610.76 | |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 654,115.98 | | 871,957.20 | |

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 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|----------------|----------------------|--|----------------------|--|
| | 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 2011年1月1日至2011年6月30日 | |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,017,674.64 | | 2,276,268.45 | |

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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

本报告期间与上年度可比期间，本基金均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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|------------|----------------------|------------|
| | 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 2011年1月1日至2011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 | 50,543,738.97 | 206,870.43 | 278,768,399.21 | 570,961.59 |

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 2012 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 213,600,372.47 元(2011 年 6 月 30 日：人民币 155,615,991.43 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

本报告期间与上年度可比期间，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

2012 年上半年度，本基金未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2012 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

本报告期内本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 600267 | 海正药业 | 2012-06-29 | 临时股东大会 | 17.48 | 2012-07-02 | 17.79 | 1,968,834 | 35,485,527.10 | 34,415,218.32 | - |

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

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，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

本报告期末及上年度末本基金未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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 2012年6 月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 50,543,738.97 | - | - | - | 50,543,738.97 |
| 结算备付金 | 213,600,372.47 | - | - | - | 213,600,372.47 |
| 存出保证金 | - | - | - | 1,250,000.00 | 1,250,000.00 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,293,574,672.58 | 1,293,574,672.58 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 21,922,095.32 | 21,922,095.32 |
| 应收利息 | - | - | - | 104,322.30 | 104,322.30 |

| | | | | | |
|-------------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 应收股利 | - | - | - | 403,332.57 | 403,332.57 |
| 应收申购款 | 994.04 | - | - | 140,761.29 | 141,755.33 |
| 资产总计 | 264,145,105.48 | - | - | 1,317,395,184.06 | 1,581,540,289.54 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 7,388,377.46 | 7,388,377.46 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,870,569.00 | 5,870,569.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,948,211.01 | 1,948,211.01 |
| 应付托管费 | - | - | - | 324,701.86 | 324,701.86 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,213,118.63 | 1,213,118.63 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,477,071.17 | 1,477,071.17 |
| 负债总计 | - | - | - | 18,222,049.13 | 18,222,049.13 |
| 利率敏感度缺口 | 264,145,105.48 | - | - | 1,299,173,134.93 | 1,563,318,240.41 |
| 上年度末 2011年12 月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 84,234,960.95 | - | - | - | 84,234,960.95 |
| 结算备付金 | 73,782,112.85 | - | - | - | 73,782,112.85 |
| 存出保证金 | 103,913.63 | - | - | 1,250,000.00 | 1,353,913.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,446,843,251.10 | 1,446,843,251.10 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 28,524,539.71 | 28,524,539.71 |
| 应收利息 | - | - | - | 63,302.79 | 63,302.79 |
| 应收申购 | 13,270,365.33 | - | - | - | 13,270,365.33 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 款 | | | | | |
| 资产总计 | 171,391,352.76 | - | - | 1,476,681,093.60 | 1,648,072,446.36 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 137,098.61 | 137,098.61 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,113,167.81 | 2,113,167.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | 352,194.64 | 352,194.64 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 779,554.09 | 779,554.09 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,740,309.32 | 1,740,309.32 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,122,324.47 | 5,122,324.47 |
| 利率敏感度缺口 | 171,391,352.76 | - | - | 1,471,558,769.13 | 1,642,950,121.89 |

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者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 2012年6月30日 | 上年度末 2011年12月31日 |
| | 市场利率上升25个基点 | 无影响 | 无影响 |
| | 市场利率下降25个基点 | 无影响 | 无影响 |

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股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 82.75%、无债券投资及衍生金融资产。截止 2012 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2012 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2011 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 | 1,293,574,672.58 | 82.75 | 1,446,843,251.10 | 88.06 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,293,574,672.58 | 82.75 | 1,446,843,251.10 | 88.06 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加 81,028,859.42 元 | 增加 86,987,860.99 元 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少 81,028,859.42 元 | 减少 86,987,860.99 元 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(a) 以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2012 年 06 月 30 日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

2012 年 06 月 30 日

| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 合计 |
|---------|------------------|---------------|------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | | | | |
| 股票投资 | 1,259,159,454.26 | 34,415,218.32 | - | 1,293,574,672.58 |
| 债券投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,259,159,454.26 | 34,415,218.32 | - | 1,293,574,672.58 |

2011 年 12 月 31 日

| | | | | |
|---------|------------------|---------------|---|------------------|
| 资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | | | | |
| 股票投资 | 1,430,132,640.30 | 16,710,610.80 | - | 1,446,843,251.10 |
| 债券投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,430,132,640.30 | 16,710,610.80 | - | 1,446,843,251.10 |

根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层级。

(b) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量账面价值）

除 6.4.14(a)披露的以公允价值计量的金融工具外，本基金 06 月 30 日各项金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

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 | 1,293,574,672.58 | 81.79 |
| | 其中：股票 | 1,293,574,672.58 | 81.79 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 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 | 264,144,111.44 | 16.70 |
| 6 | 其他各项资产 | 23,821,505.52 | 1.51 |
| 7 | 合计 | 1,581,540,289.54 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----|----------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | 49,868,811.51 | 3.19 |
| C | 制造业 | 583,397,304.56 | 37.32 |
| C0 | 食品、饮料 | 172,193,221.17 | 11.01 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 26,173,032.34 | 1.67 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | 5,508,457.42 | 0.35 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 192,741,884.42 | 12.33 |
| C8 | 医药、生物制品 | 186,780,709.21 | 11.95 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 64,212,161.70 | 4.11 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 32,065,153.12 | 2.05 |
| G | 信息技术业 | 58,477,887.30 | 3.74 |
| H | 批发和零售贸易 | 139,558,251.70 | 8.93 |
| I | 金融、保险业 | 270,544,591.14 | 17.31 |
| J | 房地产业 | 60,688,021.25 | 3.88 |
| K | 社会服务业 | 34,762,490.30 | 2.22 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,293,574,672.58 | 82.75 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|--------|-------|-----------|----------------|----------------------|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 5,044,818 | 105,184,455.30 | 6.73 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 4,166,999 | 85,756,839.42 | 5.49 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 1,819,888 | 83,241,677.12 | 5.32 |
| 4 | 002038 | 双鹭药业 | 2,166,999 | 69,777,367.80 | 4.46 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 6,666,967 | 64,202,892.21 | 4.11 |
| 6 | 600011 | 华能国际 | 9,666,946 | 62,351,801.70 | 3.99 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 5,166,999 | 56,423,629.08 | 3.61 |
| 8 | 600583 | 海油工程 | 8,188,639 | 49,868,811.51 | 3.19 |
| 9 | 600066 | 宇通客车 | 2,166,150 | 48,651,729.00 | 3.11 |
| 10 | 002269 | 美邦服饰 | 1,999,999 | 48,199,975.90 | 3.08 |
| 11 | 002024 | 苏宁电器 | 5,518,888 | 46,303,470.32 | 2.96 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 3,979,200 | 45,124,128.00 | 2.89 |
| 13 | 000729 | 燕京啤酒 | 5,518,518 | 40,285,181.40 | 2.58 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 2,888,999 | 36,488,057.37 | 2.33 |
| 15 | 000888 | 峨眉山 A | 1,625,935 | 34,762,490.30 | 2.22 |
| 16 | 600267 | 海正药业 | 1,968,834 | 34,415,218.32 | 2.20 |
| 17 | 000538 | 云南白药 | 568,963 | 33,728,126.64 | 2.16 |
| 18 | 600009 | 上海机场 | 2,516,888 | 32,065,153.12 | 2.05 |
| 19 | 600153 | 建发股份 | 4,316,999 | 30,909,712.84 | 1.98 |
| 20 | 600406 | 国电南瑞 | 1,652,042 | 30,876,664.98 | 1.98 |
| 21 | 300043 | 星辉车模 | 1,536,878 | 26,173,032.34 | 1.67 |
| 22 | 000423 | 东阿阿胶 | 616,999 | 24,686,129.99 | 1.58 |
| 23 | 600195 | 中牧股份 | 1,416,991 | 24,173,866.46 | 1.55 |
| 24 | 002073 | 软控股份 | 2,666,999 | 22,349,451.62 | 1.43 |
| 25 | 002152 | 广电运通 | 1,003,409 | 16,556,248.50 | 1.06 |
| 26 | 600519 | 贵州茅台 | 66,999 | 16,022,810.85 | 1.02 |
| 27 | 601336 | 新华保险 | 466,888 | 15,986,245.12 | 1.02 |
| 28 | 002244 | 滨江集团 | 1,715,975 | 15,563,893.25 | 1.00 |
| 29 | 600600 | 青岛啤酒 | 400,000 | 15,276,000.00 | 0.98 |
| 30 | 000848 | 承德露露 | 846,290 | 14,852,389.50 | 0.95 |
| 31 | 601009 | 南京银行 | 1,666,912 | 14,202,090.24 | 0.91 |
| 32 | 600859 | 王府井 | 516,999 | 14,145,092.64 | 0.90 |
| 33 | 000063 | 中兴通讯 | 999,999 | 13,959,986.04 | 0.89 |
| 34 | 600050 | 中国联通 | 3,666,999 | 13,641,236.28 | 0.87 |
| 35 | 002241 | 歌尔声学 | 150,958 | 5,508,457.42 | 0.35 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 36 | 600027 | 华电国际 | 444,000 | 1,860,360.00 | 0.12 |
|----|--------|------|---------|--------------|------|

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600837 | 海通证券 | 65,616,535.66 | 3.99 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 62,984,841.57 | 3.83 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 61,898,670.55 | 3.77 |
| 4 | 601808 | 中海油服 | 52,152,873.59 | 3.17 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 51,086,853.97 | 3.11 |
| 6 | 600583 | 海油工程 | 48,918,664.97 | 2.98 |
| 7 | 601669 | 中国水电 | 48,238,894.58 | 2.94 |
| 8 | 002269 | 美邦服饰 | 47,634,886.95 | 2.90 |
| 9 | 600337 | 美克股份 | 45,599,003.26 | 2.78 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 41,941,851.97 | 2.55 |
| 11 | 601009 | 南京银行 | 41,224,060.10 | 2.51 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 39,015,325.59 | 2.37 |
| 13 | 600267 | 海正药业 | 34,837,454.23 | 2.12 |
| 14 | 600406 | 国电南瑞 | 31,945,295.42 | 1.94 |
| 15 | 601336 | 新华保险 | 29,987,983.30 | 1.83 |
| 16 | 002244 | 滨江集团 | 29,870,674.96 | 1.82 |
| 17 | 600153 | 建发股份 | 29,745,010.09 | 1.81 |
| 18 | 000783 | 长江证券 | 29,573,874.26 | 1.80 |
| 19 | 000848 | 承德露露 | 29,208,336.23 | 1.78 |
| 20 | 600872 | 中炬高新 | 27,032,379.49 | 1.65 |

注：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，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600050 | 中国联通 | 94,021,363.98 | 5.72 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 75,792,009.93 | 4.61 |
| 3 | 002024 | 苏宁电器 | 69,996,926.54 | 4.26 |
| 4 | 002073 | 软控股份 | 62,431,803.11 | 3.80 |
| 5 | 601808 | 中海油服 | 50,943,960.61 | 3.10 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 6 | 601669 | 中国水电 | 48,681,208.78 | 2.96 |
| 7 | 300020 | 银江股份 | 48,449,274.14 | 2.95 |
| 8 | 600153 | 建发股份 | 46,548,012.51 | 2.83 |
| 9 | 000729 | 燕京啤酒 | 39,619,099.18 | 2.41 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 37,796,469.17 | 2.30 |
| 11 | 600337 | 美克股份 | 35,613,056.00 | 2.17 |
| 12 | 600066 | 宇通客车 | 32,356,778.59 | 1.97 |
| 13 | 000783 | 长江证券 | 31,509,300.67 | 1.92 |
| 14 | 000069 | 华侨城 A | 28,935,414.20 | 1.76 |
| 15 | 002152 | 广电运通 | 28,848,831.53 | 1.76 |
| 16 | 600872 | 中炬高新 | 28,473,897.56 | 1.73 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 27,187,912.44 | 1.65 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 25,761,161.13 | 1.57 |
| 19 | 000338 | 潍柴动力 | 24,778,321.63 | 1.51 |
| 20 | 601111 | 中国国航 | 24,125,447.09 | 1.47 |

注：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，不考虑相关交易费用。

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 | 1,300,459,539.54 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,479,101,155.05 |

注：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，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 | 1,250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 21,922,095.32 |
| 3 | 应收股利 | 403,332.57 |
| 4 | 应收利息 | 104,322.30 |
| 5 | 应收申购款 | 141,755.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,821,505.52 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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不存在流通受限情况。

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

| 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 |
| 28,871 | 46,234.88 | 890,773,657.64 | 66.73% | 444,073,471.43 | 33.27% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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基金 | 244,282.53 | 0.0183% |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 1 万份至 5 万份(含)。本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为 1 万份至 5 万份(含)。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006 年 9 月 27 日）基金份额总额 | 1,436,388,715.89 |
| 本报告期初基金份额总额 | 1,414,815,712.64 |
| 本报告期基金总申购份额 | 36,964,073.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 116,932,656.72 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,334,847,129.07 |

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

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。

基金托管人交通银行于 2012 年 5 月 28 日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在 2012 年 5 月 30 日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

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 | |
| 兴业证券 | 1 | 915,007,974.42 | 33.03% | 750,312.78 | 32.20% | - |
| 国泰君安 | 1 | 446,551,570.04 | 16.12% | 379,566.49 | 16.29% | - |
| 华泰证券 | 1 | 436,539,033.33 | 15.76% | 379,082.13 | 16.27% | - |
| 安信证券 | 1 | 267,527,954.23 | 9.66% | 227,397.57 | 9.76% | - |
| 中金公司 | 1 | 258,650,283.10 | 9.34% | 219,853.39 | 9.44% | - |
| 民生证券 | 1 | 200,111,801.63 | 7.22% | 170,094.30 | 7.30% | - |
| 山西证券 | 1 | 105,921,076.86 | 3.82% | 86,061.26 | 3.69% | - |
| 国信证券 | 1 | 72,452,535.24 | 2.62% | 58,867.98 | 2.53% | - |
| 国金证券 | 1 | 67,462,347.84 | 2.44% | 58,895.81 | 2.53% | - |
| 合计 | 9 | 2,770,224,576.69 | 100.00% | 2,330,131.71 | 100.00% | - |

注：①本报告期内本基金新增交易单元国泰君安和华泰证券，减少交易单元中信建投和光大证券。

②专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

实力雄厚，信誉良好；

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；

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；

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；

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：

研究报告的数量和质量；

提供研究服务的主动性；

资讯提供的及时性及便利性；

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 |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - | - |

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 | 2012-01-04 |
| 2 | 汇丰晋信关于继续通过农业银行开展基金网银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 | 2012-01-05 |
| 3 | 汇丰晋信关于旗下基金继续通过华夏银行开展定期定额申购费率优惠和网银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 | 2012-01-05 |
| 4 | 汇丰晋信基金2011年第4季度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-01-20 |
| 5 | 新增中信证券(浙江)有限责任公司为代销机构的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-02-13 |
| 6 | 汇丰晋信关于旗下基金通过工商银行开展网银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 | 2012-03-30 |
| 7 | 汇丰晋信基金2011年年度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-03-30 |
| 8 | 汇丰晋信基金2012年第1季度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-04-23 |
| 9 | 汇丰晋信龙腾股票型证券投资基金更新招募说明书（2012年第1号） | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-05-11 |
| 10 | 汇丰晋信关于新增洛阳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 | 2012-06-25 |
| 11 | 关于通过洛阳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 | 2012-06-25 |
| 12 | 汇丰晋信关于新增深圳众禄基金销售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 | 2012-06-28 |
| 13 | 汇丰晋信关于在深圳众禄基金销售有限公司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 | 2012-06-28 |
| 14 | 关于通过深圳众禄基金销售有限公司开办 | 本基金选定的信息 | 2012-06-28 |

| | | | |
|----|--|--------------------|------------|
| | 汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告 | 披露报纸、管理人网站 | |
| 15 | 汇丰晋信关于旗下基金通过深圳众禄基金销售有限公司开展网上交易、定期定额申购费率优惠的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2012-06-28 |
| 16 | 汇丰晋信关于旗下基金参加中信银行股份有限公司网上银行、移动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 | 2012-06-29 |
| 17 | 汇丰晋信龙腾基金关于通过交通银行开展网上银行、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 | 2012-06-29 |

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龙腾股票型开放式证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信龙腾股票型开放式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) 报告期内汇丰晋信龙腾股票型开放式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
二〇一二年八月二十八日