

# 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

## 2012 年半年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信中小盘股票
基金主代码	540007
交易代码	540007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	614,511,514.17份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有持续成长潜力的中小型优势企业，充分把握其在成长为行业龙头过程中所体现出的高成长性、可持续性以及市值高速扩张所带来的投资机会，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>根据本基金所奉行的“关注成长、较高仓位、精选研究”的投资理念和“研究创造价值”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) 行业配置策略</p> <p>行业研究员通过分析行业特征，定期提出行业投资评级和配置建议。行业比较分析师综合内、外部研究资源，结合宏观基本面分析等状况，提出重点行业配置比重的建议。</p> <p>(3) 股票投资策略</p> <p>本基金主要采用“自下而上”的方式挑选具有持续潜力、目前股价尚未充分反映公司未来高成长性的中小型上市公司股票作为主要投资对象。</p>

业绩比较基准	中证700（中小盘）指数*90%+同业存款利率*10%。
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和预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	尹东
	联系电话	021-38789898	010-67595003
	电子邮箱	melody.y.gu@hsbcjt.cn	Yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38789998	010-67595096
传真		021-68881925	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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； 中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

注：

## 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	-17,192,071.71
本期利润	21,279,527.68
加权平均基金份额本期利润	0.0341
本期基金份额净值增长率	4.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	-0.2450

期末基金资产净值	463,981,722.63
期末基金份额净值	0.7550

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	-1.99%	0.81%	-7.18%	1.11%	5.19%	-0.30%
过去三个月	3.57%	0.91%	0.78%	1.10%	2.79%	-0.19%
过去六个月	4.67%	1.26%	4.48%	1.42%	0.19%	-0.16%
过去一年	-17.58%	1.26%	-22.02%	1.40%	4.44%	-0.14%
自基金成立起至今	-23.13%	1.35%	-23.63%	1.45%	0.50%	-0.10%

#### 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

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

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

（2009 年 12 月 11 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的 85%–95%，其中，将不低于 80% 的股票资产投资于国内 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小上市公司股票。本基金权证投资比例范围为基金资产净值的 0%–3%。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%–15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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 2010 年 6 月 11 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 = 中证 700（中小盘）指数\*90% + 同业存款利率\*10%。

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的计算未包含中证 700 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
廖志峰	本基金基金经理、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理	2011-02-26	-	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、汇丰晋信龙腾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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待, 充分保护基金份额持有人的合法权益, 汇丰晋信基金管理有限公司根据《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，中证 700 指数收于 3179.05 点，半年涨幅为 4.94%。在此期间，随着经济景气度的逐步下降，央行进行了适度的货币政策微调，两次降低金融机构存款准备金率各 0.5%，并在 6 月份初进行了近三年半以来的首次降息。但由于 5、6 月份实体经济数据表现较预期疲软，投资者信心的相对匮乏使得市场整体呈现先涨后跌的震荡格局。从行业表现来看也反映出了投资者较为矛盾的心态，上半年受益于经济复苏预期、或股票市场市场上涨的房地产、有色金属、券商、保险等周期性行业，以及医药生物、食品饮料、电力及公用事业等传统意义上的防御性行业，均出现在行业涨幅前列。而跌幅靠前的行业中，也同时出现了煤炭、建材、电力设备、通信等行业的身影。

2012 年初我们认为国内宏观经济虽头绪繁多，但主要的矛盾仍在于经济减速节奏和支持政策组合两者间可能存在一定程度的不匹配，从而导致一些局部的风险。从上半年的情况来看，该判断总体正确。特别是 4 月底以来，宏观预调微调政策并未改变逐步下滑的经济景气度，股票市场也出现了明显的调整。基于对政策和宏观的总体判断框架，本基金在 2012 上半年实行了“具有可验证成长性且估值合理的成长股+低估值中小盘价值股”的策略构建组合配置。在保持对餐饮旅游、食品饮料、页岩气开发、汽车等行业中的高成长性公司的配置的同时，也提高了对 PE 和 PB 均处于全市场估值底部区域的房地产、金融行业内中小市值公司的配置比例。在上半年取得局部效果。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至上半年末，本基金份额净值比 2011 年末上涨 4.67%，业绩比较基准上涨 4.48%，净值表现领先业绩比较基准 0.19%

#### 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，全球经济形势有进一步恶化迹象。欧元区内部纷争不断，迟迟不能拿出解决债务危机的有效方案。虽然欧央行行长德拉吉承诺将会不惜一切代价维护欧元区的完整，暂时缓解了市场紧张情绪，但并未得到核心国家德国的积极响应，西班牙和意大利长期国债收益率仍徘徊在 7% 的危险水平附近，欧债危机后续仍有进一步扩散的风险，很大程度上提高了下半年全球经济运行的不确定性。美国方面，二季度实际 GDP 年化环比增速从一季度修正后的 2.0% 回落至 1.5%，国内需求不振是 GDP 回落的主要原因。二季度美国居民消费年化环比增速仅为 1.5%，为 2011 年二季度以来最低。耐用品消费年化环比增速从一季度的 11.5% 下降 -1.0%，为去年二季度以来首次出现负值。但是，美国住宅市场开始出现明显企稳迹象，将为下半年美国经济保持温和增长提供一定的支撑。

国内经济方面，从二季度环比仍较快速下降的社会用电量、财政收入、企业利润增速等经济指标看，我们认为，国内实体经济仍在经历类似 U 型复苏的左侧阶段，虽然三季度是否是经济增长的阶段性底部区域仍有待数据的进一步验证，但从资本市场角度出发，央行 6 月初的降息正式意味着国内货币政策进入更大力度的放松阶段。我们预计随着经济景气度的继续下滑以及通胀压力的显著降低，货币政策、财政政策以及产业政策等各方面正逐步向有利于经济复苏、有利于资本市场活跃的方向转变。历史经验表明，资本市场底部的产生往往

领先于实体经济。下半年我们将更加关注经济运行中可能出现的环比改善情况。同时，也将紧密跟踪仍处于探底过程中的股票市场可能存在的投资机会。按照我们对宏观情况和政策组合的判断，下半年的股票市场在经历了较低的经济景气和不佳的企业盈利增长所致的冲击后，市场整体性投资机会将可能显现。

基于宏观经济可能在下半年某个时点触底的判断，我们在规避经济下滑、股票市场下跌风险的同时，将更加注重寻找受益于政策宽松、以及逐步增强的经济复苏预期可能带来的行业性投资机会。如果投资者的过度悲观导致市场非理性下跌，将为后续可能的投资机会打开更大的空间。下半年，本基金将继续坚持“具有可验证成长性且估值合理的成长股+低估值中小盘价值股”的策略构建组合。密切跟踪宏观政策、经济运行情况的变化以调整我们的策略。

#### 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展开工作，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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### 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：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

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	65,334,165.18	65,073,085.86
结算备付金		1,278,875.79	644,857.86
存出保证金		250,000.00	341,311.55
交易性金融资产	6.4.7.2	394,893,269.77	396,305,354.31
其中: 股票投资	6.4.7.2	394,893,269.77	396,305,354.31
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		4,001,245.26	4,434,482.18
应收利息	6.4.7.5	12,354.44	10,543.00
应收股利		1,992,083.94	-
应收申购款		31,808.94	52,602.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		467,793,803.32	466,862,237.68
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,160,166.59	8,767,737.85
应付赎回款		137,465.71	105,110.74
应付管理人报酬		574,801.28	596,967.18
应付托管费		95,800.24	99,494.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	644,424.64	1,016,108.18
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	199,422.23	360,396.14
负债合计		3,812,080.69	10,945,814.59
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	614,511,514.17	632,079,112.69
未分配利润	6.4.7.10	-150,529,791.54	-176,162,689.60

所有者权益合计		463,981,722.63	455,916,423.09
负债和所有者权益总计		467,793,803.32	466,862,237.68

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7550 元，基金份额总额 614,511,514.17 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		<b>27,777,425.47</b>	<b>-107,676,900.92</b>
1.利息收入		227,560.92	310,871.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	227,560.92	310,871.11
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）		-10,945,189.25	33,721,123.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-15,219,504.69	29,590,837.67
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	4,274,315.44	4,130,285.61
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	38,471,599.39	-142,094,660.93
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	23,454.41	385,765.62
<b>减：二、费用</b>		<b>6,497,897.79</b>	<b>12,798,495.65</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,453,914.49	5,460,713.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	575,652.42	910,119.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,259,992.72	6,175,861.50
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	208,338.16	251,801.41
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>21,279,527.68</b>	<b>-120,475,396.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>21,279,527.68</b>	<b>-120,475,396.57</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

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)	632,079,112.69	-176,162,689.60	455,916,423.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,279,527.68	21,279,527.68
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)	-17,567,598.52	4,353,370.38	-13,214,228.14
其中：1. 基金申购款	7,524,191.88	-1,976,231.62	5,547,960.26
2. 基金赎回款	-25,091,790.40	6,329,602.00	-18,762,188.40
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)	614,511,514.17	-150,529,791.54	463,981,722.63
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
一、期初所有者权益(基金净值)	840,396,697.80	72,002,703.98	912,399,401.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-120,475,396.57	-120,475,396.57
三、本期基金份额交易产	-185,275,595.23	-6,542,523.14	-191,818,118.37

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	31,426,098.56	-168,080.39	31,258,018.17
2. 基金赎回款	-216,701,693.79	-6,374,442.75	-223,076,136.54
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）	655,121,102.57	-55,015,215.73	600,105,886.84

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

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于核准汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2009]1105 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《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 11 月 10 日至 2009 年 12 月 8 日募集，募集资金总额 2,253,396,692.29 元，手续费 20,087,103.07 元，利息转份额 508,700.69 元，募集规模为 2,233,818,289.91 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了 KPMG-B(2009)CR No. 0064 号验资报告。本基金已在中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2009 年 12 月 11 日获中国证监会的书面确认（中国证监会基金部函[2009]755 号），基金合同于 2009 年 12 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信中小盘股票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国内依法上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范

围。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-15%，其中现金或到期日在一年之内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金将不低于 80%的股票资产投资于沪深两市上具有良好成长性和竞争力的上市公司股票。基金管理人每季度将对中国 A 股市场的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股市场总流通市值 60%的股票归入中小盘。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观基金情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超过上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例作适度调整。本基金业绩比较基准为：中证 700（中小盘）指数\*90%+同业存款利率\*10%。

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》、《汇丰晋信中小盘股票型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 2011 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

本基金在本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、债券的差价收入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 关联方关系

#### 6.4.7.1 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。

#### 6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
山西信托有限责任公司(“山西信托”)	基金管理人的股东
山西证券股份有限公司(“山西证券”)	见注释①
中德证券有限责任公司(“中德证券”)	见注释②
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东

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。

②中德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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 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	124,972,262.77	8.50%	452,934,480.27	11.39%

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

##### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

##### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

##### 6.4.8.1.5 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	占当期佣金	期末应付	占期末应付佣

	佣金	总量的比例	佣金余额	金总额的比例
山西证券	106,226.25	8.63%	106,226.25	16.48%
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	384,989.86	11.55%	-	-

注：1、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有限责任公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从山西证券有限责任公司获得证券研究综合服务。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	3,453,914.49	5,460,713.73
其中：支付销售机构的客户 维护费	828,562.83	1,236,071.08

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：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托 管费	575,652.42	910,119.01

注：支付基金托管人建设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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

##### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期间及上年度可比期间内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。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.8.4.1 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，本基金的基金管理人均未投资本基金。

**6.4.8.4.2 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。

**6.4.8.5 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
建设银行	65,334,165.18	217,402.87	61,202,489.17	288,419.47

注：本基金通过“建设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 06 月 30 日的相关余额为人民币 1,278,875.79 元 (2011 年 6 月 30 日：人民币 2,245,855.04 元)

**6.4.8.6 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。

**6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于 2012 年 06 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截止 2012 年 06 月 30 日，本基金无因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截止 2012 年 06 月 30 日，本基金无因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(5) 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 6 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 6 月 30 日	第一层级	第二层级	第三层级	合计
产品品种	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	394,893,269.77		394,893,269.77	
债券投资				-
合计	394,893,269.77		394,893,269.77	

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。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见附注 6.4.4.4 和 6.4.4.5。

(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，本基金其他的金融资产主要为银行存款。于资产负债表日，本基金金融负债的账面价值接近公允价值。

## 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	394,893,269.77	84.42
	其中：股票	394,893,269.77	84.42
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	66,613,040.97	14.24
6	其他各项资产	6,287,492.58	1.34
7	合计	467,793,803.32	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	15,311,650.00	3.30
C	制造业	86,170,042.51	18.57
C0	食品、饮料	40,688,156.66	8.77
C1	纺织、服装、皮毛	278,500.00	0.06
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	29,182,002.58	6.29
C8	医药、生物制品	16,021,383.27	3.45
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	66,132,877.31	14.25
E	建筑业	22,863,360.63	4.93
F	交通运输、仓储业	43,317,882.78	9.34
G	信息技术业	7,233,217.57	1.56
H	批发和零售贸易	74,925.84	0.02
I	金融、保险业	95,017,125.74	20.48
J	房地产业	19,287,443.85	4.16
K	社会服务业	39,484,743.54	8.51
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	394,893,269.77	85.11

### 7.3 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

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	000069	华侨城 A	2,859,999	18,246,793.62	3.93
2	000625	长安汽车	3,189,888	15,566,653.44	3.36
3	002353	杰瑞股份	312,300	15,146,550.00	3.26
4	600048	保利地产	1,299,999	14,741,988.66	3.18
5	600027	华电国际	3,382,186	14,171,359.34	3.05
6	000848	承德露露	806,495	14,153,987.25	3.05
7	000888	峨眉山 A	653,174	13,964,860.12	3.01
8	601009	南京银行	1,623,116	13,828,948.32	2.98
9	601669	中国水电	3,151,999	13,774,235.63	2.97
10	000538	云南白药	231,999	13,752,900.72	2.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于汇丰晋信基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

### 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	601009	南京银行	28,151,185.16	6.17
2	601333	广深铁路	24,402,921.95	5.35
3	000926	福星股份	20,638,466.68	4.53
4	000402	金融街	20,264,921.08	4.44
5	000069	华侨城 A	17,028,855.35	3.74
6	000002	万科 A	16,926,703.09	3.71
7	000800	一汽轿车	16,881,013.21	3.70
8	000001	深发展 A	16,117,499.79	3.54
9	600742	一汽富维	15,576,427.07	3.42
10	601169	北京银行	15,273,357.00	3.35
11	601398	工商银行	14,986,038.00	3.29
12	000625	长安汽车	14,608,100.26	3.20
13	601288	农业银行	14,495,301.00	3.18
14	601988	中国银行	14,467,124.00	3.17
15	600887	伊利股份	14,331,354.65	3.14

16	600583	海油工程	14,132,875.28	3.10
17	600900	长江电力	14,110,885.00	3.10
18	000888	峨眉山 A	14,023,408.41	3.08
19	000729	燕京啤酒	13,957,609.42	3.06
20	600011	华能国际	13,953,583.58	3.06
21	600009	上海机场	13,612,635.74	2.99
22	002635	安洁科技	13,525,884.44	2.97
23	600027	华电国际	13,510,440.39	2.96
24	600004	白云机场	13,362,084.63	2.93
25	002353	杰瑞股份	13,096,027.90	2.87
26	002142	宁波银行	13,084,442.68	2.87
27	000538	云南白药	13,065,484.03	2.87
28	000848	承德露露	12,822,900.82	2.81
29	600600	青岛啤酒	12,753,838.25	2.80
30	600188	兖州煤业	12,730,825.88	2.79
31	002244	滨江集团	12,435,542.32	2.73
32	601808	中海油服	12,252,766.59	2.69
33	000063	中兴通讯	11,223,544.14	2.46
34	601101	昊华能源	10,626,610.07	2.33
35	600048	保利地产	10,067,234.96	2.21
36	600236	桂冠电力	9,911,516.00	2.17
37	000686	东北证券	9,554,223.11	2.10
38	601186	中国铁建	9,374,674.00	2.06
39	600886	国投电力	9,361,334.49	2.05
40	000718	苏宁环球	9,224,097.00	2.02
41	600015	华夏银行	9,169,110.39	2.01

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	000024	招商地产	33,607,219.12	7.37
2	600778	友好集团	26,599,227.31	5.83
3	000961	中南建设	26,528,236.28	5.82
4	601009	南京银行	26,206,206.03	5.75
5	000926	福星股份	23,843,481.50	5.23
6	002142	宁波银行	21,531,992.77	4.72
7	002635	安洁科技	19,642,375.60	4.31
8	000002	万科 A	19,090,104.37	4.19
9	002146	荣盛发展	18,110,759.91	3.97

10	600376	首开股份	17,247,970.11	3.78
11	600383	金地集团	16,471,167.82	3.61
12	000402	金融街	16,468,979.34	3.61
13	601566	九牧王	15,878,696.68	3.48
14	600600	青岛啤酒	15,327,224.58	3.36
15	600048	保利地产	15,075,684.51	3.31
16	300020	银江股份	14,920,540.50	3.27
17	002073	软控股份	14,468,285.16	3.17
18	600742	一汽富维	14,280,895.58	3.13
19	000538	云南白药	14,102,627.72	3.09
20	601901	方正证券	13,842,396.83	3.04
21	601336	新华保险	13,804,451.75	3.03
22	600583	海油工程	13,280,142.45	2.91
23	002244	滨江集团	13,272,280.70	2.91
24	600887	伊利股份	13,056,944.05	2.86
25	600036	招商银行	12,844,622.01	2.82
26	002417	三元达	12,839,695.25	2.82
27	600188	兖州煤业	12,431,580.09	2.73
28	002065	东华软件	12,172,781.30	2.67
29	601808	中海油服	11,680,756.52	2.56
30	000423	东阿阿胶	11,080,205.76	2.43
31	601101	昊华能源	10,723,507.00	2.35
32	000686	东北证券	10,679,465.09	2.34
33	000063	中兴通讯	9,824,390.27	2.15
34	601377	兴业证券	9,423,698.82	2.07
35	601333	广深铁路	9,383,584.90	2.06
36	600694	大商股份	9,271,894.73	2.03
37	000718	苏宁环球	9,159,727.42	2.01

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	724,635,047.88
卖出股票的收入（成交）总额	749,299,227.12

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前十名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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查。本基金投资的前十名证券的发行主体除河北承德露露股份有限公司（000848）外，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据河北承德露露股份有限公司（以下简称“露露股份”）于 2011 年 8 月 5 日公布的《河北承德露露股份有限公司关于公司原董事长受到深圳证券交易所公开谴责的公告》，因 2007 年发生的有关商标许可审批程序和信息披露存在违规事实，深圳证券交易所决定给予露露股份时任董事长王宝林给予公开谴责的处分，且该时任董事长现已离任。本公司认为，上述处分未发现对露露股份投资价值构成实质性负面影响，本基金对露露股份的投资决策程序符合本公司规定。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	4,001,245.26
3	应收股利	1,992,083.94
4	应收利息	12,354.44
5	应收申购款	31,808.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,287,492.58

#### 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
11,111	55,306.59	78,052,886.40	12.70%	536,458,627.77	87.30%

### 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	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	75,874.29	0.0123%

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 0，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（2009 年 12 月 11 日）基金份额总额	2,233,818,289.91
本报告期期初基金份额总额	632,079,112.69
本报告期基金总申购份额	7,524,191.88
减：本报告期基金总赎回份额	25,091,790.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	614,511,514.17

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

本报告期内本基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门在报告期内无重大人事变动。

### 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、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监管部门稽查或处罚等情况

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	
海通证券	1	366,822,748.11	24.95%	300,267.05	24.39%	-
申银万国	1	278,592,948.63	18.95%	238,088.72	19.34%	-
中信证券	1	188,561,940.10	12.83%	163,821.96	13.30%	-
招商证券	1	154,788,417.91	10.53%	127,705.75	10.37%	-
国信证券	2	153,374,398.49	10.43%	130,367.86	10.59%	-
华泰联合	1	128,520,690.60	8.74%	104,422.85	8.48%	-
山西证券	1	124,972,262.77	8.50%	106,226.25	8.63%	-
中金公司	2	74,352,489.19	5.06%	60,412.52	4.91%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1.本报告期内本基金无新增交易单元

2.专用交易单元的选择标准和程序

1)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

- a.实力雄厚，信誉良好；
- b.公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好,过去三年未有任何违规经营记录；
- c.公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
- d.公司内部管理规范，研究流程严谨清晰,能满足基金操作的高度保密要求；
- e.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

- a.研究报告的数量和质量；
- b.提供研究服务的主动性；
- c.资讯提供的及时性及便利性；

d.其他可评价的考核标准。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	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
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资

**11 影响投资者决策的其他重要信息**

2012 年 1 月 16 日， 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

汇丰晋信基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十八日