

汇丰晋信货币市场基金 2015 年半年度报告

2015 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

送出日期：2015 年 8 月 29 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 2015 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 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
3.3 其他指标	Error! Bookmark not defined.
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	40
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	41
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	46
10.9 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信货币市场基金	
基金简称	汇丰晋信货币	
基金主代码	540011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 11 月 2 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	1,710,713,484.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇丰晋信货币 A	汇丰晋信货币 B
下属分级基金的交易代码：	540011	541011
报告期末下属分级基金的份额总额	28,577,958.24 份	1,682,135,526.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
投资策略	<p>1. 整体资产配置策略</p> <p>整体资产配置策略主要包括两个方面：1) 根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断；2) 根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。</p> <p>2. 类属配置策略</p> <p>基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。</p> <p>3. 个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，将首先考虑安全性因素，优先选择央票、短期国债等高信用等级债券品种以规避违约风险。</p> <p>4. 回购策略</p> <p>1) 息差放大策略：该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。</p> <p>2) 逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>5. 流动性管理策略</p> <p>由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金将紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。</p>

业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	汤嵩彦
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 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	牛锡明

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：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼； 交通银行股份有限公司：上海市浦东新区银城中路 188 号。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	汇丰晋信货币 A	汇丰晋信货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	278,619.98	23,647,637.60
本期利润	278,619.98	23,647,637.60
本期净值收益率	1.5160%	1.6364%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	28,577,958.24	1,682,135,526.09
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	11.1863%	12.1700%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信货币 A

阶段	份额净值收益率	份额净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.2153%	0.0053%	0.1110%	0.0000%	0.1043%	0.0053%
过去三个月	0.6812%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.3446%	0.0049%
过去六个月	1.5160%	0.0046%	0.6695%	0.0000%	0.8465%	0.0046%
过去一年	3.2127%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	1.8627%	0.0042%
过去三年	9.4574%	0.0032%	4.0505%	0.0000%	5.4069%	0.0032%
自基金合同生效起至今	11.1863%	0.0030%	5.0321%	0.0001%	6.1542%	0.0029%

注：过去一个月指 2015 年 6 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去三个月指 2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去六个月指 2015 年 1 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去一年指 2014 年 7 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日

过去三年指 2012 年 7 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2011 年 11 月 2 日 - 2015 年 6 月 30 日

汇丰晋信货币 B

阶段	份额净值 收益率	份额净值 收益率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去一个月	0.2349%	0.0053%	0.1110%	0.0000%	0.1239%	0.0053%
过去三个月	0.7413%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.4047%	0.0049%
过去六个月	1.6364%	0.0046%	0.6695%	0.0000%	0.9669%	0.0046%
过去一年	3.4607%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	2.1107%	0.0042%
过去三年	10.2490%	0.0032%	4.0505%	0.0000%	6.1985%	0.0032%
自基金合同 生效起至今	12.1700%	0.0030%	5.0321%	0.0001%	7.1379%	0.0029%

注：过去一个月指 2015 年 6 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去三个月指 2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去六个月指 2015 年 1 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去一年指 2014 年 7 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日

过去三年指 2012 年 7 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2011 年 11 月 2 日 - 2015 年 6 月 30 日

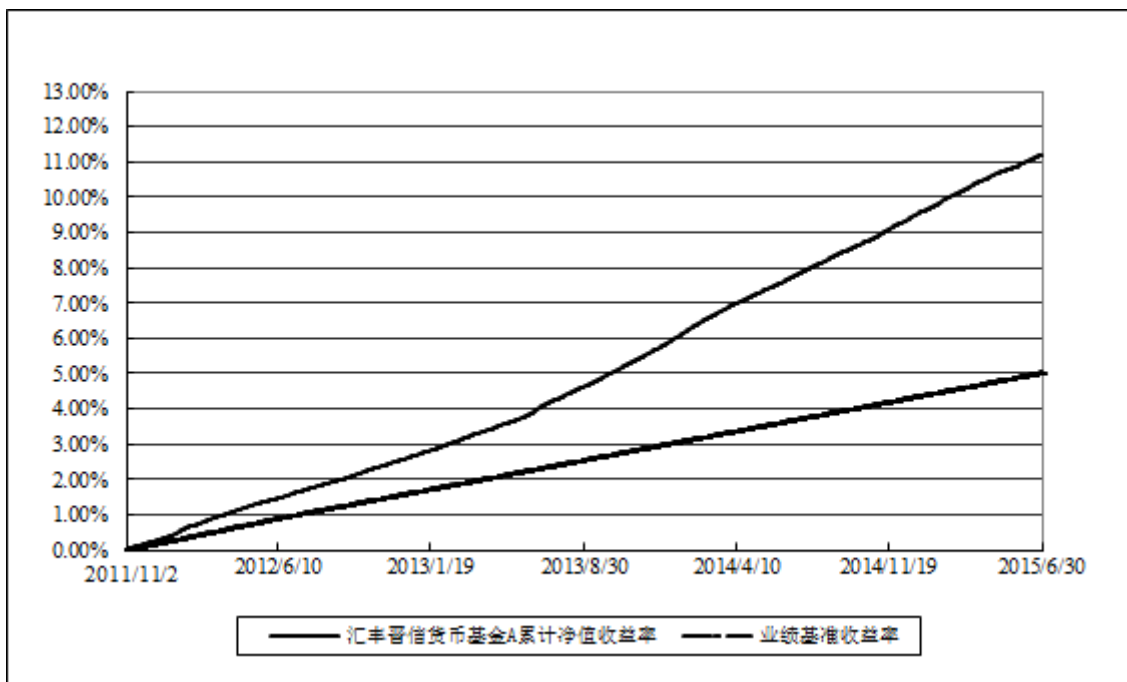
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 11 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日)

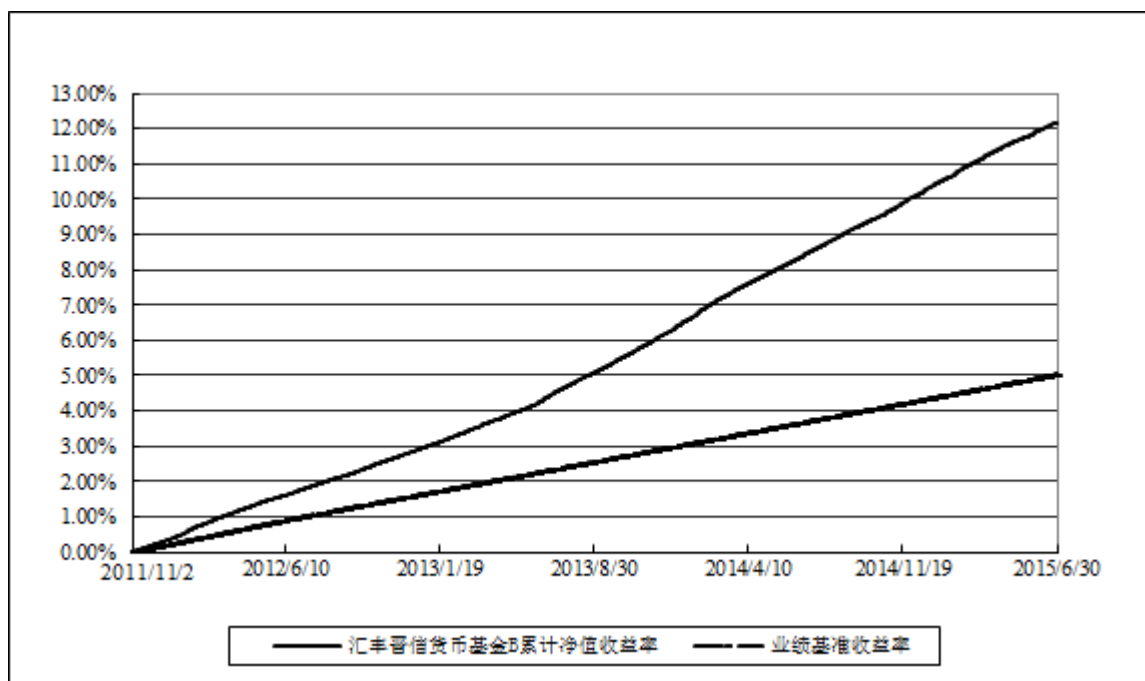
1、汇丰晋信货币 A



注：1. 按照基金合同的约定，本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款和大额存单、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2012 年 5 月 2 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

2、汇丰晋信货币 B



注：1.按照基金合同的约定，本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款和大额存单、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2012 年 5 月 2 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2.报告期内本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在上海。截止 2015 年 6 月 30 日，公司共管理 14 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)、汇丰晋信货币市场基金(2011年11月2日成立)、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金(2012年8月1日成立)、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金(2014年11月26日成立)和汇丰晋信新动力混合型证券投资基金(2015年2月11日成立)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李媛媛	本基金基金经理	2011年11月12日	-	10	李媛媛女士，曾任广东发展银行上海分行国际部交易员、法国巴黎银行（中国）有限公司资金部交易员、比利时富通银行上海分行环球市场部交易员和汇丰晋信基金管理有限公司投资经理。现任本基金基金经理。

注：1.任职日期为本基金管理人公告李媛媛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

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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。

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2015 年上半年，经济依然维持低位，企稳的迹象并不明显。上半年 GDP 同比增长 7.0%，农业生产形势较好，工业生产基本平稳，固定资产投资增速有所回落。从分项来看，制造业下滑，基建投资和房地产投资较好。商品消费增长较为稳健，居民消费价格基本稳定，通缩风险随着猪肉价格的反弹缓解。

海外方面，美国一季度经济由于严寒的天气有所放缓，但严寒过后，经济在二季度有所复苏，房地产数据较好，新屋销售反弹。就业稳健，失业率降至 7 年来的新低，劳动力市场仍然稳健改善。耶伦的讲话加强了联储年内加息的预期，美元指数走势强劲。欧洲方面，由于欧央行 QE 的刺激，通胀略有好转，欧洲经济在长期的低迷后有所恢复。希腊退欧的问题，虽然中间有所反复，但最后平稳过渡，给欧洲带来了曙光，全球风险偏好有所提升。

货币市场方面，“宽松”是 2015 年上半年的关键词，无论是资金面还是央行的货币政策操作。上半年，央行共经历了三次降息，两次降准（其中一次 100 个基点，超市场预期）和一次定向降准。同时，灵活运用 MLF，SLF，SLO 等多种货币政策工具来调节市场的流动性，维稳市场资金利率，降低社会融资成本，稳定实体经济。流动性方面，资金面仍然围绕着新股申购展开，但总体不改宽松的局面。进入 6 月，由于国泰君安等大盘股的发型，加上半年末的考核，流动性有所收紧，央行又重启了暂停数月的逆回购，并数次调低逆回购的中标利率，引导资金利率下行。在美元强劲升值，人民币被动贬值，外汇占款趋势性减少的背景下，央行需要放松货币，防范金融风险。

回顾 2015 年上半的债市，债券由于偏弱的经济，低迷的通胀，适度宽松的流动性和央行降准降息的利好刺激，债券基本保持上涨，但由于股市火爆，股债的跷跷板效应使债券在 3 月遭遇了大幅调整，收益率上行明显，但整体债券保持小幅上涨，且短端下行幅度大于长端，收益率曲线陡峭。

回顾上半年货币基金的操作，本基金总体的原则是在管理好流动性的前提下，根据市场资金面的变化，抓住关键时机选择合适的资产配置比例。本基金主要是在新股密集申购阶段，积极配置交易所回购，并且适当增加超 AAA 短融和定期存款的配置，锁定部分较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，汇丰晋信货币市场基金 A 类份额本报告期内净值增长率为 1.5160%，同期业绩比较基准增长率为 0.6695%，本基金 A 类领先同期比较基准为 0.8465%；汇丰晋信货币市场 B 类份额净值本报告期内净值增长率为 1.6364%，同期业绩比较基准增长率为 0.6695%，本基金 B 类领先同期比较基准为 0.9669%。

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 2015 年下半年，经过前期的财政、货币等一系列稳增长政策会逐步产生一定的效果，一方面加大基础设施项目的下达，另一方面，财政政策继续发力，未来托底政策的影响会逐步明显，中小企业的状况可能随后也有所改善。预计三季度第三产业也会有所改善，考虑到政策在三季度将有所体现，预计三季度经济可能暂时企稳，不再进一步下降。

海外方面，美国经济将延续复苏，市场对美联储 2015 年底加息的预期增强，在美元加息的大背景下，美元指数会继续保持强势。欧洲方面，欧元的贬值会对欧洲的出口带来提振作用，持续的量宽似乎也收到了一些成效，欧元区经济有进一步企稳的迹象，希腊问题的暂时解决也给欧洲一丝喘息的空间，同时提升了全球的风险偏好。

展望 2015 年下半年的货币政策，维持金融市场的稳定，托底经济仍是首要目的，保持市场的流动性，降低资金利率，从而降级实体经济融资成本，仍是央行下半年货币政策的主要目标。相信央行仍会适时、灵活运用多种货币供给，稳健的货币政策加定向宽松的组合是大概率事件。外汇占款趋势性下降需要放松货币避免金融条件被动收紧，防范金融风险。但由于上半年央行放松的力度超预期，市场利率已经下行较多，进一步放松的空间不大。

展望 2015 年下半年的货币基金的操作，防范流动性风险仍然是本基金操作的第一要务。结合市场环境，本基金仍会主要投资于政策性金融债、超 AAA 短融、交易所/银行间回购等收益率流动性匹配较好的优良资产，努力实现较好的组合收益率。同时，抓住时机，提高定期存款在组合中配置比例，努力提高组合收益。

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开展和落实,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开展和落实,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。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期已按本基金《基金合同》的约定:

- 1、基金收益分配方式为红利再投资,每日进行收益分配;
- 2、按照‘每日分配、按月支付’的条款进行收益分配。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润 :278,619.98 元,向 B 级份额持有人分配利润 :23,647,637.6 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015 年上半年度，托管人在汇丰晋信货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、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。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润 :278,619.98 元 ,向 B 级份额持有人分配利润 :23,647,637.6 元。

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

2015 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货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	342,775,082.40	90,866,245.26
结算备付金		208,418,500.00	53,766,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	501,024,571.96	600,319,048.54

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		501,024,571.96	600,319,048.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	715,300,000.00	562,000,685.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	10,512,773.35	15,347,712.27
应收股利		-	-
应收申购款		8,859,142.30	996,539.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,786,890,070.01	1,323,296,231.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		75,176,928.89	19,926,422.23
应付赎回款		233,446.66	86,292.06
应付管理人报酬		425,953.16	591,700.15
应付托管费		129,076.72	179,303.07
应付销售服务费		17,389.78	20,503.27
应付交易费用	6.4.7.7	15,068.10	36,314.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		113,007.08	132,364.69
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	65,715.29	120,167.04
负债合计		76,176,585.68	21,093,067.14
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,710,713,484.33	1,302,203,164.08
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,710,713,484.33	1,302,203,164.08
负债和所有者权益总计		1,786,890,070.01	1,323,296,231.22

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,710,713,484.33 份，其中 A 级基金份额总额 28,577,958.24 份，其中 B 级基金份额总额 1,682,135,526.09 份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		27,304,482.47	17,041,227.51
1.利息收入		27,048,158.35	16,635,319.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,675,490.11	1,816,610.14
债券利息收入		12,672,599.90	6,076,629.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,700,068.34	8,742,079.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		256,324.12	405,908.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	256,324.12	405,908.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		3,378,224.89	1,907,941.70
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,448,032.90	1,347,858.14
2.托管费	6.4.10.2.2	741,828.15	408,441.85
3.销售服务费	6.4.10.2.3	96,651.94	66,233.36
4.交易费用	6.4.7.19	-	-
5.利息支出		4,933.87	4,180.31
其中：卖出回购金融资产支出		4,933.87	4,180.31
6.其他费用	6.4.7.20	86,778.03	81,228.04
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		23,926,257.58	15,133,285.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		23,926,257.58	15,133,285.81

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：汇丰晋信货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	1,302,203,164.08	-	1,302,203,164.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,926,257.58	23,926,257.58
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)	408,510,320.25	-	408,510,320.25
其中：1.基金申购款	5,387,306,232.04	-	5,387,306,232.04
2.基金赎回款	-4,978,795,911.79	-	-4,978,795,911.79
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)	-	-23,926,257.58	-23,926,257.58
五、期末所有者权益(基金净值)	1,710,713,484.33	-	1,710,713,484.33
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	888,198,797.49	-	888,198,797.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,133,285.81	15,133,285.81
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)	91,165,741.55	-	91,165,741.55
其中：1.基金申购款	1,788,414,606.47	-	1,788,414,606.47
2.基金赎回款	-1,697,248,864.92	-	-1,697,248,864.92
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)	-	-15,133,285.81	-15,133,285.81

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	979,364,539.04	-	979,364,539.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 杨小勇 王栋 杨洋
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信货币市场基金(以下简称“本基金”经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”《关于核准汇丰晋信货币市场基金募集的批复》(证监许可[2011]1135 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《汇丰晋信货币市场基金基金合同》发售,基金合同于 2011 年 11 月 2 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 1,155,014,222.80 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(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信货币市场基金基金合同》和《汇丰晋信货币市场基金更新招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的

《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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

基金管理人自2015年3月27日起,对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》中规定的估值方法确定公允价值。

除上述事项,本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内,本基金无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)的有关规定,经与基金托管人、会计师事务所协商一致,自 2015 年 3 月 27 日起,汇丰晋信基金管理有限公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局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[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好

证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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：

- (a) 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。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 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。
- (d) 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 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	775,082.40
定期存款	342,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	124,000,000.00
存款期限 1 个月以内	218,000,000.00
其他存款	-
合计：	342,775,082.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日

		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	501,024,571.96	502,425,000.00	1,400,428.04	0.0819%
	合计	501,024,571.96	502,425,000.00	1,400,428.04	0.0819%

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金的交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。

本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
- 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产或负债。（上年末余额：零）

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券	715,300,000.00	-
合计	715,300,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。（2014 年末余额：零）

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	113.69
应收定期存款利息	502,036.06
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	136,911.93
应收债券利息	9,492,443.21
应收买入返售证券利息	381,268.22
应收申购款利息	0.24
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	-
合计	10,512,773.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。(2014 年末余额：零)

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	15,068.10
合计	15,068.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,167.32
预提费用	63,547.97
合计	65,715.29

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇丰晋信货币 A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	11,615,240.34	11,615,240.34
本期申购	139,570,963.69	139,570,963.69
本期赎回(以“-”号填列)	-122,608,245.79	-122,608,245.79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	28,577,958.24	28,577,958.24

注：总申购份额含基金份额级别调整和转换入份额，总赎回份额包含基金份额级别调整和转换出

份额。

金额单位：人民币元

汇丰晋信货币 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,290,587,923.74	1,290,587,923.74
本期申购	5,247,735,268.35	5,247,735,268.35
本期赎回(以“-”号填列)	-4,856,187,666.00	-4,856,187,666.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,682,135,526.09	1,682,135,526.09

注：总申购份额含基金份额级别调整和转换入份额，总赎回份额包含基金份额级别调整和转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇丰晋信货币 A			
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	278,619.98	-	278,619.98
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-278,619.98	-	-278,619.98
本期末	0.00	-	0.00

单位：人民币元

汇丰晋信货币 B			
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	23,647,637.60	-	23,647,637.60
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-23,647,637.60	-	-23,647,637.60
本期末	0.00	-	0.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	9,937.02
定期存款利息收入	2,434,549.50
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,230,743.75
其他	259.84
合计	3,675,490.11

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	256,324.12
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	256,324.12

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,194,728,456.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,150,062,730.20
减：应收利息总额	44,409,402.17
买卖债券差价收入	256,324.12

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入，赎回差价收入为零。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入，申购差价收入为零。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期内，本基金未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	29,752.78
上清所帐户维护费	9,000.00
银行汇款费用	13,756.06
银行间市场债券账户维护费	9,000.00
其他	474.00
合计	86,778.03

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金每月例行对上月实现的收益进行收益结转（如遇节假日顺延），每月例行的收益结转不再另行公告。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均无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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,448,032.90	1,347,858.14
其中：支付销售机构的客户维护费	17,749.59	18,609.88

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 0.33% 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 × 0.33% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	741,828.15	408,441.85

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 0.1% 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 × 0.1% / 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信货币 A	汇丰晋信货币 B	合计
交通银行	9,893.21	-	9,893.21
汇丰晋信基金管理有限公司	4,508.98	72,956.40	77,465.38
山西证券	237.12	-	237.12
恒生银行	144.25	-	144.25
合计	14,783.56	72,956.40	87,739.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信货币 A	汇丰晋信货币 B	合计
汇丰晋信基金管理有限公司	3,114.58	39,511.78	42,626.36
交通银行	15,270.44	188.61	15,459.05
山西证券	755.56	28.77	784.33
恒生银行	317.14	-	317.14
合计	19,457.72	39,729.16	59,186.88

注：1、支付基金销售机构的汇丰晋信货币 A 基金份额的销售服务费按前一日汇丰晋信货币 A 基金资产净值 0.25% 的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日汇丰晋信货币 A 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2、支付基金销售机构的汇丰晋信货币 B 基金份额的销售服务费按前一日汇丰晋信货币 B 基金资产净值 0.01% 的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日汇丰晋信货币 B 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

3、对于由汇丰晋信货币 B 降级为汇丰晋信货币 A 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级日后的下一个工作日起适用汇丰晋信货币 A 基金份额持有人的费率；对于由汇丰晋信货币 A 升级为汇丰晋信货币 B 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级日后的下一个工作日起享受 B 级基金份额持有人的费率。

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

本基金本报告期及上年度可比期间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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

汇丰晋信货币 A

本报告期末及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

汇丰晋信货币 B

本报告期末及上年度可比期间，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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	775,082.40	9,937.02	130,791.00	5,960.95

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和存出保证金，于 2015 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 208,418,500.00 元。（2014 年 6 月 30 日：人民币 62,345,000.00 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

金额单位：人民币元

汇丰晋信货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
278,001.35	-	618.63	278,619.98	-

汇丰晋信货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
23,667,613.84	-	-19,976.24	23,647,637.60	-

6.4.12 期末（2015 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

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股或认购的新发或增发债券，从新股获配日或债券成功认购日至该证券上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

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等流通受限股票。

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

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场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

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在

管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

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

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，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并采用券款对付交割方式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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	90,218,345.38	60,152,387.58
A-1 以下	-	150,117,661.51
未评级	410,806,226.58	390,048,999.45
合计	501,024,571.96	600,319,048.54

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券，以及无信用评级的超短期融资券。

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，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，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

级别设置	含义
A-1	为最高级短期债券，其还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末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。

本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的投资范围包括现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金所持大部分证券均能及时变现。

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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得主动超过 120 天。且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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、存出保证金等。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 2015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	218,775,082.40	124,000,000.00	-	-	-	-	342,775,082.40
结算备付金	208,418,500.00	-	-	-	-	-	208,418,500.00
交易性金融资产	100,069,153.37	180,284,467.89	220,670,950.70	-	-	-	501,024,571.96
买入返售金融资产	715,300,000.00	-	-	-	-	-	715,300,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	10,512,773.35	10,512,773.35
应收申购款	-	-	-	-	-	8,859,142.30	8,859,142.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,242,562,735.77	304,284,467.89	220,670,950.70	-	-	19,371,915.65	1,786,890,070.01
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	75,176,928.89	75,176,928.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	233,446.66	233,446.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	425,953.16	425,953.16
应付托管费	-	-	-	-	-	129,076.72	129,076.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,389.78	17,389.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,068.10	15,068.10
应付利润	-	-	-	-	-	113,007.08	113,007.08
其他负债	-	-	-	-	-	65,715.29	65,715.29
负债总计	-	-	-	-	-	76,176,585.68	76,176,585.68
利率敏感	1,242,562,735.77	304,284,467.89	220,670,950.70	-	-	-56,804,670.03	1,710,713,484.33

度缺口							
上年度末 2014 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	60,866,245.26	30,000,000.00	-	-	-	-	90,866,245.26
结算备付金	53,766,000.00	-	-	-	-	-	53,766,000.00
交易性金融资产	70,039,352.01	60,058,267.88	470,221,428.65	-	-	-	600,319,048.54
买入返售金融资产	562,000,685.50	-	-	-	-	-	562,000,685.50
应收利息	-	-	-	-	-	15,347,712.27	15,347,712.27
应收申购款	-	-	-	-	-	996,539.65	996,539.65
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	746,672,282.77	90,058,267.88	470,221,428.65	-	-	16,344,251.92	1,323,296,231.22
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19,926,422.23	19,926,422.23
应付赎回款	-	-	-	-	-	86,292.06	86,292.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	591,700.15	591,700.15
应付托管费	-	-	-	-	-	179,303.07	179,303.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,503.27	20,503.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,314.63	36,314.63
应付利润	-	-	-	-	-	132,364.69	132,364.69
其他负债	-	-	-	-	-	120,167.04	120,167.04
负债总计	-	-	-	-	-	21,093,067.14	21,093,067.14
利率敏感度缺口	746,672,282.77	90,058,267.88	470,221,428.65	-	-	-4,748,815.22	1,302,203,164.08

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	利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。
----	---

	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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-507,341.11	-529,506.44
	市场利率下降 25 个基点	507,341.11	529,506.44

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他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其他价格风险，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。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金仅持债券投资，除市场利率和外汇汇率外的其他市场价格因素变化，不会导致本基金持有的债券投资的公允价值发生重大变动。

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) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

2015 年 6 月 30 日

	第一层次	第二层次	第三层次	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	-		-	-
-				
债券投资		-	501,024,571.96	-
501,024,571.96				
合计		-	501,024,571.96	-
501,024,571.96				

2014 年 12 月 31 日

	第一层次	第二层次	第三层次	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	-		-	-
-				
债券投资		-	600,319,048.54	-
600,319,048.54				
合计		-	600,319,048.54	-
600,319,048.54				

2015 年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。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。

2015 年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

§ 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	固定收益投资	501,024,571.96	28.04
	其中：债券	501,024,571.96	28.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	715,300,000.00	40.03
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	551,193,582.40	30.85
4	其他各项资产	19,371,915.65	1.08
5	合计	1,786,890,070.01	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.04	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使不符合规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	72.63	4.39
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	3.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	9.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.32	4.39

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	260,458,163.75	15.23
	其中：政策性金融债	260,458,163.75	15.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,566,408.21	14.06
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	501,024,571.96	29.29
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041454049	14 长电 CP002	700,000	70,228,819.61	4.11
2	150411	15 农发 11	600,000	60,284,566.24	3.52
3	011599019	15 中电信 SCP002	600,000	60,069,587.32	3.51
4	011502001	15 铁道 SCP001	500,000	50,099,926.40	2.93
5	150202	15 国开 02	500,000	50,074,948.97	2.93
6	140223	14 国开 23	400,000	40,017,417.05	2.34
7	140218	14 国开 18	400,000	39,999,566.05	2.34
8	011567001	15 神华能源 SCP001	200,000	20,124,907.50	1.18
9	150206	15 国开 06	200,000	20,106,020.61	1.18
10	140230	14 国开 30	200,000	19,996,078.25	1.17

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1932%
报告期内偏离度的最低值	0.0317%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0890%

注：以上数据按交易日统计。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 投资组合报告附注

7.8.1

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.8.2

本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值 20%的情况。

7.8.3

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。

7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,512,773.35
4	应收申购款	8,859,142.30
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,371,915.65

7.8.5 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇丰晋信货币 A	964	29,645.18	2,068.25	0.01%	28,575,889.99	99.99%
汇丰晋信货币 B	27	62,301,315.78	1,682,135,526.09	100.00%	0.00	0.00%
合计	991	1,726,249.73	1,682,137,594.34	98.33%	28,575,889.99	1.67%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇丰晋信货币 A	4,795.77	0.0168%
	汇丰晋信货币 B	0.00	0.0000%
	合计	4,795.77	0.0003%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇丰晋信货币 A	0
	汇丰晋信货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信货币 A	0
	汇丰晋信货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信货币 A	汇丰晋信货币 B
基金合同生效日(2011年11月2日)基金份额总额	665,979,996.74	489,034,226.06

本报告期期初基金份额总额	11,615,240.34	1,290,587,923.74
本报告期基金总申购份额	139,570,963.69	5,247,735,268.35
减:本报告期基金总赎回份额	122,608,245.79	4,856,187,666.00
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	28,577,958.24	1,682,135,526.09

注：总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额；总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

§ 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

2015年3月2日,经公司股东会审议批准,刘叔肆先生不再担任本公司董事,由郭晋普先生、柴宏杰先生担任本公司董事。

本报告期内,本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过,并经基金托管人同意,本基金于2015年4月18日将其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),并报中国证券监督管理委员会备案。

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	
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
合计	2	-	-	-	-	-

1、报告期内无增加的交易单元

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-13,578,900,000.00	100.00%	-	-
合计	-	-13,578,900,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信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	2015年1月5日
2	基金 2014 年 4 季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月22日
3	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过北京展恒基金销售有限公司开展定期定额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	2015年1月23日
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于投资者通过直销柜台认购、申购旗下基金实行费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月30日
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金开展直销柜台基金转换费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月30日
6	汇丰晋信关于在华泰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	2015年2月3日
7	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转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年2月5日
8	汇丰晋信关于在国金证券开通	本基金选定的信息披露报纸	2015年2月9日

	汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	纸、管理人网站	日
9	汇丰晋信关于在中信证券（浙江）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	2015 年 2 月 9 日
10	汇丰晋信货币基金关于 2015 年春节假期暂停申购转换转入及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	2015 年 2 月 13 日
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整基金最低转换转出份额的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
12	汇丰晋信关于在中信证券（山东）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	2015 年 3 月 2 日
13	汇丰晋信关于旗下基金通过数米基金开展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	2015 年 3 月 2 日
14	汇丰晋信货币基金关于 2015 年清明假期暂停申购转换转入及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	2015 年 3 月 31 日
15	基金 2014 年年度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 31 日
16	汇丰晋信基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 1 日
17	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整开放式基金业务规则的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 1 日
18	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 18 日

	的公告		
19	基金 2015 年 1 季度报告	本基金选定的信息披露报 纸、管理人网站	2015 年 4 月 21 日
20	汇丰晋信货币基金关于 2015 年劳动节假期暂停申购转换转入及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	2015 年 4 月 27 日
21	汇丰晋信关于在工商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	2015 年 6 月 9 日
22	货币基金关于 2015 年端午节假期暂停申购转换转入及定投业务的公告	本基金选定的信息披露报 纸、管理人网站	2015 年 6 月 15 日
23	汇丰晋信货币市场基金更新招募说明书（2015 年第 1 次）	本基金选定的信息披露报 纸、管理人网站	2015 年 6 月 16 日
24	关于防范不法人员发布虚假客服电话进行诈骗的重要提示	本基金选定的信息披露报 纸、管理人网站	2015 年 6 月 19 日
25	汇丰晋信关于在中金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	2015 年 6 月 26 日
26	汇丰晋信关于新增东兴证券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	2015 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信货币市场基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信货币市场基金基金合同
- 3) 汇丰晋信货币市场基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信货币市场基金托管协议
- 5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 6) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8) 报告期内汇丰晋信货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告
- 9) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日