

# 汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 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

送出日期：2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>20</b>
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	25
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
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.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>65</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金	
基金简称	汇丰晋信大盘波动股票	
基金主代码	002334	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 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	68,961,956.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇丰晋信大盘波动股票 A	汇丰晋信大盘波动股票 C
下属分级基金的交易代码:	002334	002335
报告期末下属分级基金的份额总额	63,176,868.05 份	5,785,088.58 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于汇丰集团低波动率策略构建投资组合，力求为投资者提供相对业绩比较基准更高的相对收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的低波动率策略。该策略包括了“估值-盈利”个股优选策略和“波动率优化策略。</p> <p>3、债券投资策略</p>

	<p>本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益。</p> <p>4. 权证投资策略</p> <p>本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。</p> <p>5. 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。</p>
业绩比较基准	业绩比较基准=沪深 300 指数*90%+同业存款利率（税后）*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、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	田青
	联系电话	021-20376868	010-67595096
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	010-67595096
传真		021-20376999	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

	大楼 17 楼	
邮政编码	200120	100033
法定代表人	杨小勇	王洪章

## 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； 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。

## 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	汇丰晋信大盘波动股票 A	汇丰晋信大盘波动股票 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	4,401,254.70	471,618.63
本期利润	6,957,690.67	673,502.91
加权平均基金份额本期利润	0.1338	0.1208
本期加权平均净值利润率	11.25%	10.21%
本期基金份额净值增长率	11.16%	11.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	14,746,588.65	1,305,929.78
期末可供分配基金份额利润	0.2334	0.2257
期末基金资产净值	79,201,561.01	7,207,988.71
期末基金份额净值	1.2536	1.2460
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	25.36%	24.60%

注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

④本基金的基金合同于 2016 年 3 月 11 日生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信大盘波动股票 A

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	3.11%	0.48%	4.49%	0.61%	-1.38%	-0.13%
过去三个月	4.34%	0.45%	5.51%	0.56%	-1.17%	-0.11%
过去六个月	11.16%	0.44%	9.74%	0.51%	1.42%	-0.07%
过去一年	23.22%	0.53%	14.71%	0.60%	8.51%	-0.07%
自基金合同生效起至今	25.36%	0.49%	19.62%	0.70%	5.74%	-0.21%

注：过去一个月指 2017 年 6 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去三个月指 2017 年 4 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去六个月指 2017 年 1 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去一年指 2016 年 7 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

自基金合同生效至今指 2016 年 3 月 11 日—2017 年 6 月 30 日

汇丰晋信大盘波动股票 C

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	3.12%	0.48%	4.49%	0.61%	-1.37%	-0.13%
过去三个月	4.31%	0.45%	5.51%	0.56%	-1.20%	-0.11%
过去六个月	11.16%	0.44%	9.74%	0.51%	1.42%	-0.07%
过去一年	22.65%	0.53%	14.71%	0.60%	7.94%	-0.07%
自基金合同生效起至今	24.60%	0.49%	19.62%	0.70%	4.98%	-0.21%

注：过去一个月指 2017 年 6 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去三个月指 2017 年 4 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去六个月指 2017 年 1 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去一年指 2016 年 7 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

自基金合同生效至今指 2016 年 3 月 11 日—2017 年 6 月 30 日

### 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

汇丰晋信大盘波动精选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

(2016 年 3 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日)

#### 1. 汇丰晋信大盘波动股票 A



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 80%–95%，除股票以外的其他资产投资比例为 5%–20%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%–3%，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%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合，本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非现金基金资产的 80%。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 2016 年 9 月 12 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数\*90%+同业存款利率（税后）\*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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## 2. 汇丰晋信大盘波动股票 C



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 80%-95%，除股票以外的其他资产投资比例为 5%-20%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，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%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合，本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非现金基金资产的 80%。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 2016 年 9 月 12 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数\*90%+同业存款利率（税后）\*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沪深 300 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2017年6月30日,公司共管理18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)、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金(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)、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金(2015年2月11日成立)、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金(2015年9月30日成立)、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(2016年3月11日成立)、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金(2016年11月10日成立)和汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金(2017年6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		
方磊	汇丰晋信大盘波动精选股票型证券	2016年3月11日	-	17	方磊女士,新加坡南洋理工大学数学硕士,具备基金从业资格。曾任上海市长宁卫生局、上海电器有限公司统计师、Phillip

	投资基 金、汇丰 晋信恒 生龙头 指数证 券投资 基金基 金经理			Securities Ltd. Pte 金 融工程师、上海德锦投资 有限公司金融分析师、德 隆友联战略投资管理有限 公司数据分析师、易评咨 询有限公司顾问统计、汇 丰晋信基金管理有限公司 风险管理部副总监。现任 汇丰晋信大盘波动精选股 票型证券投资基金、汇丰 晋信恒生龙头指数证券投 资基金基金经理。
--	---	--	--	---

注：1. 方磊女士任职日期为本基金基金合同生效日期；

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》、《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，或者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

2017 年上半年在监管层强调和推进“去杠杆、防风险”的背景下，货币政策相对偏紧，流动性收缩。在此政策环境下，市场整体风险偏好下降。同时，监管层在第二季度发布的重要股东减持股份的制度规定，在一定程度上引导价值回归本源，上半年以大盘蓝筹龙头股为主的个股表现突出。

从公布的宏观经济数据看，制造业有所回升，基建投资好于去年同期，特别是由于收入的改善增长带动了消费增长，消费增速超预期。从行业板块看，以消费为主的家电和食品饮料行业表现最为突出，而报告期内沪深 300 指数也上涨了 10.78%。

在操作层面上，我们坚持大盘波动基金的选股策略——“低估值+高盈利”，在市场偏好下行的情况下，坚持选择相对低估值的个股，构建低波动的投资组合，以求获得超出基准的风险调整后收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类净值变化幅度为 11.16%，同期业绩比较基准为 9.74%，本基金 A 类

领先同期比较基准为 1.42%；本基金 C 类本报告期内净值变化幅度为 11.16%，同期业绩比较基准为 9.74%，本基金 C 类领先同期比较基准为 1.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为“去杠杆、防风险”仍将是政策的核心主线之一，因此货币政策将继续偏紧；同时我们也需要关注在“稳增长”的财政政策背景下，就目前监管政策的方向，我们认为中长期看，防范系统性风险的底线思维将会放在更加重要的位置，以确保经济和金融市场的相对平稳运行，这也有利于业绩成长且估值低的公司获得市场的长期关注。

#### 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其适用性的情况下, 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

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。

## 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

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：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,102,336.74	4,232,850.23
结算备付金		157,474.80	-
存出保证金		6,969.97	49,335.03
交易性金融资产	6.4.7.2	78,525,877.69	59,819,074.19
其中：股票投资		78,525,877.69	59,819,074.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		55,513.36	-
应收利息	6.4.7.5	1,716.67	877.89
应收股利		-	-
应收申购款		105,008.34	280,033.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		86,954,897.57	64,382,170.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		272, 178. 39	185, 227. 47
应付管理人报酬		95, 788. 98	82, 117. 23
应付托管费		15, 964. 82	13, 686. 20
应付销售服务费		2, 969. 62	1, 969. 81
应付交易费用	6.4.7.7	83, 894. 46	76, 649. 69
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	74, 551. 58	320, 338. 36
负债合计		545, 347. 85	679, 988. 76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	68, 961, 956. 63	56, 513, 282. 56
未分配利润	6.4.7.10	17, 447, 593. 09	7, 188, 899. 66
所有者权益合计		86, 409, 549. 72	63, 702, 182. 22
负债和所有者权益总计		86, 954, 897. 57	64, 382, 170. 98

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额为 68,961,956.63 份，其中 A 类基金份额净值 1.2536 元，基金份额 63,176,868.05 份；C 类基金份额净值 1.2460 元；基金份额 5,785,088.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月11日(基金 合同生效日)至2016年6 月30日
<b>一、收入</b>		8,526,063.37	6,034,440.93
1.利息收入		19,043.26	970,900.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,023.36	138,466.29
债券利息收入		19.90	612.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	831,821.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,692,160.33	1,911,227.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,202,209.76	117,036.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,790.10	36,399.19
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	483,160.47	1,757,792.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,758,320.25	2,988,251.03
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	56,539.53	164,061.51
<b>减：二、费用</b>		894,869.79	2,022,931.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	507,092.47	1,279,072.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	84,515.44	213,178.62

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,350.05	95,546.64
4. 交易费用	6.4.7.19	202,709.88	311,762.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	84,201.95	123,372.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>7,631,193.58</b>	<b>4,011,509.05</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>7,631,193.58</b>	<b>4,011,509.05</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	56,513,282.56	7,188,899.66	63,702,182.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,631,193.58	7,631,193.58
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	12,448,674.07	2,627,499.85	15,076,173.92

填列)			
其中：1.基金申购款	35,567,793.49	6,882,365.05	42,450,158.54
2.基金赎回款	-23,119,119.42	-4,254,865.20	-27,373,984.62
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）	68,961,956.63	17,447,593.09	86,409,549.72
项目	上年度可比期间		
	2016年3月11日(基金合同生效日)至2016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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,011,509.05	4,011,509.05
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）	191,761,518.90	-700,374.87	191,061,144.03
其中：1.基金申购款	291,640,627.08	1,209.42	291,641,836.50
2.基金赎回款	-99,879,108.18	-701,584.29	-100,580,692.47
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)	191,761,518.90	3,311,134.18	195,072,653.08
---------------------	----------------	--------------	----------------

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：

_____ 王栋	_____ 赵琳	_____ 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

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(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”)证监许可[2015]第 2564 号《关于准予汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金注册的批复》核准,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》和《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 291,092,480.36 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 255 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 291,130,104.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,624.38 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据经批准的《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持

证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 80%-95%，除股票以外的其他资产投资比例为 5%-20%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金使用“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非现金基金资产的 80%。基金业绩比较基准：沪深 300 指数×90%+同业存款利率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于 2017 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2015]101 号《关于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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关

于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，对资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4) 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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,102,336.74

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,102,336.74

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	71,821,461.36	78,525,877.69	6,704,416.33
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
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	71,821,461.36	78,525,877.69	6,704,416.33

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,650.07
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	63.81
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.79
合计	1,716.67

### 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 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	83,894.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	83,894.46

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	169.63
预提费用	74,381.95
合计	74,551.58

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

汇丰晋信大盘波动股票 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,255,319.21	52,255,319.21
本期申购	26,084,259.09	26,084,259.09
本期赎回(以“-”号填列)	-15,162,710.25	-15,162,710.25
- 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	63,176,868.05	63,176,868.05

金额单位：人民币元

汇丰晋信大盘波动股票 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,257,963.35	4,257,963.35
本期申购	9,483,534.40	9,483,534.40

本期赎回(以“-”号填列)	-7,956,409.17	-7,956,409.17
- 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	5,785,088.58	5,785,088.58

注：此处申购含红利再投入、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

汇丰晋信大盘波动股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,673,219.38	-998,977.52	6,674,241.86
本期利润	4,401,254.70	2,556,435.97	6,957,690.67
本期基金份额交易产生的变动数	2,672,114.57	-279,354.14	2,392,760.43
其中：基金申购款	5,515,366.19	-330,685.09	5,184,681.10
基金赎回款	-2,843,251.62	51,330.95	-2,791,920.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,746,588.65	1,278,104.31	16,024,692.96

单位：人民币元

汇丰晋信大盘波动股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	595,045.63	-80,387.83	514,657.80
本期利润	471,618.63	201,884.28	673,502.91
本期基金份额交易产生的变动数	239,265.52	-4,526.10	234,739.42
其中：基金申购款	1,717,414.49	-19,730.54	1,697,683.95
基金赎回款	-1,478,148.97	15,204.44	-1,462,944.53

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,305,929.78	116,970.35	1,422,900.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	18,054.51	
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	831.43	
其他	137.42	
合计	19,023.36	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	63,114,605.42	
减：卖出股票成本总额	57,912,395.66	
买卖股票差价收入	5,202,209.76	

#### 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	
	2017年1月1日至2017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	6,790.10
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	6,790.10

#### 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
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	233,810.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	227,000.00
减：应收利息总额	19.90
买卖债券差价收入	6,790.10

#### 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。

#### 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。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	483,160.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	483,160.47

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,758,320.25
——股票投资	2,758,320.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,758,320.25

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	49,447.91
转出基金补偿收入	7,091.62
合计	56,539.53

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	202,709.88
银行间市场交易费用	-
合计	202,709.88

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	44,629.17
银行汇款费用	820.00
银行间市场债券账户维护费	9,000.00

合计	84,201.95
----	-----------

### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)，2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### 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、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
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金融投资控股集团有限公司控制。
- 2、相关关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 3 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	507,092.47	1,279,072.31
其中：支付销售机构的客	250,538.94	303,568.55

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 3 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,515.44	213,178.62

注：支付基金托管人建设银行的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。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信大盘波动股票 A	汇丰晋信大盘波动股票 C	合计
汇丰晋信基金管理有限 公司	-	83.67	83.67
建设银行	-	4,065.52	4,065.52
山西证券	-	3.62	3.62
合计	-	4,152.81	4,152.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 3 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	汇丰晋信大盘波动 股票 A	汇丰晋信大盘波动 股票 C	合计
汇丰晋信基金管理有限 公司	-	37,211.83	37,211.83
建设银行	-	6,997.96	6,997.96
山西证券	-	1.09	1.09
合计	-	44,210.88	44,210.88

注：A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇丰晋信，再由汇丰晋信计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 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
中国建设银行	8,102,336.74	18,054.51	20,059,644.13	92,519.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

### 6.4.12 期末（2017 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 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
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大事项	10.57	-	-	130,600	1,375,359.80	1,380,442.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	362,800	1,112,223.48	1,306,080.00	-
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事项	17.40	-	-	58,880	1,023,941.62	1,024,512.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。



### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 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

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中预期风险、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。本基金投资的金融工具主要为股票和债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	8,102,336.74	-	-	-	8,102,336.74
结算备付金	157,474.80	-	-	-	157,474.80
存出保证金	6,969.97	-	-	-	6,969.97
交易性金融资产	-	-	-	78,525,877.69	78,525,877.69
应收证券清算款	-	-	-	55,513.36	55,513.36
应收利息	-	-	-	1,716.67	1,716.67
应收申购款	-	-	-	105,008.34	105,008.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,266,781.51	-	-	78,688,116.06	86,954,897.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	272,178.39	272,178.39
应付管理人报酬	-	-	-	95,788.98	95,788.98

应付托管费	-	-	-	15,964.82	15,964.82
应付销售服务费	-	-	-	2,969.62	2,969.62
应付交易费用	-	-	-	83,894.46	83,894.46
其他负债	-	-	-	74,551.58	74,551.58
负债总计	-	-	-	545,347.85	545,347.85
利率敏感度缺口	8,266,781.51	-	-	-78,142,768.21	86,409,549.72
上年度末 2016 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	4,232,850.23	-	-	-	4,232,850.23
存出保证金	49,335.03	-	-	-	49,335.03
交易性金融资产	-	-	-	-59,819,074.19	59,819,074.19
应收利息	-	-	-	877.89	877.89
应收申购款	-	-	-	280,033.64	280,033.64
资产总计	4,282,185.26	-	-	-60,099,985.72	64,382,170.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	185,227.47	185,227.47
应付管理人报酬	-	-	-	82,117.23	82,117.23
应付托管费	-	-	-	13,686.20	13,686.20
应付销售服务费	-	-	-	1,969.81	1,969.81
应付交易费用	-	-	-	76,649.69	76,649.69
其他负债	-	-	-	320,338.36	320,338.36
负债总计	-	-	-	679,988.76	679,988.76
利率敏感度缺口	4,282,185.26	-	-	-59,419,996.96	63,702,182.22

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券（2016 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 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交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例范围为基金资产的 80%-95%，其中投资于个股优选策略及波动率优化策略精选的股票不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	78,525,877.69	90.88	59,819,074.19	93.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,525,877.69	90.88	59,819,074.19	93.90

#### 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(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(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	3,303,542.39	1,658,689.94
	业绩比较基准下降 5%	-3,303,542.39	-1,658,689.94

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 74,814,843.69 元，属于第二层次的余额为 3,711,034.00 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 59,747,613.05 元，属于第二层次的余额为 71,461.14 元，无属于第三层次的余额。)

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,525,877.69	90.31
	其中：股票	78,525,877.69	90.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,259,811.54	9.50
8	其他各项资产	169,208.34	0.19
9	合计	86,954,897.57	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,563,486.05	6.44
C	制造业	23,265,523.35	26.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,276,951.00	7.26
E	建筑业	-	-



F	批发和零售业	1,304,108.76	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	3,360,926.66	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,043,642.00	3.52
J	金融业	25,928,317.07	30.01
K	房地产业	2,106,672.80	2.44
L	租赁和商务服务业	3,420,668.00	3.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,590,984.00	1.84
R	文化、体育和娱乐业	2,664,598.00	3.08
S	综合	-	-
	合计	78,525,877.69	90.88

### 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	601318	中国平安	41,900	2,078,659.00	2.41
2	600009	上海机场	54,386	2,029,141.66	2.35
3	002085	万丰奥威	99,140	1,928,273.00	2.23
4	601888	中国国旅	63,000	1,898,820.00	2.20
5	601601	中国太保	55,567	1,882,054.29	2.18
6	600036	招商银行	78,200	1,869,762.00	2.16
7	600518	康美药业	85,200	1,852,248.00	2.14
8	600276	恒瑞医药	36,280	1,835,405.20	2.12

9	600900	长江电力	115,200	1,771,776.00	2.05
10	600893	航发动力	62,200	1,698,060.00	1.97
11	601985	中国核电	212,100	1,656,501.00	1.92
12	600030	中信证券	95,400	1,623,708.00	1.88
13	600535	天士力	39,074	1,623,133.96	1.88
14	600066	宇通客车	72,627	1,595,615.19	1.85
15	600369	西南证券	284,100	1,593,801.00	1.84
16	300015	爱尔眼科	68,400	1,590,984.00	1.84
17	601169	北京银行	172,280	1,579,807.60	1.83
18	600196	复星医药	50,840	1,575,531.60	1.82
19	600016	民生银行	191,300	1,572,486.00	1.82
20	601899	紫金矿业	456,200	1,564,766.00	1.81
21	600177	雅戈尔	154,340	1,561,920.80	1.81
22	600271	航天信息	75,000	1,548,000.00	1.79
23	601988	中国银行	417,100	1,543,270.00	1.79
24	601166	兴业银行	90,800	1,530,888.00	1.77
25	600028	中国石化	257,900	1,529,347.00	1.77
26	600415	小商品城	210,200	1,521,848.00	1.76
27	002594	比亚迪	30,200	1,508,490.00	1.75
28	600000	浦发银行	117,875	1,491,118.75	1.73
29	000001	平安银行	157,240	1,476,483.60	1.71
30	600637	东方明珠	67,900	1,471,393.00	1.70
31	600519	贵州茅台	3,105	1,465,094.25	1.70
32	600023	浙能电力	266,900	1,457,274.00	1.69
33	601818	光大银行	355,600	1,440,180.00	1.67
34	600015	华夏银行	155,640	1,435,000.80	1.66
35	600837	海通证券	95,983	1,425,347.55	1.65
36	601857	中国石油	181,600	1,396,504.00	1.62

37	300144	宋城演艺	66,600	1,389,942.00	1.61
38	600959	江苏有线	130,600	1,380,442.00	1.60
39	600703	三安光电	69,300	1,365,210.00	1.58
40	601211	国泰君安	64,200	1,316,742.00	1.52
41	600795	国电电力	362,800	1,306,080.00	1.51
42	601928	凤凰传媒	130,600	1,274,656.00	1.48
43	600867	通化东宝	68,760	1,254,182.40	1.45
44	601998	中信银行	181,700	1,142,893.00	1.32
45	000963	华东医药	22,456	1,116,063.20	1.29
46	600547	山东黄金	37,085	1,072,869.05	1.24
47	002385	大北农	164,000	1,031,560.00	1.19
48	600666	奥瑞德	58,880	1,024,512.00	1.19
49	002450	康得新	42,300	952,596.00	1.10
50	601628	中国人寿	34,326	926,115.48	1.07
51	000895	双汇发展	38,257	908,603.75	1.05
52	600018	上港集团	92,000	583,280.00	0.68
53	000671	阳光城	93,600	544,752.00	0.63
54	601018	宁波港	90,900	513,585.00	0.59
55	601006	大秦铁路	28,000	234,920.00	0.27
56	002131	利欧股份	58,300	191,807.00	0.22
57	000008	神州高铁	13,600	99,008.00	0.11
58	601933	永辉超市	13,707	97,045.56	0.11
59	600827	百联股份	5,600	91,000.00	0.11
60	600886	国投电力	10,800	85,320.00	0.10

## 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	601018	宁波港	3,077,311.00	4.83
2	600271	航天信息	2,650,587.00	4.16
3	002450	康得新	2,105,788.32	3.31
4	600893	航发动力	1,885,691.81	2.96
5	300144	宋城演艺	1,874,220.07	2.94
6	300015	爱尔眼科	1,816,024.07	2.85
7	002594	比亚迪	1,802,207.01	2.83
8	600369	西南证券	1,753,371.32	2.75
9	002085	万丰奥威	1,708,947.36	2.68
10	600518	康美药业	1,687,216.35	2.65
11	601988	中国银行	1,639,407.00	2.57
12	601985	中国核电	1,619,387.00	2.54
13	600023	浙能电力	1,594,435.00	2.50
14	600030	中信证券	1,582,358.00	2.48
15	601899	紫金矿业	1,575,751.00	2.47
16	600177	雅戈尔	1,574,946.00	2.47
17	600415	小商品城	1,539,151.00	2.42
18	002385	大北农	1,491,963.00	2.34
19	601211	国泰君安	1,467,806.92	2.30
20	600637	东方明珠	1,449,758.25	2.28
21	600018	上港集团	1,388,319.00	2.18
22	600959	江苏有线	1,375,359.80	2.16
23	600221	海航控股	1,333,635.00	2.09
24	601607	上海医药	1,285,638.00	2.02

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	000538	云南白药	3,488,402.22	5.48
2	601018	宁波港	2,624,956.00	4.12
3	600221	海航控股	2,497,611.00	3.92
4	600660	福耀玻璃	1,645,181.00	2.58
5	002304	洋河股份	1,533,926.95	2.41
6	601088	中国神华	1,523,029.06	2.39
7	600886	国投电力	1,457,946.00	2.29
8	600703	三安光电	1,445,489.00	2.27
9	601006	大秦铁路	1,389,258.00	2.18
10	600089	特变电工	1,388,964.00	2.18
11	601607	上海医药	1,375,819.00	2.16
12	002142	宁波银行	1,374,522.83	2.16
13	601398	工商银行	1,355,805.00	2.13
14	601988	中国银行	1,311,131.00	2.06
15	000858	五粮液	1,302,821.00	2.05
16	600690	青岛海尔	1,290,961.00	2.03
17	601766	中国中车	1,289,022.00	2.02
18	600104	上汽集团	1,281,462.02	2.01
19	600383	金地集团	1,272,820.00	2.00
20	000876	新希望	1,260,841.00	1.98

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

买入股票成本（成交）总额	73,860,878.91
卖出股票收入（成交）总额	63,114,605.42

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序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	6,969.97
2	应收证券清算款	55,513.36
3	应收股利	-
4	应收利息	1,716.67
5	应收申购款	105,008.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,208.34

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
汇 丰 晋 信 大 盘 波 动 股 票 A	1,155	54,698.59	14,360,180.16	22.73%	48,816,687.89	77.27%
汇 丰 晋 信 大 盘 波 动 股 票 C	481	12,027.21	0.00	0.00%	5,785,088.58	100.00%
合计	1,636	42,152.79	14,360,180.16	20.82%	54,601,776.47	79.18%

### 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 大盘波动 股票 A	62,077.28	0.0983%
	汇丰晋信 大盘波动 股票 C	0.00	0.0000%



	合计	62,077.28	0.0900%
--	----	-----------	---------

### 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	汇丰晋信大盘波动股票 A	0
	汇丰晋信大盘波动股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信大盘波动股票 A	0
	汇丰晋信大盘波动股票 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇丰晋信大盘波动股票 A	汇丰晋信大盘波动股票 C
基金合同生效日（2016 年 3 月 11 日）基金份额总额	220,794,046.57	70,336,058.17
本报告期期初基金份额总额	52,255,319.21	4,257,963.35
本报告期基金总申购份额	26,084,259.09	9,483,534.40
减：本报告期基金总赎回份额	15,162,710.25	7,956,409.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,176,868.05	5,785,088.58

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

经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，本公司于 2017 年 1 月 12 日聘任曹庆先生为公司副总经理并已正式对外发布公告。

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

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，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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	
东吴证券	2	83,236,843.22	60.82%	77,518.35	60.82%	-
国信证券	2	26,122,618.74	19.09%	24,328.49	19.09%	-
中信证券	2	12,889,436.07	9.42%	12,003.90	9.42%	-
方正证券	1	6,333,616.52	4.63%	5,898.57	4.63%	-
西南证券	1	4,599,298.98	3.36%	4,283.28	3.36%	-
天风证券	2	3,674,888.68	2.69%	3,422.39	2.69%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
合计	24	136,856,702.21	100.00%	127,454.98	100.00%	-

1、报告期内无增加交易单元

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
东吴证券	233,810.00	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
合计	233,810.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017年1月3日
2	汇丰晋信基金 2016 年 4 季报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017年1月19日
3	基金行业高级管理人员变更公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017年1月19日
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于直销账户休眠及相关激活方案的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017年2月9日
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017年2月23日
6	汇丰晋信关于新增珠海盈米	本基金选定的信息	2017年2月27日

	财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	披露报纸、管理人网站	
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富管理有限公司费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017 年 2 月 27 日
8	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过珠海盈米财富管理有限公司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	2017 年 2 月 27 日
9	基金 2016 年度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017 年 3 月 29 日
10	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017 年 4 月 22 日
11	基金 2017 年 1 季度报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017 年 4 月 24 日
12	大盘波动基金更新招书(2017 年第 1 号)	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2017 年 4 月 27 日
13	汇丰晋信关于旗下基金通过平安银行开展申购费率及定期定额投资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	2017 年 5 月 8 日
14	关于新增招商银行为大盘波	本基金选定的信息	2017 年 5 月 17 日

	动基金代销机构的公告	披露报纸、管理人网站	
15	关于通过招商银行开办大盘波动基金代销机构定投业务的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人网站	2017 年 5 月 17 日
16	汇丰晋信关于在珠海盈米财富管理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	2017 年 6 月 2 日
17	关于提示直销个人投资者落实适当性管理的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人网站	2017 年 6 月 30 日
18	关于调整旗下基金风险等级划分和投资者风险承受能力类型的提示性公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人网站	2017 年 6 月 30 日
19	关于投资者分类的提示性公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人网站	2017 年 6 月 30 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 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

- (一) 中国证监会准予汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

### 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

2017 年 8 月 26 日