

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

2013 年半年度报告

2013 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：二〇一三年八月二十六日

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 2013 年 8 月 23 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|----------------------------------------------|----|
| 1 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| 2 基金简介..... | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现..... | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 4 管理人报告..... | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 5 托管人报告..... | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| 7 投资组合报告..... | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 33 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 34 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 38 |
| 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..... | 38 |

| | | |
|------|-----------------------------|----|
| 7.9 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 38 |
| 7.10 | 投资组合报告附注 | 38 |
| 8 | 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 39 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 39 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 39 |
| 10 | 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 40 |
| 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 | 40 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 40 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 40 |
| 10.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况 | 40 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 40 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 41 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 42 |
| 11 | 备查文件目录 | 45 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 45 |
| 11.2 | 存放地点 | 45 |
| 11.3 | 查阅方式 | 45 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇丰晋信大盘股票 |
| 基金主代码 | 540006 |
| 交易代码 | 540006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年6月24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 | 916,474,888.86份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 通过投资于盈利预期持续稳定增长，在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票，在将合理控制风险的基础上，追求稳健的分红收益及长期资本利得，实现基金资产持续超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>根据本基金所奉行的“较高仓位、蓝筹公司、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、股票资产投资策略</p> <p>本基金专注于分析大盘股特有的竞争优势，基金管理人将对初选股票给予全面的价值、成长分析，并结合行业地位分析，优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领</p> |

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 先地位的大盘蓝筹型股票进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数*90%+同业存款利率*10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金产品，在开放式基金中，其预期风险和收益水平高于债券型基金和混合型基金，属于风险水平较高的基金产品。本基金主要投资于大盘蓝筹股票，在股票型基金中属于中等风险水平的投资产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--------------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 汇丰晋信基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 古韵 | 裴学敏 |
| | 联系电话 | 021-20376868 | 95559 |
| | 电子邮箱 | melody.y.gu@hsbcjt.cn | peixm@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 021-20376888 | 95559 |
| 传真 | | 021-20376999 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区富城路99号 震旦大厦35楼 | 上海市浦东新区银城中路 188号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2013年1月1日至2013年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 59,181,196.86 |
| 本期利润 | 11,477,908.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0116 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.10% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 12,599,786.64 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0137 |
| 期末基金资产净值 | 929,074,675.50 |
| 期末基金份额净值 | 1.0137 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.44% |

注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -8.05% | 1.74% | -14.01% | 1.68% | 5.96% | 0.06% |
| 过去三个月 | -2.90% | 1.29% | -10.60% | 1.30% | 7.70% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.04% | 1.24% | -11.46% | 1.35% | 11.50% | -0.11% |
| 过去一年 | -0.71% | 1.12% | -9.47% | 1.23% | 8.76% | -0.11% |
| 过去三年 | 5.00% | 1.20% | -12.51% | 1.23% | 17.51% | -0.03% |
| 自基金合同生效起 | 7.44% | 1.27% | -25.48% | 1.37% | 32.92% | -0.10% |

| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

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 6 月 24 日至 2013 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，本基金将不低于 80% 的股票资产投资于国内 A 股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行各业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。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 2009 年 12 月 24 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*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 2013 年 6 月 30 日，公司共管理 12 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）和汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理） 期限 | | 证券从业 年限 | 说明 |
|----|-------------------------------|---------------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王品 | 本基金基金经理、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金基金经理 | 2009-06-24 | - | 13 年 | 王品女士，中国药科大学理学硕士。历任兴业证券股份有限公司医药行业研究员，中银国际基金管理有限公司中银中国基金经理助理、行业研究员，汇丰晋信基金管理公司高级研究员。现任本基金基金经理、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金基金经理。 |

注：1. 任职日期为本基金基金合同生效日；
2. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限；

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

2013 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年经济增长数据逐月回落，PMI 指数的变动连续低于历史数据，工业生产需

求疲弱，PPI 指数回落幅度加深，企业再库存动力不足，经济运行形势不佳；从需求端来看，消费维持较为低迷的状况，受外管局监管强化的影响，虚高的出口增速也大幅度回落，投资增速出现稳中有降的情形，整体经济下行的压力加大。在流动性方面，上半年流动性由宽松转向紧张，随着银监会关于规范银行非标准化债权资产投资的“8 号文”出台，市场资金流动性有所收紧，尤其进入 6 月份，季节性与海外资金市场的波动进一步加剧了市场资金的紧张程度，市场利率也出现大幅度飚升。在此背景下，沪深 300 指数在 2013 年上半年下跌了 12.78%，但市场风格分化严重，创业板指数逆势上涨了 41.72%。

自年初以来，我们对于市场始终持谨慎态度，对于与经济增长相关性较强的周期性板块，如银行、交通运输、非银行金融等板块我们进行了减持，同时有感于消费需求恢复程度低于预期，我们也大幅度减持了商贸零售、农林牧渔等板块的投资配置，而考虑到我国目前正处于经济结构转型的过程中，我们增持了一些新兴产业相关板块，如医药、传媒、通信等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为 0.04%，同期业绩比较基准为-11.46%，本基金领先业绩比较基准 11.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

结合 PMI、通胀、信贷数据及国外经济情况，我们预计三季度经济下行的压力将进一步显现，三大需求中消费与出口保持低迷的态势，受基数影响，投资增速预计也将小幅下滑；大宗商品价格的下跌及较弱的需求将导致企业再库存的动力减弱；二季度末期市场利率的快速上升也将对经济增速产生负面影响；尽管经济基本面目前运行状况不佳，但近期政府部门关于经济增长的底限论使我们相信，未来半年经济将运行于合理的区间内。从流动性来看，受外汇占款减少、信托理财产品偿付高峰到来、社会融资总额环比减少的影响，市场流动性在三季度将趋于紧张。因此，我们预计三季度 A 股市场可能出现区间震荡走势。在投资策略方面，我们认为目前部分新兴产业中的中小盘股估值已较高，对此，我们将持审慎态度，同时把眼光放长，寻找未来二年内景气度良好、盈利仍能稳定增长的板块与个股的投资机会，从目前来看，医药、大众消费品、传媒、移动通信、环保行业具备这样的特质，我们将对这些板块进行积极的投资布局。

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、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下开展工作，其中：

一、基金运营部

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

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

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

二、基金投资部

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

三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

四、风险控制部

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

五、督察长

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

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

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

本基金的基金管理人目前没有进行与估值相关的任何定价服务方面的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013 年上半年度，基金托管人在汇丰晋信大盘股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2013 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信大盘股票型证券投资基金投

资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013 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大盘股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
|----------|---------------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 6.4.10.5 | 3,589,980.52 | 138,118,628.56 |
| 结算备付金 | 6.4.10.5 | 91,759,239.00 | 8,234,332.43 |
| 存出保证金 | | 468,534.58 | 750,000.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 833,560,071.08 | 996,778,638.05 |
| 其中：股票投资 | 6.4.7.2 | 833,560,071.08 | 996,778,638.05 |
| 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 | | - | 9,825,071.77 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 43,407.25 | 52,354.37 |
| 应收股利 | | 2,949,450.79 | - |
| 应收申购款 | | 61,052.03 | 30,067,901.25 |
| 递延所得税资产 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 932,431,735.25 | 1,183,826,926.43 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 20,229,160.69 |
| 应付赎回款 | | 285,411.07 | 927,800.66 |
| 应付管理人报酬 | | 1,186,706.99 | 1,115,620.44 |
| 应付托管费 | | 197,784.50 | 185,936.76 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,357,807.27 | 1,182,684.05 |
| 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 | 329,349.92 | 923,496.53 |
| 负债合计 | | 3,357,059.75 | 24,564,699.13 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 916,474,888.86 | 1,143,999,348.69 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 12,599,786.64 | 15,262,878.61 |
| 所有者权益合计 | | 929,074,675.50 | 1,159,262,227.30 |
| 负债和所有者权益总计 | | 932,431,735.25 | 1,183,826,926.43 |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0137 元，基金份额总额 916,474,888.86 份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013 年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日 |
|-------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | 25,739,399.74 | 72,714,609.13 |
| 1.利息收入 | | 891,536.72 | 902,925.29 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 891,536.72 | 902,925.29 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|----------------------|
| 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） | | 72,235,417.53 | -29,385,266.29 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 64,209,113.09 | -35,723,732.03 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 8,026,304.44 | 6,338,465.74 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -47,703,288.37 | 100,958,129.41 |
| 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 | 315,733.86 | 238,820.72 |
| 减：二、费用 | | 14,261,491.25 | 11,757,450.29 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,763,670.88 | 7,512,637.82 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,293,945.16 | 1,252,106.33 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 4,985,994.13 | 2,774,648.18 |
| 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 | 217,881.08 | 218,057.96 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 11,477,908.49 | 60,957,158.84 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 11,477,908.49 | 60,957,158.84 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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） | 1,143,999,348.69 | 15,262,878.61 | 1,159,262,227.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 11,477,908.49 | 11,477,908.49 |
| 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） | -227,524,459.83 | -14,141,000.46 | -241,665,460.29 |
| 其中：1. 基金申购款 | 10,334,321.42 | 583,781.14 | 10,918,102.56 |
| 2. 基金赎回款 | -237,858,781.25 | -14,724,781.60 | -252,583,562.85 |
| 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） | 916,474,888.86 | 12,599,786.64 | 929,074,675.50 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,063,259,536.24 | -37,059,912.35 | 1,026,199,623.89 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 60,957,158.84 | 60,957,158.84 |
| 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） | -91,149,216.18 | -3,474,880.00 | -94,624,096.18 |
| 其中：1. 基金申购款 | 99,266,170.85 | -2,836,223.54 | 96,429,947.31 |
| 2. 基金赎回款 | -190,415,387.03 | -638,656.46 | -191,054,043.49 |
| 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） | 972,110,320.06 | 20,422,366.49 | 992,532,686.55 |

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：

基金管理人负责人：杨小勇，主管会计工作负责人：王栋，会计机构负责人：杨洋

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于核准汇丰晋信大盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]343 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《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2009 年 6 月 24 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 2,885,554,241.41 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,投资范围包括国内依法发行上市的股票、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它金融工具。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%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行各业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金业绩比较基准为沪深 300 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》、《汇丰晋信大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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 2012 年年度财务报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期内，本基金无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、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[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税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》、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》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) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (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；

对基金取得的股票的股息、红利收入，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。自 2013 年 1 月 1 日起，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额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂按 25% 计入应纳税所得额，上述股息红利所得适用 20% 的税率计征。

(e) 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。

(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 2013 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 3,589,980.52 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 3,589,980.52 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 | | |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 820,192,286.06 | 833,560,071.08 | 13,367,785.02 |
| 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 | 820,192,286.06 | 833,560,071.08 | 13,367,785.02 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有任何衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 908.36 |
| 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 | 42,308.18 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.99 |
| 其他 | 189.72 |
| 合计 | 43,407.25 |

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 2013年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,357,807.27 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,357,807.27 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

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

| | 2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,076.84 |
| 应付后端申购费 | - |
| 债券利息税 | - |
| 预提费用 | 328,273.08 |
| 银行手续费 | - |
| 合计 | 329,349.92 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,143,999,348.69 | 1,143,999,348.69 |
| 本期申购 | 10,334,321.42 | 10,334,321.42 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -237,858,781.25 | -237,858,781.25 |
| 本期末 | 916,474,888.86 | 916,474,888.86 |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 60,615,719.56 | -45,352,840.95 | 15,262,878.61 |
| 本期利润 | 59,181,196.86 | -47,703,288.37 | 11,477,908.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -17,874,651.62 | 3,733,651.16 | -14,141,000.46 |
| 其中：基金申购款 | 916,675.20 | -332,894.06 | 583,781.14 |
| 基金赎回款 | -18,791,326.82 | 4,066,545.22 | -14,724,781.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 101,922,264.80 | -89,322,478.16 | 12,599,786.64 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | |
|-----------|---------------------------------------|------------|
| | 活期存款利息收入 | 178,801.99 |
| 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 | 707,178.25 | |
| 其他 | 5,556.48 | |
| 合计 | 891,536.72 | |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,693,868,306.57 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,629,659,193.48 |
| 买卖股票差价收入 | 64,209,113.09 |

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内，本基金未进行债券投资，债券投资收益为零。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期内，本基金未投资衍生金融产品，衍生工具收益为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,026,304.44 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 8,026,304.44 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -47,703,288.37 |
| ——股票投资 | -47,703,288.37 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -47,703,288.37 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 308,779.74 |
| 基金转换转出费收入 | 6,954.12 |
| 合计 | 315,733.86 |

注：本基金赎回费的 25% 归入基金资产；基金转换产生的转出赎回费，该赎回费的 25%

归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 4,985,994.13 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 4,985,994.13 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 银行汇款费用 | 208.00 |
| 银行间债券账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 217,881.08 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------|
| 汇丰晋信基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人 |
| 山西证券股份有限公司（“山西证券”） | 见注释① |

注：①山西证券与本基金管理人的股东—山西信托共同受山西省国信投资（集团）公司控制。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | - | - | 153,613,339.89 | 8.62% |

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未通过关联方进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 山西证券 | 130,570.91 | 8.72% | - | - |

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费

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

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,763,670.88 | 7,512,637.82 |

| | | |
|-----------------|--------------|--------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,339,158.57 | 1,056,414.81 |
|-----------------|--------------|--------------|

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2013年1月1日至2013年6月30日 | 2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,293,945.16 | 1,252,106.33 |

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期间与上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人均未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|------------|----------------------|------------|
| | 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 2012年1月1日至2012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 | 3,589,980.52 | 178,801.99 | 36,468,855.21 | 144,331.96 |

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结算保证金，于 2013 年 06 月 30 日的余额为人民币 92,227,773.58 元 (2012 年 06 月 30 日：人民币 97,944,152.74 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

2013 年上半年度，本基金未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2013 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期内本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 000999 | 华润三九 | 2013-06-03 | 重大事项 | 26.55 | - | - | 633,000 | 18,770,161.53 | 16,806,150.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2013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 | 3,589,980.52 | - | - | - | 3,589,980.52 |
| 结算备付金 | 91,759,239.00 | - | - | - | 91,759,239.00 |
| 存出保证金 | 468,534.58 | - | - | - | 468,534.58 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 833,560,071.08 | 833,560,071.08 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应收利息 | - | - | - | 43,407.25 | 43,407.25 |
| 应收股利 | - | - | - | 2,949,450.79 | 2,949,450.79 |
| 应收申购款 | - | - | - | 61,052.03 | 61,052.03 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 95,817,754.10 | - | - | 836,613,981.15 | 932,431,735.25 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 285,411.07 | 285,411.07 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,186,706.99 | 1,186,706.99 |
| 应付托管费 | - | - | - | 197,784.50 | 197,784.50 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,357,807.27 | 1,357,807.27 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 329,349.92 | 329,349.92 |
| 负债总计 | 0.00 | - | - | 3,357,059.75 | 3,357,059.75 |
| 利率敏感度缺口 | 95,817,754.10 | - | - | 833,256,921.40 | 929,074,675.50 |

| 上年度末 2012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 | 138,118,628.56 | - | - | - | 138,118,628.56 |
| 结算备付金 | 8,234,332.43 | - | - | - | 8,234,332.43 |
| 存出保证金 | - | - | - | 750,000.00 | 750,000.00 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 996,778,638.05 | 996,778,638.05 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 9,825,071.77 | 9,825,071.77 |
| 应收利息 | - | - | - | 52,354.37 | 52,354.37 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | 29,998,000.00 | - | - | 69,901.25 | 30,067,901.25 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 176,350,960.99 | - | - | 1,007,475,965.44 | 1,183,826,926.43 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 20,229,160.69 | 20,229,160.69 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 927,800.66 | 927,800.66 |
| 应付管理人 | - | - | - | 1,115,620.44 | 1,115,620.44 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|----------------|------------------|
| 报酬 | | | | | |
| 应付托管费 | - | - | - | 185,936.76 | 185,936.76 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,182,684.05 | 1,182,684.05 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 923,496.53 | 923,496.53 |
| 负债总计 | - | - | - | 24,564,699.13 | 24,564,699.13 |
| 利率敏感度缺口 | 176,350,960.99 | - | - | 982,911,266.31 | 1,159,262,227.30 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析为除市场利率以外的其他市场变量保持不变，该计算结果为基于本基金报表每日资产组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 | | |
| | 假设所有期限的利率以相同幅度变动25个基点，其他市场变量保持不变。 | | |
| | 此项影响不考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| | 市场利率上升25个基点 | 无影响 | 无影响 |
| | 市场利率下降25个基点 | 无影响 | 无影响 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 89.72%、无债券投资及衍生金融资产。截止 2013 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2012 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 | 833,560,071.08 | 89.72 | 996,778,638.05 | 85.98 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 833,560,071.08 | 89.72 | 996,778,638.05 | 85.98 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准（见附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加 38,478,118.53 | 增加 50,616,566.37 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少 38,478,118.53 | 减少 50,616,566.37 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(a) 以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2013 年 06 月 30 日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场

报价以外的有关资产或负债的输入值；

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

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

| 2013 年 06 月 30 日 | | | | |
|------------------|----------------|---------------|------|----------------|
| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 合计 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | | | | |
| 股票投资 | 816,753,921.08 | 16,806,150.00 | - | 833,560,071.08 |
| 债券投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 816,753,921.08 | 16,806,150.00 | - | 833,560,071.08 |

| 2012 年 12 月 31 日 | | | | |
|------------------|----------------|---------------|------|----------------|
| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 合计 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | | | | |
| 股票投资 | 960,621,447.78 | 36,157,190.27 | - | 996,778,638.05 |
| 债券投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 960,621,447.78 | 36,157,190.27 | - | 996,778,638.05 |

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

(b) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量账面价值）

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

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 |
|----|----|----|-----------|
|----|----|----|-----------|

| | | | (%) |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 833,560,071.08 | 89.40 |
| | 其中：股票 | 833,560,071.08 | 89.40 |
| 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 | 95,349,219.52 | 10.23 |
| 6 | 其他各项资产 | 3,522,444.65 | 0.38 |
| 7 | 合计 | 932,431,735.25 | 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 | 8,706,423.00 | 0.94 |
| B | 采矿业 | 43,580,477.19 | 4.69 |
| C | 制造业 | 474,803,153.13 | 51.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 45,051,425.36 | 4.85 |
| E | 建筑业 | 21,013,041.00 | 2.26 |
| F | 批发和零售业 | 13,546,626.27 | 1.46 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 102,830,912.60 | 11.07 |
| K | 房地产业 | 60,672,611.75 | 6.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 30,735,256.65 | 3.31 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 32,620,144.13 | 3.51 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 833,560,071.08 | 89.72 |

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 | 000538 | 云南白药 | 568,188 | 47,733,473.88 | 5.14 |
| 2 | 600587 | 新华医疗 | 1,117,410 | 46,305,470.40 | 4.98 |
| 3 | 002104 | 恒宝股份 | 3,390,726 | 43,774,272.66 | 4.71 |
| 4 | 600583 | 海油工程 | 6,735,777 | 43,580,477.19 | 4.69 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 1,371,802 | 42,909,966.56 | 4.62 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 5,393,626 | 37,323,891.92 | 4.02 |
| 7 | 300336 | 新文化 | 766,769 | 29,727,634.13 | 3.20 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 10,463,843 | 25,741,053.78 | 2.77 |
| 9 | 000726 | 鲁泰A | 3,033,426 | 25,602,115.44 | 2.76 |
| 10 | 600422 | 昆明制药 | 882,810 | 23,394,465.00 | 2.52 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 5,380,913 | 21,631,270.26 | 2.33 |
| 12 | 000826 | 桑德环境 | 661,427 | 21,344,249.29 | 2.30 |
| 13 | 000625 | 长安汽车 | 2,237,301 | 20,784,526.29 | 2.24 |
| 14 | 000002 | 万科A | 1,951,084 | 19,218,177.40 | 2.07 |
| 15 | 600351 | 亚宝药业 | 2,987,411 | 18,342,703.54 | 1.97 |
| 16 | 601166 | 兴业银行 | 1,185,502 | 17,509,864.54 | 1.88 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 500,068 | 17,382,363.68 | 1.87 |
| 18 | 000999 | 华润三九 | 633,000 | 16,806,150.00 | 1.81 |
| 19 | 002385 | 大北农 | 1,563,367 | 16,133,947.44 | 1.74 |
| 20 | 002565 | 上海绿新 | 1,473,531 | 16,061,487.90 | 1.73 |
| 21 | 002375 | 亚厦股份 | 507,300 | 15,624,840.00 | 1.68 |
| 22 | 000024 | 招商地产 | 630,000 | 15,296,400.00 | 1.65 |
| 23 | 601601 | 中国太保 | 960,088 | 15,294,201.84 | 1.65 |
| 24 | 600383 | 金地集团 | 2,221,710 | 15,240,930.60 | 1.64 |
| 25 | 002415 | 海康威视 | 424,564 | 15,004,091.76 | 1.61 |
| 26 | 002475 | 立讯精密 | 702,743 | 14,757,603.00 | 1.59 |
| 27 | 002022 | 科华生物 | 945,350 | 14,000,633.50 | 1.51 |
| 28 | 002028 | 思源电气 | 751,127 | 11,815,227.71 | 1.27 |
| 29 | 002630 | 华西能源 | 564,112 | 11,677,118.40 | 1.26 |
| 30 | 600697 | 欧亚集团 | 594,593 | 10,934,565.27 | 1.18 |
| 31 | 600048 | 保利地产 | 1,101,625 | 10,917,103.75 | 1.18 |
| 32 | 600066 | 宇通客车 | 588,504 | 10,787,278.32 | 1.16 |
| 33 | 600332 | 广州药业 | 311,673 | 10,677,916.98 | 1.15 |
| 34 | 601299 | 中国北车 | 2,773,900 | 10,429,864.00 | 1.12 |
| 35 | 600600 | 青岛啤酒 | 257,458 | 9,778,254.84 | 1.05 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 36 | 600519 | 贵州茅台 | 50,587 | 9,731,421.19 | 1.05 |
| 37 | 000430 | 张家界 | 1,364,972 | 9,391,007.36 | 1.01 |
| 38 | 300205 | 天喻信息 | 549,086 | 9,169,736.20 | 0.99 |
| 39 | 002041 | 登海种业 | 410,100 | 8,706,423.00 | 0.94 |
| 40 | 000669 | 金鸿能源 | 204,216 | 7,727,533.44 | 0.83 |
| 41 | 002241 | 歌尔声学 | 205,060 | 7,441,627.40 | 0.80 |
| 42 | 300115 | 长盈精密 | 230,692 | 7,414,440.88 | 0.80 |
| 43 | 002482 | 广田股份 | 256,581 | 5,388,201.00 | 0.58 |
| 44 | 600030 | 中信证券 | 520,450 | 5,272,158.50 | 0.57 |
| 45 | 600498 | 烽火通信 | 284,880 | 4,694,822.40 | 0.51 |
| 46 | 300057 | 万顺股份 | 255,255 | 3,662,909.25 | 0.39 |
| 47 | 000848 | 承德露露 | 138,189 | 3,138,272.19 | 0.34 |
| 48 | 300291 | 华录百纳 | 81,000 | 2,892,510.00 | 0.31 |
| 49 | 000423 | 东阿阿胶 | 71,700 | 2,773,356.00 | 0.30 |
| 50 | 002262 | 恩华药业 | 117,396 | 2,612,061.00 | 0.28 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 39,696,748.36 | 3.42 |
| 2 | 002104 | 恒宝股份 | 39,562,520.68 | 3.41 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 35,591,502.17 | 3.07 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 34,367,361.99 | 2.96 |
| 5 | 000423 | 东阿阿胶 | 31,102,413.34 | 2.68 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 30,631,721.85 | 2.64 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 29,565,792.20 | 2.55 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 29,307,608.80 | 2.53 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 29,225,124.90 | 2.52 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 28,989,957.36 | 2.50 |
| 11 | 000100 | TCL 集团 | 28,547,419.10 | 2.46 |
| 12 | 601009 | 南京银行 | 28,301,306.90 | 2.44 |
| 13 | 300336 | 新文化 | 28,056,236.29 | 2.42 |
| 14 | 002063 | 远光软件 | 26,352,651.02 | 2.27 |
| 15 | 000639 | 西王食品 | 25,282,336.08 | 2.18 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 24,483,828.33 | 2.11 |
| 17 | 000726 | 鲁泰 A | 24,165,736.07 | 2.08 |
| 18 | 600011 | 华能国际 | 22,417,767.41 | 1.93 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 19 | 601688 | 华泰证券 | 21,882,952.20 | 1.89 |
| 20 | 600422 | 昆明制药 | 20,732,135.49 | 1.79 |

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 | 600837 | 海通证券 | 50,585,524.95 | 4.36 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 47,365,213.05 | 4.09 |
| 3 | 600858 | 银座股份 | 45,743,082.56 | 3.95 |
| 4 | 600467 | 好当家 | 38,747,498.80 | 3.34 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 38,027,125.51 | 3.28 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 37,997,692.76 | 3.28 |
| 7 | 600011 | 华能国际 | 36,627,027.58 | 3.16 |
| 8 | 601117 | 中国化学 | 32,414,353.72 | 2.80 |
| 9 | 600422 | 昆明制药 | 32,046,438.93 | 2.76 |
| 10 | 000002 | 万科 A | 29,327,847.34 | 2.53 |
| 11 | 000100 | TCL 集团 | 29,180,240.44 | 2.52 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 28,862,046.65 | 2.49 |
| 13 | 002244 | 滨江集团 | 27,660,366.60 | 2.39 |
| 14 | 000783 | 长江证券 | 27,470,522.69 | 2.37 |
| 15 | 600859 | 王府井 | 27,388,000.67 | 2.36 |
| 16 | 000423 | 东阿阿胶 | 27,291,700.12 | 2.35 |
| 17 | 601009 | 南京银行 | 26,750,791.05 | 2.31 |
| 18 | 600664 | 哈药股份 | 26,629,053.28 | 2.30 |
| 19 | 600585 | 海螺水泥 | 26,163,508.34 | 2.26 |
| 20 | 002557 | 洽洽食品 | 26,065,257.11 | 2.25 |
| 21 | 600009 | 上海机场 | 26,016,479.73 | 2.24 |
| 22 | 002063 | 远光软件 | 25,308,849.58 | 2.18 |
| 23 | 600587 | 新华医疗 | 24,751,708.46 | 2.14 |
| 24 | 000639 | 西王食品 | 23,874,676.78 | 2.06 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 1,514,143,914.88 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,693,868,306.57 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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 | 468,534.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 2,949,450.79 |
| 4 | 应收利息 | 43,407.25 |
| 5 | 应收申购款 | 61,052.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,522,444.65 |

7.10.4 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。

7.10.5 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。

7.10.6 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 |
| 12,638 | 72,517.40 | 423,452,075.49 | 46.20% | 493,022,813.37 | 53.80% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 549,218.93 | 0.06% |

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0至10万份(含)，本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为10万份至50万份(含)。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2009年6月24日)基金份额总额 | 2,885,554,241.41 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,143,999,348.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 10,334,321.42 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 237,858,781.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 916,474,888.86 |
|-------------|----------------|

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

2013 年 3 月 27 日，基金管理人发布公告，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，聘任赵琳女士为公司副总经理。

本报告期内，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 | 2 | 1,214,579,507.81 | 37.86% | 1,097,363.95 | 37.74% | - |
| 东方证券 | 1 | 453,641,295.20 | 14.14% | 412,991.83 | 14.20% | - |
| 兴业证券 | 1 | 362,882,533.67 | 11.31% | 330,367.99 | 11.36% | - |
| 中金公司 | 1 | 322,812,019.37 | 10.06% | 293,886.89 | 10.11% | - |
| 银河证券 | 1 | 300,124,078.82 | 9.36% | 273,231.73 | 9.40% | - |
| 申银万国 | 1 | 251,679,363.08 | 7.85% | 229,127.39 | 7.88% | - |
| 中银证券 | 1 | 157,138,840.18 | 4.90% | 142,657.65 | 4.91% | - |
| 安信证券 | 1 | 145,154,583.32 | 4.52% | 128,447.04 | 4.42% | - |
| 华泰联合 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 16 | 3,208,012,221.45 | 100.00% | 2,908,074.47 | 100.00% | - |

注：①本报告期内本基金新增交易单元兴业证券、华泰联合、中信证券。

②专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

- 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 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - | - |

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。

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 | 2013-01-04 |
| 2 | 汇丰晋信基金2012年第4季度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-01-21 |
| 3 | 汇丰晋信关于新增齐鲁证券为旗下开放式 | 本基金选定的信息 | 2013-01-23 |

| | | | |
|----|-------------------------------------------|--------------------|------------|
| | 基金代销机构的公告 | 披露报纸、管理人网站 | |
| 4 | 关于通过齐鲁证券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 | 2013-02-01 |
| 5 | 汇丰晋信关于旗下基金通过齐鲁证券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 | 2013-02-01 |
| 6 | 汇丰晋信关于在齐鲁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 | 2013-02-01 |
| 7 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于新增浙商证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-02-07 |
| 8 | 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说明书（2013年第1号） | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-02-07 |
| 9 | 汇丰晋信关于新增华鑫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 | 2013-02-27 |
| 10 | 关于通过华鑫证券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 | 2013-02-27 |
| 11 | 汇丰晋信关于在华鑫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 | 2013-02-27 |
| 12 | 汇丰晋信关于旗下基金通过华鑫证券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 | 2013-02-27 |
| 13 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于调整基金最低转换份额限制公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-03-01 |
| 14 | 汇丰晋信关于新增信达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 | 2013-03-28 |
| 15 | 关于通过信达证券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 | 2013-03-28 |
| 16 | 汇丰晋信关于在信达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 | 2013-03-28 |
| 17 | 汇丰晋信关于旗下基金通过信达证券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 | 2013-03-28 |

| | | | |
|----|------------------------------------------------|--------------------|------------|
| 18 | 汇丰晋信基金2012年年度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-03-28 |
| 19 | 汇丰晋信关于旗下基金通过工商银行开展网银申购费率优惠活动的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-04-01 |
| 20 | 汇丰晋信关于新增和讯科技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 | 2013-04-17 |
| 21 | 关于通过和讯科技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 | 2013-04-17 |
| 22 | 汇丰晋信关于在和讯科技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 | 2013-04-17 |
| 23 | 汇丰晋信关于旗下基金通过和讯科技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 | 2013-04-17 |
| 24 | 关于通过好买基金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 | 2013-04-18 |
| 25 | 汇丰晋信关于旗下基金通过好买基金开展定期定额申购费率优惠的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-04-18 |
| 26 | 汇丰晋信基金2013年第1季度报告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-04-18 |
| 27 | 汇丰晋信关于开通基金“强定投”计划的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-04-22 |
| 28 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于通过平安银行和洛阳银行开通旗下开放式基金“强定投”计划业务的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-05-15 |
| 29 | 汇丰晋信关于新增展恒基金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 | 2013-05-17 |
| 30 | 关于通过展恒基金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 | 2013-05-17 |
| 31 | 汇丰晋信关于在展恒基金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 | 2013-05-17 |
| 32 | 汇丰晋信关于旗下基金通过北京展恒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 | 2013-06-01 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------|--------------------|------------|
| | | 网站 | |
| 33 | 关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金持有的长期停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-06-07 |
| 34 | 汇丰晋信关于在山西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 | 2013-06-08 |
| 35 | 汇丰晋信基金管理有限公司关于通过和讯和山西证券开通旗下开放式基金“强定投”计划业务的公告 | 本基金选定的信息披露报纸、管理人网站 | 2013-06-08 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 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。

11.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。
 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。
 客户服务中心电话：021-20376888
 公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
 二〇一三年八月二十六日