

# 汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金 2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信动态策略混合
基金主代码	540003
交易代码	540003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 9 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	440,955,587.45 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将致力于捕捉股票、债券等市场不同阶段中的不同投资机会，无论其处于牛市或者熊市，均通过基金资产在不同市场的合理配置，追求基金资产的长期较高回报。
投资策略	<p>1. 积极主动的资产配置策略</p> <p>本基金奉行“恰当时机、恰当比重、恰当选股”的投资理念和“自上而下”与“自下而上”的双重选股策略。在投资决策中，本基金结合全球经济增长、通货膨胀和利息的预期，预测中国股票、债券市场的未来走势，在长期投资的基础上，将战略资产配置与择时相结合，灵活、主动的调整基金资产在股票、固定收益和现金上的配置比例。同时，在各类资产中，本基金根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产品种具体投资品种的种类和数量。</p> <p>2. 综合相对、绝对估值方法的股票筛选策略</p> <p>本基金不拘泥于单一的价值标准或成长标准，对股票给予全面的成长、价值分析，优选出价值低估，成长低估的上市公司进行投资。成长指标包括：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率（P/E）、净资产收益率（ROE）等；价值指标包括：市净率（P/B）、每股收益率、年现金流/市值、股息率等。同时，再通过严格的基本面分析（CFROI（投资现金回报率）指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析）和公司实地调研，最大程度地筛选出有投资价值的投资品种。</p>

业绩比较基准	业绩比较基准 = 50%×MSCI 中国 A 股指数收益率 +50%×中债新综合指数收益率（全价）。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益中等的基金产品。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	汤嵩彦
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：上海市浦东新区世纪大道 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。

## § 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	686,035,572.64
本期利润	285,423,710.94
加权平均基金份额本期利润	0.4285
本期基金份额净值增长率	26.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	1.1448
期末基金资产净值	945,774,108.97
期末基金份额净值	2.1448

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	-9.10%	3.75%	-4.06%	1.73%	-5.04%	2.02%
过去三个月	15.17%	2.75%	7.10%	1.31%	8.07%	1.44%
过去六个月	26.35%	2.31%	17.54%	1.11%	8.81%	1.20%
过去一年	106.13%	2.03%	57.88%	0.89%	48.25%	1.14%
过去三年	133.16%	1.62%	55.80%	0.74%	77.36%	0.88%
自基金合同生效起至今	137.95%	1.55%	56.55%	0.94%	81.40%	0.61%

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

过去三个月指 2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去六个月指 2015 年 1 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去一年指 2014 年 7 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

过去三年指 2012 年 7 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2007 年 4 月 9 日—2015 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

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007 年 4 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日）



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2007 年 10 月 9 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 基金合同生效日(2007 年 4 月 9 日)至 2014 年 5 月 31 日,本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中信标普全债指数收益率” (MSCI 中国 A 股指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中)。自 2014 年 6 月 1 日起,本基金的业绩比较基准调整为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率(全价)”。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理(英国)有限公司合资设立,注册资本为 2 亿元人民币,注册地在上海。截止 2015 年 6 月 30 日,公司共管理 14 只开放式基金: 汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金(2006 年 5 月 23 日成立)、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金(2006 年 9 月 27 日成立)、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金(2007 年 4 月 9 日成立)、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金(2008 年 7 月 23 日成立)、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金(2008 年 12 月 3 日成立)、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金(2009 年 6 月 24 日成立)、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(2009 年 12 月 11 日成立)、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(2010 年 6 月 8 日成立)、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金(2010 年 12 月 8 日成立)、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金(2011 年 7 月 27 日成立)、汇丰晋信货币市场基金(2011 年 11 月 2 日成立)、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金(2012 年 8 月 1 日成立)、

汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014 年 11 月 26 日成立）和汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王春	本基金、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理	2012 年 7 月 21 日	2015 年 5 月 23 日	14	王春先生，复旦大学企业管理硕士。曾任德恒证券有限责任公司研究员；兴业证券股份有限公司投资策略部经理；平安资产管理有限责任公司投资经理兼权益投资部研究主管；汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理、首席策略分析师及策略与金融工程总监。
郭敏	研究部副总监、本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	8	硕士研究生。曾任上海证券研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司研究部副总监、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期为本基金管理人公告王春先生、郭敏女士担任本基金基金经理的日期；

2. 离任日期为本基金管理人公告王春先生不再担任本基金基金经理的日期；

3. 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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



## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年沪深 300 指数上涨 26.58%，中小板指数上涨 69.06%，创业板指数上涨 94.23%，按照中信行业指数分类，上半年表现较好的行业是计算机、通信、轻工制造、餐饮旅游，而表现较差的行业是非银行金融、银行、煤炭、有色金属，其中计算机上涨约 132%，涨幅排名前四的行业上半年涨幅都超过 100%；而非银行金融仅上涨 0.8%。行业指数表现呈现八二现象，除了银行、非银以外，其余行业指数上涨幅度都超过 40%。

从国内经济的上半年表现来看，上半年 GDP 增速稳定在 7%，符合政府的宏观经济的预期增长。同时由于经济下行的压力较大，上半年央行分别进行了 3 次降准、3 次降息，以宽松的货币来刺激经济发展。虽然宽松的货币政策带动了利率的下行并有助于改善经济的增长，但经济下行的压力依旧较大，预计下半年财政政策和货币政策会双管齐下，经济增速预计在 6.5%-7%，大概率呈现 L 型走势，长端利率仍有下行的空间。

股市表现来看，上半年在资金推动下 A 股市场有尚佳表现。其中，改革带来的风险溢价的限制下行，金融创新带来的杠杆资金入市以及新兴行业的颠覆性发展是这波牛市的主旋律。资本市场的估值大幅修复，新兴行业如 TMT、互联网、工业 4.0 等等估值大幅提升。但在 6 月份股指经历了大幅回调，杠杆资金是导致股市短期出现流动性危机同时出现超调的重要原因。同时，估值过高脱离经济基本面也是重要的促发因素。展望后市，从基本面来看，后续经济企稳的压力较大，企业盈利未见明显复苏。新兴行业发展向好，但短期估值较高，仍需要有一定的消化空间。从资金面来看，股市流动性因去杠杆资金面有所削弱，对下半年股市，认为大概率是震荡过程。

在降息降准的背景下，上半年对市场一直保持乐观，重点配置了代表经济转型方向的行业 and 低估值蓝筹，同时也适当配置了国企改革主题。基金一直维持在高股票仓位，行业配置上主要以大金融、TMT、医药、交运等行业为重点。

### 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 26.35%，同期业绩比较基准为 17.54%，本基金领先业绩比较基准 8.81%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年从资金面来看将有所弱化，第一，杠杆资金仍在清理当中，未来杠杆带来的资金将显著弱化；第二，猪价上涨虽然难以对 CPI 形成实质性影响，但或一定层面上制约货币政策的大幅

宽松，整体流动性较上半年变差；从宏观经济来看，经济企稳的压力依然较大。积极方面来说，中小盘个股的估值中枢大幅回落，仍有估值合理的成长性个股具备投资价值。预计下半年市场会在维持一个箱体震荡，震荡过程中寻找 Alpha。

我们相对看好传媒、工业 4.0、地产、国企改革等相关标的，并根据市场情况调整策略。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会会计字[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。

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

2015 年上半年度，基金托管人在汇丰晋信动态策略混合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

2015 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信动态策略混合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

2015 年上半年度，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信动态策略混合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：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金  
 报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	855,233.27	501,128.77
结算备付金		126,551,806.41	77,758,653.94
存出保证金		1,216,204.67	605,779.93

交易性金融资产	6.4.7.2	882,238,005.46	1,433,527,477.12
其中：股票投资		882,238,005.46	1,422,372,796.54
基金投资		-	-
债券投资		-	11,154,680.58
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		7,571,953.41	18,712,173.58
应收利息	6.4.7.5	55,109.40	323,866.98
应收股利		-	-
应收申购款		622,233.70	3,224,856.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,019,110,546.32	1,534,653,937.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		46,666,726.45	-
应付赎回款		21,704,557.28	15,605,148.70
应付管理人报酬		1,398,586.49	1,743,230.69
应付托管费		233,097.75	290,538.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,053,077.84	2,943,237.31
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	280,391.54	458,816.42
负债合计		73,336,437.35	21,040,971.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	440,955,587.45	891,673,055.67
未分配利润	6.4.7.10	504,818,521.52	621,939,909.83
所有者权益合计		945,774,108.97	1,513,612,965.50
负债和所有者权益总计		1,019,110,546.32	1,534,653,937.07

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1448 元，基金份额总额 440,955,587.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		304,420,418.41	-17,479,191.71
1.利息收入		1,371,941.58	4,017,930.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,217,035.15	1,318,443.13
债券利息收入		99,543.83	614,326.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		55,362.60	2,085,161.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		702,345,082.44	45,754,790.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	699,027,875.81	39,541,967.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	475,927.64	223,824.80
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	2,841,278.99	5,988,998.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-400,611,861.70	-67,570,665.58
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	1,315,256.09	318,751.95
<b>减：二、费用</b>		18,996,707.47	13,633,874.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,316,286.16	8,516,610.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,552,714.35	1,419,435.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,919,103.88	3,488,218.10
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	208,603.08	209,611.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		285,423,710.94	-31,113,066.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		285,423,710.94	-31,113,066.42

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	891,673,055.67	621,939,909.83	1,513,612,965.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	285,423,710.94	285,423,710.94
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）	-450,717,468.22	-402,545,099.25	-853,262,567.47
其中：1.基金申购款	101,635,891.15	97,287,146.38	198,923,037.53
2.基金赎回款	-552,353,359.37	-499,832,245.63	-1,052,185,605.00
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）	440,955,587.45	504,818,521.52	945,774,108.97
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,224,312,535.72	83,185,858.79	1,307,498,394.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-31,113,066.42	-31,113,066.42
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）	-231,557,001.28	-11,857,399.54	-243,414,400.82
其中：1.基金申购款	7,165,769.56	441,377.33	7,607,146.89
2.基金赎回款	-238,722,770.84	-12,298,776.87	-251,021,547.71

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）	992,755,534.44	40,215,392.83	1,032,970,927.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于同意汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2007] 64 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《汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2007 年 4 月 9 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 5,265,643,757.13 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、《汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为上市交易的股票、债券和国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产 30%-95%;除股票以外的其他资产 5%-70%;其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准是:50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率(全价)。

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》、2007 年度新修改的《汇丰晋信动态策略混合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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

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

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策的变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内,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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税

率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.8.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,316,286.16	8,516,610.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,616,523.17	1,260,907.57

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

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,552,714.35	1,419,435.11

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山西信托股份有限公司	2,013,406.88	0.4600%	2,013,406.88	0.2300%

注：除上表所示外，本基金其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	855,233.27	3,826.19	874,139.24	125,650.93

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2015 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 127,768,011.08 元。（2014 年 6 月 30 日：人民币 41,640,588.34 元）。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

### 6.4.9.2 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
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项	42.89	-	-	153,800	5,964,155.00	6,596,482.00	-
000024	招商地产	2015 年 8 月 3 日	重大事项	36.51	-	-	1,500,000	40,877,901.45	54,765,000.00	-
300028	金亚科技	2015 年 6 月 9 日	重大事项	27.00	-	-	1,594,136	58,526,397.00	43,041,672.00	-
300190	维尔利	2015 年 5 月 25 日	重大事项	31.13	-	-	869,500	21,584,292.12	27,067,535.00	-
600153	建发股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项	16.95	-	-	2,632,552	34,060,702.78	44,621,756.40	-
300197	铁汉生态	2015 年 6 月 16 日	重大事项	27.66	-	-	843,142	19,897,883.91	23,321,307.72	-
601311	骆驼股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	23.31	2015 年 7 月 15 日	25.38	1,193,001	25,034,158.24	27,808,853.31	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

##### (a) 公允价值计量的层次

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

2015 年 6 月 30 日				
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
资产				
交易性金融资产				
股票投资	831,849,162.74	50,388,842.72	-	882,238,005.46
债券投资	-	-	-	-
合计	831,849,162.74	50,388,842.72	-	882,238,005.46

2014 年 12 月 31 日				
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
资产				
交易性金融资产				
股票投资	1,421,922,796.54	450,000.00	-	1,422,372,796.54
债券投资	1,162,680.58	9,992,000.00	-	11,154,680.58
合计	1,423,085,477.12	10,442,000.00	-	1,433,527,477.12

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	882,238,005.46	86.57
	其中: 股票	882,238,005.46	86.57
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	127,407,039.68	12.50
7	其他各项资产	9,465,501.18	0.93
8	合计	1,019,110,546.32	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	47,470,176.00	5.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	336,406,167.65	35.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,432,222.97	5.44
F	批发和零售业	72,469,458.40	7.66
G	交通运输、仓储和邮政业	47,035,419.20	4.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	76,794,996.00	8.12

	业		
J	金融业	94,714,060.70	10.01
K	房地产业	54,765,000.00	5.79
L	租赁和商务服务业	51,484,452.06	5.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	49,666,052.48	5.25
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	882,238,005.46	93.28

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000024	招商地产	1,500,000	54,765,000.00	5.79
2	600172	黄河旋风	2,483,211	51,725,285.13	5.47
3	002400	省广股份	2,038,181	51,484,452.06	5.44
4	000599	青岛双星	3,786,400	49,261,064.00	5.21
5	002038	双鹭药业	842,540	47,729,891.00	5.05
6	600016	民生银行	4,779,542	47,508,647.48	5.02
7	002477	雏鹰农牧	2,472,405	47,470,176.00	5.02
8	601601	中国太保	1,564,129	47,205,413.22	4.99
9	002063	远光软件	1,506,000	47,092,620.00	4.98
10	600115	东方航空	3,817,810	47,035,419.20	4.97

### 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	002400	省广股份	60,962,648.59	4.03
2	002063	远光软件	59,195,639.51	3.91
3	300028	金亚科技	58,526,397.00	3.87
4	002038	双鹭药业	54,982,368.07	3.63
5	600172	黄河旋风	53,844,825.83	3.56
6	600406	国电南瑞	53,655,691.61	3.54
7	601318	中国平安	52,732,839.14	3.48
8	002477	雏鹰农牧	50,141,486.05	3.31
9	600016	民生银行	46,499,168.20	3.07
10	601601	中国太保	45,739,130.04	3.02
11	000599	青岛双星	44,658,707.97	2.95
12	600115	东方航空	43,610,851.51	2.88
13	000488	晨鸣纸业	43,368,333.08	2.87
14	000024	招商地产	40,877,901.45	2.70
15	000712	锦龙股份	38,467,817.36	2.54
16	601021	春秋航空	37,478,368.90	2.48
17	601398	工商银行	36,415,800.00	2.41
18	601628	中国人寿	35,647,114.54	2.36
19	600015	华夏银行	32,778,643.67	2.17
20	600161	天坛生物	32,682,149.69	2.16

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	600048	保利地产	109,290,184.02	7.22
2	600015	华夏银行	102,757,263.01	6.79
3	600036	招商银行	97,200,606.39	6.42
4	600837	海通证券	87,172,453.73	5.76
5	601688	华泰证券	86,401,315.92	5.71
6	600030	中信证券	74,946,924.61	4.95
7	601377	兴业证券	73,645,584.96	4.87
8	601111	中国国航	72,974,114.84	4.82

9	600406	国电南瑞	72,841,240.97	4.81
10	600000	浦发银行	71,858,822.68	4.75
11	601021	春秋航空	65,535,215.84	4.33
12	601166	兴业银行	65,501,944.60	4.33
13	600029	南方航空	62,189,094.14	4.11
14	601668	中国建筑	61,849,468.76	4.09
15	601318	中国平安	61,716,308.42	4.08
16	600511	国药股份	60,559,728.89	4.00
17	000540	中天城投	52,893,922.59	3.49
18	000002	万科A	52,214,873.67	3.45
19	601169	北京银行	52,122,780.43	3.44
20	601788	光大证券	48,420,163.16	3.20
21	600161	天坛生物	47,830,828.01	3.16
22	601009	南京银行	46,270,957.70	3.06
23	600415	小商品城	44,798,970.58	2.96
24	600585	海螺水泥	44,334,015.71	2.93
25	600522	中天科技	43,872,054.51	2.90
26	600999	招商证券	43,421,200.08	2.87
27	600642	申能股份	41,486,571.62	2.74
28	000783	长江证券	40,904,071.56	2.70
29	002044	江苏三友	40,020,093.32	2.64
30	300378	鼎捷软件	38,956,373.00	2.57
31	000712	锦龙股份	38,333,432.20	2.53
32	002055	得润电子	36,455,102.38	2.41
33	601555	东吴证券	36,047,396.33	2.38
34	600352	浙江龙盛	35,364,330.77	2.34
35	002312	三泰控股	32,948,834.60	2.18
36	601099	太平洋	32,413,874.40	2.14
37	601398	工商银行	31,752,000.00	2.10

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	2,043,214,231.18
卖出股票收入（成交）总额	2,882,100,466.95

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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	1,216,204.67
2	应收证券清算款	7,571,953.41
3	应收股利	-
4	应收利息	55,109.40
5	应收申购款	622,233.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,465,501.18

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000024	招商地产	54,765,000.00	5.79	重大事项

### 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

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
16,032	27,504.71	5,236,574.18	1.19%	435,719,013.27	98.81%

### 8.3 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	256,272.75	0.0581%

### 8.4 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2007 年 4 月 9 日 ）基金份额总额	5,265,643,757.13
本报告期期初基金份额总额	891,673,055.67
本报告期基金总申购份额	101,635,891.15
减:本报告期基金总赎回份额	552,353,359.37
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	440,955,587.45

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

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

2015 年 5 月 23 日，基金管理人发布公告，聘任郭敏女士担任本基金基金经理，王春先生不再担任本基金基金经理。

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。  
本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	1,502,542,546.88	30.51%	1,367,913.89	30.51%	-
中信建投	1	1,191,915,761.33	24.20%	1,085,116.61	24.20%	-
申万宏源	1	757,340,967.92	15.38%	689,478.90	15.38%	-
长江证券	1	525,089,137.48	10.66%	478,040.52	10.66%	-
兴业证券	1	371,872,728.24	7.55%	338,553.28	7.55%	-
东方证券	1	317,777,783.87	6.45%	289,305.88	6.45%	-
广发证券	1	199,657,196.21	4.05%	181,768.11	4.05%	-
中金公司	1	59,068,426.20	1.20%	53,775.78	1.20%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
合计	13	4,925,264,548.13	100.00%	4,483,952.97	100.00%	-

1、报告期内未增加交易单元。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,297,152.00	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
合计	1,297,152.00	100.00%	-	-	-	-

**§ 11 影响投资者决策的其他重要信息**

无。



2015 年 8 月 29 日