

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 2015 年 半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	Error! Bookmark not defined.
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41

7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 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	856,236,032.37 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、且在各行各业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票进行投资。</p>
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	汤嵩彦
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		杨小勇	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼； 交通银行股份有限公司：上海市浦东新区银城中路 188 号。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	581,872,792.01

本期利润	549,720,236.38
加权平均基金份额本期利润	0.5168
本期加权平均净值利润率	24.92%
本期基金份额净值增长率	29.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	910,754,491.54
期末可供分配基金份额利润	1.0637
期末基金资产净值	1,994,222,079.67
期末基金份额净值	2.3291
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	146.86%

注： 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；

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)；

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.03%	3.14%	-6.83%	3.15%	6.86%	-0.01%
过去三个月	16.31%	2.41%	9.39%	2.35%	6.92%	0.06%
过去六个月	29.96%	2.15%	23.96%	2.03%	6.00%	0.12%
过去一年	130.19%	1.83%	96.01%	1.65%	34.18%	0.18%
过去三年	128.12%	1.44%	73.76%	1.34%	54.36%	0.10%
自基金合同生效起至今	146.86%	1.38%	40.98%	1.38%	105.88%	0.00%

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

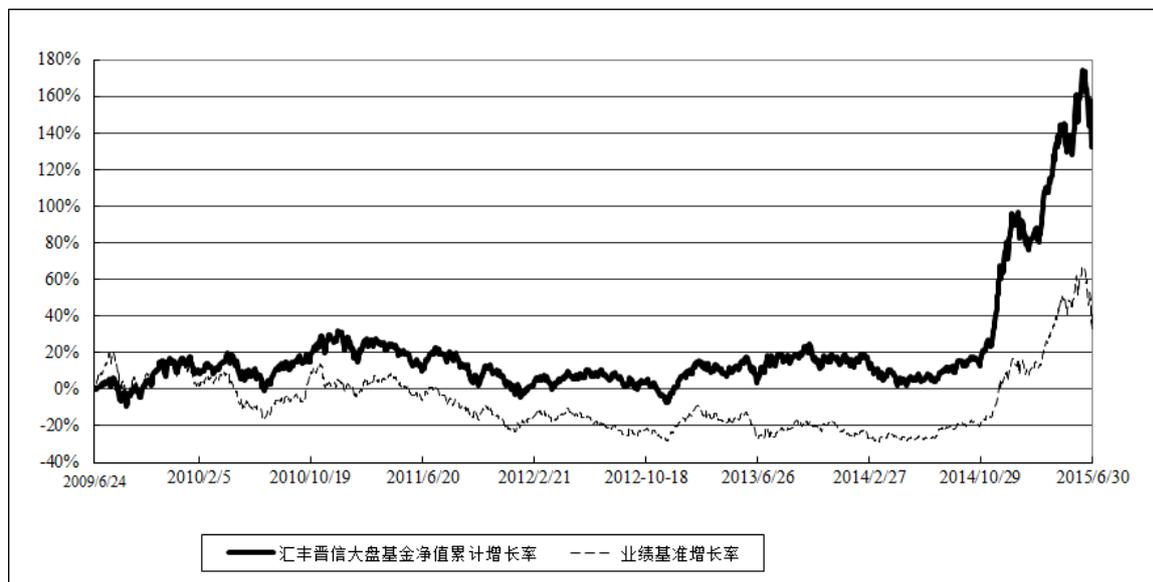
自基金合同生效起至今指 2009 年 6 月 24 日 - 2015 年 6 月 30 日

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

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 6 月 24 日至 2015 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		
王品	投资部副总监、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理	2009年6月24日	2015年5月23日	14	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、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金、汇丰晋信大盘股票型证券投资基

					金基金经理。现任汇丰晋信投资部副总监、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理。
丘栋荣	本基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金基金经理	2014 年 9 月 16 日	-	7	丘栋荣先生，硕士研究生，曾任群益国际控股上海代表处研究员，汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员。现任本基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 王品女士任职日期为本基金基金合同生效日，丘栋荣先生任职日期为本基金管理人公告其担任本基金基金经理的日期；

2. 王品女士离任日期为基金管理人公告其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

2015 年上半年，国内经济增长速度继续放缓，央行持续降息降准，市场整体流动性宽裕。同时，在持续宽松的货币政策及房地产政策持续放松，房地产市场预期企稳，销售明显企稳回升。但总体经济依然疲软，货币政策环境依然持续宽松，财政政策持续发力，市场整体政策环境较好。

在宽松的货币环境下，新增资金持续涌入 A 股市场，同时融资杠杆工具被广泛使用，杠杆资金的流入加速了整体市场估值泡沫化的进程。经过 1—5 月份的持续上涨，A 股市场整体估值水平尤其是中位数估值处于历史高位，大部分中小市值公司，以及成长板块估值泡沫特征比较明显。在 6 月份监管层开始加大对市场杠杆工具，尤其是场外配资工具的限制之后，市场开始出现持续调整，并由于去杠杆效应带来流动性缺失导致系统性大幅下跌。

上半年大盘基金在对市场整体看好的背景下，整体维持相对较高仓位，但基于风险考虑及潜在回报考虑，以及对结构性泡沫问题的担心，大盘基金在市场持续大幅上涨过程中，尤其是二季度中后期，对持仓结构作出较大调整，减持了涨幅过大、估值明显偏高的相关板块和个股，尤其是成长板块，以及受主题投资因素推动股价过多上涨的大盘蓝筹股，包括轻工、建筑、航空、医药等；增持了基本面持续改善、估值依然具有防御性，甚至依然具有吸引力的板块，包括地产、食品饮料、银行等板块的龙头公司。

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 29.96%，同期业绩比较基准为 23.96%，本基金领先业绩比较基准 6.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 6 月份监管层开始加大对市场杠杆工具，尤其是场外配资工具的限制之后，市场开始出现持续调整，并由于去杠杆效应带来流动性缺失导致系统性大幅下跌。在监管层积极救市主导下，市场去杠杆造成流动性缺乏问题获得缓解，融资融券规模已有比较明显下降，剧烈的去杠杆过程可能将高一段落，但上半年尤其是二季度基于快速加杠杆推动的快速上涨的市场基础已不存在，后续市场将可能更多依赖于基本面和业绩的推动。

虽然基本面经过调整后，A 股市场整体估值依然不算很低，但以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股估值已低于历史均值，没有显著的泡沫特征，扣除无风险收益后，目前大盘蓝筹股股价隐含的风险补偿依然较高，甚至依然有不错的分红收益率。同时在本基本上，地产产业链已开始企稳复苏，有望带动经济见底，因此在整体市场企稳的背景下，大盘蓝筹股依然有继续走强的基础和动力。

在大跌之后，大盘基金对后市中期继续谨慎乐观，在投资思路上主要基于两大方面，一方面聚焦于目前基于估值和基本面看潜在回报依然具有较高吸引力低估值大盘蓝筹板块，包括银行、家电、房地产等板块，继续关注这些领域的配置价值，同时关注化工、交运等基本面持续改善，估值依然比较低的板块的投资机会；另一方面，在市场估值大幅回调之后，我们将更加关注成长板块，尤其是传统了领域的细分行业中成长性不错的优质龙头公司的投资机会，在其估值回落到有吸引力的范围之后，我们将借机持续增持，包括电子、计算机、传媒、医药、化工、机械、消费等成长板块中的优质龙头公司。

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

2015 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

2015 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

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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	858,038.54	460,027.56
结算备付金		117,584,570.91	98,564,327.25
存出保证金		1,542,904.90	249,010.04
交易性金融资产	6.4.7.2	1,863,930,647.96	1,425,233,333.59
其中：股票投资		1,863,930,647.96	1,425,233,333.59
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		106,138,059.31	-
应收利息	6.4.7.5	49,771.78	58,865.98
应收股利		-	-
应收申购款		13,570,022.04	18,635,386.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,103,674,015.44	1,543,200,950.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		41,281,418.71	391,622.07
应付赎回款		60,265,090.75	25,340,233.41
应付管理人报酬		2,810,884.36	1,334,904.43
应付托管费		468,480.73	222,484.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,195,456.11	2,094,626.70
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	430,605.11	485,513.43
负债合计		109,451,935.77	29,869,384.11
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	856,236,032.37	844,424,559.34
未分配利润	6.4.7.10	1,137,986,047.30	668,907,007.02
所有者权益合计		1,994,222,079.67	1,513,331,566.36
负债和所有者权益总计		2,103,674,015.44	1,543,200,950.47

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3291 元，基金份额总额 856,236,032.37 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		578,906,397.99	-42,721,102.54
1.利息收入		1,352,293.54	425,371.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,352,293.54	423,334.33
债券利息收入		-	2,037.24
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）		605,253,429.65	-6,128,301.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	581,590,297.21	-8,384,246.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	73,208.03
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	23,663,132.44	2,182,737.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-32,152,555.63	-37,306,332.58
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	4,453,230.43	288,159.49
减：二、费用		29,186,161.61	7,045,255.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,205,932.20	3,434,967.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,700,988.65	572,494.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	10,066,266.23	2,834,764.90
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	212,974.53	203,028.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		549,720,236.38	-49,766,357.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		549,720,236.38	-49,766,357.60

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：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)	844,424,559.34	668,907,007.02	1,513,331,566.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	549,720,236.38	549,720,236.38
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)	11,811,473.03	-80,641,196.10	-68,829,723.07
其中：1.基金申购款	1,705,505,213.17	1,788,206,149.56	3,493,711,362.73
2.基金赎回款	-1,693,693,740.14	-1,868,847,345.66	-3,562,541,085.80
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)	856,236,032.37	1,137,986,047.30	1,994,222,079.67
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	570,002,703.83	67,409,248.00	637,411,951.83

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-49,766,357.60	-49,766,357.60
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)	-200,221,678.70	-13,288,705.21	-213,510,383.91
其中：1.基金申购款	15,727,408.63	1,287,749.82	17,015,158.45
2.基金赎回款	-215,949,087.33	-14,576,455.03	-230,525,542.36
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)	369,781,025.13	4,354,185.19	374,135,210.32

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 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

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报告符合企业会计准则(2006)的要求，真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日

活期存款	858,038.54
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	858,038.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,673,488,931.57	1,863,930,647.96	190,441,716.39
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	1,673,488,931.57	1,863,930,647.96	190,441,716.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产或负债。

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

本基金于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

本基金于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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	105.30
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	49,037.27
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.34
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	624.87
合计	49,771.78

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,195,456.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,195,456.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	227,291.43
预提费用	203,313.68
合计	430,605.11

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

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	844,424,559.34	844,424,559.34
本期申购	1,705,505,213.17	1,705,505,213.17
本期赎回(以“-”号填列)	-1,693,693,740.14	-1,693,693,740.14
- 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	856,236,032.37	856,236,032.37

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	418,165,742.00	250,741,265.02	668,907,007.02
本期利润	581,872,792.01	-32,152,555.63	549,720,236.38
本期基金份额交易产生的变动数	-89,284,042.47	8,642,846.37	-80,641,196.10
其中：基金申购款	1,098,078,660.17	690,127,489.39	1,788,206,149.56
基金赎回款	-1,187,362,702.64	-681,484,643.02	-1,868,847,345.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	910,754,491.54	227,231,555.76	1,137,986,047.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	12,758.55
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	1,331,134.65
其他	8,400.34
合计	1,352,293.54

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	3,338,984,673.12
减：卖出股票成本总额	2,757,394,375.91
买卖股票差价收入	581,590,297.21

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

本报告期内，本基金未投资债券，债券投资收益为零。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内，本基金未投资债券，买卖债券差价收入为零。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内，本基金未投资债券，赎回差价收入为零。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内，本基金未投资债券，申购差价收入为零。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期内，本基金未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期内，本基金未投资贵金属，贵金属投资收益为零。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期内，本基金未投资衍生金融产品，衍生工具收益为零。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期内，本基金未投资衍生金融产品，衍生工具收益为零。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	23,663,132.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,663,132.44

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-32,152,555.63
——股票投资	-32,152,555.63
——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	-32,152,555.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,435,324.37
转出基金补偿收入	1,017,906.06
合计	4,453,230.43

注：本基金赎回费的 25% 归入基金资产；基金之间的转换费由转出基金的赎回费和转换手续费两部分组成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,066,266.23
银行间市场交易费用	-
合计	10,066,266.23

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	148,765.71
银行间债券账户维护费	9,000.00
银行汇款费用	260.85
其他	400.00
合计	212,974.53

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

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期末与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.1.6 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	16,205,932.20	3,434,967.40
其中：支付销售机构的客户维护费	2,695,175.75	728,711.05

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

6.4.10.1.7 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	2,700,988.65	572,494.57

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

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		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	858,038.54	12,758.55	247,260.38	34,547.44

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 119,127,475.81 元。（2014 年 6 月 30 日：人民币 46,940,396.44 元）

6.4.10.5 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

2015 年上半年度，本基金未进行过利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002557	洽洽	2015	重大	16.38	2015	14.74	848,201	12,787,995.89	13,893,532.38	-

	食品	年 6 月 29 日	事项		年 8 月 24 日					
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项	62.50	2015 年 8 月 5 日	69.20	1,144,317	69,970,596.87	71,519,812.50	-
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	23	495.07	536.13	-
601877	正泰电器	2015 年 5 月 18 日	重大事项	30.81	-	-	827,515	19,127,923.99	25,495,737.15	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

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

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除在附注 6.4.12.2 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。

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。

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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	858,038.54	-	-	-	858,038.54
结算备付金	117,584,570.91	-	-	-	117,584,570.91
存出保证金	1,542,904.90	-	-	-	1,542,904.90
交易性金融资产	-	-	-	1,863,930,647.96	1,863,930,647.96
应收证券清算款	-	-	-	106,138,059.31	106,138,059.31
应收利息	-	-	-	49,771.78	49,771.78
应收申购款	132,349.69	-	-	13,437,672.35	13,570,022.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,117,864.04	-	-	1,983,556,151.40	2,103,674,015.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41,281,418.71	41,281,418.71
应付赎回款	-	-	-	60,265,090.75	60,265,090.75
应付管理人报酬	-	-	-	2,810,884.36	2,810,884.36
应付托管费	-	-	-	468,480.73	468,480.73
应付交易费用	-	-	-	4,195,456.11	4,195,456.11
其他负债	-	-	-	430,605.11	430,605.11
负债总计	-	-	-	109,451,935.77	109,451,935.77
利率敏感度缺口	120,117,864.04	-	-	1,874,104,215.63	1,994,222,079.67
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2014 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	460,027.56	-	-	-	460,027.56
结算备付金	98,564,327.25	-	-	-	98,564,327.25
存出保证金	249,010.04	-	-	-	249,010.04
交易性金融资产	-	-	-	1,425,233,333.59	1,425,233,333.59
应收利息	-	-	-	58,865.98	58,865.98
应收申购款	75,332.86	-	-	18,560,053.19	18,635,386.05
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	99,348,697.71	-	-	1,443,852,252.76	1,543,200,950.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	391,622.07	391,622.07
应付赎回款	-	-	-	25,340,233.41	25,340,233.41
应付管理人报酬	-	-	-	1,334,904.43	1,334,904.43
应付托管费	-	-	-	222,484.07	222,484.07
应付交易费用	-	-	-	2,094,626.70	2,094,626.70
其他负债	-	-	-	485,513.43	485,513.43
负债总计	-	-	-	29,869,384.11	29,869,384.11
利率敏感度缺口	99,348,697.71	-	-	1,413,982,868.65	1,513,331,566.36

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	无影响	无影响
市场利率下降 25 个基点	无影响	无影响	

注：本基金于本期末与上年末均未持有债券，无重大利率风险，因而市场利率的变动对本期末和上年末基金资产净值均无影响。

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，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 93.47%，债券投资比例为基金资产净值的 0%，无衍生金融资产。于 2015 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	1,863,930,647.96	93.47	1,425,233,333.59	94.18
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	1,863,930,647.96	93.47	1,425,233,333.59	94.18

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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	101,200,833.95	82,649,724.94
业绩比较基准下降 5%	-101,200,833.95	-82,649,724.94	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 2015 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：

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	1,753,021,029.80	110,909,618.16	-	1,863,930,647.96
债券投资	-	-	-	-
合计	1,753,021,029.80	110,909,618.16	-	1,863,930,647.96

2014 年 12 月 31 日				
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
资产				
交易性金融资产				
股票投资	1,400,275,504.62	24,957,828.97	-	1,425,233,333.59
债券投资	-	-	-	-
合计	1,400,275,504.62	24,957,828.97	-	1,425,233,333.59

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	1,863,930,647.96	88.60
	其中：股票	1,863,930,647.96	88.60
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	118,442,609.45	5.63
7	其他各项资产	121,300,758.03	5.77
8	合计	2,103,674,015.44	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	107,929,017.50	5.41
C	制造业	716,647,110.02	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,709,537.46	5.25
G	交通运输、仓储和邮政业	46,421,161.78	2.33
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	765,643,818.08	38.39
K	房地产业	112,742,449.12	5.65
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	-	-
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	9,837,554.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	1,863,930,647.96	93.47

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	600036	招商银行	8,448,355	158,153,205.60	7.93
2	600000	浦发银行	7,272,224	123,336,919.04	6.18
3	601169	北京银行	9,042,453	120,445,473.96	6.04
4	000651	格力电器	1,884,232	120,402,424.80	6.04
5	601318	中国平安	1,390,011	113,897,501.34	5.71
6	600015	华夏银行	7,438,905	113,145,745.05	5.67
7	000963	华东医药	1,144,317	71,519,812.50	3.59
8	000002	万科A	4,777,621	69,371,056.92	3.48
9	600887	伊利股份	3,332,506	62,984,363.40	3.16
10	600028	中国石化	8,352,988	58,972,095.28	2.96
11	600585	海螺水泥	2,367,899	50,791,433.55	2.55
12	601166	兴业银行	2,801,202	48,320,734.50	2.42
13	601818	光大银行	8,863,818	47,510,064.48	2.38
14	000333	美的集团	1,240,915	46,261,311.20	2.32
15	002376	新北洋	2,260,100	40,455,790.00	2.03
16	600741	华域汽车	1,746,460	37,286,921.00	1.87
17	601998	中信银行	4,331,241	33,393,868.11	1.67
18	600697	欧亚集团	977,402	30,279,913.96	1.52

19	601006	大秦铁路	2,147,700	30,153,708.00	1.51
20	002152	广电运通	910,678	29,451,326.52	1.48
21	000858	五粮液	919,683	29,153,951.10	1.46
22	600252	中恒集团	1,179,115	27,119,645.00	1.36
23	601877	正泰电器	827,515	25,495,737.15	1.28
24	000999	华润三九	831,806	25,278,584.34	1.27
25	600104	上汽集团	1,028,697	23,248,552.20	1.17
26	600019	宝钢股份	2,575,461	22,509,529.14	1.13
27	601088	中国神华	1,043,300	21,752,805.00	1.09
28	600048	保利地产	1,766,500	20,173,430.00	1.01
29	600089	特变电工	1,250,272	18,516,528.32	0.93
30	000568	泸州老窖	554,250	18,074,092.50	0.91
31	600761	安徽合力	992,705	16,607,954.65	0.83
32	002038	双鹭药业	287,447	16,283,872.55	0.82
33	600029	南方航空	1,118,807	16,267,453.78	0.82
34	000521	美菱电器	1,707,660	15,403,093.20	0.77
35	002557	洽洽食品	848,201	13,893,532.38	0.70
36	601699	潞安环能	1,423,300	13,763,311.00	0.69
37	000937	冀中能源	1,675,911	13,440,806.22	0.67
38	600426	华鲁恒升	682,956	12,675,663.36	0.64
39	000042	中洲控股	518,920	12,666,837.20	0.64
40	600383	金地集团	832,500	10,531,125.00	0.53
41	000789	万年青	984,887	10,193,580.45	0.51
42	600172	黄河旋风	474,900	9,892,167.00	0.50
43	600801	华新水泥	934,400	9,876,608.00	0.50
44	601098	中南传媒	429,400	9,837,554.00	0.49
45	002372	伟星新材	476,585	8,468,915.45	0.42
46	002202	金风科技	405,700	7,898,979.00	0.40
47	000001	平安银行	511,680	7,439,827.20	0.37
48	600362	江西铜业	320,500	6,893,955.00	0.35
49	000729	燕京啤酒	613,000	6,375,200.00	0.32
50	000726	鲁泰A	370,600	5,151,340.00	0.26
51	000501	鄂武商A	141,942	2,909,811.00	0.15
52	002531	天顺风能	77	1,123.43	0.00
53	601311	骆驼股份	23	536.13	0.00
54	601009	南京银行	21	478.80	0.00
55	601233	桐昆股份	20	399.20	0.00

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	600015	华夏银行	226,644,788.73	14.98
2	601169	北京银行	189,005,615.78	12.49
3	600036	招商银行	134,506,736.73	8.89
4	000651	格力电器	119,204,521.98	7.88
5	600029	南方航空	115,166,705.43	7.61
6	601318	中国平安	112,708,064.40	7.45
7	600000	浦发银行	110,449,790.01	7.30
8	601398	工商银行	105,299,347.25	6.96
9	601818	光大银行	81,006,809.00	5.35
10	000568	泸州老窖	80,788,194.04	5.34
11	601166	兴业银行	77,053,054.35	5.09
12	000002	万科A	73,956,518.47	4.89
13	600887	伊利股份	71,475,801.49	4.72
14	600252	中恒集团	67,502,737.80	4.46
15	000333	美的集团	66,988,604.04	4.43
16	600028	中国石化	66,401,973.45	4.39
17	000963	华东医药	64,348,190.26	4.25
18	000858	五粮液	57,161,231.03	3.78
19	600104	上汽集团	52,677,463.90	3.48
20	600060	海信电器	48,510,344.84	3.21
21	601607	上海医药	45,279,087.01	2.99
22	600837	海通证券	44,211,967.70	2.92
23	600369	西南证券	43,095,572.09	2.85
24	002531	天顺风能	42,017,394.73	2.78
25	601601	中国太保	39,272,743.60	2.60
26	002376	新北洋	38,905,481.88	2.57
27	601311	骆驼股份	37,887,712.40	2.50
28	601233	桐昆股份	36,039,618.92	2.38
29	601555	东吴证券	36,012,629.38	2.38
30	002701	奥瑞金	34,380,025.57	2.27
31	601998	中信银行	32,747,782.04	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	600029	南方航空	216,255,741.40	14.29
2	601398	工商银行	202,010,345.51	13.35
3	600015	华夏银行	182,764,375.63	12.08
4	000651	格力电器	168,663,682.96	11.15
5	601166	兴业银行	112,382,673.01	7.43
6	601318	中国平安	98,301,333.13	6.50
7	601169	北京银行	97,908,804.20	6.47
8	600104	上汽集团	89,720,020.62	5.93
9	600036	招商银行	87,693,700.53	5.79
10	601233	桐昆股份	83,577,353.90	5.52
11	601607	上海医药	82,264,069.83	5.44
12	601668	中国建筑	80,990,887.27	5.35
13	600000	浦发银行	80,080,773.06	5.29
14	601818	光大银行	74,340,390.77	4.91
15	002531	天顺风能	68,069,164.19	4.50
16	000568	泸州老窖	66,188,408.27	4.37
17	600660	福耀玻璃	61,473,292.77	4.06
18	600060	海信电器	57,948,943.19	3.83
19	600352	浙江龙盛	57,810,501.84	3.82
20	601111	中国国航	56,573,791.56	3.74
21	002701	奥瑞金	52,160,446.72	3.45
22	600369	西南证券	51,939,334.59	3.43
23	600837	海通证券	50,471,882.00	3.34
24	601555	东吴证券	45,783,071.84	3.03
25	601311	骆驼股份	43,940,254.13	2.90
26	600016	民生银行	43,671,038.28	2.89
27	600887	伊利股份	40,459,993.07	2.67
28	600252	中恒集团	40,132,997.49	2.65
29	000333	美的集团	39,838,643.46	2.63
30	601601	中国太保	39,284,174.21	2.60
31	601566	九牧王	37,064,032.66	2.45

32	000858	五 粮 液	35,297,617.73	2.33
33	601628	中国人寿	34,430,606.88	2.28
34	600742	一汽富维	33,537,165.63	2.22
35	600011	华能国际	33,456,912.31	2.21
36	000002	万 科 A	32,057,960.76	2.12
37	601009	南京银行	30,426,231.98	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,228,244,245.91
卖出股票收入（成交）总额	3,338,984,673.12

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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	1,542,904.90
2	应收证券清算款	106,138,059.31
3	应收股利	-
4	应收利息	49,771.78
5	应收申购款	13,570,022.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,300,758.03

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	000963	华东医药	71,519,812.50	3.59	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
13,500	63,424.89	438,346,623.89	51.19%	417,889,408.48	48.81%

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	474,924.08	0.0555%

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0-10
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 (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	844,424,559.34
本报告期基金总申购份额	1,705,505,213.17
减:本报告期基金总赎回份额	1,693,693,740.14
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	856,236,032.37

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,王品女士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	
申万宏源	1	1,608,940,199.14	24.50%	1,464,775.16	24.50%	-
银河证券	1	1,363,116,341.13	20.76%	1,240,981.79	20.76%	-
兴业证券	2	1,038,616,095.75	15.82%	945,553.78	15.82%	-
光大证券	1	924,603,224.24	14.08%	841,761.53	14.08%	-
安信证券	2	474,079,275.55	7.22%	431,602.07	7.22%	-
中信建投	1	416,188,251.62	6.34%	378,897.53	6.34%	-
招商证券	2	289,667,905.81	4.41%	263,713.40	4.41%	-
东兴证券	1	216,145,766.81	3.29%	196,779.85	3.29%	-
川财证券	1	131,695,210.16	2.01%	119,895.57	2.01%	-
华创证券	1	104,176,648.82	1.59%	94,842.52	1.59%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
合计	27	6,567,228,919.03	100.00%	5,978,803.20	100.00%	-

注：1、本报告期内本基金新增深圳交易单元中信建投、东兴证券、川财证券、平安证券

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		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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

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	2015 年 1 月 5 日
2	基金 2014 年 4 季度报告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 1 月 22 日
3	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过北京展恒基金销售有限公司开展定期定额费率优惠活动的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 1 月 23 日
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于投资者通过直销柜台认购、申购旗下基金实行费率优惠的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 1 月 30 日
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金开展直销柜台基金转换费率优惠的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 1 月 30 日
6	汇丰晋信关于在华泰证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 2 月 3 日
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于在中信证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务	本基金选定的信息 披露报纸、管理人	2015 年 2 月 5 日

	的公告	网站	
8	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 7 日
9	汇丰晋信关于在国金证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 9 日
10	汇丰晋信关于在中信证券（浙江）开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 9 日
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整基金最低转换转出份额的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
12	汇丰晋信关于在中信证券（山东）开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
13	汇丰晋信关于旗下基金通过数米基金开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
14	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金通过招商证券开展网上交易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	2015 年 3 月 13 日
15	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 3 月 31 日
16	汇丰晋信关于旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 31 日
17	基金 2014 年年度报告	本基金选定的信息	2015 年 3 月

		披露报纸、管理人 网站	31 日
18	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	2015 年 4 月 1 日
19	汇丰晋信基金管理有限公司关于取消纸质 对账单寄送的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 4 月 1 日
20	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整开放 式基金业务规则的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 4 月 1 日
21	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采 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	2015 年 4 月 9 日
22	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金 更换会计师事务所的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 4 月 18 日
23	汇丰晋信基金管理有限公司关于汇丰晋信 大盘股票型证券投资基金通过浙江同花顺 基金销售有限公司开展网上交易费率优惠 活动的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 4 月 20 日
24	基金 2015 年 1 季度报告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 4 月 21 日
25	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继 续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	2015 年 4 月 24 日
26	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采 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	2015 年 5 月 8 日

		网站	
27	汇丰晋信关于旗下开放式基金通过诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司开展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	2015 年 5 月 11 日
28	汇丰晋信关于暂停旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 11 日
29	汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理变更公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 23 日
30	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 5 月 27 日
31	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 5 月 29 日
32	汇丰晋信关于通过农业银行网上银行、手机银行开展基金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	2015 年 5 月 30 日
33	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 6 月 9 日
34	汇丰晋信关于在工商银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 6 月 9 日
35	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 6 月 17 日
36	关于防范不法人员发布虚假客服电话进行	本基金选定的信息	2015 年 6 月

	诈骗的重要提示	披露报纸、管理人 网站	19 日
37	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 6 月 20 日
38	汇丰晋信关于在中金公司开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 6 月 26 日
39	汇丰晋信关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金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	2015 年 6 月 29 日
40	汇丰晋信关于新增东兴证券为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息 披露报纸、管理人 网站	2015 年 6 月 29 日
41	关于汇丰晋信旗下基金持有的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	2015 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日