

---

# 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 26 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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.....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
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.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信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	
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	980,981,269.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇丰晋信大盘股票 A	汇丰晋信大盘股票 H
下属分级基金的交易代码:	540006	960000
报告期末下属分级基金的份额总额	959,316,820.11 份	21,664,448.91 份

注：本基金自 2015 年 12 月 30 日起增加 H 类份额

### 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

基金级别	汇丰晋信大盘股票 A	汇丰晋信大盘股票 H
------	------------	------------

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-9,484,753.21	-66,584.92
本期利润	-122,580,816.52	506,010.97
加权平均基金份额本期利润	-0.1308	0.0254
本期加权平均净值利润率	-6.17%	2.93%
本期基金份额净值增长率	-8.82%	-8.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	1,119,200,894.64	10,300,045.86
期末可供分配基金份额利润	1.1667	0.4754
期末基金资产净值	2,118,994,108.39	19,520,038.55
期末基金份额净值	2.2089	0.9010
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	134.12%	-9.90%

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

扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

④本基金自 2015 年 12 月 30 日起增加 H 类份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇丰晋信大盘股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.94%	0.95%	-0.44%	0.88%	2.38%	0.07%
过去三个月	1.38%	1.10%	-1.78%	0.91%	3.16%	0.19%
过去六个月	-8.82%	1.90%	-13.88%	1.66%	5.06%	0.24%
过去一年	-5.16%	2.31%	-26.47%	2.07%	21.31%	0.24%
过去三年	117.90%	1.86%	39.21%	1.65%	78.69%	0.21%
自基金合同生效起至今	134.12%	1.55%	2.56%	1.50%	131.56%	0.05%

注：

过去一个月指 2016 年 6 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去三个月指 2016 年 4 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去六个月指 2016 年 1 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去一年指 2015 年 7 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去三年指 2013 年 7 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

自基金合同生效至今指 2009 年 6 月 24 日—2016 年 6 月 30 日

汇丰晋信大盘股票 H

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	1.88%	0.95%	-0.44%	0.88%	2.32%	0.07%
过去三个月	1.25%	1.10%	-1.78%	0.91%	3.03%	0.19%
过去六个月	-8.93%	1.90%	-13.88%	1.66%	4.95%	0.24%
自基金合同生效起至今	-9.90%	1.88%	-14.51%	1.65%	4.61%	0.23%

注：

过去一个月指 2016 年 6 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去三个月指 2016 年 4 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

过去六个月指 2016 年 1 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

自基金合同生效至今指 2015 年 12 月 30 日—2016 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

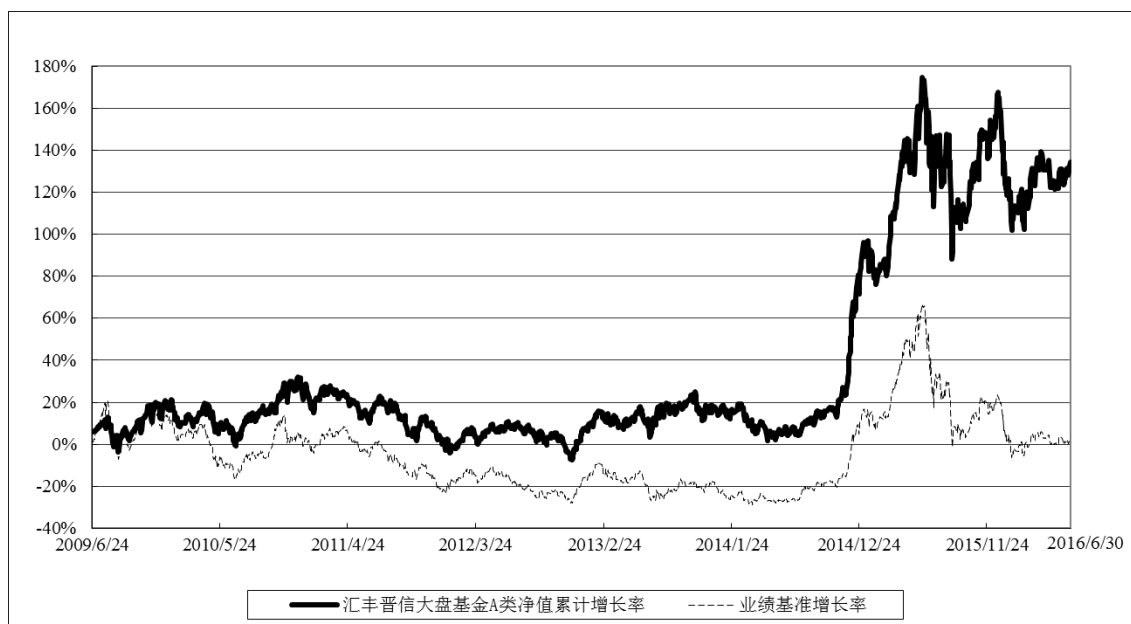
汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

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

#### 1. 汇丰晋信大盘股票 A

(2009 年 6 月 24 日至 2016 年 6 月 30 日)





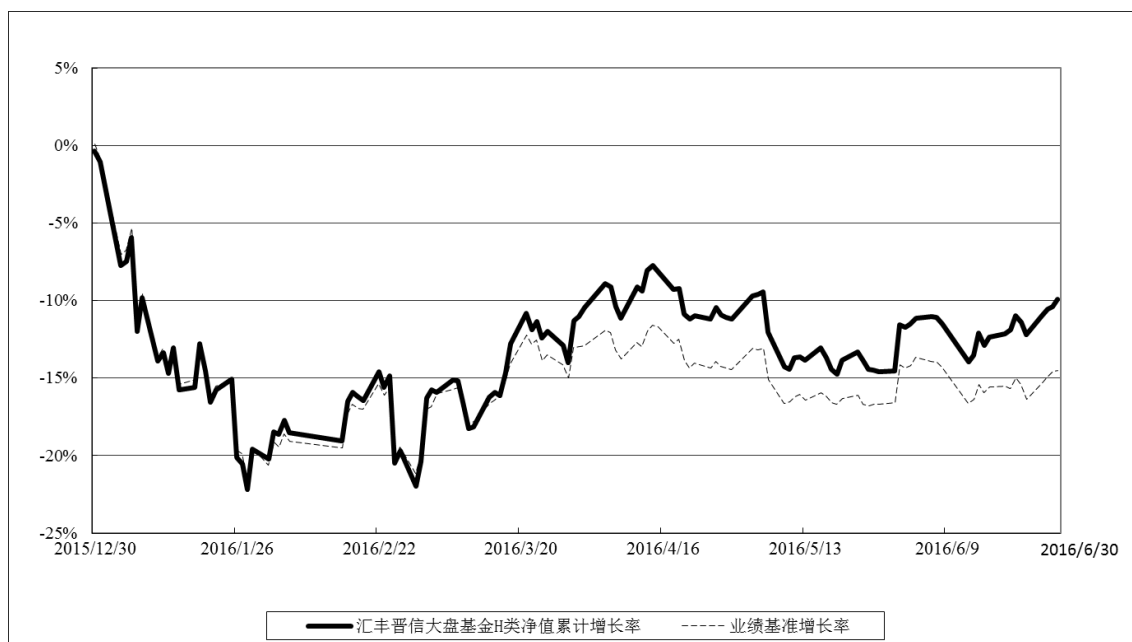
注：1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，其中，本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内 A 股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过 6 个月内完成建仓，截止 2009 年 12 月 24 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

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。

## 2. 汇丰晋信大盘股票 H

(2015 年 12 月 30 日至 2016 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%。

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. 本基金自 2015 年 12 月 30 日起增加 H 类份额。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 16 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型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）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015 年 9 月 30 日成立）和汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016 年 3 月 11 日成立）。

#### 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		
丘栋荣	股票投资部总监、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	-	8	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。现任股票投资部总监、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. 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. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

基金管理有限公司公平交易制度》。

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

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或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

从基本面上看，虽然 2016 年上半年中国整体经济依然相对缓慢，但在地产产业链投资回升、基础设施投资维持高水平、供给侧改革等共同推动下，需求增长有所恢复，商品价格反弹明显，上游行业盈利预期明显改善，推动全市场盈利增长弱复苏。估值方面，在一季度市场大幅下跌之后，市场风险释放充分，整体估值具有吸引力，我们对市场保持相对乐观的看法，尤其是大盘蓝筹股估值吸引力更加突出。大盘基金在总体上维持高股票仓位配置的同时，积极调整股票持仓结构，降低估值已显著回升或基本面不及预期的行业和个股的配置，持续买入基本面不错、季度业绩超预期、估值低、股价依然合理的品种，包括部分优质的成长板块龙头以及基本面有望持续改善的强周期板块低估值龙头，包括石油石化、化工、建材、汽车、TMT 等行业的龙头公司。

但在二季度持续反弹，尤其是主题性及结构性行情持续发酵过程中，市场结构性风险也开始

累积，我们密切关注市场结构性风险的变化，积极调整大盘基金持仓结构，减持部分涨幅较大、估值较高、或者未来业绩存在风险的标的，包括部分成长板块的公司及中小市值公司，使整体组合始终处于具有相对吸引力的状态。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类净值变化幅度为-8.82%，同期业绩比较基准增长率为-13.88%，本基金 A 类领先同期比较基准为 5.06%；本基金 H 类本报告期内净值变化幅度为-8.93%，同期业绩比较基准增长率为-13.88%，本基金 H 类领先同期比较基准为 4.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在新常态下，中国整体经济短期内依然处于低速发展阶段，但在地产产业链投资回升、基础设施投资维持高水平、供给侧改革等共同推动下，需求增长有所恢复，商品价格反弹明显，上游行业盈利预期明显改善，推动全市场盈利增长弱复苏。A 股市场在年初大幅调整，充分释放基本面和估值风险之后，二季度有比较明显的反弹，结构性机会及个股表现更为突出，市场整体估值水平有所修复，市场依然存在一定的结构性估值风险，但以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股总体估值依然不高，依然低于历史均值水平，在目前低利率背景下，依然具有相对吸引力。汇丰晋信大盘基金将继续基于“盈利-估值”策略，选择低估值高盈利的板块和公司，构建风险收益比有吸引力的投资组合，以获得经风险调整后的持续超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重

大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下展开工作，其中：

#### 一、基金运营部

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

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

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

#### 二、基金投资部

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

#### 三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

#### 四、风险控制部

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

#### 五、督察长

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

1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、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

2016 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

2016 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，符合基金合同的规定。

### 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

2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	57,064.43	548,756.14
结算备付金		121,107,326.37	266,642,348.76
存出保证金		634,551.77	1,316,302.58
交易性金融资产	6.4.7.2	1,928,193,130.51	1,714,360,202.53
其中: 股票投资		1,928,193,130.51	1,714,360,202.53
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	60,678.57	76,023.74
应收股利		-	-
应收申购款		110,385,036.22	10,651,343.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,160,437,787.87	1,993,594,976.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		11,888,097.98	123,628,264.92
应付赎回款		5,809,336.19	6,141,027.10
应付管理人报酬		2,415,328.35	1,991,833.76
应付托管费		402,554.76	331,972.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,181,787.61	1,236,744.77
应交税费		752.95	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	225,783.09	433,149.24
负债合计		21,923,640.93	133,762,992.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	968,164,308.02	767,687,063.36
未分配利润	6.4.7.10	1,170,349,838.92	1,092,144,921.32
所有者权益合计		2,138,514,146.94	1,859,831,984.68



负债和所有者权益总计		2, 160, 437, 787. 87	1, 993, 594, 976. 76
------------	--	----------------------	----------------------

注: 报告截止日 2016 年 6 月 30 日, 基金 A 类份额净值 2. 2089 元, 基金 A 类份额 959, 316, 820. 11 份; 基金 H 类份额净值 0. 9010, 基金 H 类份额 21, 664, 448. 91 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: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-99, 587, 323. 41	578, 906, 397. 99
1. 利息收入		1, 039, 651. 80	1, 352, 293. 54
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	1, 039, 651. 80	1, 352, 293. 54
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)		10, 978, 987. 01	605, 253, 429. 65
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-12, 496, 776. 07	581, 590, 297. 21
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	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, 475, 763. 08	23, 663, 132. 44
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-112, 523, 467. 42	-32, 152, 555. 63
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	917, 505. 20	4, 453, 230. 43
<b>减: 二、费用</b>		22, 487, 482. 14	29, 186, 161. 61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14, 938, 826. 27	16, 205, 932. 20
2. 托管费	6.4.10.2.2	2, 489, 804. 40	2, 700, 988. 65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4, 845, 308. 25	10, 066, 266. 23
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	213, 543. 22	212, 974. 53
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-122, 074, 805. 55	549, 720, 236. 38
减: 所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-122,074,805.55	549,720,236.38
-------------------	--	-----------------	----------------

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	767,687,063.36	1,092,144,921.32	1,859,831,984.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-122,074,805.55	-122,074,805.55
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）	200,477,244.66	200,279,723.15	400,756,967.81
其中：1.基金申购款	545,981,411.41	588,651,402.38	1,134,632,813.79
2.基金赎回款	-345,504,166.75	-388,371,679.23	-733,875,845.98
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）	968,164,308.02	1,170,349,838.92	2,138,514,146.94
项目	上年度可比期间 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	11,811,473.03	-80,641,196.10	-68,829,723.07



金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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：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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本报告期内，本基金无重大会计差错发生。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	57,064.43
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	57,064.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,945,221,933.28	1,928,193,130.51	-17,028,802.77
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	1,945,221,933.28	1,928,193,130.51	-17,028,802.77

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,107.82
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	54,313.47
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.24
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	257.04
合计	60,678.57

#### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,181,787.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,181,787.61

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21,904.87
预提费用	203,878.22
合计	225,783.09

注：此处应付赎回费含应付转出费。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇丰晋信大盘股票 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	767,465,128.87	767,465,128.87
本期申购	536,054,588.31	536,054,588.31
本期赎回(以“-”号填列)	-344,202,897.07	-344,202,897.07
- 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	959,316,820.11	959,316,820.11

注：A 类基金份额申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

金额单位：人民币元

汇丰晋信大盘股票 H		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	543,441.23	221,934.49
本期申购	24,307,370.37	9,926,823.10
本期赎回(以“-”号填列)	-3,186,362.69	-1,301,269.68
- 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	21,664,448.91	8,847,487.91

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇丰晋信大盘股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	901,557,920.18	190,271,273.19	1,091,829,193.37
本期利润	-9,484,753.21	-113,096,063.31	-122,580,816.52
本期基金份额交易产生的变动数	227,127,727.67	-36,698,816.24	190,428,911.43
其中：基金申购款	623,485,178.73	-46,166,246.20	577,318,932.53
基金赎回款	-396,357,451.06	9,467,429.96	-386,890,021.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,119,200,894.64	40,476,393.64	1,159,677,288.28

单位：人民币元

汇丰晋信大盘股票 H			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	260,705.91	55,022.04	315,727.95
本期利润	-66,584.92	572,595.89	506,010.97
本期基金份额交易产生的变动数	10,105,924.87	-255,113.15	9,850,811.72
其中：基金申购款	11,601,742.35	-269,272.50	11,332,469.85
基金赎回款	-1,495,817.48	14,159.35	-1,481,658.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,300,045.86	372,504.78	10,672,550.64



### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,563.03
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	1,024,571.19
其他	6,517.58
合计	1,039,651.80

### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,480,811,950.35
减：卖出股票成本总额	1,493,308,726.42
买卖股票差价收入	-12,496,776.07

### 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

本基金本报告期内无相关债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无相关债券投资收益。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无相关债券投资收益。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无相关债券投资收益。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,475,763.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,475,763.08

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-112,523,467.42
——股票投资	-112,523,467.42
——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	-112,523,467.42

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	726,754.38
转出基金补偿收入	190,750.82
合计	917,505.20

注：1. A 类基金份额的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。A 类基金份额的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

2. H 类基金份额的赎回费率为 0.13%，赎回费总额 100% 归入基金资产。H 类基金份额暂未开通转换业务。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,845,308.25
银行间市场交易费用	-
合计	4,845,308.25

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	54,700.10
信息披露费	149,178.12
银行间债券账户维护费	9,000.00
银行汇款费用	465.00
其他	200.00
合计	213,543.22

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,938,826.27	16,205,932.20
其中：支付销售机构的客户维护费	1,963,914.42	2,695,175.75

注：支付基金管理人汇丰晋信的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。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,489,804.40	2,700,988.65

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

#### 6.4.10.3 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无通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015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	57,064.43	8,563.03	858,038.54	12,758.55

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

2016 年上半年度，本基金未进行过利润分配。

## 6.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 28 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 27 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 7 月 4 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 7 月 1 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

## 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	22.07	-	-	3,153,670	66,195,933.11	69,601,496.90	-
000002	万科 A	2015 年 12 月 21 日	重大事项	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	994,814	15,050,885.79	18,105,614.80	-
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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。

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

本报告期末，本基金未持有债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感



性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	57,064.43	-	-	-	57,064.43
结算备付金	121,107,326.37	-	-	-	121,107,326.37
存出保证金	634,551.77	-	-	-	634,551.77
交易性金融资产	-	-	-	1,928,193,130.51	1,928,193,130.51
应收利息	-	-	-	60,678.57	60,678.57
应收申购款	-	-	-	110,385,036.22	110,385,036.22
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	121,798,942.57	-	-	2,038,638,845.30	2,160,437,787.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,888,097.98	11,888,097.98
应付赎回款	-	-	-	5,809,336.19	5,809,336.19
应付管理人报酬	-	-	-	2,415,328.35	2,415,328.35
应付托管费	-	-	-	402,554.76	402,554.76
应付交易费用	-	-	-	1,181,787.61	1,181,787.61
应交税费	-	-	-	752.95	752.95
其他负债	-	-	-	225,783.09	225,783.09
负债总计	-	-	-	21,923,640.93	21,923,640.93
利率敏感度缺口	121,798,942.57	-	-	2,016,715,204.37	2,138,514,146.94
上年度末 2015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	548,756.14	-	-	-	548,756.14
结算备付金	266,642,348.76	-	-	-	266,642,348.76

存出保证金	1,316,302.58	-	-	-	1,316,302.58
交易性金融资产	-	-	-	1,714,360,202.53	1,714,360,202.53
应收利息	-	-	-	76,023.74	76,023.74
应收申购款	1,988.07	-	-	10,649,354.94	10,651,343.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	268,509,395.55	-	-	1,725,085,581.21	1,993,594,976.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	123,628,264.92	123,628,264.92
应付赎回款	-	-	-	6,141,027.10	6,141,027.10
应付管理人报酬	-	-	-	1,991,833.76	1,991,833.76
应付托管费	-	-	-	331,972.29	331,972.29
应付交易费用	-	-	-	1,236,744.77	1,236,744.77
其他负债	-	-	-	433,149.24	433,149.24
负债总计	-	-	-	133,762,992.08	133,762,992.08
利率敏感度缺口	268,509,395.55	-	-	1,591,324,577.20	1,859,831,984.68

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例为基金资产的 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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及

时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,928,193,130.51	90.17	1,714,360,202.53	92.18
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	1,928,193,130.51	90.17	1,714,360,202.53	92.18

#### 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(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(2016年6月30日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	120,393,112.01	97,797,771.63
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-120,393,112.01	-97,797,771.63	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,839,483,079.27 元，属于第二层次的余额为 88,710,051.24 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 1,673,520,783.73 元，属于第二层次的余额为 40,839,418.80 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,928,193,130.51	89.25
	其中：股票	1,928,193,130.51	89.25
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	121,164,390.80	5.61
7	其他各项资产	111,080,266.56	5.14
8	合计	2,160,437,787.87	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	220,153,076.36	10.29
C	制造业	826,300,680.38	38.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,711,223.06	2.37
E	建筑业	55,274,333.60	2.58
F	批发和零售业	171,982,112.17	8.04
G	交通运输、仓储和邮政业	23,189,146.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.00
J	金融业	306,360,811.89	14.33
K	房地产业	144,790,908.51	6.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	129,340,220.04	6.05
S	综合	-	-
	合计	1,928,193,130.51	90.17

## 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	000786	北新建材	22,615,226	205,346,252.08	9.60

2	600028	中国石化	42,290,738	199,612,283.36	9.33
3	601098	中南传媒	6,741,564	122,089,724.04	5.71
4	600335	国机汽车	9,441,582	105,840,134.22	4.95
5	000999	华润三九	3,930,381	95,193,827.82	4.45
6	600048	保利地产	10,102,917	87,188,173.71	4.08
7	000903	云内动力	10,143,338	81,451,004.14	3.81
8	601318	中国平安	2,302,893	73,784,691.72	3.45
9	601688	华泰证券	3,874,819	73,311,575.48	3.43
10	000651	格力电器	3,153,670	69,601,496.90	3.25
11	601339	百隆东方	10,750,057	68,262,861.95	3.19
12	601555	东吴证券	4,269,735	57,214,449.00	2.68
13	000876	新希望	5,691,678	47,354,760.96	2.21
14	002585	双星新材	4,136,955	43,934,462.10	2.05
15	601607	上海医药	2,196,523	39,647,240.15	1.85
16	601668	中国建筑	7,340,201	39,049,869.32	1.83
17	000625	长安汽车	2,766,124	37,812,915.08	1.77
18	000581	威孚高科	1,343,920	27,093,427.20	1.27
19	601818	光大银行	7,093,563	26,671,796.88	1.25
20	000963	华东医药	393,097	26,494,737.80	1.24
21	600266	北京城建	2,057,600	25,699,424.00	1.20
22	000001	平安银行	2,950,391	25,668,401.70	1.20
23	600674	川投能源	3,064,377	25,311,754.02	1.18
24	002422	科伦药业	1,623,704	25,021,278.64	1.17
25	600782	新钢股份	4,421,467	23,566,419.11	1.10
26	000598	兴蓉环境	4,431,543	23,398,547.04	1.09
27	600104	上汽集团	1,087,379	22,062,919.91	1.03
28	601088	中国神华	1,459,900	20,540,793.00	0.96
29	600089	特变电工	2,316,072	19,732,933.44	0.92
30	600196	复星医药	1,017,054	19,344,367.08	0.90
31	000002	万科A	994,814	18,105,614.80	0.85
32	601009	南京银行	1,835,483	17,235,185.37	0.81
33	600837	海通证券	1,015,047	15,652,024.74	0.73
34	600068	XD 葛洲坝	2,654,500	15,449,190.00	0.72
35	600376	首开股份	1,240,800	13,797,696.00	0.65
36	601111	XD 中国国	2,035,303	13,758,648.28	0.64
37	000333	美的集团	539,797	12,803,984.84	0.60
38	600585	海螺水泥	813,611	11,829,903.94	0.55
39	601788	光大证券	594,200	10,065,748.00	0.47
40	601006	大秦铁路	1,464,363	9,430,497.72	0.44

41	600887	伊利股份	506,639	8,445,672.13	0.39
42	000719	大地传媒	686,600	7,250,496.00	0.34
43	002202	金风科技	448,922	6,792,189.86	0.32
44	601998	中信银行	1,191,700	6,756,939.00	0.32
45	600969	郴电国际	134,200	2,000,922.00	0.09
46	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
47	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
48	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
49	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
50	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
51	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
52	000568	泸州老窖	1,884	55,954.80	0.00
53	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
54	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
55	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
56	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
57	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
58	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	000786	北新建材	215,268,607.44	11.57
2	600028	中国石化	127,080,698.06	6.83
3	600335	国机汽车	114,161,272.53	6.14
4	601339	百隆东方	91,703,429.53	4.93
5	000903	云内动力	88,611,374.48	4.76
6	601555	东吴证券	84,301,530.17	4.53
7	601111	中国国航	77,634,547.21	4.17
8	000999	华润三九	66,526,567.74	3.58
9	002152	广电运通	60,766,042.55	3.27
10	002585	双星新材	51,472,558.22	2.77
11	601607	上海医药	50,233,027.79	2.70
12	000625	长安汽车	49,024,107.15	2.64
13	601098	中南传媒	47,939,319.33	2.58

14	000709	河钢股份	47,903,313.67	2.58
15	000876	新希望	46,241,100.66	2.49
16	600048	保利地产	34,409,003.33	1.85
17	000598	兴蓉环境	32,478,284.02	1.75
18	600782	新钢股份	32,118,138.79	1.73
19	601688	华泰证券	31,967,375.35	1.72
20	600741	华域汽车	30,928,750.55	1.66

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	601169	北京银行	105,713,668.68	5.68
2	002152	广电运通	104,224,773.14	5.60
3	601111	中国国航	70,239,138.77	3.78
4	600741	华域汽车	55,608,325.55	2.99
5	601555	东吴证券	51,620,687.54	2.78
6	600697	欧亚集团	49,846,226.98	2.68
7	600409	三友化工	47,315,761.96	2.54
8	600028	中国石化	46,698,228.77	2.51
9	601678	滨化股份	46,408,359.22	2.50
10	600823	世茂股份	44,672,523.61	2.40
11	000709	河钢股份	41,097,221.50	2.21
12	600335	国机汽车	40,357,359.39	2.17
13	002557	洽洽食品	39,053,831.68	2.10
14	000501	鄂武商 A	38,744,164.48	2.08
15	600048	保利地产	37,106,925.83	2.00
16	600104	上汽集团	36,321,229.42	1.95
17	000963	华东医药	32,158,126.43	1.73
18	601607	上海医药	30,907,144.30	1.66
19	000858	五粮液	30,582,415.45	1.64
20	601318	中国平安	28,853,672.16	1.55

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	1,819,665,121.82
卖出股票收入（成交）总额	1,480,811,950.35

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰证券股份有限公司（601688）外，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。

根据华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）于 2015 年 8 月 26 日公布的《关于收到中国证监会调查通知书的公告》，华泰证券于 2015 年 8 月 24 日收到中国证监会《调查通知书》（编号：渝证调查字 2015004 号），因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。根据华泰证券于 2015 年 9 月 12 日公布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，公司于 2015 年 9 月 10 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]72 号），拟对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。本公司会紧密跟踪并及时采取相应投资决策，截至目前，本基金对华泰证券的投资决策流程符合本公司规定。

### 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	634,551.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60,678.57
5	应收申购款	110,385,036.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,080,266.56

### 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	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------	----------

				比例 (%)	
1	000651	格力电器	69,601,496.90	3.25	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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇丰晋信大盘股票 A	21,946	43,712.60	619,572,263.31	64.58%	339,744,556.80	35.42%
汇丰晋信大盘股票 H	3	7,221,482.97	0.00	0.00%	21,664,448.91	100.00%
合计	21,949	44,693.67	619,572,263.31	63.16%	361,409,005.71	36.84%

注：本基金 H 类份额的投资者均为个人投资者。依据香港市场的特点，香港投资者持有的本基金 H 类别份额将由香港销售机构代表香港投资者名义持有，同时，香港销售机构以名义持有人的形式出现在注册登记机构的持有人名册中。基金管理人无法得知具体的投资者信息，此处本基金 H 类份额持有人户数为 H 类份额名义持有人户数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇丰晋信大盘股票 A	367,193.26	0.0383%
	汇丰晋信大盘股票 H	0.00	0.0000%

	合计	367,193.26	0.0374%
--	----	------------	---------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇丰晋信大盘股票 A	10~50
	汇丰晋信大盘股票 H	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信大盘股票 A	0~10
	汇丰晋信大盘股票 H	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇丰晋信大盘股票 A	汇丰晋信大盘股票 H
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	767,465,128.87	543,441.23
本报告期基金总申购份额	536,054,588.31	24,307,370.37
减：本报告期基金总赎回份额	344,202,897.07	3,186,362.69
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	959,316,820.11	21,664,448.91

## § 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

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。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。

### 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	611,016,506.10	18.52%	569,039.68	18.52%	-
申万宏源	1	599,129,117.83	18.16%	557,969.11	18.16%	-
平安证券	1	405,926,448.24	12.31%	378,040.68	12.31%	-
银河证券	1	292,935,236.20	8.88%	272,809.51	8.88%	-
中金公司	1	269,977,583.33	8.18%	251,429.69	8.18%	-
川财证券	1	259,402,138.18	7.86%	241,581.47	7.86%	-
东方证券	1	244,742,359.88	7.42%	227,927.01	7.42%	-
安信证券	2	238,115,044.84	7.22%	221,757.07	7.22%	-
光大证券	1	133,326,876.55	4.04%	124,166.52	4.04%	-
中银国际	1	76,105,922.10	2.31%	70,876.80	2.31%	-
招商证券	2	70,030,475.40	2.12%	65,219.58	2.12%	-
中投证券	2	30,872,752.14	0.94%	28,751.51	0.94%	-

国金证券	1	20,732,779.53	0.63%	19,308.47	0.63%	-
中信建投	1	20,516,611.38	0.62%	19,107.39	0.62%	-
广发证券	1	18,781,864.90	0.57%	17,491.50	0.57%	-
华泰证券	1	6,881,644.91	0.21%	6,408.65	0.21%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
合计	27	3,298,493,361.51	100.00%	3,071,884.64	100.00%	-

注：1、本报告期内本基金无新增交易单元。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
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	2016 年 1 月 4 日
2	有关上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	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	2016 年 1 月 5 日
4	有关上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄金融控股股份有限公司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	2016 年 1 月 11 日
6	汇丰晋信基金 2015 年 4 季报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 1 月 21 日
7	大盘基金更新招募说明书	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 2 月 5 日
8	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	2016 年 2 月 26 日

9	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	2016 年 3 月 1 日
10	汇丰晋信基金 2015 年年报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 3 月 29 日
11	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	2016 年 4 月 1 日
12	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加同花顺基金网费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 4 月 1 日
13	关于旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司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	2016 年 4 月 13 日
14	汇丰晋信基金 2016 年 1 季报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 4 月 20 日
15	汇丰晋信关于新增中信期货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	2016 年 5 月 10 日
16	汇丰晋信关于在中信期货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	2016 年 5 月 10 日
17	关于通过中信期货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	2016 年 5 月 10 日
18	关于通过北京钱景财富投资管理有限公司开办汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 5 月 18 日
19	汇丰晋信关于旗下基金参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购和定期定额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	2016 年 5 月 18 日
20	汇丰晋信关于新增北京钱景财富投资管理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	2016 年 5 月 18 日
21	汇丰晋信关于在北京钱景财富投资管理有限公司开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 5 月 18 日
22	汇丰晋信关于新增上海陆金所资产管理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	2016 年 6 月 21 日
23	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司网上费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 6 月 21 日
24	关于通过上海陆金所资产管理有限公司开办汇丰晋信旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2016 年 6 月 24 日
25	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加上海陆金所资产管理有限公司定期定额投资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	2016 年 6 月 30 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  
2016 年 8 月 27 日