# 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

**基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司**
**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期：二〇〇九年八月二十九日**

## §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009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2009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

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 汇丰晋信2026生命周期证券投资基金 | |
| 基金简称 | 汇丰晋信2026周期混合 | |
| 交易代码 | 540004（前端） | 541004（后端） |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年7月23日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 96,909,334.86份 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过基于内在价值判断的股票投资方法，基于宏观经济、现金流、信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程，本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求高于业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 1. 动态调整的资产配置策略<br>本基金投资的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，基金的投资风格相应的从"进取"，转变为"稳健"，再转变为"保守"，股票类资产比例逐步下降，而非股票类资产比例逐步上升。<br>2. 以风险控制为前提的股票筛选策略<br>根据投研团队的研究成果，本基金首先筛选出股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票；同时，再通过严格的基本面分析（CFROI为核心的财务分析、公司治理结构分析）和公司实地调研，最终挑选出质地优良的具有高收益风险比的优选股票。<br>3. 动态投资的固定收益类资产投资策略<br>在投资初始阶段，本基金债券投资将奉行较为"积极"的策略；随着目标期限的临近和达到，本基金债券投资将逐步转向"稳健"和"保守"，在组合久期配置、组合久期浮动权限、个券选择上相应变动。 |
| 业绩比较基准 | 1. 基金合同生效日~2026年8月31日（包括2026年8月31日）<br>业绩比较基准=X * MSCI中国A股指数收益率 + (1-X)* 中信标普全债指数收益率<br>其中X值见下表：<br>时间段 / 股票类资产比例% / X值(%) / (1-X)值(%)<br>基金合同生效之日至2012/8/31 / 60-95 / 75 / 25<br>2012/9/1-2016/8/31 / 50-80 / 65 / 35<br>2016/9/1-2021/8/31 / 30-65 / 45 / 55<br>2021/9/1-2026/8/31 / 10-40 / 20 / 80<br>2. 2026年9月1日（包括2026年9月1日）后<br>业绩比较基准=中信标普全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只生命周期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。<br>本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于较高水平；随着目标投资期限的逐步接近，本基金会逐步降低预期风险与收益水平，转变成为中等风险的证券投资基金；在临近目标期限和目标期限达到以后，本基金转变成为低风险的证券投资基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 汇丰晋信基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵隽扬 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-38789898 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | green.j.y.zhao@hsbcjt.cn | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 021-38789998 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-68881925 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100140 |
| 法定代表人 | | 杨小勇 | 郭树清 |

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 | http://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：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼<br>中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |

## §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 | 2009年1月1日－2009年6月30日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 53,372,431.09 |
| 本期利润 | 75,756,062.70 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4510 |
| 本期加权平均净值利润率 | 39.01% |
| 本期基金份额净值增长率 | 43.91% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009年1月1日－2009年6月30日 |
| 期末可供分配利润 | 31,679,412.75 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3269 |
| 期末基金资产净值 | 136,209,580.77 |
| 期末基金份额净值 | 1.406 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2009年1月1日－2009年6月30日 |
| 基金份额累计净值增长率 | 40.60% |

注：

1、本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年；

2、本期已实现收益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；

3、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）；

4、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 | 9.25% | 0.95% | 10.63% | 0.86% | -1.38% | 0.09% |
| 过去三个月 | 18.15% | 1.24% | 19.62% | 1.12% | -1.47% | 0.12% |
| 过去六个月 | 43.91% | 1.47% | 54.69% | 1.44% | -10.78% | 0.03% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 40.60% | 1.10% | 8.32% | 1.88% | 32.28% | -0.78% |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

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2026生命周期证券投资基金
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
（2008年7月23日至2009年6月30日）

注：

1）本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

2）按照基金合同的约定，自基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例60-95%，非股票类资产比例5-40%。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1月23日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

3）基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的业绩比较基准 = 75%×MSCI中国A股指数收益率+25%×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）。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托有限责任公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2009年6月30日，公司共管理六只开放式基金：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）和汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009年6月24日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 蔡立辉 | 本基金基金经理 | 2008-7-23 | - | 9年 | 蔡立辉先生，1975年出生，武汉大学工商管理学硕士。曾任湖北国际信托投资公司证券管理总部分析师；国元证券股份有限公司研发中心行业研究员、资产管理部投资经理；万家基金管理有限公司研究部行业研究员、基金管理部基金经理，曾于2005年7月至2007年2月期间担任万家公用事业行业股票型证券投资基金的基金经理。 |

注：该任职日期为本基金基金合同生效日。

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》及其他相关法律法规、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

2009年上半年度，本基金严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易，未出现任何异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内汇丰晋信2016基金和汇丰晋信2026基金业绩比较情况如下：

| | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 汇丰晋信2016 | 15.51% | 0.66% | 26.64% | 0.75% | -11.13% | -0.09% |
| 汇丰晋信2026 | 43.91% | 1.47% | 54.69% | 1.44% | -10.78% | 0.03% |

报告期内，汇丰晋信2016基金、汇丰晋信2026基金净值增长率差异超过5%，原因主要如下：

1. 根据基金合同规定，汇丰晋信2016基金的比较基准是：自2008年6月1日起至2009年5月31日：38.5%×新华富时中国A全指+61.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；自2009年6月1日起至2010年5月31日：31.5%×新华富时中国A全指+68.5%×新华巴克莱资本中国全债指数；汇丰晋信2026基金的比较基准是75%*MSCI中国A股指数收益率+25%*中信标普全债指数收益率，而2009年上半年度上述两个基金比较基准的涨幅分别为26.64%和54.69%，存在较大差异；

2. 根据基金合同规定，自2008年6月1日起至2009年5月31日期间，汇丰晋信2016基金的股票仓位最高比例不能超过55%，自2009年6月1日起至2010年5月31日期间，汇丰晋信2016基金的股票仓位最高比例不能超过45%，而汇丰晋信2026基金的股票仓位比例是60%-95%，而沪深两地市场在上半年度继续大幅上涨，基金合同关于仓位比例的不同规定也是两个基金业绩出现较大差异的重要原因。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年1月1日至2009年6月30日，本基金净值增长率为43.91%，同期业绩比较基准收益率为54.69%，本基金落后业绩比较基准10.78个百分点。本基金建仓期于2009年1月23日结束，我们在1月份和2月份股票仓位相对较低。此外，我们前期采用相对防御的行业配置思路，在业绩增长相对确定的电力设备、医药等行业配置较高，而对表现较好的有色、煤炭、地产等行业超配并不明显，这在一定程度上影响了基金的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009年上半年，国家出台的一系列经济刺激政策初见成效，多项宏观经济指标开始好转，企业盈利出现环比上涨的态势，中国经济逐渐走出底部。中国政府执行的积极的财政政策和适度宽松的货币政策一方面带动了中游制造业的直接需求，一方面催生了大量的流动性，并进一步推高各类资产的价格，2009年上半年股市和楼市都出现了明显上涨。海外经济方面，美联储定量放松的政策取向更是直接向市场注入了大量的流动性，这些政策在促进美国经济见底回升的同时，也导致国际市场上原油、基本金属等商品出现大幅度上涨。

2009年下半年，我们预计中国政府执行的积极的财政政策和适度宽松的货币政策方向不会发生改变，这主要是由于中国经济正处于企稳回升的关键时期，同时海外经济回升滞后于中国，短期内出口对中国经济增长的拉动并不明显。不过，我们预计在2009年上半年出现大量的新增贷款之后，货币政策有可能出现微调，下半年贷款增速将显著低于上半年。

2009年股票市场出现了强劲上涨，估值水平得到了大幅提升。我们认为影响未来市场走势的因素主要集中于流动性和企业盈利的变化。就流动性而言，我们判断目前市场处于流动性高度宽松的局面，进一步放松的可能性不大，但是全社会存款活期化的倾向在加强，这在短期内会有助于股票市场进一步上涨。但是，随着实体经济的全面好转，实体经济对流动性的要求将会增强，2009年下半年资金有可能从虚拟经济流向实体经济。企业盈利方面，宏观经济政策的效果更加明显，企业盈利回升的趋势已经明显，钢铁、建材、化工等中游制造业企业开工率快速回升，产品价格开始上涨。与此同时，受海外经济复苏的影响，出口导向型行业的订单将有所恢复，相关企业盈利有望改善。总体而言，考虑到上市公司未来12个月的盈利预期，我们认为市场整体上处于合理估值区间的上端。

基于上述判断，我们对2009年下半年的走势保持谨慎乐观的态度，同时我们判断大类资产配置的超额收益有可能会逐渐提高。在行业配置方面，我们将保持相对均衡的行业配置。在有色、地产、煤炭等强周期性行业取得较大涨幅之后，我们将通过加强钢铁、化工、机械等周期性行业的配置保持组合的攻击性，我们认为这些中游行业的盈利水平有望在下半年得到改善。此外，我们认为金融、食品饮料等行业的估值吸引力在不断提高。一方面，这些行业的估值水平相对于全市场平均估值水平的溢价程度处于历史较低位；另一方面，随着经济的好转，处于产业链下游的消费服务业将逐渐受益，相关公司的盈利水平可能得到改善。

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、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贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

五、督察长

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

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

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

本基金的基金管理人目前没有进行与估值相关的任何定价服务方面的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金本报告期内暂未进行利润分配。

2、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，本基金于2009年8月6日进行了利润分配，每10份基金份额分红3.20元，本次收益分配共计47,658,805.97元。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》，基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2009年6月30日 | 上年度末 2008年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.6.1 6.4.9.5 | 21,050,136.24 | 93,880,089.51 |
| 结算备付金 | | 588,159.72 | 650,232.78 |
| 存出保证金 | | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 116,612,282.10 | 187,564,405.46 |
| 其中：股票投资 | | 116,612,282.10 | 187,564,405.46 |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.6.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.6.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 285,215.40 | - |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 4,441.23 | 25,398.94 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 830,960.81 | 59,295.78 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | - | - |
| 资产总计 | | 139,621,195.50 | 282,429,422.47 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末 2009年6月30日** | **上年度末 2008年12月31日** |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,124,152.44 | 11,602,352.20 |
| 应付赎回款 | | 681,548.71 | 44,878.57 |
| 应付管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 168,696.40 | 348,482.20 |
| 应付托管费 | 6.4.9.2.2 | 28,116.05 | 58,080.38 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | 426,856.15 | 314,733.27 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 982,244.98 | 1,010,771.44 |
| 负债合计 | | 3,411,614.73 | 13,379,298.06 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 96,909,334.86 | 275,250,784.30 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | 39,300,245.91 | -6,200,659.89 |
| 所有者权益合计 | | 136,209,580.77 | 269,050,124.41 |
| 负债和所有者权益总计 | | 139,621,195.50 | 282,429,422.47 |

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值1.406元，基金份额总额96,909,334.86份。本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
本报告期：2009年1月1日 － 2009年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 79,500,658.01 | - |
| 1.利息收入 | | 168,351.44 | - |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 168,351.44 | - |
| 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） | | 56,628,170.99 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | 55,898,211.99 | - |
| 债券投资收益 | 6.4.6.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.6.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.6.15 | 729,959.00 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | 6.4.6.16 | 22,383,631.61 | - |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | 6.4.6.17 | 320,503.97 | - |
| 二、费用（以"-"号填列） | | -3,744,595.31 | - |
| 1.管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | -1,462,562.20 | - |
| 2.托管费 | 6.4.9.2.2 | -243,760.35 | - |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.6.18 | -1,820,525.18 | - |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | 6.4.6.19 | -217,747.58 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | | 75,756,062.70 | - |
| 所得税费用（以"-"号填列） | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列 | | 75,756,062.70 | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
本报告期：2009年1月1日 － 2009年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日－2009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） | 275,250,784.30 | -6,200,659.89 | 269,050,124.41 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 75,756,062.70 | 75,756,062.70 |
| 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） | -178,341,449.44 | -30,255,156.90 | -208,596,606.34 |
| 其中：1.基金申购款 | 39,930,222.40 | 7,872,775.62 | 47,802,998.02 |
| 2.基金赎回款（以"-"号填列） | -218,271,671.84 | -38,127,932.52 | -256,399,604.36 |
| 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） | 96,909,334.86 | 39,300,245.91 | 136,209,580.77 |

| 项目 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|---|---|---|---|
| 一、期初所有者权益（基金净值） | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | - | - |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款（以"-"号填列） | - | - | - |
| 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） | - | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

6.4 报表附注

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

本报告期内，本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与2008年年度财务报告相一致。

本报告期内，本基金无重大会计差错发生。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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 |
| 建设银行股份有限公司（"建设银行"） | 基金托管人 |
| 山西证券股份有限公司（"山西证券"） | 见备注 |

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

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 山西证券 | 11,953,208.50 | 1.05% | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年。

6.4.3.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 山西证券 | 10,160.32 | 1.06% | - | - |
| **关联方名称** | **上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 当期佣金** | **占当期佣金总量的比例** | **期末应付佣金余额** | **占期末应付佣金总额的比例** |
| - | - | - | - | - |

注：1、本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

2、股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-清算库中买（卖）经手费

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

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用山西证券有限责任公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从山西证券有限责任公司获得证券研究综合服务。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 1,462,562.20 | - |
| 其中：当期已支付 | 1,293,865.80 | - |
| 期末未支付 | 168,696.40 | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

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

6.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 243,760.35 | - |
| 其中：当期已支付 | 215,644.30 | - |
| 期末未支付 | 28,116.05 | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年6月30日，基金合同生效未满1年。

支付基金托管人建设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6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | - | - |
| 期间认购总份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分增加的份额 | - | - |
| 期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年。

6.4.3.4.2 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 2009年6月30日 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年

6.4.3.5 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 2009年1月1日－2009年6月30日 期末余额 | 当期利息收入 | 上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 建设银行 | 21,050,136.24 | 160,871.06 | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 本期 2009年1月1日－2009年6月30日 基金在承销期内买入 数量（单位：） | 总金额 |
|---|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - | - |
| **关联方名称** | **证券代码** | **证券名称** | **发行方式** | **上年度可比期间 2008年1月1日－2008年6月30日 基金在承销期内买入 数量（单位：）** | **总金额** |
| - | - | - | - | - | - |

注：本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2009年06月30日，基金合同生效未满1年。

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.4 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2009-8-6 | 2009-8-6 | 3.2 | 36,413,913.48 | 11,244,892.49 | 47,658,805.97 |

注：上述分配为资产负债表日之后，本报告批准报出日之前公告并实施的利润分配。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止2009年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

截止2009年06月30日，本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截止2009年06月30日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截止2009年06月30日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

## §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 | 116,612,282.10 | 83.52 |
| | 其中：股票 | 116,612,282.10 | 83.52 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 21,638,295.96 | 15.50 |
| 6 | 其他资产 | 1,370,617.44 | 0.98 |
| 7 | 合计 | 139,621,195.50 | 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（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| 2 | 采掘业 | 10,477,900.00 | 7.69 |
| 3 | 制造业 | 45,392,082.10 | 33.33 |
| 4 | 食品、饮料 | 9,486,700.00 | 6.96 |
| 5 | 纺织、服装、皮毛 | 1,251,792.50 | 0.92 |
| 6 | 木材、家具 | - | - |
| 7 | 造纸、印刷 | - | - |
| 8 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| 9 | 电子 | 1,522,287.20 | 1.12 |
| 10 | 金属、非金属 | 4,788,300.00 | 3.52 |
| 11 | 机械、设备、仪表 | 21,353,400.00 | 15.68 |
| 12 | 医药、生物制品 | 4,613,602.40 | 3.39 |
| 13 | 其他制造业 | 2,376,000.00 | 1.74 |
| 14 | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| 15 | 建筑业 | - | - |
| 16 | 交通运输、仓储业 | 1,003,600.00 | 0.74 |
| 17 | 信息技术业 | 2,058,000.00 | 1.51 |
| 18 | 批发和零售贸易 | 7,957,100.00 | 5.84 |
| 19 | 金融、保险业 | 35,206,900.00 | 25.85 |
| 20 | 房地产业 | 14,516,700.00 | 10.66 |
| 21 | 社会服务业 | - | - |
| 22 | 传播与文化产业 | - | - |
| 23 | 综合类 | - | - |
| 24 | 合计 | 116,612,282.10 | 85.62 |

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 | 600000 | 浦发银行 | 310,000 | 7,136,200.00 | 5.24 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 150,000 | 5,566,500.00 | 4.09 |
| 3 | 000001 | 深发展A | 230,000 | 5,018,600.00 | 3.68 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 220,000 | 4,930,200.00 | 3.62 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 90,000 | 4,451,400.00 | 3.27 |
| 6 | 000002 | 万科A | 280,000 | 3,570,000.00 | 2.62 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 120,000 | 3,444,000.00 | 2.53 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 120,000 | 3,346,800.00 | 2.46 |
| 9 | 600785 | 新华百货 | 180,000 | 3,290,400.00 | 2.42 |
| 10 | 000983 | 西山煤电 | 110,000 | 3,289,000.00 | 2.41 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于汇丰晋信基金管理公司网站（www.hsbcjt.cn）的半年度报告正文。

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 | 600739 | 辽宁成大 | 9,757,292.15 | 3.63 |
| 2 | 600123 | 兰花科创 | 9,724,823.04 | 3.61 |
| 3 | 600005 | 武钢股份 | 9,432,797.49 | 3.51 |
| 4 | 600026 | 中海发展 | 8,243,045.47 | 3.06 |
| 5 | 600031 | 三一重工 | 8,082,069.77 | 3.00 |
| 6 | 000001 | 深发展A | 7,436,782.75 | 2.76 |
| 7 | 000983 | 西山煤电 | 7,244,161.00 | 2.69 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 7,228,900.00 | 2.69 |
| 9 | 601699 | 潞安环能 | 7,131,408.47 | 2.65 |
| 10 | 600547 | 山东黄金 | 7,062,291.98 | 2.62 |
| 11 | 600511 | 国药股份 | 7,054,216.88 | 2.62 |
| 12 | 600376 | 首开股份 | 6,677,106.33 | 2.48 |
| 13 | 600628 | 新世界 | 6,607,932.57 | 2.46 |
| 14 | 601168 | 西部矿业 | 6,526,454.00 | 2.43 |
| 15 | 600161 | 天坛生物 | 6,338,374.84 | 2.36 |
| 16 | 600785 | 新华百货 | 6,249,927.77 | 2.32 |
| 17 | 000858 | 五粮液 | 6,214,979.00 | 2.31 |
| 18 | 600036 | 招商银行 | 6,195,580.00 | 2.30 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 6,085,423.28 | 2.26 |
| 20 | 600100 | 同方股份 | 6,052,836.06 | 2.25 |
| 21 | 000012 | 南玻A | 5,659,172.36 | 2.10 |
| 22 | 002073 | 青岛软控 | 5,529,760.18 | 2.06 |
| 23 | 600693 | 东百集团 | 5,462,528.71 | 2.03 |
| 24 | 00731 | 四川美丰 | 5,431,412.66 | 2.02 |

注：本项"买入金额"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。

7.4.2 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 | 601398 | 工商银行 | 12,287,000.00 | 4.57 |
| 2 | 600123 | 兰花科创 | 11,837,703.62 | 4.40 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 11,392,915.08 | 4.23 |
| 4 | 000895 | 双汇发展 | 11,166,974.49 | 4.15 |
| 5 | 600325 | 华发股份 | 10,832,929.90 | 4.03 |
| 6 | 600005 | 武钢股份 | 10,271,116.36 | 3.82 |
| 7 | 600754 | 锦江股份 | 10,105,615.26 | 3.76 |
| 8 | 002122 | 天马股份 | 9,507,068.61 | 3.53 |
| 9 | 600895 | 张江高科 | 8,969,752.11 | 3.33 |
| 10 | 600664 | 哈药股份 | 8,928,948.67 | 3.32 |
| 11 | 000401 | 冀东水泥 | 8,785,223.09 | 3.27 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 8,703,117.27 | 3.23 |
| 13 | 600026 | 中海发展 | 8,554,866.17 | 3.18 |
| 14 | 600880 | 博瑞传播 | 8,533,252.28 | 3.17 |
| 15 | 000800 | 一汽轿车 | 8,448,385.58 | 3.14 |
| 16 | 600547 | 山东黄金 | 8,420,740.64 | 3.13 |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 8,329,000.00 | 3.10 |
| 18 | 600100 | 同方股份 | 8,225,617.90 | 3.06 |
| 19 | 601899 | 紫金矿业 | 8,200,720.00 | 3.05 |
| 20 | 600376 | 首开股份 | 7,945,460.07 | 2.95 |
| 21 | 600425 | 青松建化 | 7,771,926.84 | 2.89 |
| 22 | 601699 | 潞安环能 | 7,756,756.00 | 2.88 |
| 23 | 600030 | 中信证券 | 7,731,396.44 | 2.87 |
| 24 | 600161 | 天坛生物 | 7,501,476.52 | 2.79 |
| 25 | 000629 | 攀钢钢钒 | 7,278,000.00 | 2.71 |
| 26 | 600739 | 辽宁成大 | 7,237,364.42 | 2.69 |
| 27 | 600690 | 青岛海尔 | 7,083,246.66 | 2.63 |
| 28 | 601168 | 西部矿业 | 7,060,508.00 | 2.62 |
| 29 | 600511 | 国药股份 | 7,032,848.00 | 2.61 |
| 30 | 600536 | 中国软件 | 7,029,163.16 | 2.61 |
| 31 | 600628 | 新世界 | 6,863,424.70 | 2.55 |
| 32 | 600000 | 浦发银行 | 6,829,379.20 | 2.54 |
| 33 | 600089 | 特变电工 | 6,789,055.56 | 2.52 |
| 34 | 002252 | 上海莱士 | 6,729,285.13 | 2.50 |
| 35 | 600875 | 东方电气 | 6,705,829.52 | 2.49 |
| 36 | 601318 | 中国平安 | 6,683,161.00 | 2.48 |
| 37 | 600054 | 黄山旅游 | 6,641,089.15 | 2.47 |
| 38 | 002065 | 东华软件 | 6,578,128.94 | 2.44 |
| 39 | 601088 | 中国神华 | 6,520,604.32 | 2.42 |
| 40 | 600820 | 隧道股份 | 6,263,323.99 | 2.33 |
| 41 | 600428 | 中远航运 | 6,055,867.00 | 2.25 |
| 42 | 601186 | 中国铁建 | 6,043,540.00 | 2.25 |
| 43 | 000731 | 四川美丰 | 6,025,675.00 | 2.24 |
| 44 | 000759 | 武汉中百 | 6,002,155.61 | 2.23 |
| 45 | 600693 | 东百集团 | 5,976,400.30 | 2.22 |
| 46 | 000858 | 五粮液 | 5,870,739.81 | 2.18 |
| 47 | 000422 | 湖北宜化 | 5,850,564.66 | 2.17 |
| 48 | 000012 | 南玻A | 5,774,626.52 | 2.15 |

注：本项"卖出金额"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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 496,927,488.01 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 646,161,454.97 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 285,215.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,441.23 |
| 5 | 应收申购款 | 830,960.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,370,617.44 |

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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 持有份额 | 占总份额比例 | 个人投资者 持有份额 | 占总份额比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 4,542 | 21,336.27 | 11,416,423.75 | 11.78% | 85,492,911.11 | 88.22% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 971,165.21 | 1.0021% |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 334,873,888.23 |
| 报告期期初基金份额总额 | 275,250,784.30 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 39,930,222.40 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 218,271,671.84 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 96,909,334.86 |

## §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

1.2008年12月，董事会审议通过聘任林彤彤先生和王品女士担任汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理。在2009年4月《基金经理注册登记规则》正式实施后，我公司于4月2日向中国证券业协会申请办理林彤彤先生基金经理变更手续和王品女士基金经理任职注册手续。林彤彤先生和王品女士于2009年6月24日起正式任职汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理。

2.2009年4月，董事会审议通过增聘邵骥咏先生为汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理。我公司于2009年5月4日向中国证券业协会申请办理邵骥咏先生基金经理任职注册手续。邵骥咏先生于2009年5月21日起正式任职汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理。

3.本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

自本基金募集以来，毕马威华振会计师事务所有限公司一直为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 应支付该券商的佣金 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 联合证券 | 1 | 18,738,288.58 | 1.64% | 15,224.86 | 1.59% | - |
| 国泰君安 | 1 | 103,671,221.47 | 9.07% | 84,234.25 | 8.80% | - |
| 安信证券 | 1 | 252,503,826.15 | 22.09% | 205,161.96 | 21.43% | - |
| 申银万国 | 1 | 756,222,398.28 | 66.16% | 642,785.39 | 67.13% | - |
| 山西证券 | 1 | 11,953,208.50 | 1.05% | 10,160.32 | 1.06% | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券交易 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 备注 |
|---|---|---|---|---|
| 联合证券 | 1 | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - |

注：①在报告期内，本基金使用的证券公司交易单元无变更情况；

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。

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇〇九年八月二十九日