金额单位:人民币元

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送出日期: 二〇一一年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1里來形別 基金管理人的董事会及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2011年8月22日复核了本报告中的财 务指标、净值表现,利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记

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

签证的以往近级对个(\&失本本本必绝。这负有《地》)以页有任[hulx页改集前他];如两块 说明书及其更新。 本半年度报告被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2011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	2 基金简介
2.1 至 至 至 平 同 0.1 基 金 简 称	汇丰晋信大盘股
基金主代码	5400
交易代码	5400
基金运作方式	契约型开放
基金合同生效日	2009年6月24
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公
基金托管人	交通银行股份有限公
报告期末基金份额总额	1,161,269,601.75
基金合同存续期	不定
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监筹型股票 在将合理控制风险的基础上,追求稳健的分组收益及长期资本利等,实现基金资 持续超越业绩比较基准的收益。
投资策略	1. 於个配置策略 根据本基金所奉行的"较高仓位、蓝等公司,特选研究"的经按理念和"研究 造价值"的投票构造策略,在投资决策中,本基金仅根据精选的各类证券的风险 益特征的相对变化、适度的调整确定基金资产在投票,债券及现金等受到资产问 分配比例。 2. 行业配置策略 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设。行业比 分析缔结合约,外部研究资源、结合宏观虚本面分析等状况。提出重点行业配置 重的建议。 3. 表票资产户投资额 "本基金专注于分析大盘股特有的竞争优势,基金管理人将对初违股票给予 面的价值。成长分析,并给合行业地位分析,优选出具有盈利标准稳定增长,价值 估。且在各行业中具有领产地位的大量需要提票进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数 * 90%+同业存款利率 * 10%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品,在开放式基金中,其预期风险和收益水平高于债券 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监筹 票,在股票型基金中属于中等风险水平的投资产品。

项目	3	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	
	姓名	古韵	张咏东	
信息披露负责人	联系电话	021-38789898	021-32169999	
	电子邮箱	melody.y.gu@hsbcjt.cn	zhangyd@bankcomm.com	
客户服务电话		021-38789998	95559	
传真		021-68881925	021-62701216	

*载基金半年度报告正文的管理人互联网网 www.hsbejt.cn 主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 通银行股份有限公司:上海市浦东新区银城中路 188 号。

3 主要财务指标和基金净值表现

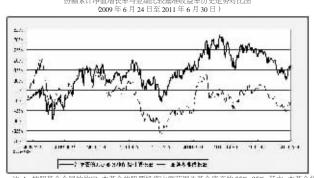
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	31,783,239.69
本期利润	-106,481,646.07
加权平均基金份額本期利润	-0.0929
本期基金份額净值增长率	-7.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1043
期末基金资产净值	1,282,445,699.48
期末基金份額净值	1.1043

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对收益; 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 (5) 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。 32基金净值表现

阶段	份額净值增长率 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	2.57%	1.11%	1.28%	1.07%	1.29%	0.04%
过去三个月	-3.65%	0.99%	-4.99%	0.99%	1.34%	0.00%
过去六个月	-7.77%	1.14%	-2.39%	1.11%	-5.38%	0.03%
过去一年	14.39%	1.31%	16.96%	1.26%	-2.57%	0.05%
自基金成立起 至今	17.05%	1.38%	-1.01%	1.50%	18.06%	-0.12%

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 2009年6月24日至2011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 股市场上具有盈和特华稳定增长,价值低估,且在各行业中具有领先也的大盘监务股票,本基金局证收益类正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至

5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% 比较基准收益率的计算未包含沪深 300 指数成份 5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

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验 汇丰曾信基金管理伺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 2011 年 6 月 30 日、公司共管理 9 只开放式基金;汇丰管信 2016 生命周期开放式已成 投资基金 (2006 年 5 月 23 日成立)、汇丰曾信产遗歷股型开放式证券投资基金 (2006 年 9 月 2 日成立)、 汇丰置信动态策略混合型证券投资基金 (2007 年 4 月 9 日成立)、汇丰置信 2026 生命周期证券投资基金 礼丰曾信ى您東路保台型业券投资基金 2007 年 4 月 9 日成立 1,礼丰曾信 2026 生命周期业券投资基金 2008 年 1 月 3 日成立 1,礼丰曾信字卷 2008 年 1 月 3 日成立 1,礼丰曾信字卷 2008 年 1 月 3 日成立 1,礼丰曾信告 盘股票型证券投资基金 2009 年 6 月 24 日成立 1,礼丰曾信中小盘股票型证券投资基金 2009 年 1 月 11 日成立 1,礼丰曾信陈碳先锋股票型证券投资基金 2010 年 6 月 8 日成立 1,和礼丰曾信消费红利股票型证券投资基金 2010 年 1 月 8 日成立 1 月 1 日成立 1 日成立

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年	说明
81.41	87. 9F	任职日期	离任日期	限	155.95
王品	本基金基金经理、汇丰晋信证 费红利股票型金 券投资基金基金 经理	2009-06-24	-	10年	王品女士,中国药料大学理学 硕士。历任火业证券股份有限国 队工业场股份产业研究员,但用国 斯基金管理公司中级中国基金 任品金管理公司南级研究员。汇丰百 信基金管理公司高级研究员。现任本基金基金经理。汇丰百 信消费公司投票型证券投资基 金基金经理。

注:1.任职日期为本基金管理人公告王品女士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 (此券投资基金法)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盲型从外估产制件公平交易间依的专项原明 4.31。公平交易制度的执行情况 2011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 公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易。未发现本基金有重大违反公平交易制度的投资行为。 4.32。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 本基金与本公司旗下的其他投资组合的投资风格不同。 4.33、胃常交易行为的专项说明 4.43、胃常交易行为的专项说明

本基金与本公司原下的共他权贷组合的投资风格不同。
4.33 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。
4.46 理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运情分析
2011 年上半年受较高的通胀数据影响,央行采取了紧缩的货币政策,市场利率出现明显上升,同时经济增速在宏观调控政策的51号下也出现了缓步回落的态势,A股市场自二季度以来出现明显回落。沪深 300 指数在上半年下跌 2.69%,其中二季度跌幅达到 5.56%。从大小盘风格指数来看上半年表征大盘股的沪深 300 指数能赢表征中小盘股的中证 500 指数 4.55%。分行业来看根据中信行业分类。2011 年上半年表现是好的三个行业分别为建林、煤炭、家电,涨幅分别为18.13%、12.89%。9.49%、表现最差的三个行业为计算机、电力设备、传媒板块、分别下跌了18.04%、15.39%、14.49%。
2011 年上半年、考虑到一些依估值的周期股却拥有不俗的盈利增长、我们据此对组合结构进行了调整。减转了医疗、电力设备、信息服务等板块、增特了家电、截体、金融服务、黑色金属等周期类板块。同时在食品饮料板块经历了一定跌幅后,我们认为其已具备长期投资价值、对该板块进行了积极配置。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2011 年上半年本基金净值增长率为~7.77%,同期业绩比较基准变动幅度为~2.39%。本基金落后于业

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 2011年上半年本基金净值增长率为-7.77%,同期业绩比较基准变动幅度为-2.39%,本基金落后于业绩比较基准 5.38%,其中二季度本基金的净值增长率领先业绩比较基准 1.34%。 4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望未来一个季度,我们认为保障房将在三季度陆续开工、房地产投资增速有望保持平稳,而由于 展望未来一个季度,我们认为保障房将在三季度陆续开工、房地产投资增速有望保持平稳,而由于 健康则有一定的不确定性。预计二季度经济增速将呈现平稳解降的态势。 因为成本压力得到明显的缓解,三季度企业盈利下调的幅度有限,预计不会出现较大的下滑。三季度通胀将逐步见顶回落,但为防止通胀反复,我们预计紧缩的货币政策仍将持续,市场资金面仍将维持紧张。

。 从外围市场来看,美债与欧债的相关政策仍未确定,这使相关区域的经济前景蒙上阴影,对 A 股市

从外围市场来看,美债与欧债的相关政策仍未确定,这使相关区域的经济前景蒙上阴影,对 A 股市场走势也可能产生一定的负面影响。从估值情况来看,目前市场估值水平已具有一定的安全性,若从沪深 300 看,市场 PE 估值已基本接近 2008 年与 2010 年的低位,但中证 500 现有估值水平仍然较高。综合上述,我们认为未来一个季度市场基本面与流动性并不会出现大的改观,外围市场情况短期可能对 A 股市场的情绪面产生消极影响,但目前市场估值吸引力较高,市场存在的转机在于保障房建设的开工情况及水积投资等政府投资项目的推进速度。因此,未来一个季度对价将重点关注保障房建设与水积投资相关产业链的投资机会,我们还将关注经济结构转型催生出来的如新能源领域的投资机会;我们将进一步深化个股的前瞻性研究,以寻找出具有持续成长性的上市公司进行投资。46管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明本基金份额净值计价,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 征券投资基金会计核算业务指引》、关于证券投资基金执行《企业会计律则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》证监会计专 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》征监会公告 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 化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。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门一基金投资部、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。

汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

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 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 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、风险经验制制 相联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

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

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

一型以上於白祖中央。 本基金的基金管理人目前沒有进行与估值相关的任何定价服务方面的签约。 4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 根据基金相关法律法规和基金合同的要求、结合本基金实际运作情况,本报告期内,本基金暂不进

行利润分配。
 5.托管人报告
 5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
 2011年上半年度,基金托管人在汽车管官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》及集他考关法律法规、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.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
 2011年上半年度,几丰曾信基金管理有限公司在汽车曾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

·班西河179。 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 2011年上半年度,由汇丰曾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 以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 床经审计)

6.1资产负债表

E体:		基金	单位
资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年 12 月 31

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1 6.4.10.5	42,468,855.31	17,856,114.1
结算备付金	6.4.10.5	133,283,394.41	145,896,446.3
存出保证金		750,000.00	773,984.0
交易性金融资产	6.4.7.2	1,109,271,564.47	1,209,636,872.4
其中:股票投资	6.4.7.2	1,109,271,564.47	1,209,636,872.4
基金投资		-	
债券投资		-	
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产	6.4.7.3	_	
买人返售金融资产	6.4.7.4	_	
应收证券清算款		2,542.11	6,635,582.0
应收利息	6.4.7.5	58,334.63	34,246.3
应收股利		95,571.50	
应收申购款		602,217.64	1,219,486.2
递延所得税资产		_	
其他资产	6.4.7.6	_	
资产总计		1,286,532,480.07	1,382,052,731.5
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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		-	26,899,644.1
应付赎回款		293,670.53	718,753.5
应付管理人报酬		1,544,070.63	1,484,284.7
应付托管费		257,345.12	247,380.8
应付销售服务费		-	
应付交易费用	6.4.7.7	1,252,558.09	2,420,593.5
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	739,136.22	1,102,708.8
负债合计		4,086,780.59	32,873,366.4
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,161,269,601.75	1,126,878,876.6
	6.4.7.10	121,176,097.73	222,300,488.5
未分配利润			
未分配利润 所有者权益合计		1,282,445,699.48	1,349,179,365.1

会计主体: 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月 30日
一、收入		-89,974,562.88	-168,803,784.56
1.利息收入		971,265.23	1,086,163.56
其中:存款利息收入	6.4.7.11	971,265.23	1,086,163.56
债券利息收入		-	
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	
2.投资收益(损失以"-"填列)		47,102,035.23	55,848,851.16
其中:股票投资收益	6.4.7.12	40,153,821.99	48,765,542.79
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	-	
资产支持证券投资收益		-	
衍生工具收益	6.4.7.14	-	
股利收益	6.4.7.15	6,948,213.24	7,083,308.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-138,264,885.76	-226,309,396.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	217,022.42	570,597.45
减:二、费用		16,507,083.19	19,103,486.13
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	9,723,824.81	10,791,998.90
2.托管费	6.4.10.2.2	1,620,637.47	1,798,666.47
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	4,915,389.43	6,265,930.58
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	
6.其他费用	6.4.7.19	247,231.48	246,890.18
三、利润总额(亏损总额以"="号填列)		-106,481,646.07	-187,907,270.69
减:所得税费用		-	
四、净利润(净亏损以"="号填列)		-106,481,646.07	-187,907,270.69

6.3所有者权益 链壶伊值 度初表 会计主体:汇丰晋信大盘股票型证券投资基金 本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

2011年1月1日至2011年6月30日 项目 、期初所有者权益(基金净值 1,126,878,876. 222,300,488.5 1,349,179,365.14 -106,481,646.0 中:1.基金申购部 -149,552,375.4 -24,060,314.5 173,612,689.9 丘、期末所有者权益(基金净值 1,161,269,601.75 121,176,097.7 1,282,445,699.48 2010年1月1日至2010年6月30 191,724,042.5 1,572,713,097.0 、本期经营活动产生的基金净 动数(本期利润) -187,907,270.6 -187,907,270.6 7,670,636.6 中:1.基金申购部 428,304,484.0 24,801,523.9 453,106,008.00 -420,633,847.4

1,388,659,691.1 本报告。6.1至6.4,财务积贵由下列负责人签署: 基金管理公司负责人:杨小勇、主管会计工作负责人:李选进,会计机构负责人:杨洋

6.41 基金基本情况 在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" 於中国证监会 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 1343 号文 批准,由汇丰晋信基金管理有限公司依照 什 华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同》发售,基 金合同于2009 年6月24 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 2.885. 554.241.41 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股

-40,828,292.8

根据《华华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《广主晋信大盘股票型证券投资基金基金合

0-4.2 云/11/8.240)4min/25641 本基金按照财政部颁布的企业会计准则 2006),中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、任丰晋信大虚股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会基金部通知 2010 18 号 交 征券投资基金信息披露 XRRI、模版第 3 号年度报告和半年度报告》以及中国证监会允许的如会计报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

0.4.3 座間正业宏订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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。6.44 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 2010 年年度财务报告相一致。6.4.5 差错更正的说明 本报告期内,本基金无重大会计差错发生。

根据财税字 [1998] 55 号文、[2001] 61 号文 佚于证券投资基金税收问题的通知》、财税字 [2002] 128 侵越例较是 1998,55 亏义、2001 61 亏头 侯于世界校资益並税以问题的通知小财税子 2002 112多 号文 侯于开放式证券投资基金有关税收问题的通知,规税 2004 178 号文 侯于正券投资基金税收政策 的通知,财税字 2005 11 号文 侯于调整证券 般票 交易印花税税率的通知,财税 2005 102 号文 侯 于股息红利个人所得税有关政策的通知,规划 2005 100 亏文 侯于歷权分置试点改革有关税收政策回 题的通知,规税 2005 107 号文 侯于股息红利有关个人所得税政策的补充通知,财税 2007 84 号文 财政部国家税务总局关于调整证券 般票 交易印花税税率的通知,财税 2008 11 号文 财政部、国家税 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

础 ↑: ⑥)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。

(1)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。
(2)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
(3)基金件为流通股股车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。
(4)对基金取得的股票的股息、红利收人、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还收入时代扣代缴20%的个人所得税。
(5)自2005年1月24日起、基金买卖 A 股 B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券 股票 应及5年6月3日起、对个人投资者从上市公司取得的股票的股息。红和收入暂减按 50%计算个人所得税。
(5)自2005年9月24日起,基金买卖 A 股 B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券 股票 应易印花税。自2007年5月30日起,该税率上调至 0.3%。自2008年4月24日起,根据上海证券交易所均深圳证券交易所的相关规定、调整证券 股票 应多可允税税率。由 0.3%降至 0.1%。自2008年9月19日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定、证券交易印花税政为单边征收,即仅对卖出 A 股 B 股和股权按 0.1%的税率征收。
(6)对投资者 包括个人和机构投资者 从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

注:山西证券与本基金管理人的股东一山西信托共同受山西省国信投资 **集**团)公司控制。 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 6.4.8.1 股票交易

0.4.6.1.1 (12.75; 2.95)			金额	i单位:人民币:
关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年	6月30日	上年度可比期 2010年1月1日至 2010	
大联刀石桥	成交金額	占当期股票成 交总额的比例	成交金額	占当期股票成 交总额的比例
山西证券	352,933,385.06	10.95%	392,666,503.72	9.58%
6.4.8.1.2 权证交易				

本报告期间与上年度可比期间,本基金均未通过关联方进行权证交易。 6.4.8.1.3 债券交易 本报告期间与上年度可比期间,本基金均未通过关联方进行债券交易。

6.48.1.4 (第至順交易 本报告期间与上年度可比期间,本基金均未通过关联方进行债券回购交易。 6.48.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元 2011年1月1日至2011年6月30日 关联方名称

关联方名称 注:股票交易佣金计提标准如下: 深圳证券交易所交易佣金=买 侯 城交金额x1%e-清算库中买 侯 烧手费 上海证券交易所交易佣金=买 侯 城交金额x1%e-清算库中买 侯 烧手费 上海证券交易所交易佣金=买 侯 城交金额x1%e-买 侯 贬手费-买 侯 加管费 上述交易佣金比率次在强商业条款范围内收取,并符合户业标准。 根据 征券研究服务协议入本基金管理人在租用山西证券股份有限公司证券交易专用交易单元进 行股票 债券和权证交易的同时,还从山西证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

单位:人民币元

单位:人民币元

-40,828,292.8

1,340,611,575.47

	0.4.8.2.1 巫並自珪页		单位:人民币:
	项目	本期	上年度可比期间
	坝日	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	9,723,824.81	10,791,998.90
	其中:支付销售机构的客户维护费	1,473,421.89	2,240,726.51
	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	理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的
ź	F费率计提,逐日累计至每月月/i	底,按月支付。计算公式为:	
	日基全管理费=前一日基全	答产净值√1.50℃出年天数**	

6.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 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

64.8.4 各关联方投资本基金的情况 64.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期及上年度可比期间,本基金管理人均未投资本基金。 64.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本报告期期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。 64.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元 2010年1月1日至2010年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日

		2011年1月1	本期 日至 2011 年 6 月	30 ⊟	
24 mi ->- A- 16-	201.00 (0.00)	tori dili. An Tila	4D C	基金在承销	期内买人
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量(单位:股/张)	总金額
-	-	-	-	-	-
			E度可比期间 日至 2010 年 6 月	30 ⊟	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销	期内买人
大联万石标	III: 95-1 C (6-9)	UE 35-40 MV	及11万瓦	数量(单位:股/张)	总金额
中德证券	002362	汉王科技	网上发行	500	20.950.00

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

04.9.1 国/N94研及//电及证券间 J 別本行有的/加理文限证券 根据 使养发行与系统管理办法, 证券投资基金参与网下配售, 应当承诺获得网下配售的股票持有 期限不少于 3 个月, 持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股, 从新股 获配日至该新股上市日期间, 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 化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。 64.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票 代码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因 重大	估值 单价	复牌 日期	开盘 单价	数量(股)	期末 成本总額	期末 估值总額	备注
600170	上海建工	2011-06- 29	资产 重组 事项	15.59	2011- 07-04	16.25	707,937	13,634,010.05	11,036,737.83	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

64.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 本基金本报告期末未发生有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

7.1. /////	E732.54/ XX 1119.6		金额单位:人民币
序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,109,271,564.47	86.22
	其中:股票	1,109,271,564.47	86.22
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	买人返售金融资产	-	-
	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	175,752,249.72	13.66
6	其他各项资产	1,508,665.88	0.12
7	合计	1,286,532,480.07	100.00
7.2期末	安行业分类的股票投资组合		

衣、林、牧、渔业 564,987,252.7 126,015,606.60 织.服装.皮 19,479,745.1 油、化学、塑胶、塑料 64,825,756.08 24,241,347.55 金属、非金属 20, 151, 552.00 机械、设备、仪表 236,427,536.41 18.44 73,845,709.0 5.76 32,886,761.44 交通运输、仓储。 73,022,179,88 59,090,185.86 金融、保险业 172,467,982.63 45,619,321.10

48,094,671.

				金	额单位:人民币
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	600519	贵州茅台	314,658	66,905,730.54	5.22
2	601601	中国太保	2,144,924	48,024,848.36	3.74
3	000651	格力电器	2,006,680	47,156,980.00	3.68
4	600467	好当家	3,721,957	44,291,288.30	3.45
5	600036	招商银行	3,369,435	43,870,043.70	3.42
6	600587	新华医疗	1,305,948	42,221,298.84	3.29
7	600104	上海汽车	1,766,933	33,112,324.42	2.58
8	600030	中信证券	2,479,386	32,430,368.88	2.53
9	600125	铁龙物流	2,994,569	31,562,757.26	2.46
10	002073	软控股份	1,519,821	31,308,312.60	2.44
7.4据约	上扣内卧画投资组。	会的重大恋社			

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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 比例(%)
1	600900	长江电力	88,253,753.78	
2	600887	伊利股份	52,603,565.59	
3	600519	贵州茅台	47,371,765.94	
4	601166	兴业银行	42,195,251.92	
5	600467	好当家	40,093,758.66	
6	600458	时代新材	39,028,945.98	
7	600036	招商银行	35,813,859.92	
8	600125	铁龙物流	34,988,271.47	
9	601088	中国神华	32,698,557.04	
10	600019	宝钢股份	32,512,924.61	
11	600104	上海汽车	30,966,829.69	
12	600048	保利地产	30,119,910.80	
13	002024	苏宁电器	29,936,340.78	
14	000063	中兴通讯	29,448,902.11	
15	600068	葛洲坝	29,393,159.99	
16	002038	双鹭药业	28,544,307.31	
17	600585	海螺水泥	26,285,743.62	
18	600581	八一钢铁	25,499,927.51	
19	000829	天音控股	24,729,215.82	
20	600030	中信证券	24,322,530.53	

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

				金额里位:人民市
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	600900	长江电力	76,179,175.53	5.65
2	600585	海螺水泥	55,442,027.87	4.11
3	600587	新华医疗	55,282,184.24	4.10
4	000651	格力电器	54,910,455.97	4.07
5	601299	中国北车	48,234,759.83	3.58
6	600875	东方电气	46,424,888.95	3.44
7	601888	中国国旅	37,543,298.08	2.78
8	601607	上海医药	37,539,274.66	2.78
9	000425	徐工机械	35,180,194.63	2.61
10	600068	葛洲坝	34,643,304.20	2.57
11	600887	伊利股份	33,810,490.62	2.51
12	002238	天威视讯	32,359,123.06	2.40
13	000937	冀中能源	31,497,592.51	2.33
14	000811	烟台冰轮	29,365,306.60	2.18
15	600019	宝钢股份	28,475,444.98	2.11
16	601318	中国平安	28,014,062.14	2.08
17	600581	八一钢铁	27,104,370.15	2.01
18	601088	中国神华	26,852,011.31	1.99
19	600690	青岛海尔	25,340,561.52	1.88
20	000983	西山煤电	24,957,903.95	1.85
注, 本=	主 张期更计泰山会	·媚"炫赤山武赤今媚。	はな角仏張口 むな粉具 精利 不	老虎相关亦且患

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

1,610,292,927.80

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。

7.3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

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。 7.91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。 7.92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 期末其他各项资产构成 单位:人民币5

58,334.6 1,508,665.88

7.9.4 期末抒有的处工转旋期的归转积顷新时期 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 分项之和与合计可能存在尾差 由于四舍五人原因,投资组合报告中,市值

81期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份 持有份額

8 基金份额持有人信息

坝目		符有份額忌数(份)	占基並尽份額比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金		469,306.35	0.0404%
	9 开放式基	金份额变动	
			单位:6
基金合同生效日(2009年6月24日)基金份額息	急額		2,885,554,241.41
本报告期期初基金份額总額			1,126,878,876.63
本报告期基金总申购份额			183,943,100.54
减:本报告期基金总赎回份額			149,552,375.42

10 重大事件揭示

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
2011年5月11日、经股东会审议批准、Mark McCombe 先生不再担任本公司董事,由 John Flint 先生
继任本公司董事。李选进先生不再担任本公司董事,由 Joanna Munro 女士继任本公司董事。
2011年7月23日、基金管理人发布公告、经公司董事会审议通过,并报中国证监会核准,聘任王立
荣先生担任本公司副总经理。
据生期由,本公司董师等组从是有社会公司本发生不能正常服务和来的结构。

荣先生担任本公司副总经理。 报告期内,本公司高级管理人及和公告、经公司重事妥单以助过、升报中国证益妥核准、构任土立 报告期内,本公司高级管理人员和基金经理未发生不能正常履行职责的情况。 本报告期内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 本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。 10.4 基金投资策略的改变。 本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况。 本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。自本基金募集以来,毕马威华振会计师事务所有限公司一直为本基金提供审计服务。 10.6 管理人,托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况 本基金本报告期内,基金管理人及支高资管理/局未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。 本报告期内托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。 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的有关情况

10.7.1 2532	L/111L/3/ Z/ -1/2/33-	+76211107612302	V1177571111	NOC.	金额单位:	人民币
		股票交易		应支付该券	备注	
券商名称	交易单元数量	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	
东方证券	1	-	-	-	-	
中投证券	1	321,476,354.62	9.98%	261,200.93	9.66%	
中金公司	1	-	-	-	-	
中银证券	1	388,392,938.37	12.05%	315,571.34	11.68%	
光大证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	765,054,133.84	23.74%	650,296.12	24.06%	
华泰联合	1	66,941,484.88	2.08%	56,899.80	2.11%	
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	352,933,385.06	10.95%	299,990.79	11.10%	-
招商证券	1	210,369,013.80	6.53%	170,925.96	6.32%	
海通证券	1	47,694,004.00	1.48%	38,751.49	1.43%	
申银万国	1	1,069,690,185.25	33.19%	909,232.12	33.64%	-

全班 1 1,000,000,103.03 33.19% 907,03.1.1 35.00% 全班 1 1,000,000,103.03 100,00% 2,702,868.65 100,00% 注:1.在报告期内,本基金新增的交易单元为;安信证券深圳交易单元,国金证券深圳交易单元,各公司上海交易单元,光大证券上海交易单元,兴业证券上海交易单元。2.专用交易单元的证券经营机构的选择标准和程序 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

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 □实力越厚,信誉良好; □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; □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; □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; □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; □研究报告的数量和质量; □提供研究服务的主对性; □提供研究服务的互对性; □其他可评价的考核标准。

金额单位:人民币元

□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

- - - - -	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	占当期回购成 交总额的比例 - - -	成交金額	占当期权证成交的
= - -	_ _ _		- - -	- - -	-
- -	-	- - -	- -		
-	-	- -	-	-	
-		-	-	-	
	-	-			
_			-	-	-
	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
	- - - - -				

传播与文化

金额单位:人民币元