

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

2017 第二季度报告

2017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：2017年7月20日

1.1 重要提示
 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。
 基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2017年7月13日发布了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证该等信息不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
 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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。
 本报告中财务资料截止于2017年6月30日。
 本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信龙腾
基金代码	000903
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
报告期末基金份额总额	206,719,271.21份
报告期末基金份额持有人户数	10,922户
报告期末基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	99.99%

1.3 主要财务指标和基金净值表现

注：自2017年8月1日起，本基金更名为“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”，基金简称变更为“汇丰晋信龙腾混合”，基金投资策略比例不变。

代码	名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
A	汇丰晋信龙腾	76,620,131.39	3.70
B	债券	471,361,200.29	22.37
C	货币	30,110,226.26	1.45
D	资产支持证券	49,692,524.24	2.38
E	其他	26,333,308.28	1.25
G	交易保证金	21,647,608.12	1.04
H	应收利息	18,279,123.28	0.88
I	预收账款	1,000,000.00	0.05
J	应付利息	1,000,000.00	0.05
K	应付债券	1,712,026.04	0.08
L	其他应付款	3,414,619.09	0.16
M	其他	1,000,000.00	0.05
N	资产减值准备	203,203.26	0.01
O	其他	1,000,000.00	0.05
P	其他	1,000,000.00	0.05
Q	其他	1,000,000.00	0.05
R	其他	1,000,000.00	0.05
S	其他	1,000,000.00	0.05
T	其他	1,000,000.00	0.05
合计		1,563,649,613.13	74.95

5.1 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%	公允价值占净值比例%
1	000001	平安银行	7,776,116	0.37	0.37
2	000111	中国银行	7,442,467	0.36	0.36
3	000025	招商证券	5,666,667	0.27	0.27
4	000002	万科A	4,295,267	0.20	0.20
5	000033	荣信股份	4,000,000	0.19	0.19
6	000024	招商证券	3,200,000	0.15	0.15
7	000001	平安银行	3,200,000	0.15	0.15
8	000001	平安银行	3,200,000	0.15	0.15
9	000001	平安银行	3,200,000	0.15	0.15
10	000001	平安银行	3,200,000	0.15	0.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	国债	1,000,000	0.05
2	地方政府债	1,000,000	0.05
3	金融债	1,000,000	0.05
4	企业债	1,000,000	0.05
5	其他	1,000,000	0.05

5.5 报告期末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

序号	债券名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	170001	170001	500,000
2	170002	170002	500,000
3	170003	170003	500,000
4	170004	170004	500,000
5	170005	170005	500,000

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.7 报告期末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

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.9 报告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指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细

序号	国债期货名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	公允价值占净值比例%
1	1	1,000,000	0.05
2	2	1,000,000	0.05
3	3	1,000,000	0.05
4	4	1,000,000	0.05
5	5	1,000,000	0.05

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号
