

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

【2011】第二季度报告

比较
汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益的历史走势对比图
Q009年12月11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,将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场,具有良好成长性且基本面良好的中小上市公司股票。本基金固定收益类资产的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2010年6月11日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的范围。

2.报告期内本基金业绩比较基准=中证700(中小盘)指数×90%+同期存款利率×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内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中证700指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
廖志峰	本基金基金经理、汇丰晋信龙股票型证券投资基金基金经理	2011-2-26	-	9年	廖志峰先生,香港大学工商管理硕士,具备基金从业资格,曾任上海南汇证券研究所研究员,2005年10月起任汇丰晋信基金管理有限公司研究员,2007年10月加入汇丰晋信基金管理有限公司,现任汇丰晋信龙股票型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期为本基金公告人公告廖志峰先生担任本基金基金经理的日期;

2.基金经理为证券投资基金的工作经历年限。

3.2.2 基金经理人对报告期内基金运作遵信情况的说明

本报告期内,本基金管理人秉承诚信信用、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。本报告期内,本基金未发生任何异常交易行为。

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

4.1.2 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

4.1.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

4.1.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

4.1.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	538,249,792.37	89.19
2	其中:股票	538,249,792.37	89.19
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	63,448,344.21	10.51
10	其他各项资产	1,802,074.59	0.30
11	合计	603,500,211.17	100.00

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	6,001,363.12	1.00
B	采掘业	11,802,372.72	1.97
C	制造业	273,189,411.69	45.52
C1	食品、饮料	24,320,103.60	4.05
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	36,115,543.22	6.02
C6	金属、非金属	71,471,542.79	11.91
C7	机械、设备、仪表	84,784,322.95	14.13
C8	医药、生物制品	44,358,574.13	7.39
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应	2,792,607.84	0.47
E	建筑业	25,839,919.56	4.31
F	交通运输、仓储业	36,373,294.59	6.06
G	信息技术业	23,275,518.88	3.90
H	批发和零售贸易	137,838,852.58	22.89
I	金融、保险业	21,255,874.40	3.54
J	房地产业	236,300.00	0.04
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		538,249,792.37	89.69

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	6,001,363.12	1.00
B	采掘业	11,802,372.72	1.97
C	制造业	273,189,411.69	45.52
C1	食品、饮料	24,320,103.60	4.05
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	36,115,543.22	6.02
C6	金属、非金属	71,471,542.79	11.91
C7	机械、设备、仪表	84,784,322.95	14.13
C8	医药、生物制品	44,358,574.13	7.39
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应	2,792,607.84	0.47
E	建筑业	25,839,919.56	4.31
F	交通运输、仓储业	36,373,294.59	6.06
G	信息技术业	23,275,518.88	3.90
H	批发和零售贸易	137,838,852.58	22.89
I	金融、保险业	21,255,874.40	3.54
J	房地产业	236,300.00	0.04
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		538,249,792.37	89.69

5.3 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票投资明细

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	1,887,788,558.90	86.67
2	其中:股票	-	1,887,788,558.90	86.67
3	固定收益投资	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-
6	金融衍生品投资	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	-	288,856,877.52	13.26
10	其他各项资产	-	1,526,830.96	0.07
11	合计	-	2,178,172,267.38	100.00

5.4 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债券投资明细

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	85,169,787.50	3.92
B	采掘业	-	-
C	制造业	954,678,650.10	43.96
CD	食品、饮料	268,039,942.16	12.34
C1	纺织、服装、皮毛	56,384,504.70	2.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	51,581,592.76	2.38
C5	电子	41,010,180.25	1.89
C6	金属、非金属	15,969,110.88	0.74
C7	机械、设备、仪表	358,552,152.49	16.51
C8	医药、生物制品	163,161,666.86	7.51
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应	30,260,182.54	1.39
E	建筑业	39,191,829.74	1.80
F	交通运输、仓储业	87,271,321.42	4.02
G	信息技术业	125,129,981.79	5.76
H	批发和零售贸易	141,905,550.07	6.53
I	金融、保险业	267,678,110.22	12.33
J	房地产业	77,678,127.79	3.58
K	社会服务业	78,825,017.73	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		1,887,788,558.90	86.93

5.5 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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519 贵州茅台	599,475	127,466,369.25	5.87
2	600467 好当家	7,157,122	85,169,787.50	3.92
3	601601 中国太保	3,757,777	84,136,627.03	3.87
4	600587 新华医疗	2,422,925	78,333,165.25	3.61
5	600651 格力电器	2,332,643	78,317,110.95	3.61
6	600036 招商银行	4,966,915	64,669,233.30	2.98
7	002029 七匹狼	1,778,691	56,384,504.70	2.60
8	600125 铁龙物流	5,182,873	54,627,481.42	2.52
9	002038 双鹭药业	1,321,244	49,876,961.00	2.30
10	600101 格力电器	2,641,669	49,504,877.06	2.28

5.6 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,103,785.56	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收利息	-	167,657.58	-
4	应收股利	-	200,544.64	-
5	其他应收款	-	113,352.13	-
6	待摊费用	-	-	-
7	待处理资产	-	61,491.05	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,526,830.96	-

5.7 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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,103,785.56	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收利息	-	167,657.58	-
4	应收股利	-	200,544.64	-
5	其他应收款	-	113,352.13	-
6	待摊费用	-	-	-
7	待处理资产	-	61,491.05	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,526,830.96	-

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,103,785.56	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收利息	-	167,657.58	-
4	应收股利	-	200,544.64	-
5	其他应收款	-	113,352.13	-
6	待摊费用	-	-	-
7	待处理资产	-	61,491.05	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,526,830.96	-

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,103,785.56	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收利息	-	167,657.58	-
4	应收股利	-	200,544.64	-
5	其他应收款	-	113,352.13	-
6	待摊费用	-	-	-
7	待处理资产	-	61,491.05	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,526,830.96	-

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	1,103,785.56	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收利息	-	167,657.58	-
4	应收股利	-	200,544.64	-
5	其他应收款	-	113,352.13	-
6	待摊费用	-	-	-
7	待处理资产	-	61,491.05	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	1,526,830.96	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 饶基经 基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
饶基经	本基金基金经理	2010-10-20	-	5年	饶基经先生,中国人民大学经济学学士,美国波士顿大学金融与数学硕士,具备基金从业资格,曾任中国人寿保险股份有限公司投资经理,现任中国人寿保险股份有限公司投资经理,现任中国人寿保险股份有限公司投资经理。

注:1.任职日期为本基金公告人公告饶基经先生担任本基金基金经理的日期;

2.基金经理为证券投资基金的工作年限。

3.2.2 基金经理人对报告期内基金运作遵信情况的说明

本报告期内,本基金管理人秉承诚信信用、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。本报告期内,本基金未发生任何异常交易行为。

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

4.1.2 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

4.1.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

4.1.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

4.1.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

5.1.2 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

5.1.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

5.1.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

5.1.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.2 报告期末基金资产组合情况

5.2.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

5.2.2 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

5.2.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

5.2.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

5.2.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.3 报告期末基金资产组合情况

5.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

5.3.2 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

5.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

5.3.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

5.3.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.4 报告期末基金资产组合情况

5.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

5.4.2 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

5.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

5.4.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

5.4.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.5 报告期末基金资产组合情况

5.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度,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制度执行,未发现任何异常交易行为。

5.5.2 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

5.5.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

5.5.4 报告期内基金的流动性风险管理说明

5.5.5 报告期内基金资产组合情况

2011年第二季度末,本基金资产组合情况如下:

5.6 报告期末基金资产组合情况