汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2010年第1号)

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

【重要提示】

汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2008年9月26日证监许可【2008】1156号文核准募集。本基金基金合同于2008年12月3日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2009年12月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:汇丰晋信基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼
办公地址:上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼
法定代表人:杨小勇
设立日期:2005年11月16日
电话:021-38789898
联系人:周慧
注册资本:2亿元人民币

股权结构:山西信托有限责任公司持有51%的股权,HSBC Global Asset Management (UK) Limited(汇丰环球投资管理(英国)有限公司)持有49%的股权。

(二)主要人员情况

(1)董事会成员

杨小勇先生,董事长,1963年出生,硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资(集团)公司副总经理。现任山西省国信投资(集团)公司党委书记、山西信托有限责任公司副董事长和山西光信实业有限公司副董事长。

李选进先生,董事,1972年出生,硕士学历。曾任怡富证券(台湾)有限公司董事长特别助理、怡富集团(台湾)台湾区负责人特别助理、电子商务部经理、怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监和汇丰投资管理(香港)有限公司董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管。

李永清先生,董事,1955年出生,硕士学历。曾任山西新华印刷厂财务科科长、总会计师、山西新闻出版局财务处副处长、山西省信托投资公司房地产开发部副经理、房地产部副主任、投资实业总部监理。现任山西信托有限责任公司副总经理。

Mr. Mark Seumas MCCOMBE,董事,1966年出生,1987年毕业于Aberdeen大学。曾任汇丰私人银行(法国)行政总裁、汇丰投资管理(英国)有限公司董事、汇丰银行(土耳其)副行政总裁、汇丰私人银行(英国、海峡群岛和卢森堡)行政总裁。现任汇丰集团投资管理业务行政总裁。

常修泽先生,独立董事,1945年出生。曾任南开大学经济研究所教授、副所长、国家计委经济研究所常务副所长、教授和博士研究生导师。现任国家发改委经济研究所教授和博士研究生导师。

叶林先生,独立董事,1963年出生,博士学历。现任中国人民大学法学院法学教授和博士研究生导师。

Mr. Alan Howard SMITH,独立董事,1943年出生,本科学历。曾任怡富控股有限公司董事、董事总经理和董事长、瑞士信贷第一波士顿副董事长。现任金威啤酒集团有限公司独立非执行董事。

(2)监事会成员基本情况:

任宏伟先生,监事,1952年出生,硕士学历。曾任山西省信托投资公司计划财务部经理。现任山西省国信投资(集团)公司财务总监兼计划财务部经理。

Mr. Rudolf Apenbrink,监事,1963年出生,博士学历。曾任汇丰银行(香港)固定收益销售部董事、汇丰银行(伦敦)固定收益销售部董事、汇丰投资(德国)固定收益资产管理主管、汇丰投资(德国)经理董事和汇丰投资管理(德国)首席执行官,现任汇丰投资管理亚太区首席执行官。

王栋先生,监事,1974年出生,硕士学历,CFA(特许金融分析师)。曾任汇丰环球投资管理(香港)有限公司亚太区企业拓展经理、汇丰晋信基金管理有限公司财务总监,现任汇丰晋信基金管理有限公司特别项目总监。

(3)总经理及其他高级管理人员基本情况:

李选进先生,总经理,1972年出生,硕士学历。曾任怡富证券(台湾)有限公司董事长特别助理、怡富集团(台湾)台湾区负责人特别助理、电子商务部经理、怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监和汇丰投资管理(香港)有限公司董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管。

闫太平先生,副总经理,1959年出生,本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托投资有限责任公司副处长、国际金融部经理。

李毅先生,副总经理,1972年出生,硕士学历。曾任中国国际期货经纪有限公司客户经理、中国证券监督管理委员会副处长。

赵隽扬先生,督察长,1962年出生,硕士学历。曾任渣打银行上海分行业务主任、荷兰银行上海分行财务总监、瑞士信贷第一波士顿银行股份有限公司上海分行合规主管。

(4)本基金基金经理

朱文辉先生,1970年出生,清华大学工商管理硕士,特许金融分析师(CFA)。历任中国平安保险公司集团投资管理中心债券研究员、东方人寿保险股份公司投资部债券投资经理和生命人寿保险股份有限公司资产管理部助理总经理。2006年1月任汇丰晋信基金管理有限公司债券投资经理,现任汇丰晋信基金固定收益副总监兼汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。

(5)投资委员会成员的姓名和职务

李选进,总经理;林彤彤,首席投资官;曹庆,研究副总监;朱文辉,固定收益副总监;孙宇,交易总监。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

(6)上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:胡怀邦
住所:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:489.94亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:张咏东
电话:021-68888917

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

(1)直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心
地址:上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼
电话:021-68596998
传真:021-68881922
联系人:薛蓓
客户服务中心电话:021-38789998
公司网址:www.hsbcjt.cn
汇丰晋信基金电子交易平台
网址:https://etrading.hsbcjt.cn/
联系人:薛蓓
电话:021-38789898*6659

(2)代销机构

●交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
联系人:曹榕
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

●中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
联系人:尹东
传真:010-66218888
网址:www.ccb.com

●中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:010-66106912
传真:021-66107914
联系人:田耕
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

●中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
传真:(010)85109219
联系人:蒋浩
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

●招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83195834,82090060
传真:(0755)83195049,82090817
联系人:刘薇
客户服务热线:95555
网址:www.cmbchina.com

●上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:倪苏云、汤嘉惠
联系电话:021-63296188-82438、82410
客户服务电话:95528,021-63298615
网址:www.spdb.com.cn

●中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
联系人:王斌
联系电话:010-65541585
客服电话:95558(全国)
网址:www.ecitic.com

●中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:唐双宁
电话:010-68098778
传真:010-68560661
联系人:李伟
客服电话:95595(全国)
网址:www.cebbank.com

●中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘安东
电话:11185
传真:010-66415194
联系人:陈春林
网址:www.psbc.com

●中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-58351666
传真:010-83914283
联系人:李群
客户服务热线:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

●深圳平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:黄立哲
客户服务电话:40066-99999
网址:www.18ebank.com

●华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:翟鸿祥
电话:010-85238423
传真:010-85238680
联系人:陈宇
客户服务电话95577
公司网站:www.hxb.com.cn

●宁波银行股份有限公司
注册地址:浙江省宁波市中山东路294号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:96528(上海地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

●山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:张治国
联系电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

●国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
联系电话:021-62580818-213
传真:021-62569400
客服电话:400-8888-666
联系人:芮敏祺
网址:www.gtja.com

●申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
联系人:黄维琳
客户服务电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

●中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:4008888108
传真:010-65182261
联系人:权唐
网址:http://www.csc108.com

●中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:肖时庆
电话:010-66568888
传真:010-66568536
联系人:李洋
客服电话:4008-888-888
网址:http://www.chinastock.com.cn

●海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021-53594566
传真:021-53858549
客户服务电话:4008888001,021-962503
联系人:金芸
网址:www.htsec.com

●招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943511
传真:0755-82943237
联系人:黄健
网址:www.newone.com.cn

●兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:0591-87613888
传真:0591-87546058
客户服务电话:0591-87547101
联系人:杨胜芳
网址:www.xyzq.com.cn

●光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人:王明权
电话:021-68816000
联系人:刘晨
客户服务电话:021-68823685
网址:www.ebscn.com

●国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:胡继之
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
客户服务电话:8008108868
联系人:林建闽
网址:www.guosen.com.cn

●中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507至1510室)
法定代表人:史洁民
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁韶燕
客服电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn

●国元证券股份有限公司
注册地址:合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客服电话:4008-888-777
公司网址:www.gyzq.com.cn

●中国国际金融有限公司
注册地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:李剑阁
客服电话:010-65051166
公司网址:www.cicc.com.cn

(二)登记结算机构

名称:汇丰晋信基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼
法定代表人:杨小勇
联系人:赵琳
联系电话:021-38789992

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所
住所:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:萧伟强
联系电话:010-8518 5000
传真电话:010-8518 5111
经办注册会计师:王国蓓、黄小熠
联系人:彭成初

四、基金的名称

汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金。

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下,获取债券的利息收入及价差收益。通过参与股票一级市场投资,获取新股发行收益,为投资者谋取稳定的当期收益与较高的长期投资回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中股票投资仅限于参与新股认购和可转债转股获得的股票,权证投资仅限于参与可分离转债申购而获得的权证,即本基金不从二级市场购买股票或权证。

本基金通过新股认购策略所认购新发行股票在上市首日择机卖出,所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过10个交易日,通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种,包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等,投资比例不低于基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在对企业债券进行信用评级的基础上,综合考量企业债券(含公司债、企业短期融资券)的信用评级以及包括其它券种在内的债券流动性、供求关系、收益率水平等因素,自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套利操作、新股认购等策略,提高投资组合收益。

(1)资产配置策略

本基金从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利息的预期)出发,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,通过深入研究和分析中国国民经济的增长、利率和汇率政策的调整、上市公司总体和各个行业的盈利变化趋势,结合定性分析和定量分析,形成对不同类属市场的预测和判断,确定债权类证券、股权类证券和货币市场工具的配置比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整类属资产的投资比例,以规避或控制市场风险,提高资金收益率。

资产配置流程如下:

(2)久期管理策略

久期管理策略是债券型基金最基本的投资策略。久期管理策略在本质上是一种自上而下的策略,其目的在于通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利息的预期)出发,本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政、货币政策变化做出判断,密切跟踪CPI、PPI、汇率、M2等利率敏感指标,运用数量化工具,对未来市场利率趋势进行分析与预测,并据此确定合理的债券组合久期。

具体而言,基金管理人通过以下三个方面的分析来确定实际投资中债券组合的目标久期:

1)宏观经济环境分析:通过对宏观经济数据如月度、季度进出口增长率、消费增长率、投资增长率等的跟踪与分析,预测宏观经济运行趋势,合理预期当前经济运行在经济周期中所处的阶段;针对当前的经济运行存在的问题,合理预期中央政府的财政与货币政策取向以及当前利率在利率周期中所处的阶段。

2)市场利率变动趋势分析:基于利率周期运行阶段的预期,密切关注月度CPI、PPI等物价指数、准备金比率、货币供应量、信贷、汇率等金融运行数据、投资、贸易顺差、工业增加值等实体经济运行数据以及就业数据等等央行货币政策所监控的目标数据的变化,预测法定利率在时间与空间上的变动与趋势。根据法定利率的变化,分析投资人心理与市场供求关系以及流动性等的变化,合理预期市场利率、债券收益率在时间与空间上的可能变动。

3)目标久期分析:根据法定利率与市场利率的变动趋势、所处利率周期的阶段,结合当期的债券收益率水平,确定组合目标久期。基本原则为,在利率上行通道中,通过缩短目标久期规避利率风险;在利率下行通道中,通过延长目标久期分享债券价格上涨的收益。

(3)品种选择策略

综合考虑收益性、流动性和风险性,进行主动性的品种选择,主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会,增加盈利性、控制风险等等,以争取获得适当的超额收益,提高整体组合收益率。

(4)企业债(含公司债)投资策略

企业债投资策略是一种自上而下的利率风险管理与自下而上的信用风险管理相结合的策略,是本基金最主要的投资策略。本基金所指企业债券,包括公司债和企业短期融资券。

本基金通过宏观经济运行、企业发展前景、企业偿债能力、建设项目质量等多重因素的综合考量对企业债券进行信用评级,并在信用评级的基础上,建立企业债债券池;然后基于既定的目标久期、信用利差精选个券进行投资。

具体而言,主要通过以下三个步骤来对企业债券进行投资管理:

1)信用评级分析:建立企业债券的信用评级指标体系,通过综合信用评级确定企业债信用特征。

2)公司基本面分析:投资部对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析,并结合实际调研结果,判定并评价债券的信用程度。

3)筛选企业债券:根据信用评级分析和公司基本面分析的结果,结合第三方信用评级数据,将高信用等级的债券纳入备选债券池,基金经理可直接按流程、按权限从备选债券池中选择债券进行投资。备选债券池外债券,需经投资决策委员会决定方可进行投资。

(5)可转换债券的投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种,兼具股性和债性的双重特征。一方面,通过投资部可转换债券对应标的股票的研究,判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系,对目标转债的股性进行合理定价。另一方面,同通过对可转换债券债性的研究,结合可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级,考量其合理定价区间。力求选择被市场低估的品种,来构建本基金可转换债券的投资组合。

(6)资产支持证券的投资策略

通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化;通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略,并估计违约率和提前偿付比率,对资产支持证券进行估值。将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(7)股票投资策略:

本基金持有股票余额合计不超过基金资产净值的20%。

1)新股认购策略

本基金将主动参与股票一级市场投资,但本基金认为股票一、二级市场之间存在一定的价差是暂时现象,因此,新股认购策略只是一种阶段性投资策略。

本基金将通过分析影响股票一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化、股票发行政策取向(如扩容节奏、发行市盈率与二级市场市盈率的差距),预测新股一级市场供求关系的变化,并据此进一步预测认购新股中签率和新股的收益率变动趋势;同时,借助公司投资平台行业研究员的研究建议,预测拟认购新股的中签率和认购收益率,确定合理规模的资金、精选个股认购,实现新股认购收益率的最大化。

本基金通过新股认购策略所认购新发行股票在上市首日择机卖出。

2)可转换债券转股策略

本基金在进行可转换债券投资时,面对可能出现可转换债券与正股之间存在套利机会的现象或者出现可转换债券流动性暂时不足的现象,采用可转换债券转股策略,即将持有的可转换债券在转换期内转股抛售,以更好的保护基金投资人利益、实现基金可转换债券投资收益最大化。

本基金通过所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过10个交易日。

3)权证投资策略

本基金通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

权证投资策略主要包括以下几个方面:

本基金将综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

本基金将根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理内在价值的考量,决定卖出策略及价格区间。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中信标普全债指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金产品,在开放式基金中,风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币基金和中短债基金,属于中低风险的产品。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资组合报告的报告期为2009年7月1日起至2009年9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

(1)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	386,575,566.30	90.70
	其中:债券	386,575,566.30	90.70
	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	35,651,905.28	8.36
6	其他资产	3,992,713.76	0.94
7	合计	426,220,185.34	100.00

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(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

本基金本报告期末未持有股票。

(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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,319,040.00	5.53
2	央行票据	255,216,000.00	60.50
3	金融债券	49,890,000.00	11.83
	其中:政策性金融债	49,890,000.00	11.83
4	企业债券	21,779,999.00	5.16
5	企业短期融资券	20,056,000.00	4.75
6	可转债	16,314,527.30	3.87
7	其他	-	-
8	合计	386,575,566.30	91.63

(5)报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080225	08国开25	500,000	49,890,000.00	11.83
2	0901037	09央票37	300,000	29,901,000.00	7.09
3	0901034	09央票34	300,000	29,493,000.00	6.99
4	0901040	09央票40	300,000	29,487,000.00	6.99
5	0901046	09央票46	300,000	29,478,000.00	6.99

(6)报告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)报告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。

(8)投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	240,158.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,689,243.48
5	应收申购款	63,312.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,992,713.76

8.4 报告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。

8.5 报告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。

8.6 其他需说明的重要事项

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。

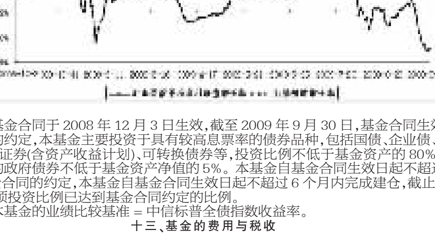
十二、基金的业绩

本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。

(一)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
2008/12/3-2008/12/31	1.00%	0.12%	1.60%	0.07%	-0.60%	0.05%
2009/1/1-2009/6/30	-0.99%	0.12%	0.42%	0.08%	-1.41%	0.04%

(二)基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:

1.本基金的基金合同于2008年12月3日生效,截至2009年9月30日,基金合同生效未满1年。

2.按照基金合同的约定,本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种,包括国债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等,投资比例不低于基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。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6月3日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

3.报告期内本基金的业绩比较基准 = 中信标普全债指数收益率。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金的证券交易费用;
(4)基金合同生效以后的信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的年管理费率为0.60%。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费

本基金的年托管费率为0.20%。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)本条第(一)款第(3)至第(7)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

(五)其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定,基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用,并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

(六)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

(一)对“三、基金管理人”中的基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。
(二)对“四、基金托管人”的基本情况、主要人员情况和基金托管业务经营情况进行了更新。
(三)更新了“五、相关服务机构”的有关信息。
(四)在“十三、基金的投资”中增加了基金投资组合报告(报告期:2009年7月1日起至2009年9月30日)。
(五)在“十四、基金的业绩”中增加了自基金合同生效日起至2009年9月30日止的基金业绩表现数据。
(六)在“二十六、其他应披露事项”中披露了自2009年6月4日至2009年12月3日以来涉及本基金的相关公告。

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一〇年一月七日

证券代码:600816　　股票简称:安信信托　　编号:临2010-001

安信信托投资股份有限公司
关于召开2010年第一次临时股东大会的二次通知

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本公司曾于2009年12月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、上海证券交易所网站上刊登了关于召开2010年第一次临时股东大会的通知,由于本次股东大会将通过上海证券交易所交易系统向社会公众股股东提供网络形式的投票平台,根据中国证监会《关于加强社会公众股股东权益保护的若干规定》的要求,现再次公告股东大会通知。

重要内容提示:

● 会议召开时间

现场会议召开时间2010年1月8日下午14:00,网络投票时间为当日上午9点30分至11点30分、下午13点至15点。

● 会议召开地点

上海肇嘉浜路777号东安路8号青松城大酒店三楼黄山厅。

●会议方式

本次会议采取现场投票与网络投票相结合的方式,无限售条件的流通股股东可以在交易时间内通过上海证券交易所的交易系统行使表决权。

●重大提案

1、关于安信信托向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售方案有效期延期一年的议案
2、关于提请股东大会授权董事会全权办理本次向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售相关事项的议案
3、关于续聘立信会计师事务所有限公司为2009年度审计机构的议案
4、关于选举公司监事的议案
5、安信信托投资股份有限公司关联交易制度的议案
6、安信信托投资股份有限公司担保制度的议案

一、召开会议基本情况

根据公司2009年12月22日第六届董事会第六次会议决议,公司决定召开2010年第一次临时股东大会。公司董事会为会议的召集人,本次会议采取现场和网络投票相结合的表决的方式召开。

二、本次股东大会审议的提案及其对应的网络投票表决序号

1、关于安信信托向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售方案有效期延期一年的议案
2、关于提请股东大会授权董事会全权办理本次向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售相关事项的议案
3、关于续聘立信会计师事务所有限公司为2009年度审计机构的议案
4、关于选举公司监事的议案
5、安信信托投资股份有限公司关联交易制度的议案
6、安信信托投资股份有限公司担保制度的议案

三、会议出席对象

1、本次股东大会的股权登记日为2010年1月6日。截至股权登记日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的所有股东均有权参加本次股东大会;在上述日期登记在册的所有A股股东均有权在规定的交易时间内参加网络投票。

2、因故不能出席会议的股东可以委托代理人出席(授权委托书格式附后);

3、本公司的董事、监事及高级管理人员。

四、会议登记方法

1、登记时间:2010年1月7日,上午9:00-11:30,下午1:00-4:00
2、登记地点:上海广东路689号海通证券大厦29层
3、登记方式:

⑴符合条件的个人股东持股东账户卡、身份证,授权委托代理人还应持授权委托书(授权委托书见附件2)、本人身份证、委托人股东账户卡办理登记手续。

⑵符合条件的法人股东之法定代表人持本人身份证、法定代表人证明书、法人股东账户卡、营业执照复印件办理登记手续,或由授权委托代理人持本人身份证、法人代表授权委托书、法人代表证明书、法人股东账户卡、营业执照复印件办理登记手续。

五、无限售条件的流通股股东参加网络投票的具体操作流程

无限售条件的流通股股东进行网络投票类似于买卖股票,其具体投票流程详见附件1。

六、相关说明

1、同一股份只能选择一种表决方式。同一股份通过现场、网络或其他方式重复进行表决的,以第一次投票结果为准。

七、其他

出席本次现场会议者食宿、交通费用自理,会期半天。
联系地点:上海市广东路689号海通证券大厦29层
联系电话:021-63410710　　邮政编码:200001
传　真:021-63410712　　联系人:尚俊萍

特此公告。

安信信托投资股份有限公司
二〇一〇年一月七日

附件1:

投资者参加网络投票的操作流程

一、投票流程

1、投票代码

沪市挂牌投票代码	沪市挂牌投票简称	表决议案数量	说明
738816	安信投票	6	A股

2、表决议案

议案序号	议案内容	对应的申报价格
1	关于安信信托向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售方案有效期延期一年的议案	1元
2	关于提请股东大会授权董事会全权办理本次向特定对象发行股份购买资产暨重大资产出售相关事项的议案	2元
3	关于续聘立信会计师事务所有限公司为2009年度审计机构的议案	3元
4	关于选举公司监事的议案	4元
5	安信信托投资股份有限公司关联交易制度的议案	5元
6	安信信托投资股份有限公司担保制度的议案	6元

3、表决意见

表决意见种类	对应的申报股数
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

二、投票举例

1、股权登记日持有“安信信托”A股的投资者对该公司的议案投同意票,其申报如下:

投票代码	买卖方向	申报价格	申报股数
738816	买入	1元	1股

如某投资者对该公司的议案投了反对票,只要将申报股数改为2股,其他申报内容相同。

投票代码	买卖方向	申报价格	申报股数
738816	买入	1元	2股

三、投票注意事项

1、可以按照任意次序对各议案进行表决申报,表决申报不得撤单。
2、对同一议案不能多次进行表决申报,多次申报的,以第一次申报为准。
3、对不符合上述要求的申报将作为无效申报,不纳入表决统计。

附件2:授权委托书(剪报及复印均有效)

授权委托书

兹全权委托　　　　先生(女士)代表我单位(个人)出席安信信托投资股份有限公司2010年第一次临时股东大会,并代为行使表决权。

委托人姓名:　　　　委托人身份证号码:
委托人持股数:　　　委托人股东账号:
代理人签名:　　　　代理人身份证号码:
委托日期:

鹏华基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)代销机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与信达证券股份有限公司(以下简称“信达证券”)签署的《开放式基金销售和服务代理协议》,信达证券将代理本公司旗下鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)(基金代码160616)的销售业务。

自2010年1月7日起,投资者通过信达证券在以下29个主要城市的54家营业网点办理本基金的账户开户和交易等业务:北京、上海、深圳、广州、沈阳、成都、杭州、天津、蚌埠、佛山、茂名、湛江、海口、常州、南京、本溪、朝阳、大连、丹东、阜新、葫芦岛、辽阳、盘锦、铁岭、营口、宽甸、东港、兴城、凌源等。

投资者可通过以下途径咨询有关情况:

1、信达证券股份有限公司
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
2、鹏华基金管理有限公司
客户服务热线:0755-82353668,400-6788-999(免长途话费)
公司网站:www.phfund.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2010年1月7日

鹏华基金管理有限公司关于增加部分证券公司为鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)代销机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与东海证券有限责任公司(以下简称“东海证券”)、国金证券股份有限公司(以下简称“国金证券”)、浙商证券有限责任公司(以下简称“浙商证券”)、华安证券有限责任公司(以下简称“华安证券”)签署的《开放式基金销售和服务代理协议》,自2010年1月8日起,上述四家机构将代理本公司旗下鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)(基金代码160616)的销售业务。

投资者可通过以下途径咨询有关情况:

1、东海证券
客服电话:4008888588
公司网址:www.longone.com.cn
2、国金证券
客服电话:4006600109
公司网址:www.gjzq.com.cn
3、浙商证券
客服电话:0571-87901963
公司网址:www.stocke.com
4、华安证券
客服电话:4008096518、96518
公司网址:www.hazq.com
5、鹏华基金管理有限公司
客户服务热线:0755-82353668,400-6788-999(免长途话费)
公司网站:www.phfund.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2010年1月7日

关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金继续参与湘财证券有限责任公司网上定期定额申购费率优惠活动的公告

为满足广大投资者的理财需求,鼓励基金投资者树立长期投资理念,经鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")与湘财证券有限责任公司(以下简称"湘财证券")协商一致,决定继续参与湘财证券网上交易系统定期定额申购费率优惠活动。自2010年1月8日起,对通过湘财证券网上交易系统定期定额申购本公司旗下部分开放式基金的投资者给予前端费率优惠。现将具体事项公告如下:

一、适用投资者范围

通过湘财证券网上交易系统定期定额申购本公司旗下下述基金的合法投资者。

二、适用基金

1、鹏华普天系列开放式证券投资基金(包括:普天债券基金A类份额,基金代码160602;普天收益基金,基金代码160603)
2、鹏华中国50开放式证券投资基金(基金代码160605)
3、鹏华价值优势股票型证券投资基金LOF(基金代码160607)
4、鹏华动力增长混合型证券投资基金LOF(基金代码160610)
5、鹏华优质治理股票型证券投资基金LOF(基金代码160611)
6、鹏华丰收债券型证券投资基金(基金代码160612)
7、鹏华盛世创新股票型证券投资基金LOF(基金代码160613)
8、鹏华沪深300指数证券投资基金LOF(基金代码160615)
9、鹏华行业成长证券投资基金(基金代码206001)
10、鹏华精选成长股票型证券投资基金(基金代码206002)

三、优惠费率措施

投资者通过湘财证券网上交易系统定期定额申购上述适用基金,其申购费率享有如下优惠:原申购费率高于0.6%的,最低优惠至0.6%,且不低于原费率的四折;原申购费率低于或等于0.6%或为固定金额的,则按原费率执行。优惠活动详情请参见湘财证券的相关公告或宣传资料。

四、重要提示

1、本次优惠活动期间,业务办理的具体流程及业务细则等以湘财证券受理网点的安排和规定为准。定期定额投资的划款金额、划款时间及划款方式等具体事项由投资者与湘财证券通过协议形式进行约定。

2、当发生限制申购或暂停申购的情形时,定期定额投资业务申购亦可按照与日常申购相同的方式处理(例如同时限制或暂停申购),基金管理人与代销机构将不承担违约责任,请投资者详阅相关公告的规定。

3、本次优惠活动不适用于除上述基金使用湘财证券网上交易定期定额业务外的其它日常申购业务。

4、基金定投最低申购金额不低于人民币200元。投资者在办理相关基金定期定额投资业务的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。

5、具体各基金优惠前的申购费率参见相关《基金合同》、《招募说明书》及最新业务公告。

五、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况:

1、湘财证券有限责任公司(网址及客户服务电话:www.xcsc.com　400-888-1551)及其各营业部
2、鹏华基金管理有限公司(网址及客户服务电话:www.phfund.com.cn　400-6788-999(免长途通话费用))

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资人应充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品进行投资。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2010年1月7日

鹏华基金管理有限公司关于增加广发银行为鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)代销机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与广东发展银行股份有限公司(以下简称“广发银行”)签署的销售代理协议,自2010年1月7日起,

广发银行将增加代理本公司旗下鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)(基金代码160616)的销售业务。

投资者可在广发银行设在北京、上海、广州、杭州、宁波、温州、南京、无锡、大连、沈阳、大庆、郑州、昆明、武汉、深圳、珠海、汕头、东莞、佛山、江门、中山、惠州、肇庆、梅州、湛江、茂名、清远、河源等28个城市的493家营业网点为投资者办理开户、认购等基金相关业务。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

一、广东发展银行股份有限公司
注册地址:广州市农林下路83号
客服电话:95508
电话:020-87310888
网址:www.gdb.com.cn
二、鹏华基金管理有限公司
客户服务中心电话:400-6788-999或0755-82353668
网址:www.phfund.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2010年1月7日