

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金 2008 年半年度报告摘要

(上续 C73 页)
于 2008 年 6 月 30 日,本基金因认购首发或增发证券而于期末持有的流通受限股票列示如下:

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 成功认购日, 可流通日, 限售类型, 认购价格, 期末成本, 数量, 期末成本总额, 期末估值总额

(注: 1) 2008 年 6 月 30 日, 本基金持有的暂时停牌股票列示如下:

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值总额, 复牌日期, 复牌参考价格, 数量, 期末成本总额, 期末估值总额

(2) 流通转让受到限制的债券
本基金本期末未有流通转让受到限制的债券。
(4) 流通转让受到限制的权证
本基金本期末未有流通转让受到限制的权证。

22. 风险管理
本基金金融工具的风险主要包括:

- 信用风险
利率风险
流动性风险
操作风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可能的管理手段及信息系统持续控制上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的, 由风险控制委员会、风险管理部、和相关职能部门构成的多层次风险管理架构体系。

(1) 信用风险
信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

(2) 流动性风险
流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难, 另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求, 并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析。

(3) 利率风险
利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

(4) 操作风险
操作风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求, 并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析。

(5) 基金估值
基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

基金估值是指基金管理人按照一定的估值方法对基金资产进行估值, 以确定基金资产净值的过程。

Table with columns: 其他负债, 负债总计, 利率敏感性缺口

于 2008 年 6 月 30 日, 若市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变, 本基金资产净值将不发生变动(2007 年: 不发生变动); 反之, 若市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变, 本基金资产净值将不发生变动(2007 年: 不发生变动)。

(4) 市场价格风险
市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 83.15%。于 2008 年 6 月 30 日, 本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

Table with columns: 公允价值, 占基金资产净值的比例

Table with columns: 公允价值, 占基金资产净值的比例

于 2008 年 6 月 30 日, 若本基金的业绩比较基准(见附注 1)的公允价值上升 5% 且其他市场变量保持不变, 本基金资产净值将相应增加约 90,933,075.53 元(2007 年 106,298,458.33 元); 反之, 若本基金的业绩比较基准(见附注 1)的公允价值下降 5% 且其他市场变量保持不变, 本基金资产净值将相应下降约 90,933,075.53 元(2007 年 106,298,458.33 元)。

六、投资组合报告
(一) 报告期末基金资产组合

Table with columns: 股票, 债券, 权证, 银行存款和清算备付金, 其他资产, 合计

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 行业分类, 股票市值(元), 占基金资产净值比例

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末数量(股), 期末市值(元), 占基金资产净值比例

投资者若了解本报告期内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有限公司网站 www.hsbcjm.com 的《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金 2008 年半年度报告》正文。

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1. 报告期末买入股票市值占基金资产净值 2% 的股票明细如下:

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额(元), 占期末基金资产净值比例

2. 报告期末卖出股票市值占基金资产净值 2% 或前二十名的股票明细如下:

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额(元), 占期末基金资产净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

(五) 本报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with columns: 债券类别, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with columns: 序号, 债券名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例

(七) 投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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。

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库之外的股票。

3. 本基金期末持有的其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 期末市值(元), 占基金资产净值比例

4. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期内获得权证的数量明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末数量(股), 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例

2. 报告期末累计卖出价值超过报告期初基金资产净值 2% 的股票明细如下:

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

4. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末本基金股权投资情况如下:

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量总计(份), 期末市值(元), 获得途径

6. 报告期内本基金未投资资产支持证券。

7. 基金持有人户数、持有人结构

Table with columns: 基金持有人户数, 机构投资者持有基金份额比例, 个人投资者持有基金份额比例

八、开放式基金费用变动

(一) 基金合同生效日(2006 年 9 月 27 日)的基金资产总额: 1,436,388,715.89 元。

Table with columns: 本报告期初, 本报告期末, 本报告期间, 本报告期末

九、重大事件提示

(一) 基金份额持有人大会: 本报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二) 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: 2008 年 3 月 4 日, 经公司董事会决议通过, 由黄铁生先生担任汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金的基金经理, 万文俊先生不再担任基金经理的职务。

(三) 基金资产净值计价错误达基金份额净值 0.5% 以上: 2008 年 3 月 5 日, 上海证监局通报了汇丰晋信 2016 生命周期基金基金经理任职/免职报告材料和万文俊先生的离任审查报告。

中欧新趋势股票型证券投资基金 (LOF) 2008 年半年度报告摘要

(上续 C75 页)
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末数量(股), 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例

(四) 报告期内本基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于中欧基金管理有限公司网站 (www.lcfunds.com) 的半年度报告正文。

(五) 报告期末买入股票市值占基金资产净值 2% 或前二十名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额(元), 占期末基金资产净值比例

(六) 报告期末卖出股票市值占基金资产净值 2% 或前二十名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额(元), 占期末基金资产净值比例

(七) 投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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。

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库之外的股票。

3. 本基金期末持有的其他资产构成

Table with columns: 序号, 项目, 期末市值(元), 占基金资产净值比例

4. 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期内获得权证的数量明细

2008 年 3 月 14 日, 中国证监会核准我公司员工李毅先生的基金行业高级管理人员任职资格, 李毅先生自该日起担任我公司副总经理的职务。

(三) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼: 本报告期无涉及及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 基金投资策略的改变: 本报告报告期内未发生基金投资策略的改变。

(五) 基金收益分配事项: 本报告期, 本基金共进行了 1 次收益分配, 情况如下:

Table with columns: 分红公告日, 权益发放起止日, 每 10 份基金份额派息金额(元), 收益分配金额

对上述分红, 本公司已于相应日期在指定的报刊和公司网站上公告。

(六) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、基金审计机构、基金会计师事务所的变更: 本报告期未发生变更。

(七) 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形: 本报告期, 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。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的情况

Table with columns: 证券公司名称, 租用席位数量, 股票交易金额(元), 占股票交易金额的比例, 佣金(元), 占佣金总额的比例

2. 报告期内租用证券公司席位进行的债券和债券回购成交金额

Table with columns: 证券公司名称, 债券成交金额(元), 占债券成交金额的比例, 债券回购成交金额(元), 占债券回购成交金额的比例

3. 报告期内租用证券公司席位进行的权证交易成交金额

Table with columns: 证券公司名称, 权证成交金额(元), 占权证成交金额的比例, 佣金(元), 占佣金总额的比例

4. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

Table with columns: 证券公司名称, 变更前/减少席位数量, 新增/减少席位数量

(九) 其他在报告期内发生的大事

2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日, 本基金管理人已在临时公告披露的报告期内发生的其他重要事项(信息披露渠道: 上海证券报、中国证券报、证券时报和汇丰晋信基金管理有限公司网站):

Table with columns: 披露日期, 公告内容

十、半年度报告备查文件目录

- 1. 中国证监会批准汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金设立的文件
2. 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同
3. 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金招募说明书
4. 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金托管协议
5. 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照
7. 基金托管人业务资格批件和营业执照
8. 报告期内汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
9. 中国证监会要求的其他文件

10. 中国证监会要求的其他文件

11. 中国证监会要求的其他文件

12. 中国证监会要求的其他文件

13. 中国证监会要求的其他文件

14. 中国证监会要求的其他文件

15. 中国证监会要求的其他文件

16. 中国证监会要求的其他文件

17. 中国证监会要求的其他文件

18. 中国证监会要求的其他文件

19. 中国证监会要求的其他文件

20. 中国证监会要求的其他文件

21. 中国证监会要求的其他文件

22. 中国证监会要求的其他文件

23. 中国证监会要求的其他文件

24. 中国证监会要求的其他文件

25. 中国证监会要求的其他文件

26. 中国证监会要求的其他文件

27. 中国证监会要求的其他文件

28. 中国证监会要求的其他文件

29. 中国证监会要求的其他文件

30. 中国证监会要求的其他文件

31. 中国证监会要求的其他文件

32. 中国证监会要求的其他文件

33. 中国证监会要求的其他文件

34. 中国证监会要求的其他文件

35. 中国证监会要求的其他文件

36. 中国证监会要求的其他文件

37. 中国证监会要求的其他文件

38. 中国证监会要求的其他文件

39. 中国证监会要求的其他文件

40. 中国证监会要求的其他文件

41. 中国证监会要求的其他文件

42. 中国证监会要求的其他文件

43. 中国证监会要求的其他文件

44. 中国证监会要求的其他文件

45. 中国证监会要求的其他文件

46. 中国证监会要求的其他文件

47. 中国证监会要求的其他文件

48. 中国证监会要求的其他文件

49. 中国证监会要求的其他文件

50. 中国证监会要求的其他文件

51. 中国证监会要求的其他文件

52. 中国证监会要求的其他文件

53. 中国证监会要求的其他文件

54. 中国证监会要求的其他文件

55. 中国证监会要求的其他文件

56. 中国证监会要求的其他文件

57. 中国证监会要求的其他文件

58. 中国证监会要求的其他文件

59. 中国证监会要求的其他文件

60. 中国证监会要求的其他文件

61. 中国证监会要求的其他文件

62. 中国证监会要求的其他文件

63. 中国证监会要求的其他文件

64. 中国证监会要求的其他文件

65. 中国证监会要求的其他文件

66. 中国证监会要求的其他文件

67. 中国证监会要求的其他文件

68. 中国证监会要求的其他文件

69. 中国证监会要求的其他文件

70. 中国证监会要求的其他文件

71. 中国证监会要求的其他文件

72. 中国证监会要求的其他文件

73. 中国证监会要求的其他文件

74. 中国证监会要求的其他文件

75. 中国证监会要求的其他文件

76. 中国证监会要求的其他文件

77. 中国证监会要求的其他文件

78. 中国证监会要求的其他文件

79. 中国证监会要求的其他文件

80. 中国证监会要求的其他文件

81. 中国证监会要求的其他文件

82. 中国证监会要求的其他文件

83. 中国证监会要求的其他文件

84. 中国证监会要求的其他文件

85. 中国证监会要求的其他文件

86. 中国证监会要求的其他文件

87. 中国证监会要求的其他文件

88. 中国证监会要求的其他文件

89. 中国证监会要求的其他文件

90. 中国证监会要求的其他文件

91. 中国证监会要求的其他文件

92. 中国证监会要求的其他文件

93. 中国证监会要求的其他文件

94. 中国证监会要求的其他文件

95. 中国证监会要求的其他文件

96. 中国证监会要求的其他文件

97. 中国证监会要求的其他文件

98. 中国证监会要求的其他文件

99. 中国证监会要求的其他文件

100. 中国证监会要求的其他文件

101. 中国证监会要求的其他文件

102. 中国证监会要求的其他文件

103. 中国证监会要求的其他文件

104. 中国证监会要求的其他文件

105. 中国证监会要求的其他文件

106. 中国证监会要求的其他文件

107. 中国证监会要求的其他文件

108. 中国证监会要求的其他文件