

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

2013 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

送出日期：二〇一三年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 23 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、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。

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及其更新。

本半年度报告摘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 2013 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

基金简称	汇丰晋信中小盘股票
基金主代码	540007
交易代码	540007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11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
报告期末基金份额总额	480,191,126.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有持续成长潜力的中小型优势企业，充分把握其在成长为行业龙头过程中所体现出的高成长性、可持续性以及市值高速扩张所带来的投资机会，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>根据本基金所奉行的“关注成长、较高仓位、精选研究”的投资理念和“研究创造价值”的股票精选策略，在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>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议。行业比较分析师综合内、外部研究资源，结合宏观基本面分析等状况，提出重点行业配置比重的建议。</p> <p>(3) 股票投资策略</p> <p>本基金主要采用“自下而上”的方式挑选具有持续潜力、目前股价尚未充分反映公司未来高成长性的中小型上市公司股票作为主要投资对象。</p>

业绩比较基准	中证700（中小盘）指数*90%+同业存款利率*10%。
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	田青
	联系电话	021-20376868	010-67595096
	电子邮箱	melody.y.gu@hsbcjt.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	010-67595096
传真		021-20376999	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼； 中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	17,106,353.85
本期利润	10,655,012.83
加权平均基金份额本期利润	0.0175
本期基金份额净值增长率	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	-0.2465
期末基金资产净值	361,819,778.36

期末基金份额净值	0.7535
----------	--------

注：1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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（为期末余额，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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	-6.63%	2.09%	-13.94%	1.74%	7.31%	0.35%
过去三个月	3.06%	1.61%	-6.80%	1.36%	9.86%	0.25%
过去六个月	2.98%	1.55%	-3.44%	1.32%	6.42%	0.23%
过去一年	-0.20%	1.22%	-6.74%	1.29%	6.54%	-0.07%
过去三年	-14.68%	1.31%	-10.90%	1.37%	-3.78%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-23.28%	1.32%	-28.57%	1.41%	5.29%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信中小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 12 月 11 日至 2013 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 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小上市公司股票。本基金权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。本基金固定收益类证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比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证 700（中小盘）指数*90% + 同业存款利率*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

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

汇丰晋信基金管理有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 2013 年 6 月 30 日，公司共管理 12 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金（2008 年 12 月 3 日成立）、汇丰晋信

大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011 年 7 月 27 日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 日成立）和汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯玉琦	本基金基金经理	2013-04-13	-	16 年	侯玉琦先生，工商管理硕士。曾任山西省国信投资集团投资经理，2006 年 1 月加入汇丰晋信基金管理有限公司，先后担任研究员、高级研究员和投资经理、汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金基金经理。现任本基金基金经理。
廖志峰	本基金基金经理、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理	2011-02-26	2013-04-13	11 年	廖志峰先生，香港大学工商管理硕士。曾任上海国禾投资有限公司研究员，2005 年 10 月起任汇丰晋信基金管理有限公司研究员、高级研究员、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理、本基金基金经理。

注：1. 任职日期为本基金管理人公告廖志峰先生、侯玉琦先生担任本基金基金经理的日期；

2. 离任日期为本基金管理人公告廖志峰先生不再担任本基金基金经理的日期；

3. 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《证券投资基金法》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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

2013 年上半年度，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管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作分析

2013 年上半年沪深 300 指数下跌 12.78%，这与宏观经济走势偏弱有关，但是板块之间的分化非常明显，一些行业和个股表现突出。按照中信行业指数分类，上半年表现较好的行业是传媒、通信、计算机，而表现较差的行业是煤炭、有色金属、钢铁，整体看，非周期行业表现好于周期行业。

从经济数据看，中国经济回升动能依然较弱，经济复苏之路较之前更为漫长。上半年 GDP 回落至 7.6%，其中 2 季度为 7.5%，市场对经济回落的预期进一步确认和加强。发电量，水泥、钢材、挖掘机销量等微观指标普遍不达预期，此外，房地产价格进一步上涨，房地产调控政策和银行理财产品规范政策进一步压低政策放松预期。

操作上，年初我们认为经济复苏预期动能不足，重点持有了估值较低、业绩相对确定的银行、地产、机场等板块，但是忽略了该类板块受到宏观经济影响较大的因素，因此表现一般，之后二季度对组合进行了调整，重点持有了估值较低、去产能相对彻底的化工、家电板块，以及政策受益基本面向好的电子、环保、传媒等板块的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为 2.98%，同期业绩比较基准为-3.44%，本基金领先业绩比较基准 6.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然判断经济处于缓慢复苏的进程当中，政策将成为经济复苏的重要指引。

未来货币政策放松的可能性偏小，从全年看经济运行中存在的不确定性依然较多。产能过剩、企业生产成本上升和创新能力不足，国民经济回升动力总体较弱等问题并没有得到有效解决，经济形势仍然不容乐观。

对于市场而言，下半年出现宏观驱动行情的可能性仍然偏小，因此我们认为大部分周期行业尽管估值较低，但是缺乏系统性的机会。未来政策的核心变化是经济改革，我们认为十八届三中全会有可能推动一系列中观行业的管制放松及政策扶持，这将整体有利于消费服务和新兴产业领域，这也是新一届政府“保民生”的落实和制度保证。

配置上，我们认为市场仍相对较弱，股票方面将重点寻找一些业绩确定较强的行业和个

股，更多的寻找自下而上的机会。在板块配置上，我们相对看好面临供给收缩、价格回升、市场化竞争的一些估值较低的防守类板块，例如化工、家电等行业，以及政府鼓励和支持的前景看好的一些行业，例如环保、科技、医药、消费、文化等产业，保持组合适度的仓位和配置的灵活性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，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《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[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》（证监会公告[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《汇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。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和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。

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政策和程序。

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。

二、基金投资部

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、风险控制部

根据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议。

五、督察长

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规性审核意见。

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论并通过上述估值事项。

本基金的基金管理人目前没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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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、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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	58,101,029.98	37,754,801.43
结算备付金		1,032,557.27	1,216,136.54
存出保证金		269,521.74	250,000.00

交易性金融资产	6.4.7.2	325,640,587.74	397,233,659.48
其中：股票投资	6.4.7.2	325,640,587.74	397,233,659.48
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	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		62,378,038.62	24,797,887.33
应收利息	6.4.7.5	10,477.72	11,373.77
应收股利		-	-
应收申购款		321,717.69	13,923.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		447,753,930.76	461,277,781.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	22,701,544.08
应付赎回款		83,616,133.57	406,621.33
应付管理人报酬		561,979.47	535,900.63
应付托管费		93,663.25	89,316.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,051,365.37	874,890.83
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	611,010.74	401,532.47
负债合计		85,934,152.40	25,009,806.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	480,191,126.28	596,276,143.46
未分配利润	6.4.7.10	-118,371,347.92	-160,008,167.91
所有者权益合计		361,819,778.36	436,267,975.55
负债和所有者权益总计		447,753,930.76	461,277,781.67

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7535 元，基金份额总额 480,191,126.28 份。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		18,420,965.18	27,777,425.47
1.利息收入		226,143.72	227,560.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	226,143.72	227,560.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,471,911.80	-10,945,189.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,933,493.97	-15,219,504.69
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	1,538,417.83	4,274,315.44
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-6,451,341.02	38,471,599.39
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	174,250.68	23,454.41
减：二、费用		7,765,952.35	6,497,897.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,418,628.27	3,453,914.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	569,771.44	575,652.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,572,293.06	2,259,992.72
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	205,259.58	208,338.16
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		10,655,012.83	21,279,527.68
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,655,012.83	21,279,527.68
-------------------	--	---------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	596,276,143.46	-160,008,167.91	436,267,975.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,655,012.83	10,655,012.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-116,085,017.18	30,981,807.16	-85,103,210.02
其中：1. 基金申购款	68,320,775.84	-14,025,134.38	54,295,641.46
2. 基金赎回款	-184,405,793.02	45,006,941.54	-139,398,851.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	480,191,126.28	-118,371,347.92	361,819,778.36
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	632,079,112.69	-176,162,689.60	455,916,423.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,279,527.68	21,279,527.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,567,598.52	4,353,370.38	-13,214,228.14
其中：1. 基金申购款	7,524,191.88	-1,976,231.62	5,547,960.26
2. 基金赎回款	-25,091,790.40	6,329,602.00	-18,762,188.40
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	614,511,514.17	-150,529,791.54	463,981,722.63

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨小勇，主管会计工作负责人：王栋，会计机构负责人：杨洋

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于核准汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2009]1105 号文)批准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 11 月 10 日至 2009 年 12 月 8 日募集，募集资金总额 2,253,396,692.29 元，手续费 20,087,103.07 元，利息转份额 508,700.69 元，募集规模为 2,233,818,289.91 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了 KPMG-B(2009)CR No.0064 号验资报告。本基金已在中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2009 年 12 月 11 日获中国证监会的书面确认（中国证监会基金部函[2009]755 号），基金合同于 2009 年 12 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。固定收益类证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之内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金将不低于 80% 的股票资产投资于沪深两市上具有良好成长性和竞争力的上市公司股票。基金管理人每季度将对中国 A 股市场的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股市场总流通市值 60% 的股票归入中小盘。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观基金情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超过上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例作适度调整。本基金业绩比较基准为：中证 700（中小盘）指数*90%+同业存款利率*10%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

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》、《汇丰晋信中小盘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]5 号文《证券投资基金信息披露 XBRL 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。

6.4.3 遵循企业会计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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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 2012 年年度财务报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本期无重大会计差错发生。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政

策的补充通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 基金作为流通股股东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。

(d) 对基金取得的债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，自 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计算个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息、红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂按 25%计入应纳税所得额，上述股息红利所得适用 20%的税率计征。

(e) 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）交易印花税。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与深圳证券交易所的相关规定，调整证券（股票）交易印花税税率，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，证券交易印花税改为单边征收，即仅对卖出 A 股、B 股和股权按 0.1% 的税率征收。

(f) 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

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
山西信托有限责任公司(“山西信托”)	基金管理人的股东
山西证券股份有限公司(“山西证券”)	见注释①
中德证券有限责任公司(“中德证券”)	见注释②
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东

注:①山西证券与本基金管理人的股东——山西信托共同受山西省国信投资(集团)公司控制。

②中德证券与本基金管理人的股东——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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
山西证券	-	-	124,972,262.77	8.50%

注:本报告期内,本基金未通过关联方交易单元进行此类交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
山西证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
山西证券	106,226.25	8.63%	106,226.25	16.48%

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(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用山西证券有限责任公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从山西证券有限责任公司获得证券研究综合服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,418,628.27	3,453,914.49
其中：支付销售机构的客户 维护费	772,539.77	828,562.83

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人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	569,771.44	575,652.42

注：支付基金托管人建设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，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期间及上年度可比期间内均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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，本基金的基金管理人均未投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	58,101,029.98	206,303.75	65,334,165.18	217,402.87

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和结算保证金，于 2013 年 06 月 30 日的余额为人民币 1,302,079.01 元（2012 年 6 月 30 日：人民币 1,278,875.79 元）

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

根据《证券发行与承销管理办法》，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《上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。

本报告期期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
30002	华谊	2013-06-	重	29.35	2013-0	31.4	154,045	4,762,139.	4,521,220.	-

7	兄弟	05	大 事 项		7-24	1		10	75	
30013 3	华策 影视	2013-05- 28	重 大 事 项	23.88	2013-0 7-30	26.8 7	371,514	6,859,685. 34	8,871,754. 32	-
60043 6	片仔 癩	2013-06- 21	配 股	136.82	2013-0 7-01	118. 73	33,100	4,634,000. 00	4,528,742. 00	-

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

截止 2013 年 06 月 30 日，本基金无因银行间市场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

截止 2013 年 06 月 30 日，本基金无因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(a) 以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2013 年 06 月 30 日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：

2013 年 6 月 30 日

	第一层级	第二层级	第三层级	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
资产				
交易性金融资产				
股票投资	312,247,612.67	13,392,975.07	-	325,640,587.74
债券投资	-	-	-	-

合计 312,247,612.67 13,392,975.07 - 325,640,587.74

2012 年 12 月 31 日

	第一层级	第二层级	第三层级	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元

资产

交易性金融资产

股票投资 397,233,659.48 - - 397,233,659.48

债券投资 - - - -

合计 397,233,659.48 - - 397,233,659.48

根据估值方法的变更,本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层级。

(b) 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

除 6.4.14(a)披露的以公允价值计量的金融工具外,本基金 06 月 30 日各项金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	325,640,587.74	72.73
	其中:股票	325,640,587.74	72.73
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	59,133,587.25	13.21
6	其他各项资产	62,979,755.77	14.07
7	合计	447,753,930.76	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,295,820.99	2.85
C	制造业	208,686,887.29	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,908,978.30	3.84
E	建筑业	11,183,848.48	3.09
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,962,340.88	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,904,234.40	5.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,664,685.10	2.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,700,696.76	4.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,333,095.54	8.66
S	综合	-	-
	合计	325,640,587.74	90.00

7.3 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

金额单位：人民币元

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	002508	老板电器	798,732	26,054,637.84	7.20
2	002450	康得新	879,464	24,607,402.72	6.80
3	600352	浙江龙盛	1,935,058	18,150,844.04	5.02
4	600389	江山股份	408,015	13,888,830.60	3.84
5	002318	久立特材	731,142	12,524,462.46	3.46
6	002241	歌尔声学	339,388	12,316,390.52	3.40
7	002038	双鹭药业	203,515	11,925,979.00	3.30

8	300336	新文化	305,575	11,847,142.75	3.27
9	000669	金鸿能源	303,284	11,476,266.56	3.17
10	601117	中国化学	1,174,774	11,183,848.48	3.09

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601009	南京银行	30,482,157.18	6.99
2	601169	北京银行	29,520,027.00	6.77
3	600889	南京化纤	26,194,897.96	6.00
4	002450	康得新	25,869,273.99	5.93
5	000538	云南白药	25,325,138.24	5.80
6	000423	东阿阿胶	24,664,795.91	5.65
7	002508	老板电器	24,304,493.32	5.57
8	600352	浙江龙盛	23,960,439.15	5.49
9	601688	华泰证券	22,761,064.40	5.22
10	600409	三友化工	22,136,588.48	5.07
11	601668	中国建筑	19,688,934.00	4.51
12	000999	华润三九	17,583,607.86	4.03
13	601117	中国化学	16,870,590.33	3.87
14	002172	澳洋科技	16,550,528.11	3.79
15	000024	招商地产	14,813,917.79	3.40
16	600166	福田汽车	14,428,344.65	3.31
17	002142	宁波银行	14,335,802.29	3.29
18	600389	江山股份	13,965,442.57	3.20
19	002146	荣盛发展	13,927,605.24	3.19
20	600546	山煤国际	13,811,390.70	3.17
21	600596	新安股份	13,680,117.53	3.14
22	600887	伊利股份	13,598,680.38	3.12
23	600000	浦发银行	13,528,096.57	3.10
24	600015	华夏银行	13,451,331.98	3.08
25	002318	久立特材	13,181,266.25	3.02
26	300113	顺网科技	13,158,916.30	3.02
27	601166	兴业银行	13,067,755.00	3.00
28	600030	中信证券	13,017,308.00	2.98
29	000651	格力电器	12,917,690.79	2.96
30	601901	方正证券	12,880,295.65	2.95

31	000669	金鸿能源	12,781,049.51	2.93
32	300336	新文化	12,775,940.30	2.93
33	600157	永泰能源	12,671,947.00	2.90
34	600011	华能国际	12,333,577.24	2.83
35	600583	海油工程	12,321,851.44	2.82
36	600027	华电国际	12,290,255.70	2.82
37	002064	华峰氨纶	12,148,536.42	2.78
38	000401	冀东水泥	12,144,786.70	2.78
39	300205	天喻信息	11,972,440.44	2.74
40	601299	中国北车	11,853,461.30	2.72
41	600016	民生银行	11,851,602.00	2.72
42	002104	恒宝股份	11,684,555.00	2.68
43	600388	龙净环保	11,460,312.62	2.63
44	002244	滨江集团	11,251,093.45	2.58
45	002250	联化科技	11,166,424.00	2.56
46	000100	TCL 集团	11,156,080.88	2.56
47	002038	双鹭药业	11,063,783.05	2.54
48	300070	碧水源	10,825,440.90	2.48
49	600801	华新水泥	10,783,832.38	2.47
50	000961	中南建设	10,448,750.38	2.40
51	002241	歌尔声学	10,294,823.62	2.36
52	600383	金地集团	10,117,000.00	2.32
53	600276	恒瑞医药	10,035,292.10	2.30
54	601377	兴业证券	9,945,967.92	2.28
55	600318	巢东股份	9,869,906.93	2.26
56	000937	冀中能源	9,530,808.43	2.18
57	600009	上海机场	9,512,952.77	2.18
58	601288	农业银行	9,360,000.00	2.15
59	300026	红日药业	9,273,139.59	2.13
60	002475	立讯精密	9,237,319.00	2.12
61	002304	洋河股份	9,141,805.66	2.10
62	600637	百视通	9,075,180.42	2.08

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

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	601117	中国化学	37,921,885.71	8.69
2	000625	长安汽车	33,040,328.36	7.57
3	600801	华新水泥	31,169,798.35	7.14

4	601668	中国建筑	29,520,868.85	6.77
5	601009	南京银行	28,716,852.23	6.58
6	601169	北京银行	26,618,553.80	6.10
7	601390	中国中铁	26,248,132.00	6.02
8	600015	华夏银行	26,173,017.40	6.00
9	600004	白云机场	25,406,470.26	5.82
10	600889	南京化纤	25,376,903.40	5.82
11	601299	中国北车	24,924,093.87	5.71
12	000423	东阿阿胶	24,510,184.77	5.62
13	600409	三友化工	24,260,432.29	5.56
14	600383	金地集团	23,669,409.47	5.43
15	000024	招商地产	23,609,023.56	5.41
16	601688	华泰证券	22,752,792.65	5.22
17	600284	浦东建设	21,919,705.41	5.02
18	000538	云南白药	21,540,918.53	4.94
19	601288	农业银行	19,891,407.27	4.56
20	000961	中南建设	18,611,736.11	4.27
21	600458	时代新材	17,539,668.52	4.02
22	000999	华润三九	17,468,357.53	4.00
23	002146	荣盛发展	16,993,997.62	3.90
24	601988	中国银行	16,514,034.85	3.79
25	601901	方正证券	16,251,095.68	3.73
26	601377	兴业证券	16,027,934.25	3.67
27	600027	华电国际	15,056,986.93	3.45
28	002172	澳洋科技	14,726,444.37	3.38
29	600030	中信证券	14,141,549.11	3.24
30	600674	川投能源	14,136,357.50	3.24
31	600166	福田汽车	13,852,833.30	3.18
32	600900	长江电力	13,792,581.13	3.16
33	600887	伊利股份	13,474,308.06	3.09
34	000651	格力电器	13,318,915.02	3.05
35	601398	工商银行	13,267,746.86	3.04
36	600388	龙净环保	13,144,856.69	3.01
37	000001	平安银行	12,710,319.62	2.91
38	600000	浦发银行	12,675,605.04	2.91
39	000401	冀东水泥	12,546,552.68	2.88
40	601166	兴业银行	12,498,230.75	2.86
41	000783	长江证券	12,468,170.89	2.86
42	601186	中国铁建	12,291,187.77	2.82
43	002142	宁波银行	12,253,426.80	2.81
44	601628	中国人寿	11,983,265.45	2.75

45	600546	山煤国际	11,794,848.66	2.70
46	600157	永泰能源	11,668,747.47	2.67
47	002064	华峰氨纶	11,546,731.90	2.65
48	600016	民生银行	11,170,400.00	2.56
49	600011	华能国际	10,963,047.14	2.51
50	002244	滨江集团	10,845,343.19	2.49
51	000100	TCL 集团	10,737,314.95	2.46
52	600009	上海机场	10,294,929.14	2.36
53	002250	联化科技	9,910,389.00	2.27
54	600318	巢东股份	9,435,315.28	2.16
55	600509	天富热电	9,143,248.35	2.10
56	601766	中国南车	8,979,454.43	2.06
57	601788	光大证券	8,850,921.93	2.03

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,108,856,852.51
卖出股票的收入（成交）总额	1,196,932,077.20

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.7 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	269,521.74
2	应收证券清算款	62,378,038.62
3	应收股利	-
4	应收利息	10,477.72
5	应收申购款	321,717.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,979,755.77

7.10.4 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。

7.10.5 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。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,739	49,306.00	4,509,336.01	0.94%	475,681,790.27	99.06%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	55,784.63	0.01%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0，本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 12 月 11 日）基金份额总额	2,233,818,289.91
本报告期期初基金份额总额	596,276,143.46
本报告期基金总申购份额	68,320,775.84
减：本报告期基金总赎回份额	184,405,793.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	480,191,126.28

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

2013 年 3 月 27 日，基金管理人发布公告，经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，聘任赵琳女士为公司副总经理。

2012 年 4 月 13 日，基金管理人发布公告，聘任侯玉琦先生担任本基金基金经理，廖志峰先生不再担任本基金基金经理。

本报告期内，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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门在报告期内无重大人事变动。

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，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

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进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
中信证券	1	787,013,727.35	34.13%	716,496.91	34.27%	-
海通证券	1	535,529,923.92	23.23%	481,405.40	23.03%	-
中金公司	2	415,458,329.14	18.02%	377,910.57	18.08%	-
招商证券	1	224,781,855.48	9.75%	204,641.19	9.79%	-
申银万国	1	186,489,839.84	8.09%	169,779.78	8.12%	-

安信证券	1	77,200,607.02	3.35%	68,314.60	3.27%	-
华泰联合	1	73,352,587.32	3.18%	66,780.41	3.19%	-
中投证券	1	5,962,059.64	0.26%	5,275.84	0.25%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
合计	12	2,305,788,929.71	100.00%	2,090,604.70	100.00%	-

注：1.本报告期内本基金无新增交易单元。

2.专用交易单元的选择标准和程序

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

- a.实力雄厚，信誉良好；
- b.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；
- c.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；
- d.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；
- e.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：

- a.研究报告的数量和质量；
- b.提供研究服务的主动性；
- c.资讯提供的及时性及便利性；
- d.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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金 2013 年半年度报告摘要

申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一三年八月二十六日