

---

**汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金**  
**2013 年年度报告摘要**  
2013 年 12 月 31 日

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  
报告送出日期：二〇一四年三月二十六日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信低碳先锋股票
基金主代码	540008
交易代码	540008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 8 日
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
报告期末基金份额总额	1,127,121,033.90 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，通过积极把握资本利得机会以拓展收益空间，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>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>本基金所投资对象主要定位受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，这些上市公司会包含很多一般意义的行业。本基金在行业选择上综合考虑多方面的因素，择优而选。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，对受益于低碳经济领域、行业基本面因素已出现积极变化、景气程度增加，但股票市场反应滞后的行业进行重点配置。同时，本基金将根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会，实现“资本增值”目标。</p> <p>(3) 股票资产投资策略</p> <p>本基金根据上市公司的基本面情况，首先对股票进行初步筛选，将基本面较差、投资价值较低的上市公司剔除基础股票池。在此基础上，按照本基金对于低碳经济概念的识别，我们将依靠研究团队，主要采取自下而上的选股策略，对基础股票池进行二次筛选，筛选出与低碳经济主题相关的上市公司。</p> <p>根据上市公司与低碳经济主题之间的关系，本基金将低碳经济主题的上市公司细分为两类：1) 直接从事或受益于低碳经济主题的上市公司；2) 与低碳经济主题密切相关的上市公司。</p>
业绩比较基准	沪深 300 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计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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵
	联系电话	021-20376868
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn
客户服务电话	021-20376888	95559
传真	021-20376999	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金年度报告备置地点	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； 交通银行股份有限公司：上海市浦东新区银城中路188号。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	220,172,553.34	-109,450,101.25	-39,585,943.25
本期利润	174,845,808.66	-6,900,227.92	-159,046,502.31
加权平均基金份额本期利润	0.1986	-0.0145	-0.2628
本期基金份额净值增长率	41.42%	-0.62%	-24.09%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0153	-0.2531	-0.1513
期末基金资产净值	1,344,307,897.47	312,268,506.66	482,986,690.16
期末基金份额净值	1.1927	0.8434	0.8487

注：本期已实现收益是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；

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）；

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-14.60%	1.73%	-2.93%	1.01%	-11.67%	0.72%
过去六个月	6.74%	2.03%	5.33%	1.16%	1.41%	0.87%
过去一年	41.42%	2.05%	-6.81%	1.25%	48.23%	0.80%
过去三年	6.68%	1.56%	-22.75%	1.19%	29.43%	0.37%
自基金合同生效起至今	30.03%	1.52%	-11.95%	1.23%	41.98%	0.29%

#### 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

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月8日至2013年12月31日)



1. 按照基金合同的约定，本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、现金和其他资产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%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2010 年 12 月 8 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

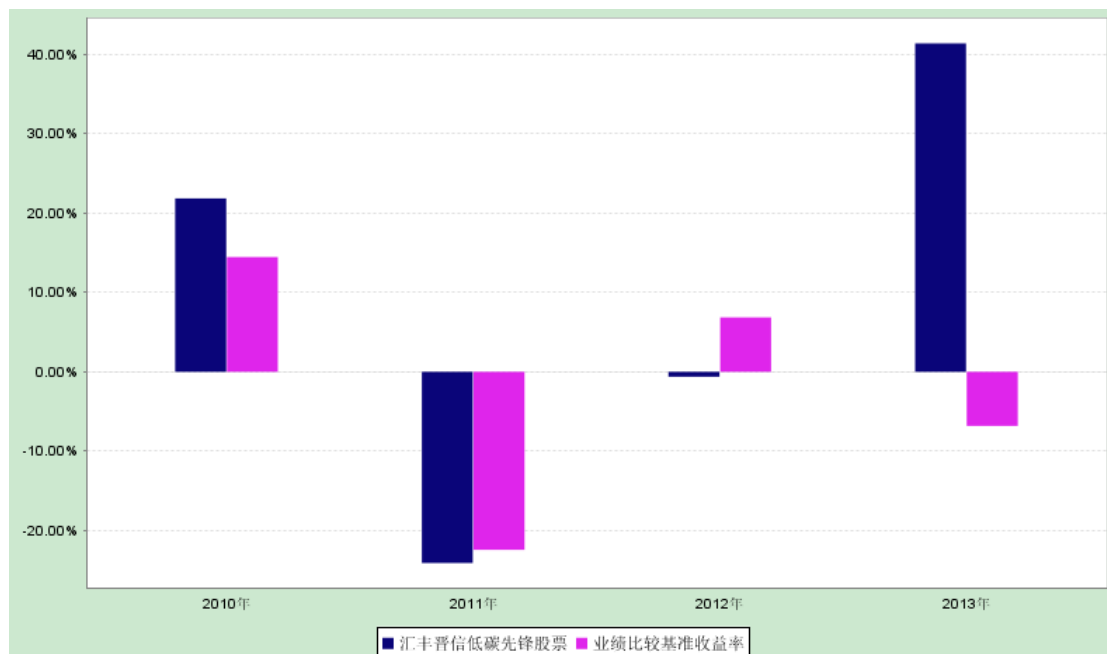
2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数\*90% + 同业存款利率\*10%。

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沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



本基金的基金合同于 2010 年 6 月 8 日生效，截至 2013 年 12 月 31 日，基金运作未满四年。本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：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。

## §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，注册地在中国上海。截止 2013 年 12 月 31 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		
曹庆	本基金基金经理	2013-12-21	-	10 年	曹庆先生，伦敦政治经济学院硕士。曾任东方基金管理有限公司研究员、法国巴黎银行证券上海代表处研究员、汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员、研究副总监。现任汇丰晋信基金管理有限公司研究总监、本基金基金经理。
刘辉	本基金基金经理、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金基金经理	2012-07-21	2013-12-21	7 年	刘辉先生，澳大利亚阿德莱德大学硕士。曾任华泰证券股份有限公司研究员、东吴基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司研究员、汇丰晋信 2026 生命周期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刘辉先生、曹庆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刘辉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

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，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析。公司对不同投资组合间同向交易的平均溢价率、溢价金额占投资组合平均净值百分比、正溢价率占比等指标进行专项计算分析，计算分析结果显示：以上各指标值均在合理正常的范围之内，未发现不同投资组合间相近交易日内的同向交易存在不公平及存在利益输送的行为。

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，或者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。

报告期内，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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年 A 股市场整体而言再次经历了宽幅震荡的格局，沪深 300 指数在年初呈现 1 个月的冲高走势后，随即在宏观经济数据连续不达预期的负面影响下，开始震荡下跌，特别是年中出现的“钱荒”事件，加剧了投资者对中国经济硬着陆的担心，沪深 300 指数下探至近 4 年多来的低点。3 季度开始，受益于政府的定向刺激政策，国内的宏观经济数据开始触底反弹，A 股市场也随之震荡回升。但 4 季度开始，市场再次陷入弱势震荡的格局，其间虽有十八届三中全会刺激下的短暂反弹，但邻近年底前货币市



场紧张的流动性再次负面影响 A 股。最终，沪深 300 指数 2013 全年下跌 7.65%。

虽然 2013 年 A 股市场的权重股整体表现不尽如人意，但以创业板为代表的新兴成长类行业却走出了一轮波澜壮阔的牛市行情。创业板指数全年上涨 82.73%，按中信证券一级行业分类统计，行业指数涨幅超过 20% 的一级行业共有 11 个，其中的传媒行业指数、计算机行业指数更是分别上涨 103% 和 76%。“结构性”成为投资者间的热门词汇，从“结构性机会”到“结构性行情”再到“结构性牛市”，这背后反映的是在中国经济转型背景下，投资者对“旧经济”的无情抛弃和对“新经济”的热情追捧。

回顾本基金在 2013 年的操作，我们在年初及时的将持仓结构由金融地产等偏周期行业调整到优质成长股的方向，在电子、传媒、医药、计算机、环保等符合经济转型方向的新兴成长行业中持续保持了较大的超配力度，并在细分行业及重仓个股选择上结合行业基本面和估值情况不断进行动态调整。其间虽然由于部分重仓个股的深度回调导致本基金净值在 4 季度出现明显回撤，但从全年表现来看，本基金仍取得相对较好的投资效果。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 41.42%，同期业绩比较基准变动幅度为-6.81%，本基金领先业绩比较基准 48.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

十八届三中全会吹响了中国经济全面改革的号角，这无疑会提升投资者对未来中国经济转型成功的信心。但同时我们需要清醒的看到，全面改革的进程可能并不会一帆风顺，改革红利的释放还需要较长的时间，而中国经济面临的去杠杆、去产能、调结构的短期挑战仍将十分艰巨，高企的资金利率对实体经济以及对股票市场估值带来的压制短期内仍难以消除。

而从 A 股市场自身来看，管理层虽然在积极引导更多资金进入股票市场，例如通过制定投资者保护的“国九条”来引导中小投资者入市、通过鼓励上市公司现金分红及发行优先股来引导企业年金、养老金等长期资金入市、通过提高 QFII 和 RQFII 额度等吸引海外资金入市，但今年开始的市场化 IPO 重启所引发的“股市扩容”速度恐仍将明显超出“投资者扩容”速度。

因此，我们判断 A 股市场年内出现整体大幅攀升的机会有限，市场仍将是结构性机会为主。在经济转型大背景下，我们还将不断看到部分新兴行业的快速成长和消费服务行业持续受益于崛起的大众消费，而这两个领域也将是本基金的年度配置重点方向。但相较于 2013 年，我们判断 2014 年的结构性机会可能呈现两个特点。一是经过 2013 年的估值快速提升，目前“新经济”类股票的估值水平相较于 2013 年初时已有明显上升，后续简单依靠估值提升的空间有限，结构性牛市的幅度可能不如 2013 年。二是 2014 年可能出现结构性机会的子行业相较于 2013 年或许会更多、更广泛，特别是一些通过改革创

新，通过新技术、新产品、新模式或是新机制而可能重现生机的传统行业。为此，我们将依托于公司的投研平台，深入挖掘和精选细分行业及个股的投资机会，努力为基金持有人带来满意的业绩回报。

#### 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、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下开展工作，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其适用性的情况下，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。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

#### 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

2013 年度，基金托管人在汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013 年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013 年度,由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

毕马威华振会计师事务所对汇丰晋信基金管理有限公司汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的资产负债表, 2013 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第 1400090 号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

### §7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		25,039,553.93	9,066,577.91
结算备付金		114,723,434.98	7,751,438.73
存出保证金		845,003.98	379,438.17
交易性金融资产		1,217,686,774.45	293,256,871.40
其中：股票投资		1,217,686,774.45	293,256,871.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,134,536.48	8,770,681.54
应收利息		52,245.09	11,032.33
应收股利		-	-
应收申购款		6,770,659.54	113,482.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,366,252,208.45	319,349,522.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	2013年12月31日	2012年12月31日
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	9,079,017.62	5,531,246.58
应付赎回款	7,868,413.86	112,367.00
应付管理人报酬	1,834,495.34	370,603.16
应付托管费	305,749.22	61,767.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,436,270.54	598,608.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	420,364.40	406,423.49
负债合计	21,944,310.98	7,081,016.18
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,127,121,033.90	370,230,185.36
未分配利润	217,186,863.57	-57,961,678.70
所有者权益合计	1,344,307,897.47	312,268,506.66
负债和所有者权益总计	1,366,252,208.45	319,349,522.84

注：1.报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1927 元，基金份额总额 1,127,121,033.90 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>204,289,813.87</b>	<b>4,342,983.83</b>
1. 利息收入		989,355.27	640,048.50
其中：存款利息收入		989,355.27	640,048.50
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)		244,616,500.98	-99,158,600.45
其中：股票投资收益		242,730,410.50	-102,205,311.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,886,090.48	3,046,711.12
3. 公允价值变动收益( 损失以“ - ”号填列)		-45,326,744.68	102,549,873.33
4. 汇兑收益( 损失以“ - ”号填列)		-	-
5. 其他收入( 损失以“ - ”号填列)		4,010,702.30	311,662.45
<b>减：二、费用</b>		<b>29,444,005.21</b>	<b>11,243,211.75</b>
1. 管理人报酬		15,474,414.62	5,879,063.09
2. 托管费		2,579,069.00	979,843.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		11,016,694.09	3,960,011.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		373,827.50	424,293.50
<b>三、利润总额( 亏损总额以“ - ”号填列)</b>		<b>174,845,808.66</b>	<b>-6,900,227.92</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润( 净亏损以“ - ”号填列)</b>		<b>174,845,808.66</b>	<b>-6,900,227.92</b>

### 7.3 所有者权益( 基金净值) 变动表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	370,230,185.36	-57,961,678.70	312,268,506.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数( 本期利润)	-	174,845,808.66	174,845,808.66
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)	756,890,848.54	100,302,733.61	857,193,582.15
其中：1. 基金申购款	3,361,974,918.68	703,719,053.44	4,065,693,972.12

2. 基金赎回款	-2,605,084,070.14	-603,416,319.83	-3,208,500,389.97
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)	1,127,121,033.90	217,186,863.57	1,344,307,897.47
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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)	569,094,114.50	-86,107,424.34	482,986,690.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,900,227.92	-6,900,227.92
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)	-198,863,929.14	35,045,973.56	-163,817,955.58
其中：1. 基金申购款	104,501,089.93	-18,995,211.07	85,505,878.86
2. 基金赎回款	-303,365,019.07	54,041,184.63	-249,323,834.44
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)	370,230,185.36	-57,961,678.70	312,268,506.66

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：杨小勇，主管会计工作负责人：王栋，会计机构负责人：杨洋

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于核准汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]471号)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《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2010 年 6 月 8 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 666,460,299.86 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。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、现金和其他资产投资比例范

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%。本基金主要投资于受益于低碳经济领域的上市公司，80%以上的股票资产属于上述投资方向所确定的内容。本基金业绩比较基准为沪深 300 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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制，同时亦按照中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况、自 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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

本基金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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错。



#### 7.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[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》、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》、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》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) 对基金取得的股票的股息、红利收入，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持有期限计提个人所得税：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所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	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
中德证券有限责任公司(“中德证券”)	见注释
汇丰银行(中国)有限公司(“汇丰银行”)	见注释
恒生银行(中国)有限公司(“恒生银行”)	见注释

注：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。

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。

汇丰银行与本基金管理人的股东—汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

恒生银行与本基金管理人的股东—汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	62,299,197.29	0.83%	-	-

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 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12月31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	56,717.37	0.83%	56,717.37	2.33%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	-	-	-	-
------	---	---	---	---

上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,474,414.62	5,879,063.09
其中：支付销售机构的客户维护费	5,258,713.86	1,819,049.12

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

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,579,069.00	979,843.88

注：支付基金托管人交通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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期及上年度可比期间内均未投资过本基金。

**7.4.8.4.2 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。

**7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	25,039,553.93	453,474.01	9,066,577.91	51,680.95

注：本基金通过“交通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存出保证金，于 2013 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 115,568,438.96 元。(2012 年 12 月 31 日：人民币 7,751,438.73 元)。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本年度及上一年度，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

上述与关联方进行的交易是按一般正常商业条款或按相关协议进行。

**7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.9.1 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》(2012 年修订)，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。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，为流动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。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

**7.4.9.2 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002573	国电清新	2013-12-23	重大	22.17	2014-03-25	20.80	1,552,282	39,932,135.6	34,414,091.94	-

			事项					7	
--	--	--	----	--	--	--	--	---	--

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**7.4.10 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 12 月 31 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 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
<b>资产</b>				
<b>交易性金融资产</b>				
股票投资	1,183,272,682.51	34,414,091.94	-	1,217,686,774.45
债券投资	-	-	-	-
合计	1,183,272,682.51	34,414,091.94	-	1,217,686,774.45

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
<b>资产</b>				
<b>交易性金融资产</b>				

股票投资	283,324,199.40	9,932,672.00	-	293,256,871.40
债券投资	-	-	-	-
合计	283,324,199.40	9,932,672.00	-	293,256,871.40

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。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。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见附注 7.4.4.4 和 7.4.4.5。

(b) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量账面价值）

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,217,686,774.45	89.13
	其中：股票	1,217,686,774.45	89.13
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	139,762,988.91	10.23
6	其他各项资产	8,802,445.09	0.64
7	合计	1,366,252,208.45	100.00

### 8.2 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	-	-
C	制造业	858,021,835.12	63.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,331,140.07	3.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,929,637.50	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,247,312.50	0.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	73,329,376.89	5.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	214,827,472.37	15.98
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,217,686,774.45	90.58

### 8.3 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	300070	碧水源	2,281,487	93,518,152.13	6.96
2	002236	大华股份	2,142,379	87,580,453.52	6.51
3	002456	欧菲光	1,721,452	82,767,412.16	6.16
4	002450	康得新	3,271,165	79,489,309.50	5.91
5	300274	阳光电源	2,404,019	77,289,210.85	5.75
6	002241	歌尔声学	1,935,045	67,881,378.60	5.05
7	300026	红日药业	1,576,563	58,900,393.68	4.38
8	000826	桑德环境	1,463,259	50,921,413.20	3.79
9	600292	中电远达	1,828,163	47,331,140.07	3.52
10	300205	天喻信息	1,384,256	46,026,512.00	3.42

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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 (%)
	300074	华平股份	269,349,021.27	86.26
	002241	歌尔声学	202,205,570.77	64.75
	002456	欧菲光	189,642,286.12	60.73
	300070	碧水源	176,269,537.68	56.45
	600637	百视通	150,424,941.53	48.17
	002236	大华股份	136,754,699.37	43.79
	002450	康得新	128,290,582.42	41.08
	600389	江山股份	108,218,850.06	34.66
	300058	蓝色光标	94,478,275.38	30.26
	300026	红日药业	93,476,605.48	29.93
	600804	鹏博士	93,340,528.30	29.89
	300182	捷成股份	92,672,163.64	29.68
	300274	阳光电源	86,894,427.86	27.83
	300075	数字政通	83,389,819.30	26.70
	002038	双鹭药业	80,115,565.69	25.66
	300205	天喻信息	78,557,522.20	25.16
	300287	飞利信	77,494,883.10	24.82
	600535	天士力	74,322,470.41	23.80
	002400	省广股份	70,698,136.90	22.64
	002104	恒宝股份	70,674,004.48	22.63
	300027	华谊兄弟	69,876,009.87	22.38
	002649	博彦科技	69,152,647.40	22.15
	600867	通化东宝	56,330,320.46	18.04
	300014	亿纬锂能	56,248,182.93	18.01
	000826	桑德环境	55,719,927.63	17.84
	600292	中电远达	52,774,827.00	16.90
	300168	万达信息	51,878,953.84	16.61
	600089	特变电工	50,135,269.32	16.06
	600352	浙江龙盛	50,082,516.20	16.04
	300253	卫宁软件	49,049,289.91	15.71
	002140	东华科技	48,346,651.23	15.48
	000860	顺鑫农业	47,490,675.84	15.21
	300271	华宇软件	44,393,606.21	14.22
	000625	长安汽车	44,389,530.03	14.22
	002573	国电清新	39,932,135.67	12.79
	600048	保利地产	38,814,999.83	12.43
	300187	永清环保	37,101,408.14	11.88
	600422	昆明制药	34,411,544.18	11.02
	300054	鼎龙股份	34,231,191.31	10.96



	300057	万顺股份	29,804,622.20	9.54
	002415	海康威视	28,350,498.51	9.08
	600690	青岛海尔	28,164,828.06	9.02
	300115	长盈精密	27,150,987.40	8.69
	000024	招商地产	26,666,962.01	8.54
	300212	易华录	26,171,239.22	8.38
	300315	掌趣科技	25,709,309.81	8.23
	300113	顺网科技	25,432,732.14	8.14
	600195	中牧股份	25,075,550.23	8.03
	300336	新文化	24,764,653.22	7.93
	002565	上海绿新	23,335,533.84	7.47
	002475	立讯精密	21,647,297.62	6.93
	002310	东方园林	20,627,462.37	6.61
	000538	云南白药	20,316,452.69	6.51
	300088	长信科技	20,051,151.42	6.42
	002273	水晶光电	18,953,595.54	6.07
	300083	劲胜股份	18,338,247.31	5.87
	002353	杰瑞股份	17,509,044.98	5.61
	600426	华鲁恒升	17,311,677.68	5.54
	000651	格力电器	17,274,996.00	5.53
	002065	东华软件	17,266,892.88	5.53
	300241	瑞丰光电	17,099,130.11	5.48
	002508	老板电器	16,990,156.43	5.44
	300128	锦富新材	15,145,182.76	4.85
	002269	美邦服饰	14,491,691.72	4.64
	300017	网宿科技	14,302,981.24	4.58
	002223	鱼跃医疗	13,325,500.84	4.27
	000997	新大陆	12,321,968.37	3.95
	601928	凤凰传媒	12,011,145.80	3.85
	000963	华东医药	10,268,914.30	3.29
	002457	青龙管业	9,496,948.36	3.04
	300303	聚飞光电	9,430,851.70	3.02
	600418	江淮汽车	9,096,350.68	2.91
	002172	澳洋科技	9,062,262.13	2.90
	600596	新安股份	8,981,058.90	2.88
	002008	大族激光	8,636,376.43	2.77
	002250	联化科技	7,573,801.10	2.43
	000028	国药一致	7,215,203.00	2.31
	000876	新希望	7,001,316.00	2.24
	600438	通威股份	6,992,338.92	2.24
	000669	金鸿能源	6,980,472.12	2.24

	600409	三友化工	6,896,163.47	2.21
	600266	北京城建	6,780,057.13	2.17
	000400	许继电气	6,690,981.00	2.14
	002226	江南化工	6,686,034.70	2.14
	600276	恒瑞医药	6,500,758.84	2.08
	600016	民生银行	6,442,256.00	2.06
	601633	长城汽车	6,399,199.44	2.05

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。

#### 8.4.2 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（%）
	300074	华平股份	242,188,434.79	77.56
	600637	百视通	195,208,269.67	62.51
	002241	歌尔声学	148,978,936.26	47.71
	002456	欧菲光	142,727,332.53	45.71
	300027	华谊兄弟	136,807,733.76	43.81
	300058	蓝色光标	107,868,960.96	34.54
	002400	省广股份	92,095,377.39	29.49
	600804	鹏博士	91,983,322.12	29.46
	002236	大华股份	87,015,344.04	27.87
	300182	捷成股份	86,340,336.51	27.65
	300070	碧水源	81,387,733.15	26.06
	600389	江山股份	80,910,600.84	25.91
	002649	博彦科技	77,550,271.90	24.83
	600535	天士力	76,428,428.78	24.48
	002038	双鹭药业	76,357,483.36	24.45
	002104	恒宝股份	76,111,332.55	24.37
	300287	飞利信	70,777,378.96	22.67
	300075	数字政通	67,684,882.50	21.68
	002450	康得新	63,577,997.88	20.36
	300253	卫宁软件	60,154,396.90	19.26
	600352	浙江龙盛	56,581,377.03	18.12
	300168	万达信息	49,922,846.01	15.99
	000625	长安汽车	46,558,068.98	14.91
	002140	东华科技	45,082,254.53	14.44
	300271	华宇软件	44,659,246.42	14.30

	300026	红日药业	44,189,862.68	14.15
	300205	天喻信息	40,047,495.87	12.82
	600867	通化东宝	38,502,662.19	12.33
	600422	昆明制药	33,644,889.68	10.77
	300113	顺网科技	30,401,415.10	9.74
	300088	长信科技	30,226,341.82	9.68
	002310	东方园林	27,236,397.84	8.72
	300057	万顺股份	26,007,773.11	8.33
	300315	掌趣科技	25,686,540.72	8.23
	300336	新文化	24,679,585.16	7.90
	000538	云南白药	24,632,887.02	7.89
	300212	易华录	24,523,143.28	7.85
	300115	长盈精密	24,481,311.53	7.84
	002565	上海绿新	21,821,237.68	6.99
	300241	瑞丰光电	21,750,750.32	6.97
	002273	水晶光电	21,737,816.19	6.96
	002475	立讯精密	20,823,597.30	6.67
	300017	网宿科技	20,253,338.04	6.49
	000651	格力电器	19,331,453.02	6.19
	300083	劲胜股份	18,454,038.97	5.91
	002353	杰瑞股份	17,197,651.38	5.51
	600426	华鲁恒升	16,440,736.52	5.26
	002415	海康威视	16,349,803.38	5.24
	002065	东华软件	15,698,009.22	5.03
	300274	阳光电源	14,452,224.33	4.63
	600881	亚泰集团	13,917,064.62	4.46
	601901	方正证券	13,766,145.15	4.41
	300014	亿纬锂能	13,192,636.47	4.22
	300128	锦富新材	12,962,672.38	4.15
	601928	凤凰传媒	11,798,260.18	3.78
	600999	招商证券	11,474,025.43	3.67
	600089	特变电工	11,240,437.16	3.60
	600596	新安股份	11,062,429.36	3.54
	000997	新大陆	10,974,733.87	3.51
	600837	海通证券	10,921,510.87	3.50
	000002	万科A	10,802,171.67	3.46
	601166	兴业银行	10,568,008.57	3.38
	002172	澳洋科技	10,143,859.52	3.25
	600801	华新水泥	9,959,159.21	3.19
	600030	中信证券	9,848,704.57	3.15
	601688	华泰证券	9,835,290.04	3.15

	000024	招商地产	9,618,427.26	3.08
	002457	青龙管业	9,424,072.18	3.02
	600036	招商银行	9,356,934.80	3.00
	601169	北京银行	9,228,525.61	2.96
	600000	浦发银行	9,182,313.27	2.94
	601998	中信银行	9,167,310.77	2.94
	002008	大族激光	9,068,775.28	2.90
	601336	新华保险	9,063,227.96	2.90
	601009	南京银行	9,015,588.06	2.89
	300303	聚飞光电	8,864,575.24	2.84
	600585	海螺水泥	8,747,840.57	2.80
	600376	首开股份	8,336,054.55	2.67
	000961	中南建设	8,162,423.72	2.61
	002244	滨江集团	8,121,553.98	2.60
	600418	江淮汽车	8,073,824.83	2.59
	600048	保利地产	8,009,660.98	2.56
	600318	巢东股份	7,931,953.97	2.54
	600409	三友化工	7,515,906.41	2.41
	300104	乐视网	7,474,205.69	2.39
	601318	中国平安	7,390,460.43	2.37
	600720	祁连山	7,010,459.18	2.25
	002250	联化科技	6,988,768.29	2.24
	600016	民生银行	6,478,101.68	2.07
	000669	金鸿能源	6,448,193.63	2.06
	002051	中工国际	6,414,484.51	2.05

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。

#### 8.4.3 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	4,100,932,165.27
卖出股票的收入（成交）总额	3,373,905,928.04

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

### 8.9.3 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	845,003.98
2	应收证券清算款	1,134,536.48
3	应收股利	-
4	应收利息	52,245.09
5	应收申购款	6,770,659.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,802,445.09

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 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未存在流通受限情况。

### 8.9.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	持有份额	占总份额比

			比例		例
36,215	31,123.04	258,919,209.72	22.97%	868,201,824.18	77.03%

**9.29.3 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	392,414.96	0.03%

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。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2010年6月8日)基金份额总额	666,460,299.86
本报告期期初基金份额总额	370,230,185.36
本报告期间基金总申购份额	3,361,974,918.68
减：本报告期间基金总赎回份额	2,605,084,070.14
本报告期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,127,121,033.90

**§11 重大事件揭示**

**11.1 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。

**11.2 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。

2013 年 12 月 21 日，基金管理人发布公告，聘任曹庆先生担任本基金基金经理，刘辉先生不再担任本基金基金经理。

2014 年 3 月 13 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，聘任张毅杰先生为公司副总经理。

本报告期内，本公司高级管理人员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。

**11.3 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和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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，报告年度预提审计费 95000 元，根据与毕马威华振会计师事务所签订的《审计业务约定书》，应实际支付 2013 年度审计费 95000 元。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。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	2,059,281,737.14	27.55%	1,874,773.68	27.59%	-
招商证券	1	1,783,308,311.93	23.86%	1,620,891.95	23.85%	-
安信证券	1	945,941,251.31	12.66%	854,459.41	12.57%	-
国金证券	1	681,749,912.44	9.12%	620,664.90	9.13%	-
兴业证券	1	512,661,175.16	6.86%	466,724.55	6.87%	-
国泰君安	1	461,277,654.20	6.17%	419,946.24	6.18%	-
东方证券	1	261,786,311.92	3.50%	238,328.76	3.51%	-
申银万国	1	249,300,693.78	3.34%	226,963.11	3.34%	-
华创证券	1	169,731,140.73	2.27%	154,523.73	2.27%	-
华泰证券	2	128,934,854.81	1.72%	117,381.99	1.73%	-
银河证券	1	123,039,201.07	1.65%	112,014.35	1.65%	-
山西证券	1	62,299,197.29	0.83%	56,717.37	0.83%	-
中金公司	1	25,905,081.20	0.35%	23,584.52	0.35%	-
光大证券	1	9,560,448.51	0.13%	8,703.48	0.13%	-
中银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
合计	19	7,474,776,971.49	100.00%	6,795,678.04	100.00%	-

注：1、本报告期内本基金新增深圳交易单元华创证券、广发证券；

- 2、上述交易单元均与汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金合并使用；
- 3、本基金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。

**11.7.2 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		其它交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-	-	-



海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一四年三月二十六日