

汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金 2014 年第 4 季度报告

2014 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：2015 年 1 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2015 年 1 月 21 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信 2016 周期混合
交易代码	540001
前端交易代码	540001
后端交易代码	541001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 5 月 23 日
报告期末基金份额总额	231,777,706.38 份
投资目标	通过基于内在价值判断的股票投资方法、基于宏观经济/现金流/信用分析的固定收益证券研究和严谨的结构化投资流程，本基金期望实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1. 动态调整的资产配置策略</p> <p>本基金投资的资产配置策略，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，相应的从“进取”，转变为“稳健”，再转变为“保守”，股票类资产比例逐步下降，而固定收益类资产比例逐步上升。</p> <p>2. 以风险控制为前提的股票筛选策略</p> <p>根据投研团队的研究成果，本基金首先筛选出股票市场中具有较低风险/较高流动性特征的股票；同时，再通过严格的基本面分析（CFROI 为核心的财务分析、公司治理结构分析）和公司实地调研，最终挑选出质地优良的具有高收益风险比的优选股票。</p>

	<p>3. 动态投资的固定收益类资产投资策略</p> <p>在投资初始阶段，本基金债券投资将奉行较为“积极”的策略；随着目标期限的临近和达到，本基金债券投资将逐步转向“稳健”和“保守”，在组合久期配置和个券选择上作相应变动。</p>																																												
<p>业绩比较基准</p>	<p>1. 2016 年 6 月 1 日前业绩比较基准</p> <p>基金合同生效后至 2016 年 5 月 31 日，本基金业绩比较基准如下：</p> <p>业绩比较基准 = X *富时中国 A 全指 + (1-X) *中债新综合指数（全价）</p> <p>其中 X 值见下表：</p> <table border="1" data-bbox="671 647 1386 1292"> <thead> <tr> <th>时间段</th> <th>股票 类资 产 比例%</th> <th>X 值 (%)</th> <th>(1-X) 值 (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>基金合同生效之日至 2007/5/31</td> <td>0-65</td> <td>45.5</td> <td>54.5</td> </tr> <tr> <td>2007/6/1-2008/5/31</td> <td>0-60</td> <td>42.0</td> <td>58.0</td> </tr> <tr> <td>2008/6/1-2009/5/31</td> <td>0-55</td> <td>38.5</td> <td>61.5</td> </tr> <tr> <td>2009/6/1-2010/5/31</td> <td>0-45</td> <td>31.5</td> <td>68.5</td> </tr> <tr> <td>2010/6/1-2011/5/31</td> <td>0-40</td> <td>28.0</td> <td>72.0</td> </tr> <tr> <td>2011/6/1-2012/5/31</td> <td>0-35</td> <td>24.5</td> <td>75.5</td> </tr> <tr> <td>2012/6/1-2013/5/31</td> <td>0-25</td> <td>17.5</td> <td>82.5</td> </tr> <tr> <td>2013/6/1-2014/5/31</td> <td>0-20</td> <td>14.0</td> <td>86.0</td> </tr> <tr> <td>2014/6/1-2015/5/31</td> <td>0-15</td> <td>10.5</td> <td>89.5</td> </tr> <tr> <td>2015/6/1-2016/5/31</td> <td>0-10</td> <td>7.0</td> <td>93.0</td> </tr> </tbody> </table> <p>注：</p> <p>1. 2008 年 11 月 11 日，新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。</p> <p>2. 2010 年 12 月 16 日，新华富时中国 A 全指更名为富时中国 A 全指。</p> <p>3. 2013 年 2 月 1 日起，本基金 2016 年 6 月 1 日前的业绩比较基准由原先“X *富时中国 A 全指 + (1-X) *新华巴克莱资本中国全债指数”，变更为“X *富时中国 A 全指 + (1-X) *中债新综合指数（全价）”。</p> <p>4. 2016 年 6 月 1 日后业绩比较基准</p> <p>2016 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准 = 银行活期存款利率（税后）</p>	时间段	股票 类资 产 比例%	X 值 (%)	(1-X) 值 (%)	基金合同生效之日至 2007/5/31	0-65	45.5	54.5	2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0	2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5	2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5	2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0	2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5	2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5	2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0	2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5	2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0
时间段	股票 类资 产 比例%	X 值 (%)	(1-X) 值 (%)																																										
基金合同生效之日至 2007/5/31	0-65	45.5	54.5																																										
2007/6/1-2008/5/31	0-60	42.0	58.0																																										
2008/6/1-2009/5/31	0-55	38.5	61.5																																										
2009/6/1-2010/5/31	0-45	31.5	68.5																																										
2010/6/1-2011/5/31	0-40	28.0	72.0																																										
2011/6/1-2012/5/31	0-35	24.5	75.5																																										
2012/6/1-2013/5/31	0-25	17.5	82.5																																										
2013/6/1-2014/5/31	0-20	14.0	86.0																																										
2014/6/1-2015/5/31	0-15	10.5	89.5																																										
2015/6/1-2016/5/31	0-10	7.0	93.0																																										
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是一只生命周期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。</p> <p>本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于中等水平；随着目标投资期限的逐步接近，基金会逐步降低预期风险与收益水平，转变成为中低风险的证券投资基金；在临近目标期限和目标期限达到以后，本基金转变成为低风险的证券投资</p>																																												

	资基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2014 年 10 月 1 日 — 2014 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	17,950,410.11
2. 本期利润	33,356,058.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0930
4. 期末基金资产净值	312,651,137.33
5. 期末基金份额净值	1.3489

注：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。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。本基金基金合同生效之日（含基金合同生效之日）至 2011/05/31（含 2011/05/31）年管理费率为 1.5%，年托管费率为 0.25%。2011/06/01（含 2011/06/01）至 2016/05/31（含 2016/05/31）年管理费率为 0.75%，年托管费率为 0.20%。2016/06/01 起（含 2016/06/01）年管理费率为 0.38%，年托管费率为 0.10%。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	9.69%	0.62%	4.09%	0.22%	5.60%	0.40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 2016 生命周期开放式证券投资基金

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

(2006 年 5 月 23 日至 2014 年 12 月 31 日)



注：1. 按照基金合同的约定，自基金合同生效日（2006 年 5 月 23 日）至 2007 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例 0-65%，固定收益类资产比例 35-100%。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 2006 年 11 月 23 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 根据基金合同的约定，自 2007 年 6 月 1 日起至 2008 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例 0-60%，固定收益类资产比例 40-100%。

3. 根据基金合同的约定，自 2008 年 6 月 1 日起至 2009 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-55%，固定收益类资产比例 45-100%。

4. 根据基金合同的约定，自 2009 年 6 月 1 日起至 2010 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-45%，固定收益类资产比例 55-100%。

5. 根据基金合同的约定，自 2010 年 6 月 1 日起至 2011 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-40%，固定收益类资产比例 60-100%。

6. 根据基金合同的约定，自 2011 年 6 月 1 日起至 2012 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-35%，固定收益类资产比例 65-100%。

7. 根据基金合同的约定，自 2012 年 6 月 1 日起至 2013 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-25%，固定收益类资产比例 75-100%。

8. 根据基金合同的约定，自 2013 年 6 月 1 日起至 2014 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-20%，固定收益类资产比例 80-100%。

9. 根据基金合同的约定，自 2014 年 6 月 1 日起至 2015 年 5 月 31 日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例 0-15%，固定收益类资产比例 85-100%。

10. 基金合同生效日(2006 年 5 月 23 日)至 2007 年 5 月 31 日,本基金的业绩比较基准 = 45.5%×富时中国 A 全指+54.5%×新华巴克莱资本中国全债指数; 根据基金合同的约定, 自 2007 年 6 月 1 日起至 2008 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 42%×富时中国 A 全指+58%×新华巴克莱资本中国全债指数; 自 2008 年 6 月 1 日起至 2009 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 38.5%×富时中国 A 全指+61.5%×新华巴克莱资本中国全债指数; 自 2009 年 6 月 1 日起至 2010 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 31.5%×富时中国 A 全指+68.5%×新华巴克莱资本中国全债指数; 自 2010 年 6 月 1 日起至 2011 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 28%×富时中国 A 全指+72%×新华巴克莱资本中国全债指数; 自 2011 年 6 月 1 日起至 2012 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 24.5%×富时中国 A 全指+75.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。自 2012 年 6 月 1 日起至 2013 年 1 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为: 17.5%×富时中国 A 全指+82.5%×新华巴克莱资本中国全债指数。2013 年 2 月 1 日起至 2013 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为“17.5%×富时中国 A 全指+82.5%×中债新综合指数(全价)。2013 年 6 月 1 日起至 2014 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为“14%×富时中国 A 全指+86%×中债新综合指数(全价)。2014 年 6 月 1 日起至 2015 年 5 月 31 日, 本基金的业绩比较基准调整为“10.5%×富时中国 A 全指+89.5%×中债新综合指数(全价)。
11. 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新华富时中国 A 全指成份股在报告期产生的股票红利收益。
12. 2008 年 11 月 11 日, 新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。
13. 2010 年 12 月 16 日, 新华富时中国 A 全指更名为富时中国 A 全指。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
郑屹	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	2013 年 4 月 27 日	-	7	郑屹先生, 工学硕士。曾任广发证券有限公司研究员、国泰基金管理有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员。现任本基金基金经理、汇丰晋信 2026 生

					命周期证券投资基金基金经理。
李羿	本基金基金经理、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理	2014 年 6 月 21 日	-	4	李羿先生，硕士研究生。曾任上海浦东发展银行资金总部货币市场及固定收益交易员、交银康联人寿保险有限公司固定收益高级投资经理、汇丰晋信基金管理有限公司投资经理，现任本基金基金经理、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期为本基金管理人公告郑屹、李羿先生担任本基金基金经理的日期；

2. 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 公平交易专项说明

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 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

权益方面：2014 年 4 季度沪深 300 指数上涨 44.17%，按照中信行业指数分类，季度表现较好的行业是非银行金融、建筑、银行，单季度涨幅都超过了 60%，而表现较差的行业是电子元器件、轻工制造、通信，全部是下跌，跌幅在 1%-8%。整体看，4 季度市场表现以结构化行情为主，但与前三季度结构表现反转，主要是大盘蓝筹的估值修复行情，4 季度国内市场涨幅居全球第一。

四季度的操作上，由于低估了大盘蓝筹估值修复的强度，因此 4 季度股票配置上与前三季度变化不大，重点配置了化工、医药、大众消费品等行业，整体 4 季度股票方面跑输了大盘。

债券方面：经济仍在“新常态”预期中低位徘徊，工业增加值和投资数据均继续下滑。流动性方面，央行下调了存贷款利率，下调正回购利率直至暂停了正回购公开市场操作，并通过 SLF、MLF 等操作维持流动性平稳宽松。债市方面，总体呈现小幅波动，先是由于经济数据不佳和降准预期导致收益率快速下行，后因降息兑现、新股申购和中登回购政策调整等因素影响，收益率有所回升。信用方面，受到中登回购政策调整以及个别城投债纳入地方政府债务受挫事件影响，信用利差有所扩大，尤其以城投债为甚。

四季度中债新综合全价指数上涨 1.66%，中债国债全价指数上涨 2.56%，中债金融债全价指数上涨 2.22%，中债信用债全价指数上涨 0.82%，中信标普可转债指数上涨 42.29%。

四季度的操作上，我们总体上维持了组合久期，在品种上超配了中长久期利率债、中高等级债券和可转换债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金业绩表现为 9.69%，同期业绩比较基准表现为 4.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来 1 至 2 个季度的经济可能将有所企稳，我们也观察到经济结构正在悄然发生变化。然而，目前的经济增速中长期来看仍处于高位，将来仍将趋势下行。债市从中期来看基本面对债市仍然看多，未来市场仍将有一定的行情空间。

权益方面，展望 2015 年 1 季度，虽然近几月 PMI 逐月下滑，但仍保持在 50 荣枯线之上，因此不担心经济出现硬着陆的风险，因此预计 1 季度大盘指数出现大幅回调的风险较低。在股票投资方面，将重点配置受益改革预期、供给收缩的中游行业和行业趋势向好的行业，行业配置上，相对看好医药、化工、高铁、核电、大众消费品等行业。

债券方面，总体上应遵循中期趋势，过滤短期噪音扰动。债市从中期来看基本面对债市仍然看多，未来市场仍将有一定的行情空间。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	33,494,403.30	10.63
	其中：股票	33,494,403.30	10.63
2	固定收益投资	247,065,522.17	78.39
	其中：债券	247,065,522.17	78.39
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,764,494.18	9.44
7	其他资产	4,832,098.70	1.53
8	合计	315,156,518.35	100.00

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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,431,881.60	9.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,793,891.70	0.57
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	1,268,630.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	33,494,403.30	10.71

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	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002102	冠福股份	1,003,555	8,831,284.00	2.82
2	300169	天晟新材	1,027,563	8,467,119.12	2.71
3	000612	焦作万方	506,787	5,118,548.70	1.64
4	000961	中南建设	130,941	1,793,891.70	0.57
5	600887	伊利股份	50,106	1,434,534.78	0.46
6	600352	浙江龙盛	69,900	1,375,632.00	0.44
7	000651	格力电器	36,900	1,369,728.00	0.44
8	000333	美的集团	49,000	1,344,560.00	0.43
9	300291	华录百纳	41,800	1,268,630.00	0.41
10	002366	丹甫股份	41,900	1,267,475.00	0.41

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,397,000.00	26.03
	其中：政策性金融债	81,397,000.00	26.03
4	企业债券	65,064,270.00	20.81
5	企业短期融资券	10,032,000.00	3.21
6	中期票据	-	-
7	可转债	90,572,252.17	28.97
8	其他	-	-
9	合计	247,065,522.17	79.02

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	060201	06 国开 01	200,000	19,788,000.00	6.33
2	110023	民生转债	99,710	13,786,901.70	4.41
3	124086	12 诸建投	125,000	12,687,500.00	4.06
4	113002	工行转债	72,500	10,816,275.00	3.46
5	140222	14 国开 22	100,000	10,758,000.00	3.44

5.6 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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,520.72
2	应收证券清算款	1,469,413.42
3	应收股利	-
4	应收利息	3,213,915.51
5	应收申购款	106,249.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,832,098.70

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	13,786,901.70	4.41
2	113002	工行转债	10,816,275.00	3.46
3	113001	中行转债	9,395,400.00	3.01
4	113005	平安转债	8,118,900.00	2.60
5	110015	石化转债	8,095,200.00	2.59

6	125089	深机转债	7,344,292.47	2.35
7	110018	国电转债	7,215,250.00	2.31
8	110020	南山转债	6,561,670.00	2.10
9	128005	齐翔转债	1,686,724.00	0.54

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000612	焦作万方	5,118,548.70	1.64	重大事项

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	563,413,051.41
报告期期间基金总申购份额	1,924,825.52
减：报告期期间基金总赎回份额	333,560,170.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	231,777,706.38

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信 2016 生命周期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 2016 生命周期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

9.2 存放地点

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 楼本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司
2015 年 1 月 22 日