# 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

## 2011 第二季度 报告

2011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:交通银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一一年七月二十日**

### §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2011年7月18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2011年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇丰晋信龙腾股票 |
| 基金主代码 | 540002 |
| 前端交易代码 | 540002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年9月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,462,647,930.02份 |
| 投资目标 | 本基金通过精选受益于中国经济持续高速增长而呈现出可持续竞争优势、未来良好成长性以及持续盈利增长潜力的上市公司,追求超越基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。 |
| 投资策略 | 1. 适度调整的资产配置策略<br>本基金奉行"注重成长、精选个股、长期投资"的投资理念和"自下而上"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。<br>2. 以成长指标为核心的股票筛选策略<br>本基金在明确的成长性评估体系基础上,对初选股票给予全面的成长性分析,成长性指标包括:主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率(P/E)、净资产收益率(ROE)等。同时,再通过严格的基本面分析(CFROI(投资现金回报率)指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析)和公司实地调研,最终挑选出具有可持续竞争优势,未来有良好成长性和盈利持续增长潜力的上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 75%×新华富时600成长指数收益率+25%×1年期银行定期存款利率(税后) |
| 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、收益较高的基金产品。 |
| 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(2011年4月1日-2011年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -9,255,924.06 |
| 2.本期利润 | -84,418,475.28 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0825 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,036,469,800.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3923 |

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。

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

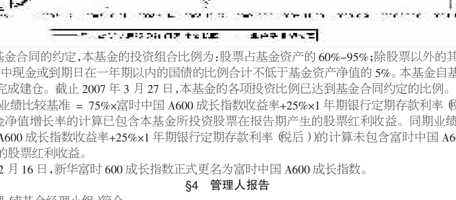
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -5.76% | 0.95% | -4.10% | 0.85% | -1.66% | 0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年9月27日至2011年6月30日)



注:1. 按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:股票占基金资产的60%-95%;除股票以外的其他资产占基金资产的5%-40%,其中现金或到期日在一年期以内的国债的比例合计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6个月内完成建仓。截止2007年3月27日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 本基金的业绩比较基准 = 75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×1年期银行定期存款利率(税后)。

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(75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×1年期银行定期存款利率(税后))的计算未包含富时中国A600成长指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4. 2010年12月16日,新华富时600成长指数正式更名为富时中国A600成长指数。

### §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 | | |
| 林彤彤 | 副总经理、首席投资官、本基金基金经理 | 2006-9-27 | - | 12年 | 林彤彤先生,硕士学历。曾任华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员,基金安信、基金安久、基金安顺、基金安瑞的基金经理,投资部总监助理兼基金安信基金经理、汇丰晋信大盘股票型开放式证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信基金副总经理、首席投资官、本基金基金经理。 |
| 廖志峰 | 本基金基金经理、汇丰晋信中小盘股票型开放式证券投资基金经理 | 2010-3-3 | - | 9年 | 廖志峰先生,香港大学工商管理硕士,具备基金从业资格。曾任上海国圣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。汇丰晋信中小盘股票型开放式证券投资基金经理,现任本基金基金经理。 |

注:1.任职日期为本基金基金合同生效日或本基金管理人公告廖志峰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

2011年2季度,本基金严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易,未发现任何异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本公司旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

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

2011年二季度,沪深300指数收于3044点,当季跌幅为5.56%。在此期间,市场风格指数分化明显,以上证50为代表的大盘蓝筹股明显跑赢以中证500为代表的中小盘股。但是从分行业表现来看,二季度表现较好的既有食品饮料,家电等消费股,也有煤炭,非银行金融,房地产等周期类股票;同样,二季度表现较差的既有有色金属,电子元器件等强周期股票;也有通信,餐饮旅游等消费类股票。事实上,二季度市场行业轮动十分频繁,热点切换也很迅速,主要原因来自于二季度市场所面临的巨大不确定性:无论是经济增长,还是通货膨胀,整个二季度投资者都处于争论,担忧,乃至恐惧之中,市场反复震荡,热点频繁切换,客观上增加了二季度的投资难度。二季度,龙腾基金延续了一直以来的精选个股策略,基金大幅降低了部分存在业绩风险的小盘股配置权重;同时,基金加大了具备良好业绩和估值优势的大盘股投资比例;保持了具有长期增长潜力的低碳环保、消费、科技等行业的投资力度,但是由于二季度市场风格完全偏向大盘股,成长股的落后表现在一定程度上拖累了本季基金业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年二季度本基金净值增长率为-5.76%,同期业绩比较基准收益率为-4.10%,本基金表现落后比较基准1.66%。

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2011年下半年,在经济回落预期趋于平稳,通胀失控预期逐步回落的背景下,下半年市场的不确定因素将明显较少,市场有望迎来震荡趋升行情。从政策预期来看,包括保障房建设,十二五规划推进等等,都可能催生新的市场热点。而从当前市场的估值来看,整体市场低估特征依然明显,经过半年多的调整,市场结构性风险也已经基本释放完毕。因此,下半年一旦通胀预期明显回落,经济重新回到增长轨道,市场就很有可能进入百花齐放的良性状态。从个股选择上来看,在趋于良性的经济环境下,成长股的优势将会重新闪现:我们判断那些符合中国经济转型需要,具备竞争优势的成长型企业将在下半年迎来更快的发展机会。以节能环保、新能源为代表的新兴产业;以高端装备,消费为代表的升级行业仍然具有长期增长潜力。龙腾基金将继续对这些行业予以重点关注。

### §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 | 1,608,307,182.60 | 78.59 |
| | 其中:股票 | 1,608,307,182.60 | 78.59 |
| 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 | 434,384,390.64 | 21.23 |
| 6 | 其他各项资产 | 3,838,435.65 | 0.19 |
| 7 | 合计 | 2,046,530,008.89 | 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 | 采掘业 | 44,273,215.80 | 2.17 |
| C | 制造业 | 784,213,757.07 | 38.51 |
| C0 | 食品、饮料 | 138,735,648.18 | 6.81 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 25,576,551.29 | 1.26 |
| C5 | 电子 | 11,101,719.75 | 0.55 |
| C6 | 金属、非金属 | 10,349,640.00 | 0.51 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 433,892,675.69 | 21.31 |
| C8 | 医药、生物制品 | 164,557,522.16 | 8.08 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 42,686,115.36 | 2.10 |
| E | 建筑业 | 40,941,081.99 | 2.01 |
| F | 交通运输、仓储业 | 53,168,874.03 | 2.61 |
| G | 信息技术业 | 98,006,696.20 | 4.81 |
| H | 批发和零售贸易 | 126,059,622.38 | 6.19 |
| I | 金融、保险业 | 350,130,642.07 | 17.19 |
| J | 房地产业 | 35,045,032.89 | 1.72 |
| K | 社会服务业 | 7,490,686.37 | 0.37 |
| L | 传播与文化产业 | 26,291,458.44 | 1.29 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,608,307,182.60 | 78.98 |

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 | 002073 | 软控股份 | 5,666,888 | 116,737,892.80 | 5.73 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,316,888 | 111,836,183.76 | 5.49 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 6,888,999 | 89,694,766.98 | 4.40 |
| 4 | 002038 | 双鹭药业 | 2,099,821 | 79,268,242.75 | 3.89 |
| 5 | 002024 | 苏宁电器 | 5,888,888 | 75,436,655.28 | 3.70 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 4,888,888 | 63,946,655.04 | 3.14 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 2,666,999 | 62,674,476.50 | 3.08 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 267,899 | 56,963,364.37 | 2.80 |
| 9 | 002123 | 荣信股份 | 2,363,313 | 53,836,270.14 | 2.64 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 1,816,854 | 51,380,631.12 | 2.52 |

5.4 报告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。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,884,895.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 831,617.51 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 106,888.38 |
| 5 | 应收申购款 | 1,015,034.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,838,435.65 |

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日基金份额总额 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 920,675,939.51 |
| 本报告期基金总申购份额 | 796,908,895.82 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 254,936,905.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,462,647,930.02 |

### §7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼本基金管理人办公地址。

7.3 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:021-38789998

公司网址:http://www.hsbcjt.cn

**汇丰晋信基金管理有限公司**
**二〇一一年七月二十日**

# 汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

## 2011 第二季度 报告

2011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:交通银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一一年七月二十日**

### §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2011年7月18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2011年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇丰晋信动态策略混合 |
| 基金主代码 | 540003 |
| 前端交易代码 | 540003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年4月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,134,330,532.79份 |
| 投资目标 | 本基金将致力于捕捉股票、债券等市场不同阶段中的不同投资机会,无论其处于牛市或者熊市,均通过基金资产在不同市场的合理配置,追求基金资产的长期较高回报。 |
| 投资策略 | 1. 积极主动的资产配置策略<br>本基金奉行"恰当时机、恰当比重、恰当选股"的投资理念和"自上而下"与"自下而上"的双重选股策略。在投资决策中,本基金结合全球经济增长、通货膨胀和利息的预期,预测中国股票、债券市场的未来走势,在长期投资的基础上,将战略资产配置与择时相结合,灵活、主动的调整基金资产在股票、固定收益和现金上的配置比例。同时,在各类资产中,本基金根据其参与市场基本要素的变动,调整各类资产品种具体投资品种的种类和数量。<br>2. 综合相对、绝对估值方法的股票筛选策略<br>本基金不拘泥于单一的价值标准或成长标准,对股票给予全面的成长、价值分析,优选出价值低估,成长低估的上市公司进行投资。成长指标包括:主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、市盈率(P/E)、净资产收益率(ROE)等;价值指标包括:市净率(P/B)、每股收益率、年现金流/市值、股息率等。同时,再通过严格的基本面分析(CFROI(投资现金回报率)指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析)和公司实地调研,最大程度地筛选出有投资价值的投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 业绩比较基准 = 50%×MSCI中国A股指数收益率+50%×中信标普全债指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,属于证券投资基金中预期风险、收益中等的基金产品。 |
| 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(2011年4月1日-2011年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 303,882.67 |
| 2.本期利润 | -134,994,015.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0625 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,447,738,133.67 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1468 |

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。

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

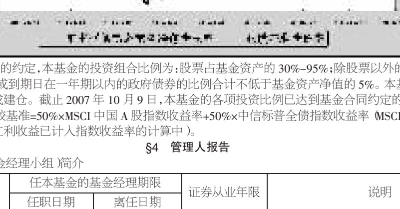
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -5.07% | 0.92% | -2.30% | 0.57% | -2.77% | 0.35% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年4月9日至2011年6月30日)



注:1. 按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:股票占基金资产的30%-95%;除股票以外的其他资产占基金资产的5%-70%,其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计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2007年10月9日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 本基金的业绩比较基准=50%×MSCI中国A股指数收益率+50%×中信标普全债指数收益率(MSCI中国A股指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中)。

### §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 | | |
| 邵骥咏 | 本基金基金经理、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理 | 2009-5-21 | - | 19年 | 邵骥咏先生,上海交通大学会计学硕士,中国注册会计师(CPA)。曾任华安基金管理有限公司交易员、汇丰晋信基金管理有限公司交易主管,2007年9月至2009年5月任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、汇丰晋信低碳先锋股票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邵骥咏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

2011年第2季度,本基金严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易,未发现任何异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本公司旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

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

2011年第二季度,沪深两市指数走势总体在国内经济增速预期回落,通胀数据持续升温的背景下展开调整行情,并在创出年内低点后有所趋稳。

回顾分析这段时间市场表现以及行业特征,我们认为投资者对经济是否陷入类滞胀的担忧,是造成二季度市场表现较为平淡,整体投资机会不多的最主要因素。

在这个阶段投资操作中,我们根据形势的变化,立足于对经济增长中最稳定因素的把握,结合各行业的估值水平比较,逐步增加了对社保保障房、水利建设、智能交通、消费需求等民生相关领域的投资力度,以期把握估值相对合理,盈利稳定增长环境下,部分行业的投资机会。同时,根据实地调研和草根研究的结果,继续坚定持有代表未来新兴产业发展方向的优秀公司,我们始终认为,在经济转型势在必然的大背景下,长期持有代表未来经济发展方向的主导性行业优秀上市公司,长期看一定能够取得好的投资回报。

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-5.07%,同期基金业绩比较基准表现为-2.30%,本基金落后业绩比较基准2.77个百分点。同期沪深300指数表现为-5.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下个阶段的投资操作,总体上我们继续保持谨慎乐观的态度,三季度市场将延续震荡的格局不变,市场底部在经济稳定增长,通胀数据回落的趋势下预计有所抬升。

我们认为,经济的平稳增长预示企业盈利能够保持稳定的增速,而通胀数据的回落,也会使得投资者上半年的谨慎情绪一定程度上得到舒缓。客观上这些都会有利于市场的估值水平回升。

因此,在具体操作中,我们将重点关注以上这些因素的变化趋势,争取及时做出正确的投资反应,在控制投资风险的同时把握机会;同时,进一步加强行业研究和公司研究,希望通过草根调研来加大对行业景气度的把握,以及对公司中长期发展趋势的了解和信心,利用市场波动机会捕捉投资良机。

### §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 | 1,888,065,159.24 | 76.88 |
| | 其中:股票 | 1,888,065,159.24 | 76.88 |
| 2 | 固定收益投资 | 9,350,717.00 | 0.38 |
| | 其中:债券 | 9,350,717.00 | 0.38 |
| | 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 | 541,555,755.27 | 22.05 |
| 6 | 其他各项资产 | 16,893,041.02 | 0.69 |
| 7 | 合计 | 2,455,864,672.53 | 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 | 17,452,164.62 | 0.71 |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,088,295,412.97 | 44.46 |
| C0 | 食品、饮料 | 209,450,723.08 | 8.56 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 100,857,491.14 | 4.12 |
| C5 | 电子 | 29,516,342.21 | 1.21 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 502,610,580.24 | 20.53 |
| C8 | 医药、生物制品 | 245,860,276.30 | 10.04 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 50,196,821.95 | 2.05 |
| F | 交通运输、仓储业 | 59,786,705.16 | 2.44 |
| G | 信息技术业 | 138,796,165.59 | 5.67 |
| H | 批发和零售贸易 | 152,096,447.48 | 6.21 |
| I | 金融、保险业 | 367,314,143.04 | 15.01 |
| J | 房地产业 | 5,999,500.00 | 0.25 |
| K | 社会服务业 | 8,127,798.43 | 0.33 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,888,065,159.24 | 77.14 |

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 | 002038 | 双鹭药业 | 3,603,879 | 136,046,432.25 | 5.56 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,578,727 | 124,475,152.29 | 5.09 |
| 3 | 002152 | 广电运通 | 3,487,657 | 107,524,465.31 | 4.39 |
| 4 | 002073 | 软控股份 | 4,796,084 | 98,799,330.40 | 4.04 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 4,294,767 | 96,159,833.13 | 3.93 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 6,266,219 | 81,586,171.38 | 3.33 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 4,976,528 | 65,092,986.24 | 2.66 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 7,299,964 | 59,786,705.16 | 2.44 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 276,000 | 58,685,880.00 | 2.40 |
| 10 | 600458 | 时代新材 | 2,895,091 | 55,701,550.84 | 2.28 |

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 | 9,350,717.00 | 0.38 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,350,717.00 | 0.38 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 9,350,717.00 | 0.38 |

5.5 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 | 080221 | 08国开21 | 94,100 | 9,350,717.00 | 0.38 |

注:上表所列示的债券,为截止本报告期末,本基金持有的全部债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,880,484.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,217,897.58 |
| 3 | 应收股利 | 2,299,488.66 |
| 4 | 应收利息 | 313,473.65 |
| 5 | 应收申购款 | 181,696.34 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,893,041.02 |

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日基金份额总额 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,157,538,348.25 |
| 本报告期基金总申购份额 | 92,992,358.07 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 116,200,173.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,134,330,532.79 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1)中国证监会批准汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金设立的文件

2)汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金合同

3)汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金招募说明书

4)汇丰晋信动态策略混合型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)报告期内汇丰晋信动态策略混合型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

7.2 存放地点

上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼本基金管理人办公地址。

7.3 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:021-38789998

公司网址:http://www.hsbcjt.cn

**汇丰晋信基金管理有限公司**
**二〇一一年七月二十日**

# 汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

## 2011 第二季度 报告

2011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:交通银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一一年七月二十日**

### §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2011年7月18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2011年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 605,000,181.85份 |
| 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 | (1)资产配置策略<br>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。<br>(2)行业配置策略<br>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。<br>(3)股票资产投资策略<br>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出基础股票池。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。<br>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。 |
| 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。 |
| 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(2011年4月1日-2011年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -4,144,113.02 |
| 2.本期利润 | -31,773,298.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0506 |
| 4.期末基金资产净值 | 609,826,226.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0080 |

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。

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

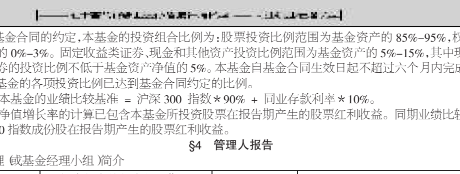
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -4.64% | 1.01% | -4.99% | 0.99% | 0.35% | 0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年6月8日至2011年6月30日)



注: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。

### §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 | | |
| 邵骥咏 | 本基金基金经理、汇丰晋信动态策略混合型基金基金经理 | 2010-6-8 | - | 19年 | 邵骥咏先生,上海交通大学会计学硕士,中国注册会计师(CPA)。曾任华安基金管理有限公司交易员、汇丰晋信基金管理有限公司交易主管,2007年9月至2009年5月任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、汇丰晋信动态策略混合型基金基金经理。 |

注:1.任职日期为本基金合同生效日;

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

2011年第2季度,本基金严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本公司制定的《公平交易管理办法》执行相关交易,未发现任何异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本公司旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有异常交易行为。

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

2011年第二季度,沪深两市指数走势总体在国内经济增速预期回落,通胀数据持续升温的背景下展开调整行情,并在创出年内低点后有所趋稳。

回顾分析这段时间市场表现以及行业特征,我们认为投资者对经济是否陷入类滞胀的担忧,是造成二季度市场表现较为平淡,整体投资机会不多的最主要因素。

在这个阶段的投资操作中,我们结合国内国际经济环境的变化,以及对市场各行业经营景气度的影响,进一步加大对重点行业和公司的草根调研和案头研究。我们认为,随着部分成长性行业中优秀公司估值水平的回落,这些公司的中长期投资价值将再次浮现。因此,在市场风格变化莫测,行业轮动持续节奏不强,投资者情绪此起彼伏的背景下,我们更愿意继续坚定持有代表未来新兴产业发展方向的重点行业和优秀公司,我们始终认为,在经济转型势在必然的大背景下,长期持有代表未来经济发展方向的主导性行业优秀上市公司,长期看一定能够取得好的投资回报。

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-4.64%,同期基金业绩比较基准表现为-4.99%,本基金表现领先业绩比较基准0.35个百分点。同期沪深300指数表现为-5.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下个阶段的投资操作,总体上我们继续保持谨慎乐观的态度,三季度市场将延续震荡的格局不变,市场底部在经济稳定增长,通胀数据回落的趋势下预计有所抬升。

我们认为,经济平稳增长,结合下半年通胀预期的回落,将有利于经济结构未来转型的节奏和力度适度加快。由此,新兴产业中部分优势行业,以及一些受内需拉动更加显著的产业如医药、食品饮料等,都将存在不错的投资机会。

因此,在具体操作中,我们将重点关注以上这些因素的变化趋势,争取及时做出正确的投资反应,在控制投资风险的同时把握机会;同时,进一步加强行业研究和公司研究,希望通过草根调研来加大对行业景气度的把握,以及对公司中长期发展趋势的了解和信心,利用市场波动机会捕捉投资良机。

### §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 | 531,586,025.07 | 86.41 |
| | 其中:股票 | 531,586,025.07 | 86.41 |
| 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 | 75,462,198.86 | 12.27 |
| 6 | 其他各项资产 | 8,163,690.48 | 1.33 |
| 7 | 合计 | 615,211,914.41 | 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 | 4,137,600.00 | 0.68 |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 316,473,721.27 | 51.90 |
| C0 | 食品、饮料 | 65,170,527.57 | 10.69 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 17,362,274.80 | 2.85 |
| C5 | 电子 | 7,024,064.39 | 1.15 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 151,424,460.04 | 24.83 |
| C8 | 医药、生物制品 | 75,492,394.47 | 12.38 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 16,816,086.94 | 2.76 |
| F | 交通运输、仓储业 | 9,696,411.27 | 1.59 |
| G | 信息技术业 | 42,661,901.43 | 7.00 |
| H | 批发和零售贸易 | 45,440,640.78 | 7.45 |
| I | 金融、保险业 | 93,731,227.59 | 15.37 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 2,628,435.79 | 0.43 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 531,586,025.07 | 87.17 |

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 | 002038 | 双鹭药业 | 910,803 | 34,382,813.25 | 5.64 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 653,722 | 31,555,160.94 | 5.17 |
| 3 | 002152 | 广电运通 | 907,612 | 27,981,677.96 | 4.59 |
| 4 | 002073 | 软控股份 | 1,347,181 | 27,751,928.60 | 4.55 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 1,127,883 | 25,253,300.37 | 4.14 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 99,941 | 21,250,454.83 | 3.48 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 1,508,024 | 19,634,472.48 | 3.22 |
| 8 | 600104 | 上海汽车 | 1,022,185 | 19,155,746.90 | 3.14 |
| 9 | 000423 | 东阿阿胶 | 430,149 | 17,747,947.74 | 2.91 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 1,321,735 | 17,288,293.80 | 2.83 |

5.4 报告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。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 329,656.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,082,466.96 |
| 3 | 应收股利 | 491,400.00 |
| 4 | 应收利息 | 26,436.64 |
| 5 | 应收申购款 | 1,233,730.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,163,690.48 |

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日基金份额总额 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 631,082,320.14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 58,214,762.08 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 84,296,900.37 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 605,000,181.85 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1)中国证监会批准汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金设立的文件

2)汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同

3)汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金招募说明书

4)汇丰晋信低碳先锋股票型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)报告期内汇丰晋信低碳先锋股票型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

7.2 存放地点

上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼本基金管理人办公地址。

7.3 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:021-38789998

公司网址:http://www.hsbcjt.cn

**汇丰晋信基金管理有限公司**
**二〇一一年七月二十日**