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
报告送出日期:二〇一三年三月二十八日

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月27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。

毕马威华振会计师事务所为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012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	596,276,143.46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	(1)资产配置策略 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。 (2)行业配置策略 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。 (3)股票投资策略 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。
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	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	021-38789898	010-67595096
	电子邮箱	melody.y.gu@hsbcjt.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38789998	010-67595096
传真		021-68881925	010-66275853

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:上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35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、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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-55,217,542.85	-75,324,067.80	38,808,020.69
本期利润	6,539,125.94	-245,168,925.00	128,906,286.89
加权平均基金份额本期利润	0.0106	-0.3573	0.0751
本期基金份额净值增长率	1.44%	-33.56%	8.60%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2683	-0.2787	0.0723
期末基金资产净值	436,267,975.55	455,916,423.09	912,399,401.78
期末基金份额净值	0.7317	0.7213	1.0867

注:①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;

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;

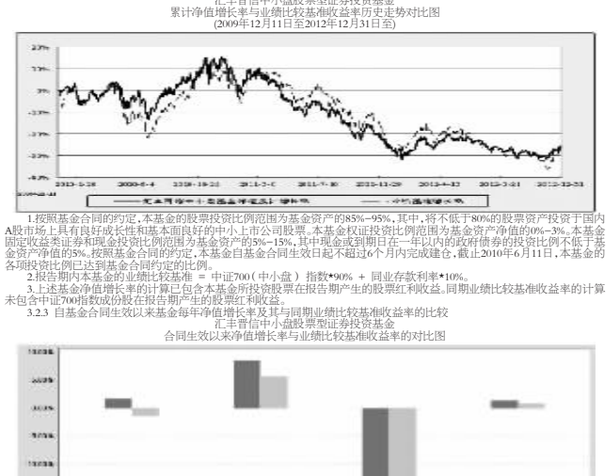
3.2基金净值表现

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
过去三个月	4.68%	0.85%	3.44%	1.24%	1.24%	-0.39%
过去六个月	-3.09%	0.81%	-3.43%	1.26%	0.34%	-0.45%
过去一年	1.44%	1.05%	0.88%	1.34%	0.56%	-0.29%
过去三年	-26.81%	1.29%	-25.16%	1.42%	-1.65%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-25.50%	1.28%	-26.14%	1.42%	0.64%	-0.14%

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
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2012年12月31日止)



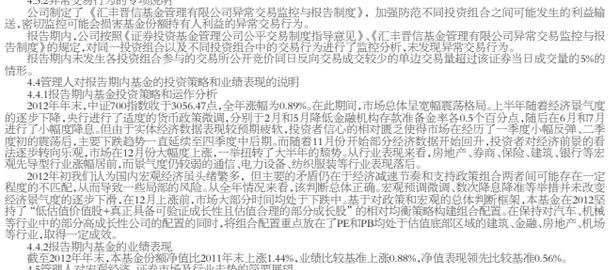
1.按照基金合同的约定,本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%,其中,将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有良好成长性和基本面向好的上市公司股票。本基金权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过6个月内完成建仓,截止2010年6月11日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

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。

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

汇丰晋信中小盘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



①本基金的基金合同于2009年12月11日生效,截至2012年12月31日,基金合同生效不满四年;

②合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,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
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	0.200	14,307,862.88	3,415,516.26	17,723,379.14	-
合计	0.200	14,307,862.88	3,415,516.26	17,723,379.14	-

注:本基金的基金合同于2009年12月11日生效,截止日为2012年12月31日,基金合同生效已满3年。

§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2012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		
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	-	11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,现任本基金基金经理、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期为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管理人对投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同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

2012年年末,中证700指数收于3056.47点,全年涨幅为0.89%。在此期间,市场总体呈宽幅震荡格局。上半年随着经济景气度的逐步下降,央行进行了适度的货币政策微调,分别于2月和5月降低金融机构存款准备金率各0.5个百分点,随后在6月和7月进行了小幅降息。但由于实体经济数据表现较预期疲软,投资者信心的相对匮乏使得市场在经历了一季度小幅反弹、二季度时的震荡后,主要下跌趋势一直延续至四季度中后期。而随着11月份开始部分经济数据开始回升,投资者对经济前景的看法逐步转向乐观,市场在12月份大幅度上涨,一举扭转了大半年的颓势。从行业表现来看,房地产、券商、保险、建筑、银行等宏观先导型行业涨幅居前;而景气度仍较弱的通信、电力设备、纺织服装等行业表现落后。

2012年初我们认为国内宏观经济虽大幅数多,但主要的矛盾仍在于经济减速节奏和支持政策组合两者间可能存在一定程度的不匹配,从而导致一些局部的风险。从全年情况来看,该判断总体正确。宏观预调微调、数次降息降准等举措并未改变经济景气度的逐步下滑,在12月上涨前,市场大部分时间均处于下跌中。基于对政策和宏观的总体判断框架,本基金在2012整持了"低估值价值股+真正具备可验证成长性且估值合理的部分成长股"的相对均衡策略构建组合配置。在保持对汽车、机械等行业中的部分高成长性公司的配置的同时,将组合配置重点放在了PE和PB均处于估值底部区域的建筑、金融、房地产、机场等行业,取得一定成效。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年年末,本基金份额净值比2011年末上涨1.44%,业绩比较基准上涨0.88%,净值表现领先比较基准0.56%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,我们认为2012年四季度出现的经济小幅复苏态势有望延续,但是目前仍无法确切判断本次经济反弹的力度和持续时间,需要进一步观察后续经济数据进行验证。另外,新一届政府对待经济转型、基础建设、收入分配改革等关键领域政策态度目前仍难称清晰。从未来一到三年的中观角度看,新一届政府提出的新型城镇化的纲领性政策,究竟是原有政府投资驱动型模式的延续,还是真正向内需消费驱动型经济体转型,对中国经济长期前景影响巨大。我们注意到,向内需驱动型经济转型的许多必要条件,如较大力度进行减税、削减政府一公开支、提高居民医疗、养老投入、鼓励国有资断等实质性举措迄今为止仍未见明显改变迹象。反而,近期各地方政府纷纷出台新一轮动辄超过万亿的固定资产投资计划的事件,使我们对经济在原有模式上越行越远、宏观及金融风险继续加速累积的长期顾虑有所加深。

从资本市场角度出发,A股市场对短期宏观经济变动越发关注,行业轮动的节奏也明显加快。2012四季度以来,社会用电量、PMI、净地产投资等一系列宏观数据均出现较明显环比改善迹象,有利于资本市场的活跃。同时,在经历了12月份市场大幅上涨后,我们对2013年一季度至终端市场采取"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。

综合判断我们认为,2013年宏观经济反弹走势有望延续,虽然力度和持续时间仍需后续数据验证,但从大格局上来看,2013年宏观面比2012年要乐观。最起码我们目前看到了经济有可能改变自08年四万亿刺激计划过后的宏观下行周期的些许可能。虽然,从理论上而言,正式确认经济复苏需要连续两个季度宏观数据的支持;虽然,我们从内心深处对中国经济许多长期的、内在的问题仍抱有深深的疑虑,但是,对于资本市场的表现,我们将比2012年要相对乐观,因为我们相信,宏观经济的好转将在股票市场表现中得到影射。本基金将增加宏观敏感型、估值较低的价值股的配置。关注新型城镇化的后续具体政策,密切跟踪宏观数据、经济运行情况的变化以调整我们的策略。

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》(《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》(《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了《汇丰晋信基金管理有限公司证券投资基金估值小组议事规则》,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证券投资基金估值小组议事规则》:

1.公司特设投资基金种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关,投资基金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。投资基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基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.投资基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,报经投资基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.公司管理的基金产品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审计报告

毕马威华振审字第 1300017 号

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的第 17 页至第40 页的汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金 (以下简称汇丰晋信中小盘基金) 财务报表,包括2012 年12 月31 日的资产负债表、2012 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。

6.1管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是汇丰晋信中小盘基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《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》及中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价汇丰晋信基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3审计意见

我们认为,汇丰晋信中小盘基金财务报表已经按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《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》及中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了汇丰晋信中小盘基金2011年12月31日的财务状况以及自2011 年1 月1 日至2011 年12 月31 日止年度的经营成果和基金净值变动情况。

毕马威华振会计师事务所　注册会计师 王国蓉 石峰
中国上海南京西路1266号恒隆广场50楼
2013-03-28

§7年度财务报表

7.1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:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	37,754,801.43	65,073,085.86
结算备付金		1,216,136.54	644,857.86
存出保证金		250,000.00	341,311.55
交易性金融资产	7.4.7.2	397,233,659.48	396,305,354.31
其中:股票投资		397,233,659.48	396,305,354.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		24,797,887.33	4,434,482.18
应收利息	7.4.7.5	11,373.77	10,543.00
应收股利		-	-
应收申购款		13,923.12	52,602.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		461,277,781.67	466,862,237.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
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		22,701,544.08	8,767,737.85
应付赎回款		406,621.33	105,110.74
应付管理人报酬		535,900.63	596,967.18
应付托管费		89,316.78	99,494.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	874,890.83	1,016,108.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	401,532.47	360,396.14
负债合计		25,009,806.12	10,945,814.59
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	596,276,143.46	632,079,112.69
未分配利润	7.4.7.10	-160,008,167.91	-176,162,689.60
所有者权益合计		436,267,975.55	455,916,423.09
负债和所有者权益总计		461,277,781.67	466,862,237.68

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.7317元,基金份额总额596,276,143.46 份。

7.2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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		20,141,075.44	-224,065,303.12
1.利息收入		455,404.48	521,712.49
其中:存款利息收入	7.4.7.11	455,404.48	521,712.49
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)		-42,117,298.73	-55,164,518.43
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-49,767,945.10	-59,866,630.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,650,646.37	4,702,112.09
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	61,756,668.79	-169,844,857.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	46,300.90	422,360.02
减:二、费用		13,601,949.50	21,103,621.88
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	6,686,767.18	9,482,210.45
2.托管费	7.4.10.2.2	1,114,461.19	1,580,368.37
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	5,381,572.13	9,536,734.79
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	419,149.00	504,308.27
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,539,125.94	-245,168,925.00
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,539,125.94	-245,168,925.00

7.3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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	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)	-	6,539,125.94	6,539,125.94
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)	-35,802,969.23	9,615,395.75	-26,187,573.48
其中:1.基金申购款	15,005,153.87	-4,154,764.17	10,850,389.70
2.基金赎回款	-50,808,123.10	13,770,159.92	-37,037,963.18
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)	596,276,143.46	-160,008,167.91	436,267,975.55
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
项目	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)	840,396,697.80	72,002,703.98	912,399,401.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-245,168,925.00	-245,168,925.00
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)	-208,317,585.11	-2,996,468.58	-211,314,053.69
其中:1.基金申购款	43,236,224.08	-2,200,094.02	41,036,130.06
2.基金赎回款	-251,553,809.19	-796,374.56	-252,350,183.75
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)	632,079,112.69	-176,162,689.60	455,916,423.09

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:

基金管理人公司负责人:杨小男,主管会计工作负责人:王栎,会计机构负责人:杨洋

7.4报表附注

7.4.1基金基本情况

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(以下简称"汇丰晋信中小盘基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"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》(证监许可[2009]1105 号文)的批准,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》发售,基金自于2009 年12 月11 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为2,233,818,289.91 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。基金投资组合的比例范围为: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,按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《汇丰晋信中小盘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 2012 年12 月31 日的财务状况,2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2011年01月01日至2011年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。

应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

持有至到期投资

本基金将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。

可供出售金融资产

本基金将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。

其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于交付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益;应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产,终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列