汇丰晋信大盘股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信大盘股票
基金主代码	540006
前端交易代码	540006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
报告期末基金份额总额	777,296,692.01份
投资目标	通过投资于盈利预期持续稳定增长,在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票,在将合理控制风险的基础上,追求稳健的分红收益及长期资本利得,实现基金资产持续超越业绩比较基准的收益。
投资策略	1、资产配置策略 根据本基金所奉行的"较高仓位、蓝筹公司、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、股票资产投资策略 本基金专注于分析大盘股特有的竞争优势,基金管理人将对初选股票给予全面的价值、成长分析,并结合行业地位分析,优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹型股票进行投资。
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	本基金属于股票型基金产品,在开放式基金中,其预期风险和收益水平高于债券型基金和混合型基金,属于风险水平较高的基金产品。本基金主要投资于大盘蓝筹股票,在股票型基金中属于中等风险水平的投资产品。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	38,685,191.50
2.本期利润	105,999,590.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.1245
4.期末基金资产净值	881,754,724.21
5.期末基金份额净值	1.1344

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	11.91%	1.35%	8.54%	1.29%	3.37%	0.06%

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

汇丰晋信大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6月24日至2013年9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,本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各行业中具有领先地位的大盘蓝筹股票。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2009年12月24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		
王品	本基基金经理、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金基金经理	2009-6-24	-	13年	王品女士,中国药科大学理学硕士。历任兴业证券股份有限公司医药行业研究员,中银国际基金管理公司中银中国基金经理助理、行业研究员,汇丰晋信基金管理公司高级研究员。现任本基金基金经理、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期为本基金基金合同生效日;
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

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年三季度,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或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运作分析

受内部与外部需求改善的推动,2013年三季度经济增长较二季度有所加快,其中,内需的改善主要得益于前期政府的一系列稳增长政策、基础设施与制造业投资增速在政策的引导下回比上升,消费增速也因地产旺销带动了相关产品的消费而企稳回升;外需则受益于海外经济的回暖有所好转;此外,企业的补库存行为也有助于总需求的扩张。三季度央行维持了中性的货币政策,相关的流动性指标如M2增速、社会融资总额均高于市场预期。在经济增速回升、货币政策中性的背景下,三季度市场出现了明显的上涨,沪深300指数上涨了9.47%,创业板指数则继续高歌猛进,上涨了35.21%,创下历史新高。

基于对三季度经济增速回升的判断,我们在二季度选择增持了周期性板块,主要增加了券商与化工板块的配置,在成长类板块中,根据成长性与估值的匹配度,我们着重增加了医药板块的配置;三季度我们对电力板块进行了减持,主要是认为发电量的回升由季节性因素引起,中期看发电量不具备反转上升的可能性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为11.91%,同期业绩比较基准变动幅度为8.54%,本基金领先于业绩比较基准3.37%。

§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	807,899,411.46	91.16
	其中:股票	807,899,411.46	91.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	70,851,052.87	7.99
7	其他各项资产	7,452,291.26	0.84
8	合计	886,202,755.59	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	40,926,440.00	4.64
C	制造业	541,056,190.05	61.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,759,617.56	1.56
F	批发和零售业	33,057,241.46	3.75
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	13,182,619.40	1.50
J	金融业	95,894,295.60	10.88
K	房地产业	30,351,593.64	3.44
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	22,973,456.25	2.61
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	16,697,957.50	1.89
S	综合	-	-
	合计	807,899,411.46	91.62

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	000538	云南白药	557,211	65,227,119.66	7.40
2	600583	海油工程	5,530,600	40,926,440.00	4.64
3	600887	伊利股份	897,385	40,095,161.80	4.55
4	000999	华润三九	1,407,502	34,863,824.54	3.95
5	600422	昆明制药	1,275,721	34,418,952.58	3.90
6	002415	海康威视	1,096,576	28,949,606.40	3.28
7	000826	桑德环境	680,695	22,973,456.25	2.61
8	600016	民生银行	2,342,900	22,398,124.00	2.54
9	000963	华东医药	502,443	22,057,247.70	2.50
10	600587	新华医疗	340,709	20,640,151.22	2.34

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 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。
5.8.2 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。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.2 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。
5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	451,824.58
2	应收证券清算款	6,791,551.49
3	应收股利	-
4	应收利息	40,767.37
5	应收申购款	168,147.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,452,291.26

5.10.4 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。
5.10.5 报告期末前十名股票中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。
5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	916,474,888.86
本报告期基金总申购份额	13,740,487.59
减:本报告期基金总赎回份额	152,918,684.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	777,296,692.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1) 中国证监会批准汇丰晋信大盘股票型证券投资基金设立的文件
2) 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金合同
3) 汇丰晋信大盘股票型证券投资基金招募说明书
4) 汇丰晋信大盘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) 报告期内汇丰晋信大盘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
8.2 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。
8.3 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

汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至9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	667,345,055.88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 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。 2. 以成长指标为核心的股票筛选策略 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%×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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	59,910,182.99
2.本期利润	154,727,079.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.2380
4.期末基金资产净值	1,022,781,518.37
5.期末基金份额净值	1.5326

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

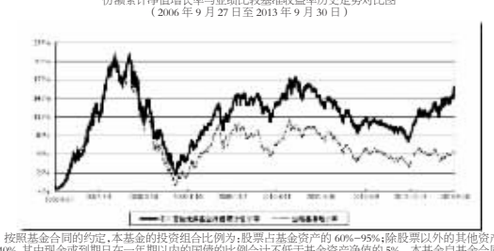
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.22%	1.50%	8.38%	1.02%	9.84%	0.48%

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

汇丰晋信龙腾股票型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9月27日至2013年9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	-	15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。

注:1.林彤彤先生的任职日期为本基金基金合同生效日;
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

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年三季度,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或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运作分析

2013年三季度,沪深300指数收于2409点,季度涨幅为9.47%。其中,传媒、零售、计算机、餐饮旅游、通信等等板块大幅上涨;而石油石化、建筑、食品饮料、电力等板块则明显滞涨。三季度,A股市场板块分化进一步加剧,投资者对成长股的热情持续高涨,以创业板为代表的中小盘成长股最创新高。回顾三季度的具体操作,龙腾基金继续坚持超配消费服务和新兴产业,加大了对智慧城市、移动互联网、大众消费品等板块的配置比例,进一步提高优质成长股的持股集中度,取得了良好的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为18.22%,同期业绩比较基准变动幅度为8.38%,本基金领先比较基准9.84%。

§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	875,324,539.82	84.82
	其中:股票	875,324,539.82	84.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	155,990,441.65	15.12
7	其他各项资产	628,955.02	0.06
8	合计	1,031,943,936.49	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	12,335,792.60	1.21
C	制造业	580,545,557.02	56.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,670,310.00	1.92
E	建筑业	-	-
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	125,744,074.58	12.29
J	金融业	64,176,268.88	6.27
K	房地产业	5,509,411.74	0.54
L	租赁和商务服务业	12,646,080.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	43,365,422.60	4.24
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	11,331,622.40	1.11
S	综合	-	-
	合计	875,324,539.82	85.58

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	600887	伊利股份	2,088,777	93,326,556.36	9.12
2	002038	双鹭药业	1,538,668	85,934,607.80	8.40
3	600637	百视通	1,359,688	71,179,666.80	6.96
4	002465	海格通信	3,189,696	60,093,872.64	5.88
5	600837	海通证券	3,516,888	43,996,268.88	4.30
6	300205	天喻信息	1,366,888	43,289,342.96	4.23
7	000651	格力电器	1,414,888	37,579,425.28	3.67
8	002241	歌尔声学	818,943	34,624,910.04	3.39
9	300074	华平股份	1,106,999	31,959,061.13	3.12
10	002557	洽洽食品	1,318,838	29,436,464.16	2.88

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 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。
5.8.2 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。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.2 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。
5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	296,500.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,898.87
5	应收申购款	291,555.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	628,955.02

5.10.4 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。
5.10.5 报告期末前十名股票中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在流通受限情况。
5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	675,641,598.03
本报告期基金总申购份额	40,732,128.91
减:本报告期基金总赎回份额	49,028,671.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	667,345,055.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 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
8.2 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。
8.3 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2016生命周期开放式证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇丰晋信2016周期混合
基金主代码	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	257,503,121.53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	1. 动态调整的资产配置策略 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。 2. 以风险控制为前提的股票筛选策略 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。 3. 动态投资的固定收益类资产投资策略 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。
业绩比较基准	1. 2016年6月1日前业绩比较基准 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: 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) 其中X值见下表: 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 注: 1.2008年11月11日,新华富曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数。 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。 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)"。 4.2016年6月1日后业绩比较基准 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)
风险收益特征	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。 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,本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