汇丰晋信科技先锋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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	汇丰晋信科技先锋股票
基金主代码	540010
前端交易代码	540010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月27日
报告期末基金份额总额	652,976,580.10份
投资目标	本基金主要投资于科技主题的优质上市公司,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化,适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。 2.股票投资策略 本基金在股票投资的比例中必须有不少于80%的比例需投资于科技主题的股票。 本基金所指的科技主题,主要分为两类:1 处于信息化升级领域的上市公司;2 利技创新类上市公司。 本基金主要投资处于科技主题中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。在子行业的配置上,本基金将综合考虑多方面的因素。具体而言,可分为三个步骤:首先,行业研究员通过对各子行业面临的国家财政税收等政策、竞争格局、估值水平进行研判,结合各行业的发展现状及发展前景,动态调整各自所属行业的投资评级和配置建议;其次,行业比较分析师综合内、外部研究资源,比较各子行业的相对投资价值,提出重点行业配置比重的建议;最后,基金经理将根据行业研究员、行业比较分析师的建议结合市场投资环境的预期与判断确定子行业的配置比重,对子行业基本面因素已出现积极变化但股票市场反应滞后的子行业进行重点配置。 科技主题的上市公司包含很多一般意义的行业,其发展阶段也有所不同。在个股的精选上,本基金将着重选择那些产品已经过前期的技术和产业准备、下游需求在政策刺激下将大幅增长、具有良好业绩成长性的上市公司。因此,本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、估值水平等方面对科技主题的上市公司进行综合评价
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数*90%+同业存款利率(税后)*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期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	中国建设银行股份有限公司

§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	71,389,194.49
2.本期利润	199,885,363.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.3958
4.期末基金资产净值	1,028,740,452.84
5.期末基金份额净值	1.5755

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	32.34%	2.11%	8.54%	1.29%	23.80%	0.82%

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

汇丰晋信科技先锋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

(2011年7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%,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80%以上的股票资产投资于科技主题的上市公司。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2012年1月20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(税后)*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		
曹庆	本基金基金经理	2012-8-18	-	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、达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。
曹晋	本基金基金经理	2013-4-20	-	4年	曹晋先生,会计学硕士。曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理研究员、研究员和基金经理助理。现任本基金基金经理。

注:1.任职日期为本基金管理人公告曹庆先生、曹晋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运作分析

2013年三季度,沪深股市表现十分活跃。一方面,经济增长出现淡季不淡,7,8月份的宏观数据如PMI和工业增加值回暖显示经济逐步好转;另一方面,政府释放一系列的改革红利,如上海自贸区和上海国企改革,极大的激发了市场对于新一届政府改革的预期和热情。由于经济复苏和改革预期,市场表现的十分活跃,主题热点频繁切换。一方面代表转型的新兴产业如传媒,环保表现较好;另一方面,受益于上海自贸区和国企改革的交运,零售和农业板块也表现活跃。

回顾三季度,本基金的投资重心集中在受益于中国经济转型方向的新兴产业成长股。我们一方面继续维持对传媒,计算机和金融IC卡等新兴产业超配;另一方面,出于对基本面的担忧,我们相应降低了电子元器件和医药行业的仓位,取得了不错的效果。

4.5 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上涨32.34%,同期业绩比较基准变动幅度为8.54%,本基金超越比较基准23.80%。

§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	901,787,885.24	78.00
	其中:股票	901,787,885.24	78.00
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	234,774,148.25	20.31
7	其他各项资产	19,610,729.56	1.70
8	合计	1,156,172,763.05	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	417,689,419.70	40.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,580,312.00	0.35
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	53,723,720.32	5.22
J	金融业	32,017,947.36	3.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	138,648,480.00	13.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,717,281.80	2.60
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	229,410,724.06	22.30
S	综合	-	-
	合计	901,787,885.24	87.66

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	300205	天喻信息	2,534,224	80,258,874.08	7.80
2	300027	华谊兄弟	933,925	72,734,079.00	7.07
3	002400	省广股份	1,649,000	72,407,590.00	7.04
4	300058	蓝色光标	988,670	66,240,890.00	6.44
5	300251	光线传媒	989,769	64,077,645.06	6.23
6	300133	华策影视	1,536,828	62,226,165.72	6.05
7	002241	歌尔声学	1,336,915	56,524,766.20	5.49
8	002038	双鹭药业	940,569	52,530,778.65	5.11
9	002236	大华股份	1,010,688	46,067,159.04	4.48
10	002292	奥飞动漫	1,135,577	41,698,387.44	4.05

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	358,870.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,573.29
5	应收申购款	19,232,285.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,610,729.56

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	002400	省广股份	72,407,590.00	7.04	重大事项
2	002292	奥飞动漫	41,698,387.44	4.05	重大事项

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	417,741,003.35
本报告期基金总申购份额	706,704,773.00
减:本报告期基金总赎回份额	471,469,196.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	652,976,580.10

§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科技先锋股票型证券投资基金设立的文件
2) 汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金基金合同
3) 汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金招募说明书
4) 汇丰晋信科技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) 报告期内汇丰晋信科技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

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

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	汇丰晋信恒生行业龙头指数
基金主代码	540012
前端交易代码	540012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月1日
报告期末基金份额总额	55,390,787.27份
投资目标	本基金主要采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	恒生A股行业龙头指数*95%+银行活期存款收益率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金,属证券投资基金中的高风险、高收益品种,其长期平均风险和收益预期高于混合型基金,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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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	-267,337.88
2.本期利润	2,653,364.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0487
4.期末基金资产净值	52,901,574.86
5.期末基金份额净值	0.9551

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

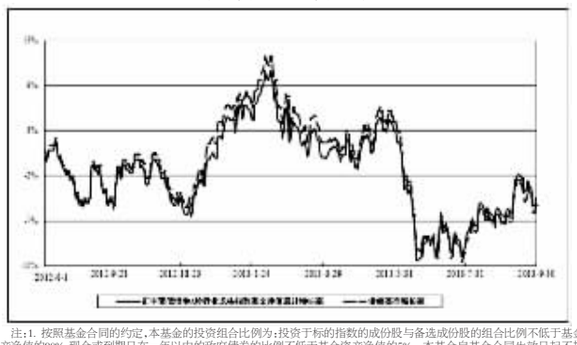
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.55%	1.09%	3.98%	1.10%	1.57%	-0.01%

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

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金

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

(2012年8月1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:投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%,现金或到期日在一年以内的政府债券的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三个月内完成建仓。截止2012年10月31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 =恒生A股行业龙头指数*95%+银行活期存款收益率(税后)*5%。

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恒生A股行业龙头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		
方磊	本基金基金经理	2012-8-1	-	14年	方磊女士,新加坡南洋理工大学数学硕士,具备基金从业资格。曾任上海市长宁卫生局、上海电器有限公司统计师、Phillip Securities Ltd. Pte金融工程师、上海德邻投资有限公司金融分析师、德隆友联战略投资管理有限公司数据分析师、易评咨询有限公司顾问统计、汇丰晋信基金管理有限公司风险管理部副总监。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的日期;

2.证券从业年限是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运作分析

经历了今年上半年经济下行、流动性偏紧之后,在政府政策微调下,第三季度以来所公布的一系列主要宏观经济数据,显示经济出现了回升,资本市场的乐观情绪开始有所恢复。本报告期内恒生A股行业龙头指数上涨了4.2%。

作为被动式指数基金,本基金在报告期内严格遵行完全被动复制基准指数的投资策略,并根据基准指数恒生A股行业龙头指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本报告期内,恒生指数公司进行了一年一度的指数编制回顾,并对成分股进行了回顾和调整,我们严格遵行基金合同的投资目标,在指数成分股调整后及时进行了相应调整。本报告期内,本基金的跟踪误差主要来源于报告期内基金投资者的申购赎回,所造成的基金投资组合仓位的偏离和交易成本的增加;以及“中国重工”和“美的电器”等指数成份股长期停牌引起的个股权重偏离。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告内基金份额净值增长率为5.55%,业绩比较基准收益率为3.98%,本基金表现领先比较基准1.57%。

§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	50,188,077.58	93.60
	其中:股票	50,188,077.58	93.60
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	3,291,677.01	6.14
7	其他各项资产	137,197.94	0.26
8	合计	53,616,952.53	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	-	-
B	采矿业	5,945,282.89	11.24
C	制造业	19,187,453.86	36.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,468,874.23	6.56
E	建筑业	2,448,050.26	4.63
F	批发和零售业	1,999,639.90	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	2,586,827.89	4.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,974,878.53	3.73
J	金融业	8,037,523.32	15.19
K	房地产业	2,850,970.32	5.39
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	1,273,002.28	2.41
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	415,574.10	0.79
	合计	50,188,077.58	94.87

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	000002	万 科A	312,264	2,850,970.32	5.39
2	601288	农业银行	1,008,465	2,521,162.50	4.77
3	000651	格力电器	88,239	2,343,627.84	4.43
4	601398	工商银行	601,717	2,322,627.62	4.39
5	600519	贵州茅台	15,613	2,122,431.22	4.01
6	002024	苏宁云商	155,614	1,999,639.90	3.78
7	601006	大秦铁路	226,627	1,649,844.56	3.12
8	601668	中国建筑	512,349	1,649,763.78	3.12
9	601088	中国神华	93,631	1,560,828.77	2.95
10	601939	建设银行	344,380	1,480,834.00	2.80

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	57,839.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	26,572.08
4	应收利息	2,163.43
5	应收申购款	50,623.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,197.94

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。

5.10.6 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	57,283,868.67
本报告期基金总申购份额	35,380,018.34
减:本报告期基金总赎回份额	37,273,099.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	55,390,787.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

截至9月30日,基金管理人通过固有资金投资持有汇丰晋信A股龙头指数基金20,000,277.79份。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恒生A股行业龙头指数证券投资基金设立的文件
2) 汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金基金合同
3) 汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金招募说明书
4) 汇丰晋信恒生A股行业龙头指数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) 报告期内汇丰晋信恒生A股行业龙头指数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

汇丰晋信货币市场基金

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	汇丰晋信货币
基金主代码	540011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月2日
报告期末基金份额总额	856,729,516.74份
投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下,争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
投资策略	1.整体资产配置策略 整体资产配置策略主要包括两个方面:1 根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断;2 根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。 2.类属配置策略 基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。 3.个券选择策略 在个券选择层面,将首先考虑安全性因素,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。 4.回购策略 1 追差放大策略:该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。 2 短回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。 5.流动性管理策略 由于货币市场基金要保持高流动性的特性,本基金会紧密关注申购赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等,建立组合流动性预警指标,实现对基金资产的结构化管理,并结合持续性投资的方法,将回购债券到期日进行均衡等量配置,以确保基金资产的整体变现能力。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属两级基金的基金简称	汇丰晋信货币A / 汇丰晋信货币B
下属两级基金的交易代码	540011 / 541011
报告期末下属两级基金的份额总额	40,799,951.59份 / 815,929,565.15份

§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)	
	汇丰晋信货币A	汇丰晋信货币B
1.本期已实现收益	314,398.88	8,010,963.42
2.本期利润	314,398.88	8,010,963.42
3.期末基金资产净值	40,799,951.59	815,929,565.15

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资