汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:二〇一四年七月十九日

§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2014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2014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	869,659,675.98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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-45,904,660.58
2.本期利润	22,674,897.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0213
4.期末基金资产净值	874,959,048.18
5.期末基金份额净值	1.0061

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。

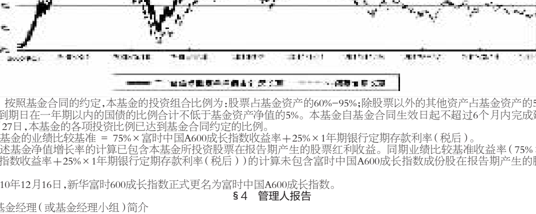
3.2 基金净值表现

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	3.31%	1.01%	0.71%	0.70%	2.60%	0.31%

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2014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		
王春	本基金基金经理、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理	2013-12-28	-	13年	王春先生,复旦大学企业管理硕士。曾任德恒证券有限责任公司研究员;兴业证券股份有限公司投资策略部经理;平安资产管理有限责任公司投资经理兼权益投资部研究主管;汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理、首席策略分析师及策略与金融工程总监。现任汇丰晋信基金首席策略分析师、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理、本基金基金经理。

注:1.王春先生的任职日期为本基金管理人公告王春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。

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

2014年二季度,沪深300指数震荡下跌。其中,计算机、传媒、电子、通信等行业逆势跑赢市场;而纺织服装、食品饮料、商贸零售、基础化工等行业则弱于市场。二季度,尽管以TMT为代表的成长股大幅波动,但成长股始终是市场持续关注的焦点。回顾二季度的具体操作,龙腾基金适当降低了传统行业的配置比例,加大了对新兴成长行业的配置比例,取得了一定的投资效果。

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3.31%,同期业绩比较基准表现为0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,本基金认为宏观经济将保持平稳增长态势,改革力度将不断加大。股票市场将通过调整蓄势逐步化解负面因素,并有望逐步企稳。

首先,从最近公布的经济数据来看,在政府一系列"稳增长"措施的定向刺激下,中国经济增速已经重新趋于稳定。我们认为:要完成今年7.5%的经济增长目标,政府在未来仍将会通过不断的微刺激政策来缓解经济下行压力,与之相关的财政、货币等方面的改革政策仍将会不断出台。因此,投资者不必过度担心三季度经济失速风险。

其次,从市场运行趋势来看,考虑到经济增速放缓和经济结构调整的影响,我们预计上市公司盈利增速在中报期间仍将面临普遍的下调压力,预计二季度市场将通过震荡调整来逐步化解负面因素。但是,鉴于当前市场整体偏低的估值水平,以及微刺激政策和结构改革渐显成效,市场后期有望逐步企稳。

第三,从行业选择上来看,三季度我们继续看好成长股的投资机会。伴随着三季度经济改革力度的不断加大,以及政府在重点领域和关键环节的改革陆续取得突破,与经济改革和转型相关的消费服务和新兴成长行业将相对活跃,在三季度逢低布局消费服务和新兴成长板块的优质股票,从全年来看仍有机会取得不错的回报。

§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	693,857,025.09	77.27
	其中:股票	693,857,025.09	77.27
2	固定收益投资	50,225,000.00	5.59
	其中:债券	50,225,000.00	5.59
	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	90,000,000.00	10.02
	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	61,643,074.20	6.87
7	其他资产	2,188,376.23	0.24
8	合计	897,913,475.52	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	448,937,261.61	51.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,747,334.90	1.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,100.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	10,839,384.00	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,773,540.36	11.29
J	金融业	82,903,665.00	9.48
K	房地产业	20,889,090.02	2.39
L	租赁和商务服务业	15,033,766.00	1.72
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	4,726,883.20	0.54
S	综合	-	-
	合计	693,857,025.09	79.30

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	300166	东方国信	1,380,080	27,435,990.40	3.14
2	300323	华灿光电	1,223,902	24,551,474.12	2.81
3	600699	均胜电子	910,993	22,893,254.09	2.62
4	600261	阳光照明	2,021,781	19,975,196.28	2.28
5	600594	益佰制药	471,500	19,392,795.00	2.22
6	600196	复星医药	929,462	18,765,837.78	2.14
7	000712	锦龙股份	1,250,000	18,662,500.00	2.13
8	300150	世纪瑞尔	1,154,056	18,280,247.04	2.09
9	600446	金证股份	591,273	18,175,732.02	2.08
10	600109	国金证券	899,500	17,873,065.00	2.04

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	50,225,000.00	5.74
	其中:政策性金融债	50,225,000.00	5.74
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	50,225,000.00	5.74

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	140204	14国开04	500,000	50,225,000.00	5.74

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。

5.10.2 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。

5.11 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	839,437.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,138,700.91
5	应收申购款	210,237.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,188,376.23

5.11.4 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。

5.11.5 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	300166	东方国信	27,435,990.40	3.14	重大事项
2	300323	华灿光电	24,551,474.12	2.81	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	1,208,207,670.36
报告期基金总申购份额	29,181,717.42
减:报告期基金总赎回份额	367,729,711.80
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	869,659,675.98

§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 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

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§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2014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2014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	598,337,464.49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)科技创新类上市公司。 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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-132,560,728.79
2.本期利润	-27,700,627.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0398
4.期末基金资产净值	768,079,885.80
5.期末基金份额净值	1.2837

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。

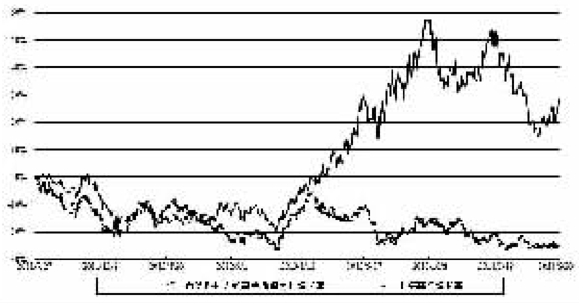
3.2 基金净值表现

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	-1.47%	1.30%	0.81%	0.79%	-2.28%	0.51%

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2014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%,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		
曹晋	本基金基金经理	2013-4-20	2014-6-21	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、本基金基金经理。
李元博	本基金基金经理	2014-6-21	-	4年	李元博先生,硕士研究生。曾任湘财证券有限责任公司研究员、天治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。

注:1. 任职日期为本基金管理人公告曹晋、李元博先生担任本基金基金经理的日期;

2.离任日期为本基金管理人公告曹晋先生不再担任本基金基金经理的日期;

3.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。

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

2014年二季度,A股继续呈现两极分化。宏观层面,从月度披露的工业增加值来看,工业生产增速有所企稳,显示微刺激政策取得成效,整体经济下半年出现断崖式下跌的风险不大。流动性层面,微刺激政策开始显现效果,资金利率持续下行且维持在低位。受相对宽松的资金面影响,A股市场仍然呈现局部性行情,特别是主题性机会活跃。

传统周期股受制于宏观经济数据乏力的影响,表现逐渐疲软;行业景气度较高,代表中国经济转型方向的软件行业和医疗服务行业则表现活跃。市场呈现两级分化的局面。

本基金的投资重心主要是重点投资受益于中国经济转型方向的新兴产业成长股。在这轮市场调整中,本基金一方面超配了TMT和医药行业,另一方面也对部分周期股实施减持,取得了一定的效果。

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-1.47%,同期业绩比较基准表现为0.81%。

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2014年三季度, 我们认为经济发展的动能仍然不强,内需仍然比较疲软,监管层的政策引导成为关键因素。一方面二季度宏观数据企稳迹象明显,经济活动有所升温,政策偏向微刺激;另一方面,监管层自年初以来出台一系列利好政策,在舒缓A股资金短缺方面有良好的效果。如果继续执行,三季度的A股仍然存在结构性机会。

鉴于目前经济处在弱复苏的阶段,微观层面经济企稳迹象明显,政府进一步简政放权、拓展企业融资渠道、降低企业融资成本,我们对三季度市场相对乐观, 但可能出现的风险是中报前后的上市公司业绩不达预期。我们仍然坚定看好新兴产业中景气度较高的TMT和医疗服务行业;同时,对科技创新带来的行业结构性变化的领域也会进行针对性布局。

在此市场环境下,本着对未来科技创新带来企业盈利持续成长的期待,本着对中国经济成功转型的信心,我们将继续寻找盈利确定的优质成长股,同时继续捕捉部分细分行业中可能出现的阶段性经营拐点,以对基金收益有所贡献。

§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	709,393,761.04	91.44
	其中:股票	709,393,761.04	91.44
2	固定收益投资	1,949,304.00	0.25
	其中:债券	1,949,304.00	0.25
	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	46,998,863.34	6.06
7	其他资产	17,451,955.76	2.25
8	合计	775,793,884.14	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	462,899,524.18	60.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,165,007.52	2.50
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	103,947,017.64	13.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,996,161.71	3.12
M	科学研究和技术服务业	22,604,900.25	2.94
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	76,781,149.74	10.00
S	综合	-	-
	合计	709,393,761.04	92.36

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	300291	华录百纳	1,557,086	54,638,147.74	7.11
2	002104	恒宝股份	2,786,141	54,608,363.60	7.11
3	300075	数字政通	1,366,996	44,194,980.68	5.75
4	601231	环旭电子	1,385,262	42,721,480.08	5.56
5	002185	华天科技	3,676,009	41,097,780.62	5.35
6	300169	天晟新材	4,550,176	40,087,050.56	5.22
7	002382	蓝帆股份	1,880,203	37,660,466.09	4.90
8	002587	奥拓电子	2,616,382	34,222,276.56	4.46
9	002138	顺络电子	1,590,898	33,186,132.28	4.32
10	300255	常山药业	1,125,212	31,719,726.28	4.13

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,949,304.00	0.25
8	其他	-	-
9	合计	1,949,304.00	0.25

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	110025	国金转债	16,980	1,949,304.00	0.25

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。

5.10.2 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。

5.11 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	782,479.61
2	应收证券清算款	16,596,002.49
3	应收股利	-
4	应收利息	16,404.63
5	应收申购款	57,069.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,451,955.76

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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	922,555,518.90
报告期基金总申购份额	33,271,065.97
减:报告期基金总赎回份额	357,489,120.38
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	598,337,464.49

§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 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

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

汇丰晋信货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014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:二〇一四年七月十九日

§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2014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2014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	979,364,539.04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)息差放大策略: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)逆回购策略: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	20,184,857.67份	959,179,681.37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(2014年4月1日-2014年6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	118,424.91	7,449,678.78
2.本期利润	118,424.91	7,449,678.78
3.期末基金资产净值	20,184,857.67	959,179,681.37

注:1、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 汇丰晋信货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7851%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	0.4485%	0.0021%

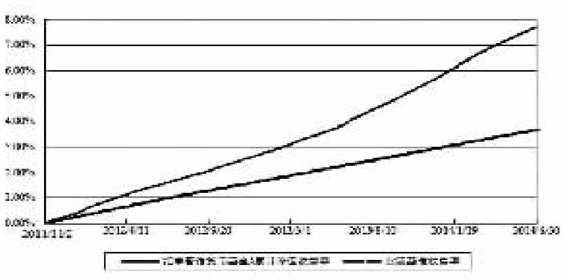
2. 汇丰晋信货币B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8454%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	0.5088%	0.0021%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年11月2日至2014年6月30日)

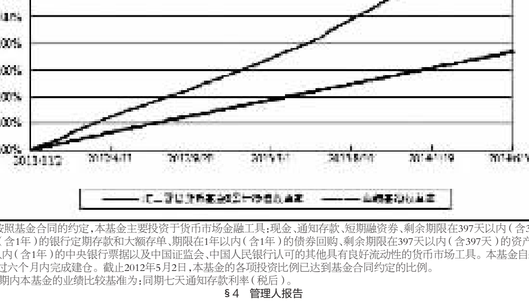
1、 汇丰晋信货币A



注:1. 按照基金合同的约定,本基金主要投资于货币市场金融工具:现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、1年以内(含1年)的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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5月2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为:同期七天通知存款利率(税后)。

2.汇丰晋信货币B



注:1. 按照基金合同的约定,本基金主要投资于货币市场金融工具:现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、1年以内(含1年)的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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5月2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为:同期七天通知存款利率(税后)。

§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		
李媛媛	本基金基金经理	2011-11-12	-	9年	李媛媛女士,曾任广东发展银行上海分行国际部交易员、法国巴黎银行(中国)有限公司资金部交易员、比利时富通银行上海分行环球市场部交易员和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。

注:1.任职日期为本基金管理人公告李媛媛女士担任本基金基金经理的日期;

2.证券从业年限是证券投资相关的工作经历年限。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

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

回顾2014年第二季度,中国经济整体呈现企稳反弹的态势,工业增速低位企稳,领先指标中采PMI连续三个月回升,货币条件有所改善,近期频繁推出的定向降准和再贷款稳定了表内信贷扩张,也在一定程度上支持实体经济企稳,欧美的复苏带动外需回升,出口数据好转,通胀无压力,房地产投资是经济最大的隐患。

海外方面,美国受到极端严寒天气的影响,一季度复苏进程被打破。进入二季度,PMI保持扩张,非农就业数据强劲,工业生产回升,房屋销售数据创新高,美联储也保持了既定的QE退出路线,预计在今年10月全面退出QE,2015年年中加息,表达了对经济前景的乐观态度。欧洲方面,德国复苏依然良好,但通缩问题成了欧元区最大的困扰,欧央行6月的议息会议,出乎意料的推出存款负利率,并预计会进一步推出更多的量宽政策来刺激商业银行放贷,摆脱通缩的困扰。全球格局由之前的美松欧紧进入欧松美紧的时代。

货币市场方面,2014年二季度,市场整体资金面较为宽松,季末效应也不明显。第二季度,央行依然维持正回购的常态化操作,由于央行频频释放微放松的信号,市场参与者对未来流动性预期改变。央行4月针对县域银行的存款准备金下调,5月中旬400亿央票到期没有续作,以及5月底克强总理在国务院常务会议上的讲话,再次提到要局部放松,定向降准,央行定向放松的基调已确立无疑。进入6月,为了应对半年大考,央行从第一周开始在公开市场净投放,四周共投放2040亿,创下来今年2月以来的单月投放的最高纪录,值得一提的是,6月中旬开始,由于新股的密集发行,对交易所回购的价格造成了较大的扰动,隔夜和7天波幅剧烈,且维持高位,交易所隔夜曾经在尾盘达到30%。

回顾2014年二季度的债市,可以用气势如虹来形容,各期限、各品种债券的收益率均大幅快速的回落,10年期国债从4月初的4.50%大幅下行44个基点至4.06%,1年期国开金融债从4.86% 下行至4.28%,10年期国开从5.66%一举突破5%的心理关口到4.95%。一级招标热情也很高,二级市场成交活跃。一级情绪也很高,短券非常抢手,短端带动长端,收益率曲线平坦化。进入6月由于前期涨幅过快过猛,6月债券市场稍显平淡,收益率窄幅波动,寻找方向。

回顾货币基金的操作,本基金总体的原则是在管理好流动性的前提下,根据市场资金面的变化,抓住关键时机选择合适的资产配置比例。本基金主要是拉长久期,锁定部分较高利率,同时在打新股阶段积极配置了交易所回购,获得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.7851%,同期业绩比较基准增长率为0.3366%;本基金B类份额净值增长率为0.8454%,同期业绩比较基准增长率为0.3366%。

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2014年三季度,在央行定向放松,经济微刺激和底线思维的指引下,稳增长政策的推出有助于经济基金面的企稳。出口随着外需的改善会有所改善。在经济偏弱的大背景下,食品价格的上涨不足以推动物价上涨,通胀无压力。海外方面,欧美的复苏将带动全球经济温和改善,极寒天气后美国重又走上复苏的通道,欧洲恢复正增长,预计会有进一步的量宽出台来抵抗通缩。

展望2014年三季度的货币政策,央行定向放松,微调整的格局已定,流动性基本无忧,近期央行推进人民币国际化的步伐明显加快,人民币不存在大幅贬值的理由,在外贸改善的大背景下,经常项目有望改善。然后,美国经济复苏,联储退出QE, 美国明年加息,资金有外流的风险,外汇占款下台阶是不争的事实,但在定向放松和维持基准利率稳定和降低融资成本的主导思想下,央行会积极进行流动性预期管理,对冲由于外汇占款下降带来对流动性带来的冲击,同时,再贷款和公开市场操作有望成为新的基础货币的投放方式。

展望2014年三季度的货币基金的操作,防范流动性风险仍然是本基金操作的第一要务。结合市场环境,本基金仍会主要投资于政策性金融债、超AAA短融、交易所/银行间回购等收益率流动性匹配较好的优良资产,努力实现较好的组合收益率。

§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	固定收益投资	326,140,616.19	32.30
	其中:债券	326,140,616.19	32.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	592,600,205.00	58.68
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	82,475,791.00	8.17
4	其他资产	8,661,485.16	0.86
5	合计	1,009,878,097.35	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	70.97	3.06
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	8.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	11.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.23	-

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	摊余成本(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	246,062,058.04	25.12
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,078,558.15	8.18
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	326,140,616.19	33.30
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130236	13国开36	500,000	49,976,882.35	5.10
2	140430	14农发30	400,000	40,061,438.89	4.09
3	140207	14国开07	300,000	30,034,147.42	3.07
4	130243	13国开43	300,000	29,953,954.31	3.06
5	011406001	14电网SCP001	200,000	20,053,645.62	2.05
6	110413	11农发13	200,000	20,004,351.98	2.04
7	041351045	13国电集CP002	100,000	10,038,584.33	1.03
8	140410	14农发10	100,000	10,012,197.49	1.02
9	011454001	14长电SCP001	100,000	10,011,089.42	1.02
10	140204	14国开04	100,000	10,006,482.29	1.02

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1004%
报告期内偏离度的最低值	0.0342%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0745%

注:以上数据按交易日统计。

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,776,564.45
4	应收申购款	884,920.71
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,661,485.16

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,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

项目	汇丰晋信货币A	汇丰晋信货币B
报告期期初基金份额总额	16,764,935.94	975,739,866.14
报告期基金总申购份额	18,615,545.61	787,743,893.64
减:报告期基金总赎回份额	15,195,623.88	804,304,078.41
报告期期末基金份额总额	20,184,857.67	959,179,681.37

注:红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的来源,统一计入本期总赎回份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1 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 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货币市场基金设立的文件
2) 汇丰晋信货币市场基金基金合同
3) 汇丰晋信货币市场基金招募说明书
4) 汇丰晋信货币市场基金托管协议
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) 报告期内汇丰晋信货币市场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

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日