汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2017年第2号）

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

【重要提示】

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2007年3月9日证监基金字【2007】64号文批准发起设立。本基金基金合同于2007年4月9日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2017年10月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：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

办公地址：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

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005年11月16日

电话：021-20376868

联系人：周慧

注册资本：2亿元人民币

股权结构：山西信托股份有限公司（以下简称“山西信托”）持有51%的股权，HSBC Global Asset Management (UK) Limited (汇丰环球投资管理（英国）有限公司)持有49%的股权。

（二）主要人员情况

（1）董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理，山西光信实业有限公司副董事长，山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托副董事长，晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长（正职待遇）。现任山西金融投资控股集团有限公司专职党委副书记、副总经理（正职待遇）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理，太原万丰房地产发展有限公司总经理，山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长，山西信托董事长。现任山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

……

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，我们选定MSCI中国A股指数、中债新综合指数（全价）作为本基金的业绩比较基准。

本基金的股票投资比例为30%-95%，业绩比较基准中的资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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。

本基金投资组合报告的报告期为2017年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

11.1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	797,529,341.96	78.76
	其中：股票	797,529,341.96	78.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,163,530.00	1.99
	其中：债券	20,163,530.00	1.99
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	80,000,000.00	7.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	104,286,257.26	10.30
8	其他资产	10,647,596.09	1.05
9	合计	1,012,626,725.31	100.00

11.2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	412,538,890.05	44.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,220.00	0.00
E	建筑业	23,438,072.00	2.50
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	97,112,981.88	10.38
J	金融业	264,368,998.03	28.25
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,730.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	15,450.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	797,529,341.96	85.22

11.3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	601601	中国太保	1,235,100	45,612,243.00	4.87
2	600015	华夏银行	4,778,292	44,294,766.84	4.73
3	601988	中国银行	10,686,321	44,027,642.52	4.70
4	000661	长春高新	293,400	43,584,570.00	4.66
5	601288	农业银行	10,110,281	38,621,273.42	4.13
6	600597	光明乳业	2,862,486	38,042,438.94	4.07
7	000921	海信科龙	2,812,141	37,260,868.25	3.98
8	601336	新华保险	646,140	36,616,753.80	3.91
9	300298	三诺生物	1,513,176	32,926,709.76	3.52
10	600062	华润双鹤	1,443,548	30,386,685.40	3.25

11.4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	20,008,000.00	2.14
	其中：政策性金融债	20,008,000.00	2.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	155,530.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,163,530.00	2.15

11.5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	140225	14国开25	200,000	20,008,000.00	2.14
2	132012	17巨化EB	1,510	155,530.00	0.02

11.6 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。

11.7 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。

11.8 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。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11. 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。

11. 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。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.10.1 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。

11.10.2 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。

11.10.3 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。

11.11 投资组合报告附注

11.11.1 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。

11.11.2 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。

11.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	490,875.55
2	应收证券清算款	9,205,106.46
3	应收股利	-
4	应收利息	862,401.96
5	应收申购款	89,212.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,647,596.09

11.11.4 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。

11.11.5 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。

11.11.6 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。

十二、基金的业绩

本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。

（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

1. 汇丰晋信动态策略混合A

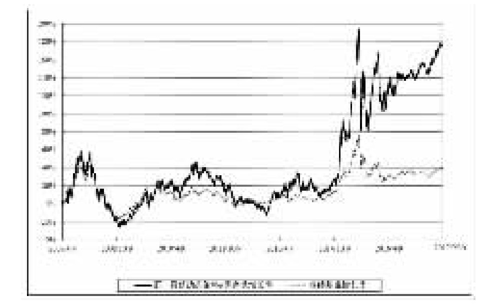
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007/4/9-2007/12/31	48.45%	1.74%	38.04%	1.13%	10.41%	0.61%
2008/1/1-2008/12/31	-47.81%	1.81%	-27.29%	1.50%	-20.52%	0.31%
2009/1/1-2009/12/31	62.55%	1.43%	48.64%	1.01%	13.91%	0.42%
2010/1/1-2010/12/31	12.54%	1.38%	-2.79%	0.79%	15.33%	0.59%
2011/1/1-2011/12/31	-25.05%	1.15%	-11.25%	0.67%	-13.80%	0.48%
2012/1/1-2012/12/31	-3.38%	1.16%	6.30%	0.65%	-9.68%	0.51%
2013/1/1-2013/12/31	15.44%	1.57%	-0.05%	0.69%	15.49%	0.88%
2014/1/1-2014/12/31	58.96%	1.52%	28.27%	0.59%	30.69%	0.93%
2015/1/1-2015/12/31	38.46%	2.58%	8.22%	1.24%	30.24%	1.34%
2016/1/1-2016/12/31	-8.30%	1.41%	-7.45%	0.77%	-0.85%	0.64%
2017/1/1-2017/9/30	15.85%	0.58%	5.57%	0.32%	10.28%	0.26%

2. 汇丰晋信动态策略混合H

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
2016/6/28（H类基金份额成立）-2016/12/31	1.80%	0.57%	2.13%	0.40%	-0.33%	0.17%
2017/1/1-2017/9/30	15.69%	0.58%	5.57%	0.32%	10.12%	0.26%

（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 汇丰晋信动态策略混合A



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. 基金合同生效日（2007年4月9日）至2014年5月31日，本基金的业绩比较基准为“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）。自2014年6月1日起，本基金的业绩比较基准调整为“50%×MSCI中国A股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。

2. 汇丰晋信动态策略混合H

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%。

2.本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI中国A股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。

3.本基金自2016年6月28日起增加H类份额。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金的证券交易费用；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费率为1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H ＝E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H ＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）本条第（一）款第（3）至第（7）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

（五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

（六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照中国、香港及投资人所在国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）更新了“三、基金管理人”之“（二）主要人员情况”部分，更新了监事会成员的相关信息。

（二）对“四、基金托管人”的“一、基金托管人基本情况”进行了更新。

（三）更新了“五、相关服务机构”之“（一）基金份额发售机构”的有关信息。

（四）在“十三、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的内容（报告期：2017年7月1日起至9月30日）。

（五）更新了“十四、基金的业绩”部分的内容（自基金合同生效日起至2017年9月30日）。

（六）更新了“二十六、其他应披露事项”部分的内容（自2016年4月10日至2017年10月9日以来涉及本基金的相关公告）。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一七年十一月二十三日