

## 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

[2011] 第二季度报告

比较

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2009年12月11日至2011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：二〇一一年七月二十日  
§ 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2011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2011年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 汇丰晋信中小盘股票

基金代码 540007

前端交易代码 540007

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2009年12月11日

报告期末基金份额总额 655,121,102.57份

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企业时所体现出来的高成长性，可持续性以及市销率高扩张所带来的投资机会，以寻求资本的长期增值。

(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”的投资操作策略，在投资决策中，本基金将根据指数类证券的市场价格收益的相对变化，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  
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的研究资源，结合宏观经济形势和政策环境，提出重行业配置比例的建议。

(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发展潜力，目前股价尚未充分反映公司未来成长性的中大型上市公司股票作为主要的投资对象。

业绩比较基准 中证700(中小板)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品种，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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -39,144,988.88

2.本期利润 -59,326,104.39

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0890

4.期末基金份额净值 600,105,886.84

5.期末基金份额净值 0.9160

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、红利再投费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期内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 准标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.92%	1.06%	-6.96%	1.18%	-1.96%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

注：本基金累计份额净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3 主要财务指标

3.3.1 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.2 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.3 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.4 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.5 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.6 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.7 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.8 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.9 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.10 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.11 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.12 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.13 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.14 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.15 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.16 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.17 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.18 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.19 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.20 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.21 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.22 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.23 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.24 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.25 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.26 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.27 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.28 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.29 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.30 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.31 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.32 本报告期内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

注：本基金资产净值增长率=每万份基金单位净值-1+100%。其中，期初份额净值为1.00元，期间内每万份基金单位净值增长（或降低）1%，即表示每10份基金单位增加（或减少）1份。

3.3.33 本报告期内基金份额净值增长率及其与同期