汇丰晋信2026生命周期证券投资基金

2013 年度报告摘要

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：二〇一四年三月二十六日

§1重要提示及目录

1.1重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
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3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	汇丰晋信2026周期混合	
基金主代码	540004	
交易代码	540004	541004
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年7月23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	
报告期末基金份额总额	179,954,874.65份	
基金合同存续期	不定期	

2.2基金产品说明

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，基金的投资风格相应的从"进取"，转变为"稳健"，再转变为"保守"，股票类资产比例逐步下降，而非股票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、组合久期浮动权限、个券选择上相应变动。
业绩比较基准	1. 基金合同生效日~2026年8月31日（包括2026年8月31日） 业绩比较基准=X * MSCI中国A股指数收益率 +(1-X)* 中信标普全债指数收益率 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2012-8-31	60-95	75	25
2012/9/1-2016/8/31	50-80	65	35
2016/9/1-2021/8/31	30-65	45	55
2021/9/1-2026/8/31	10-40	20	80

业绩比较基准	2. 2026年9月1日（包括2026年9月1日）后 业绩比较基准=中信标普全债指数收益率
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较高水平；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，转变成为中等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券投资基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	田青
	联系电话	021-20376868	010-67595096
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	010-67595096
传真		021-20376999	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：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； 中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

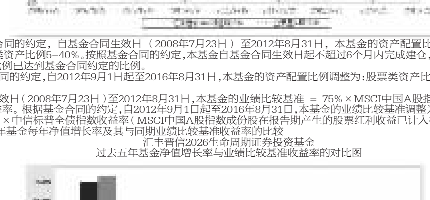
金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	53,188,932.93	-2,215,148.90	-18,675,903.06
本期利润	41,388,694.64	12,683,067.09	-31,274,180.73
加权平均基金份额本期利润	0.2383	0.1256	-0.3460
本期基金份额净值增长率	21.12%	12.71%	-26.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0566	0.0949	-0.0286
期末基金资产净值	190,145,154.25	115,097,566.67	92,433,290.06
期末基金份额净值	1.0566	1.0949	0.9714

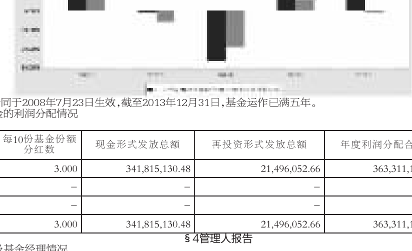
注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
3.2基金净值表现
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-15.69%	1.41%	-2.35%	0.74%	-13.34%	0.67%
过去六个月	-4.10%	1.60%	5.49%	0.83%	-9.59%	0.77%
过去一年	21.12%	1.67%	-0.60%	0.89%	21.72%	0.78%
过去三年	0.75%	1.38%	-13.72%	0.94%	14.47%	0.44%
过去五年	69.88%	1.44%	34.04%	1.13%	35.84%	0.31%
自基金合同生效起至今	65.98%	1.38%	-2.67%	1.26%	68.65%	0.12%

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2026生命周期证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2008年7月23日至2013年12月31日）



1. 按照基金合同的约定，自基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的资产配置比例为：股票类资产比例60-95%，非股票类资产比例5-40%。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1月23日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
2.根据基金合同的约定，自2012年9月1日起至2016年8月31日，本基金的资产配置比例调整为：股票类资产比例50-80%，非股票类资产比例20-50%。
3.本基金合同生效日（2008年7月23日）至2012年8月31日，本基金的业绩比较基准 = 75%×MSCI中国A股指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率。根据基金合同的约定，自2012年9月1日起至2016年8月31日，本基金的业绩比较基准调整为：65%×MSCI中国A股指数收益率+35%×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）。
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



本基金的基金合同于2008年7月23日生效，截至2013年12月31日，基金运作已满五年。
3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	3.000	341,815,130.48	21,496,052.66	363,311,183.14	-
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
合计	3.000	341,815,130.48	21,496,052.66	363,311,183.14	-

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况
4.1.1基金管理人及其管理基金的经验
汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2005年11月16日正式成立。公司由山西信托有限责任公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2亿元人民币，注册地在上海。截止2013年12月31日，公司共管理12只开放式基金：汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金（2006年5月23日成立）、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金（2006年9月27日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007年4月9日成立）、汇丰晋信2026生命周期证券投资基金（2008年7月23日成立）、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金（2008年12月3日成立）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009年6月24日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009年12月11日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010年6月8日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010年12月8日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011年7月27日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011年11月2日成立）和汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（2012年8月1日成立）。
4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郑屹	本基金基金经理、汇丰晋信2016生命周期证券投资基金基金经理	2013-12-21	-	7年	郑屹先生，工学硕士。曾任广发证券有限公司研究员、国泰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、汇丰晋信2016生命周期证券投资基金基金经理。
刘辉	本基金基金经理、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理	2011-03-19	2013-12-21	7年	刘辉先生，澳大利亚阿德莱德大学硕士。曾任华泰证券股份有限公司研究员、东吴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、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理、本基金基金经理。

注：1.任职日期为本基金管理人公告郑屹、刘辉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刘辉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》及其他有关法律法规、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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1公平交易制度的执行情况
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，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。公司对不同投资组合同向交易的平均溢价率、溢价金额占投资组合平均净值百分比、正溢价率占比等指标进行专项计算分析，计算分析结果显示：以上各指标值均在合理正常的范围之内，未发现不同投资组合间非公平交易的同向交易存在不公平及存在利益输送的行为。
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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析
在经历了2011-2012年的经济下滑后，2013年经济表现为触底弱势运行。在此背景下，全年沪深300指数下跌7.65%，行业板块之间的分化非常明显，按照中信行业指数分类，29个行业指数中，大部分行业跑赢了沪深300指数。年度表现较好的行业是传媒、计算机、通信，而表现较差的行业是传统的周期行业，如煤炭、有色金属、钢铁，主要原因在于宏观经济底部运行，与投资相关的行业需求变化不大。
目前国内处于经济转型期，同时经济存在着产能过剩和地方债务问题，因此政府的企业投资都会受到抑制，同时国家对房地产的调控政策预期也会压制投资预期，整体来看，投资增速很难出现上行，因此与投资相关行业的需求难以出现大幅上升。
从全年来看，经济整体保持弱势运行，传统周期行业如银行、地产等表现疲弱，同时国家对房地产的调控政策拉低了相关行业的估值，而以TMT为代表的新兴产业表现突出，全年市场表现为结构化行情。
随着国家对生态文明和民生的重视，企业的环保标准不断提高，因此在传统周期行业中，有部分行业会出现因为环保标准提高而供应收缩的情况，同时互联网在人民生活中的渗透，将带来新的商业模式和盈利模式。因此在1季度我们重点配置了电子、化工、医药等行业，在2季度增加了消费、传媒等行业的配置，在3季度增加了光伏行业配置，在4季度增加了节能环保等行业配置。从全年来看，取得了较好的投资收益。
4.4.2报告期内基金的业绩表现
2013年本基金净值增长率为21.12%，同期业绩比较基准变动幅度为-0.60%，本基金表现领先比较基准21.72%
4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
我们预计2014年国内经济会继续转型，仍然延续会2013年的弱势走势，随着十八届三中全会的召开，国家改革的决心很大，许多后续政策可能会超出市场预期。包括医疗服务、环保、国企改革、混合所有制等方面国家会陆续出台相关政策，同时随着居民收入的提高，消费将在经济占的比重越来越大，同时互联网等先进技术也会对传统商业、盈利模式带来的变革。
因此投资将围绕未来的经济增长点布局，消费和创新是两大方向，我们将重点关注节能环保、大众消费品、医疗和受益于互联网应用的传统消费行业和电子、传媒等行业。同时，对于受益于环保标准提高，过剩产能能够顺利化解的传统周期行业，我们也会重点关注。
4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。
根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：
1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险管理部经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。
2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门之间下展开工作，其中：
一、基金运营部
1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。
2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。
3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。
二、基金投资部
基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。
三、产品开发部
产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。
四、风险控制部
根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。
五、督察长
监督和检查公司关于估值各项工作的贯彻和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。
1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下，应及时修订本估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经过本公司管理委员会的批准后方可实施。
2. 如果基金准备采用新投资策略或投资新品种或者有其他重大或突发性相关估值事项发生时，应召开临时会议，或者投资品种估值小组成员列席参加公司风险委员会议，通过公司风险委员会议讨论并通过上述估值事项。
报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。
4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
报告期内，本基金于2013年7月23日实施分红，根据基金相关法律法规和基金合同的要求，每10 份基金份额派发现金红利3.0元，其中现金形式的分红金额为341,815,130.48元，红利再投资形式的分红金额为21,496,052.66 元，利润分配共计363,311,183.14 元。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。
5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
报告期内，本基金实施利润分配的金额为363,311,183.14 元。
5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6审计报告

毕马威华振会计师事务所对汇丰晋信基金管理有限公司汇丰晋信2026生命周期证券投资基金证券投资基金2013年12月31日的资产负债表，2013年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告（毕马威华振审字第1400086 号）。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	43,235,737.32	23,418,000.19
结算备付金		535,928.24	231,971.72
存出保证金		134,795.79	1,250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	146,598,661.60	91,954,675.17
其中：股票投资		146,598,661.60	91,954,675.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		687,070.54	2,258,029.56
应收利息	7.4.7.5	9,014.58	4,748.59
应收股利		-	-
应收申购款		188,860.99	267,141.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		191,390,069.06	119,384,566.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,241,951.42
应付赎回款		321,820.34	67,826.28
应付管理人报酬		242,649.10	137,013.44
应付托管费		40,441.54	22,835.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	361,280.68	178,832.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	278,723.15	1,638,540.63
负债合计		1,244,914.81	4,287,000.16
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	179,954,874.65	105,121,718.95
未分配利润	7.4.7.10	10,190,279.60	9,975,847.72
所有者权益合计		190,145,154.25	115,097,566.67
负债和所有者权益总计		191,390,069.06	119,384,566.83

注：1.报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.0566元，基金份额总额179,954,874.65份。
2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。
7.2利润表
会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		47,145,456.35	16,130,647.81
1.利息收入		515,076.01	175,728.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	515,076.01	129,543.63
债券利息收入		-	19,584.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	26,600.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		56,681,408.42	1,029,120.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	56,322,307.50	363,505.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-76,625.40
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	359,100.92	742,240.61
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	7.4.7.16	-11,800,238.29	14,898,215.99
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	1,749,210.21	27,582.69
减：二、费用		5,756,761.71	3,447,580.72
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,168,707.35	1,559,441.82
2.托管费	7.4.10.2.2	528,117.86	259,906.99
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,780,385.50	1,221,147.91
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	279,551.00	407,084.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		41,388,694.64	12,683,067.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		41,388,694.64	12,683,067.09

7.3所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：汇丰晋信2026生命周期证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	105,121,718.95	9,975,847.72	115,097,566.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,388,694.64	41,388,694.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	74,833,155.70	322,136,920.38	396,970,076.08
其中：1.基金申购款	1,240,067,915.96	556,256,429.70	1,796,324,345.66
2.基金赎回款	-1,165,234,760.26	-234,119,509.32	-1,399,354,269.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-363,311,183.14	-363,311,183.14
五、期末所有者权益(基金净值)	179,954,874.65	10,190,279.60	190,145,154.25

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	95,157,146.66	-2,723,856.60	92,433,290.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,683,067.09	12,683,067.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	9,964,572.29	16,637.23	9,981,209.52
其中：1.基金申购款	31,454,024.77	589,256.02	32,043,280.79
2.基金赎回款	-21,489,452.48	-572,618.79	-22,062,071.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	105,121,718.95	9,975,847.72	115,097,566.67

报告附注为财务报表的组成部分
本报告页码从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：
基金管理公司负责人：杨小勇，主管会计工作负责人：王栋，会计机构负责人：杨洋
7.4报表附注
7.4.1基金基本情况
汇丰晋信2026生命周期证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会《关于同意汇丰晋信2026生命周期证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2008]408号文)批准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2008年7月23日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为334,873,888.23份。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。(以下简称"建设银行")。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金合同》和《汇丰晋信2026生命周期证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的上市交易的股票、债券和国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。主要包括：股票(A 股及监管机构允许投资的其他种类和其他市场的股票)、债券(包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债等)、短期金融工具(包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、银行存款、短期融资券等)、现金资产、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
在基金实际管理过程中，基金管理人将随着投资人目标期限的临近和根据中国证券市场的阶段性变化，逐年适时调整基金资产在股票类资产、非股票类资产间的配置比例。同时在正常市场情况下，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为：X * MSCI 中国A 股指数收益率 +(1-X)* 中信标普全债指数收益率；自2026年9月1日起，本基金业绩比较基准为中信标普全债指数收益率。本基金的逐年资产配置和业绩比较基准所用的X值如下表所示：

时间段	股票类资产比例%	X值(%)	(1-X)值(%)
基金合同生效之日至2012/8/31	60-95	75	25
2012/9/1-2016/8/31	50-80	65	35
2016/9/1-2021/8/31	30-65	45	55
2021/9/1-2026/8/31	10-40	20	80

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。
7.4.2会计报表的编制基础
本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于2006 年2 月15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制，同时亦按照中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露XBRL 模板第3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012 年11 月16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。
7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年12 月31 日的财务状况、2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。
7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。
7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1会计政策变更的说明
本基金在本年度未发生重大会计政策的变更。
7.4.5.2会计估计变更的说明
本基金在本年度未发生重大会计估计的变更。
7.4.5.3差错更正的说明
本基金在本年度无重大会计差错发生。
7.4.6税项
根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：
(a)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。
7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("建设银行")	基金托管人
山西信托有限责任公司("山西信托")	基金管理人的股东
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
山西证券股份有限公司("山西证券")	见注释①
中德证券有限责任公司("中德证券")	见注释②
汇丰银行(中国)有限公司("汇丰银行")	见注释③
恒生银行(中国)有限公司("恒生银行")	见注释④

注：①山西证券与本基金管理人的股东——山西信托共同受山西省国信投资(集团)公司控制。
②中德证券与本基金管理人的股东——山西信托共同受山西省国信投资(集团)公司控制。
③汇丰银行与本基金管理人的股东—汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。
④恒生银行与本基金管理人的股东—汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。
7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
山西证券	10,449,320.01	0.89%	-	-

7.4.8.1.2权证交易
本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行此类交易。
7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
山西证券	9,513.05	0.89%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
山西证券	-	-	-	-

上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的金额列示。
根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用山西证券证券交易专用交易单元进行股票、债券及回购交易的同时，还从山西证券获得证券研究综合服务。
7.4.8.2关联方报酬
7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,168,707.35	1,559,441.82
其中：支付销售机构的客户维护费	570,981.15	340,250.33

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值的如下年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：
日基金管理费=前一日基金资产净值×年管理费率/当年天数
时间段 年管理费率
??自基金合同生效之日至 2021/08/31 1.50%
??自 2021/09/01 起0.75%
7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	528,117.86	259,906.99

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值的如下年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：
日基金托管费=前一日基金资产净值×年托管费率/当年天数
时间段 年托管费率
??自基金合同生效之日至 2021/08/31 0.25%
??自 2021/09/01 起0.20%
7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金在本期间及上年度可比期间内均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。
7.4.8.4各关联方投资本基金的情况
7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本基金管理人在本期间及上年度可比期间内均未投资过本基金。
7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。
7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 期末余额	当期利息收入
建设银行	43,235,737.32	504,720.18	23,418,000.19	123,902.89

注：本基金通过"中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金、存出保证金，于2013年12月31日的相关余额为人民币670,724.03元 (2012年12月31日：人民币231,971.72元)。
7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本报告期间与上年度可比期间，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。
7.4.8.7其他关联交易事项的说明
上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。
7.4.9期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与新股网下配售，应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于3个月，持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股，从新股获配日至该新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。
于2013年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。
7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002573	国电清新	2013-12-23	重大事项	22.17	2014-03-25	20.80	25,422	640,026.36	563,605.74	-

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1银行间市场债券正回购
于2013年12月31日，本基金无因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。
7.4.9.3.2交易所市场债券正回购
于2013年12月31日，本基金无因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。
7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(5) 公允价值
(a) 以公允价值计量的金融工具
下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2013 年12 月31 日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：
第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；
第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；
第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。
于资产负债表日，本基金的金融工具公允价值列示如下：
2013 年12 月31 日 第一层级 第二层级 第三层级 合计
人民币元 人民币元 人民币元 人民币元
资产
交易性金融资产
股票投资 146,035,055.86 563,605.74 146,598,661.60
债券投资
合计 146,035,055.86 563,605.74
146,598,661.60
2012 年12 月31 日 第一层级 第二层级 第三层级 合计
人民币元 人民币元 人民币元 人民币元
资产
交易性金融资产
股票投资 88,265,002.17 3,689,673 91,
954,675.17
债券投资
合计 88,265,002.17 3,689,673
91,954,675.17
对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层级。
对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见附注7.4.4.4和7.4.4.5。
(b) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量账面价值）
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	146,598,661.60	76.60
	其中：股票	146,598,661.60	76.60
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	43,771,665.56	22.87
6	其他各项资产	1,019,741.90	0.53
7	合计	191,390,069.06	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	125,881,955.89	66.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,832,835.77	3.07
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	-	-
J	金融业	-	-
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	14,883,869.94	7.83
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	-	-
	合计	146,598,661.60	77.10

8.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600389	江山股份	312,619	12,232,781.47	6.43
2	600596	新安股份	1,115,244	11,810,433.96	6.21
3	002456	欧菲光	231,569	11,133,837.52	5.86
4	300070	碧水源	235,890	9,669,131.10	5.09
5	000860	顺鑫农业	553,693	8,504,724.48	4.47
6	300107	建新股份	505,485	8,441,599.50	4.44
7	600887	伊利股份	214,800	8,394,384.00	4.41
8	600486	扬农化工	228,092	7,980,939.08	4.20
9	002236	大华股份	179,822	7,351,123.36	3.87
10	600703	三安光电	239,400	5,934,726.00	3.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。
8.4报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	42,276,957.71	36.73
2	600637	百视通	37,754,344.70	32.80
3	002236	大华股份	34,286,693.07	29.79
4	002450	康得新	33,090,977.46	28.75
5	600535	天士力	22,371,715.03	19.44
6	002038	双鹭药业	21,573,077.87	18.74
7	002456	欧菲光	21,345,005.22	18.55
8	300074	华平股份	19,846,725.94	17.24
9	300070	碧水源	19,234,171.96	16.71
10	600596	新安股份	14,982,945.09	13.02
11	600389	江山股份	14,596,489.19	12.68
12	002400	省广股份	13,258,924.94	11.52
13	300058	蓝色光标	12,957,746.86	11.26
14	002649	博彦科技	10,924,778.56	9.49
15	300287	飞利信	10,339,194.02	8.98
16	600486	扬农化工	10,292,816.07	8.94
17	000860	顺鑫农业	9,926,282.18	8.62
18	000538	云南白药	9,595,114.35	8.34
19	300026	红日药业	9,470,889.36	8.23
20	600887	伊利股份	8,491,407.21	7.38
21	600352	浙江龙盛	7,784,866.88	6.76
22	300107	建新股份	7,453,419.86	6.48
23	300075	数字政通	7,412,781.52	6.44
24	300205	天喻信息	7,208,546.79	6.26
25	300274	阳光电源	7,094,168.50	6.16
26	300088	长信科技	6,814,028.72	5.92
27	600292	中电远达	6,641,663.63	5.77
28	600089	特变电工	6,519,498.26	5.66
29	600422	昆明制药	5,709,401.46	4.96
30	300027	华谊兄弟	5,686,068.63	4.94
31	600703	三安光电	5,664,997.26	4.92
32	002104	恒宝股份	5,463,235.32	4.75
33	000625	长安汽车	5,404,933.78	4.70
34	600261	阳光照明	5,277,446.70	4.59
35	002140	东华科技	4,933,233.72	4.29
36	002415	海康威视	4,454,526.58	3.87
37	600867	通化东宝	4,253,912.47	3.70
38	600804	鹏博士	4,214,968.70	3.66
39	002310	东方园林	4,211,508.64	3.66
40	300113	顺网科技	4,143,456.27	3.60
41	000826	桑德环境	3,967,833.00	3.45
42	300054	鼎龙股份	3,929,429.24	3.41
43	300212	易华录	3,883,258.98	3.37
44	300057	万顺股份	3,699,839.01	3.21
45	002273	水晶光电	3,663,513.72	3.18
46	300241	瑞丰光电	3,486,621.23	3.03
47	300303	聚飞光电	3,457,640.98	3.00
48	600418	江淮汽车	3,337,001.00	2.90
49	300017	网宿科技	3,274,173.19	2.84
50	002475	立讯精密	3,150,049.28	2.74
51	601992	金隅股份	2,842,655.24	2.47
52	002005	德豪润达	2,839,762.60	2.47
53	600585	海螺水泥	2,823,847.00	2.45
54	300271	华宇软件	2,767,968.22	2.40
55	002250	联化科技	2,714,638.92	2.36
56	600016	民生银行	2,378,314.00	2.07
57	601633	长城汽车	2,332,809.29	2.03

注：本表"本期累计买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600637	百视通	47,041,354.04	40.87
2	002241	歌尔声学	42,524,796.30	36.95
3	002236	大华股份	40,026,965.14	34.78
4	002450	康得新	39,921,570.64	34.68
5	600535	天士力	24,457,905.77	21.25
6	002038	双鹭药业	21,558,157.01	18.73
7	002456	欧菲光	20,203,989.57	17.55
8	300074	华平股份	17,080,087.60	14.84
9	002400	省广股份	15,598,701.23	13.55
10	300058	蓝色光标	14,917,004.87	12.96
11	002649	博彦科技	12,334,179.89	10.72
12	000538	云南白药	12,323,509.61	10.71
13	300026	红日药业	11,516,764.91	10.01
14	300027	华谊兄弟	11,057,498.45	9.61
15	300070	碧水源	10,658,474.36	9.26
16	300088	长信科技	10,038,227.17	8.72
17	300287	飞利信	9,450,821.86	8.21
18	600089	特变电工	5,903,213.71	5.13
19	300075	数字政通	5,872,421.96	5.10
20	000625	长安汽车	5,680,259.56	4.94
21	600422	昆明制药	5,607,287.28	4.87
22	300113	顺网科技	5,426,373.64	4.71
23	002415	海康威视	5,351,635.50	4.65
24	002104	恒宝股份	5,200,318.65	4.52
25	600389	江山股份	5,114,864.62	4.44
26	601901	方正证券	5,081,827.77	4.42
27	300274	阳光电源	4,692,371.20	4.08
28	002140	东华科技	4,549,023.92	3.95
29	300241	瑞丰光电	4,525,411.85	3.93
30	600999	招商证券	4,220,085.60	3.67
31	300017	网宿科技	4,189,069.89	3.64
32	000002	万 科A	4,143,520.07	3.60
33	002273	水晶光电	4,140,931.18	3.60
34	002310	东方园林	4,140,258.86	3.60
35	600867	通化东宝	4,052,917.30	3.52
36	600837	海通证券	4,030,128.66	3.50
37	601166	兴业银行	3,827,432.93	3.33
38	600030	中信证券	3,818,774.99	3.32
39	601688	华泰证券	3,729,066.47	3.24
40	600048	保利地产	3,710,121.08	3.22
41	600801	华新水泥	3,669,608.46	3.19
42	000024	招商地产	3,665,733.06	3.18
43	600000	浦发银行	3,529,445.39	3.07
44	600804	鹏博士	3,476,799.76	3.02
45	600036	招商银行	3,454,455.31	3.00
46	601169	北京银行	3,408,898.39	2.96
47	601998	中信银行	3,386,644.09	2.94
48	601009	南京银行	3,328,040.74	2.89
49	300303	聚飞光电	3,256,730.07	2.83
50	600585	海螺水泥	3,226,685.86	2.80
51	300057	万顺股份	3,150,069.52	2.74
52	300212	易华录	3,121,133.44	2.71
53	000961	中南建设	3,076,999.53	2.67
54	300271	华宇软件	3,052,515.60	2.65
55	600881	亚泰集团	3,013,212.05	2.62
56	600318	巢东股份	2,964,446.25	2.58
57	600418	江淮汽车	2,961,776.31	2.57
58	002244	滨江集团	2,958,878.29	2.57
59	600720	祁连山	2,594,740.16	2.25
60	002250	联化科技	2,504,939.65	2.18
61	600352	浙江龙盛	2,419,465.04	2.10
62	600016	民生银行	2,389,552.09	2.08

注：本表"本期累计卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	592,091,112.01
卖出股票的收入(成交)总额	581,969,194.79

注：本表"买入股票成本（成交）总额"，"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
8.5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。
8.6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。
8.7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。
8.8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。
8.9投资组合报告附注
8.9.1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。
8.9.2 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。
8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	134,795.79
2	应收证券清算款	687,070.54
3	应收股利	-
4	应收利息	9,014.58
5	应收申购款	188,860.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,019,741.90

8.9.4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。
8.9.5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未存在流通受限的股票。
8.9.6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。

§9基金份额持有人信息

9.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
11,075	16,248.75	29,941,617.79	16.64%	150,013,256.86	83.36%

9.29.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	257,366.94	0.14%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份(含)，本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为0。

§10开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年7月23日)基金份额总额	334,873,888.23
本报告期期初基金份额总额	105,121,718.95
本报告期期间基金总申购份额	1,240,067,915.96
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,165,234,760.26
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	179,954,874.65

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议
本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。
11.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
2013年3月27日，基金管理人发布公告，经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，聘任赵琳女士为公司副总经理。
2013年12月21日，基金管理人发布公告，聘任郑屹先生担任本基金基金经理，刘辉先生不再担任本基金基金经理。
2014年3月13日，基金管理人发布公告，经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，聘任张毅杰先生为公司副总经理。
本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。
本基金托管人2013年12月5日发布任免通知聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。
11.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本基金本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
11.4基金投资策略的改变
本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。
11.5为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况，报告年度预提审计费85000元，根据与毕马威华振会计师事务所签订的《审计业务约定书》，应实际支付2013年度审计费85000元。自本基金募集以来，毕马威华振会计师事务所有限公司一直为本基金提供审计服务。
11.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。
11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	1	437,061,376.23	37.23%	396,817.60	37.22%	-
海通证券	1	370,931,450.62	31.59%	336,168.40	31.53%	-
申银万国	1	218,422,601.20	18.60%	198,851.35	18.65%	-
国金证券	1	76,317,208.85	6.50%	69,479.30	6.52%	-
中金公司	2	39,265,496.60	3.34%	35,747.22	3.35%	-
中信证券	1	19,786,342.35	1.69%	18,013.25	1.69%	-
山西证券	1	10,449,320.01	0.89%	9,513.05	0.89%	-
中投证券	1	1,804,411.44	0.15%	1,642.74	0.15%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
合计	15	1,174,038,207.30	100.00%	1,066,232.91	100.00%	-

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	其它交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1.报告期内无新增交易单元.
2.专用交易单元的选择标准和程序
1)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准
a.实力雄厚，信誉良好；
b.公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好，过去三年未有任何违规经营记录；
c.公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
d.公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；
e.具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。
2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序
基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：
a.研究报告的数量和质量；
b.提供研究服务的主动性；
c.资讯提供的及时性及便利性；
d.其他可评价的考核标准。

§12影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自2012年1月16日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。
2、2012年11月15日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

汇丰晋信基金管理有限公司
二〇一四年三月二十六日