# 汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金

## 【2014】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:交通银行股份有限公司
送出日期:2015年3月31日

§1 重要提示

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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月30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2014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 | 汇丰晋信龙腾股票 |
| 基金主代码 | 540002 |
| 基金交易代码 | 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 569,493,244.64份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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<br>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。<br>2. 以成长指标为核心的股票筛选策略<br>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%×富时中国A600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。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 古蔚 | 汤滋彦 |
| | 联系电话 | 021-20376868 | 95559 |
| | 电子邮箱 | compliance@hsbcjt.cn | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 021-20376888 | 95559 |
| 传真 | | 021-20376999 | 021-62701216 |

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<br>交通银行股份有限公司:上海市浦东新区银城中路188号。 |

§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

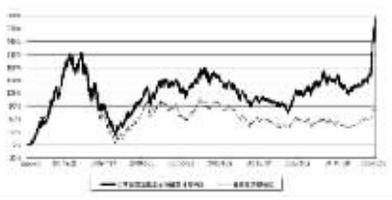
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2014年 | 2013年 | 2012年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 187,085,029.79 | 144,333,596.44 | −280,444,505.11 |
| 本期利润 | 301,097,742.87 | 203,541,547.79 | −12,091,208.56 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3060 | 0.2620 | −0.0106 |
| 本期基金份额净值增长率 | 55.01% | 24.97% | 0.79% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014年末 | 2013年末 | 2012年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6037 | 0.0820 | 0.1704 |
| 期末基金资产净值 | 955,161,900.90 | 2,260,031,013.03 | 747,382,561.12 |
| 期末基金份额净值 | 1.6772 | 1.0820 | 1.1704 |

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;
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。

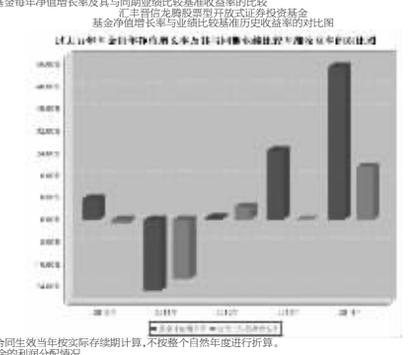
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 55.79% | 2.26% | 13.42% | 0.99% | 42.37% | 1.27% |
| 过去六个月 | 66.70% | 1.72% | 25.70% | 0.83% | 41.00% | 0.89% |
| 过去一年 | 55.01% | 1.51% | 19.27% | 0.84% | 35.74% | 0.67% |
| 过去三年 | 95.25% | 1.34% | 24.42% | 0.98% | 70.83% | 0.36% |
| 过去五年 | 56.50% | 1.30% | −4.56% | 1.04% | 61.06% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 292.82% | 1.59% | 83.54% | 1.41% | 209.28% | 0.18% |

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12月31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。
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
汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注:本基金基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014 | − | − | − | − | − |
| 2013 | 3.8000 | 790,602,277.78 | 158,763,269.52 | 949,365,547.30 | − |
| 2012 | − | − | − | − | − |
| 合计 | 3.8000 | 790,602,277.78 | 158,763,269.52 | 949,365,547.30 | − |

§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。公司由山西信托股份有限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2014年12月31日,公司共管理13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)、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)和汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金(2014年11月26日成立)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 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年12月28日 | − | 14 | 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。 |
| 林彤彤 | 副总经理、首席投资官、本基金基金经理 | 2006年9月27日 | 2014年11月11日 | 15 | 林彤彤先生,硕士学历,曾任华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员、基金安信、基金安久、基金安顺、基金安瑞的基金经理,投资部总监助理兼基金安信基金经理;汇丰晋信基金副总经理,首席投资官、汇丰晋信大盘股票型开放式证券投资基金基金经理和本基金基金经理。 |

注:1.林彤彤先生的任职日期为本基金基金合同生效日,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.离任日期为本基金管理人公告林彤彤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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和控制方法
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》、《证券投资基金运作管理办法》、《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。
公司对公平交易的控制方法包括:1、交易所市场的公平交易均通过恒生投资交易系统实现,通过开启公平交易程序,由恒生投资交易系统强制执行;2、银行间交易由执行交易员按照价格优先、比例分配的公平交易的原则实行分配,确保各投资组合获得公平的交易机会;3.对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4.使用恒生投资交易系统的公平交易分析模块,定期进行报告分析,对公平交易的情况进行检查。
4.3.2 报告期内公平交易的执行情况
报告期内,公司各投资组合(不包括专户投资组合)在投资决策、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,公司以公司制度作为指导,按照公司制度的规定,公平对待各投资组合,并