

汇丰晋信大盘波动精选股票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:中国建设银行股份有限公司

重要提示

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金的募集申请于【2015年11月10日】经中国证监会证监许可【2015】2904号文注册。

本招募说明书(更新)所载内容真实、准确、完整,本招募说明书(更新)经中国证监会注册,并不表明其对本基金的价值或收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险,中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(以下简称“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,投资者根据持有基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体经济、经济、社会等环境因素对证券市场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,由于基金份额持有人连续大量赎回产生的流动性风险。基金管理人在本基金管理运作过程中产生的积极管理风险,本基金的特定风险。本基金是一只股票型基金,属于证券投资基金中预期风险、预期收益较高的基金品种,长期风险和预期收益高于混合型、债券型基金和货币市场基金。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等法律文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑到自身的风险承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,谨慎做出投资决策,自行承担投资风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金前应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本招募说明书(更新)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8月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日,本招募说明书所披露的财务数据未经审计。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

汇丰晋信基金管理有限公司
住所: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:2006年11月16日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字【2006】172号
组织形式:有限责任公司
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:周慧
联系电话:021-20376888
公司的股权结构如下:
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,硕士学位。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)、晋商银行董事,硕士学位,曾任山西省投资股份有限公司地产事业部、投资总监兼副经理,太原万丰房地产发展有限公司总经理,山西国际信托中心、山西国际信托有限公司董事长。现任山西金融投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

梁宏杰先生,董事,本科学历。曾任长治市专委办办公室主任,晋商银行股份有限公司董事兼办公室主任,山西国信投资(集团)公司董事兼办公室主任,兼任晋商银行主任兼晋商银行党委书记,中合高资本管理有限公司董事、董事长,山西国信投资集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。

李浩进先生,董事,硕士学位。曾任怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监、汇丰投资管理(香港)董事兼亚太企业拓展及中国事务主管,汇丰晋信基金管理有限公司总经理、董事。现任汇丰中华证券投资有限公司董事。

巴培卓(Pedro Augusto Botelho Bastos)先生,董事。曾任汇丰环球投资管理(巴西)行政总裁,汇丰环球投资管理(拉丁美洲)首席投资官、行政总裁,现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

王敏女士,董事,中国注册会计师(CPA)和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理(英国)有限公司产品开发培训师,汇丰环球投资管理(香港)有限公司亚太企业拓展经理,其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司,公司成立至今历任财务总监、特别项目总监、国际业务及战略拓展部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理、晋商银行董事,硕士学位,曾任山西省投资股份有限公司地产事业部、投资总监兼副经理,太原万丰房地产发展有限公司总经理,山西国际信托中心、山西国际信托有限公司董事长。现任山西金融投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

阿姆斯特丹大学访问副教授,清华大学特聘教授、长江商学院EMBA项目副班长。现任长江商学院金融教授。

王立荣先生,独立董事,本科学历。曾任汇丰银行(英国)西岸业务副总裁,汇丰银行(香港)零售部主管,汇丰银行中国区总代表中国区业务总裁、交通银行副行长、国际信托(香港)亚太区首席代表。现任星展银行(香港)有限公司独立董事。

2、基金管理人监事会成员

魏志军先生,监事会主席,本科学历。曾任西安基金管理有限公司基金注册部总监,中银基金管理有限公司首席运营官;汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监;现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张敬波先生,副总经理,硕士学位。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务总监。

曹庆先生,副总经理,硕士学位。曾任东方基金管理有限责任公司研究员,法国巴黎银行证券上海代表处研究员,汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员、投资管理部副总监。现任晋商银行副行长、晋商银行总行零售银行部副总监、晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理。

周文先生,督察长,硕士学位。曾任山西信托及山西省国信投资(集团)公司担任业务员及投资经理,汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员,现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

3、基金管理人高级管理人员

王敏女士,总经理,硕士学位。中国注册会计师(CPA)和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理(英国)有限公司产品开发培训师,汇丰环球投资管理(香港)有限公司亚太企业拓展经理,其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司,公司成立至今历任财务总监、特别项目总监、国际业务及战略拓展部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理、晋商银行董事,硕士学位,曾任山西省投资股份有限公司地产事业部、投资总监兼副经理,太原万丰房地产发展有限公司总经理,山西国际信托中心、山西国际信托有限公司董事长。现任山西金融投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

王立荣先生,副总经理,本科学历。曾任山西信托固定收益部副经理、山西证券副总经理、创新业务部总监;上海方达投资管理有限公司副经理,汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵敏女士,副总经理,硕士学位。曾任西安基金管理有限公司基金注册部总监,中银基金管理有限公司首席运营官;汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监;现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张敬波先生,副总经理,硕士学位。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务总监。

曹庆先生,副总经理,硕士学位。曾任东方基金管理有限责任公司研究员,法国巴黎银行证券上海代表处研究员,汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员、投资管理部副总监。现任晋商银行副行长、晋商银行总行零售银行部副总监、晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理,晋商银行总行零售银行部副经理。

周文先生,督察长,硕士学位。曾任山西信托及山西省国信投资(集团)公司担任业务员及投资经理,汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员,现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

4、本基金基金经理

方蔚女士,华东师范大学数学统计系学士,新加坡南洋理工大学数学系硕士。方蔚女士曾任职于新加坡独立证券公司金融工程师,在三年任职期间,运用金融量化模型,为公司自营业务、多种投资策略模型及各类资产的指数化投资策略模型,包括股指期货与商品现货,各类基金策略模型(包括股指期货)等的套期保值,同时运用量化分析为公司做市商业务建立了程序化自动做市交易模型,其在海外证券市场上的金融交易模型研究以及成功投资有丰富的实践经验。回国后,其分别任职于易普咨询有限公司顾问职位,以及德隆友联战略咨询管理有限公司,参与并购重组及并购重组项目,并负责中国市场的基金绩效评估工作,并运用基金风险调整后收益、业绩持续性以及择时能力等量化指标在中国基金绩效评估方面进行了大量的研究和量化分析工作;参与德隆友联战略咨询管理有限公司对集团旗下基金公司的风险管理,运用数学模型化理论,建立包括信用风险评估、流动性风险管理、资产负债结构管理以及利率风险管理等量化风险评估。

方蔚女士于2006年加入汇丰晋信基金管理有限公司,曾任公司风险管理部副总监,协助管理层运用量化分析理论对各类投资组合进行业绩和风险绩效评估,并使用流动性风险、跟踪误差和投资组合周转率等辅助风险控制指标对基金投资组合进行流动性风险管理。方蔚女士不仅在风险管理理论和研究方面具有扎实的功底,而且运用量化分析工具进行证券投资业绩的长期实践中,也积累了丰富的实战经验。现任汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金基金经理,并兼任投资管理部风控一职。

5、投资决策委员会成员

王敏,总经理,投资决策部总监兼汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金和汇丰晋信沪港深发展策略混合型证券投资基金、固收收益部总监;任栋梁,股票投资部总监兼汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信沪港深发展策略混合型证券投资基金基金经理。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币2516.66亿元
组织形式:股份有限公司
存续期间:持续经营
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:田青
客服电话:10106759 5006

一、基金份额发售机构

1、直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心
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
电话:021-20376888
传真:021-20376888
联系人:王蔚
客户服务中心电话:021-20376888
公司网站:www.hsbcjt.cn

2、代销机构

中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡铭
电话:(021)58781224
传真:(021)58408483
联系人:张薇
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

中国银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:田国立
电话:(010)61810330
传真:(010)66109144
联系人:燕然
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李庆平
联系电话:01065541585
客户服务电话:95558
网址:www.citic.com

上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路8号15-20楼,22-27楼
办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层
联系人:胡晋平
电话:(021)38576888
传真:(021)60105124
客服电话:021-962999
公司网站:http://www.spdb.com.cn

平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号平安银行大厦
办公地址:深圳市深南东路5047号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系电话:01065541585
客户服务电话:95511-3
网址:http://bank.pingan.com/

中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎

电话:010-58537666
传真:010-83914293
联系人:董薇
客户服务电话:95688
公司网站:www.cmbc.com.cn
中国工商银行股份有限公司(仅代销本基金A类份额)
注册地址:北京市西城区中二环路22号
办公地址:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层
办公地址:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼22层
法定代表人:李建
公司网站:www.icbc.com.cn
客服电话:95588(限中国内地固话)
(+86)-(21)-3888 8828 (适用于境外或移动电话)
运钞服务电话:900-820-8878(限中国内地固话)
(+86)-(21)-3888 8878 (适用于境外或移动电话)
非个人客户7*24小时服务:2890(限中国内地固话)
(+86)-(21)-3888 3015 (适用于境外或移动电话)
平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼
法定代表人:肖遂宁
公司网站:www.pingan.com
客服电话:020-88620066
平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼
法定代表人:曹凡
联系人:石静璇
电话:021-38931117
传真:021-58991896
客服电话:95511-8
公司网站:stock.pingan.com

二、登记机构

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
联系人:杨小勇
联系人:戚琦
联系电话:021-20376892
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖
经办律师:黎明、陆奇
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人/首席合伙人:杨绍信
联系电话:021-2323 8888
传真电话:021-2323 8800
经办注册会计师:薛威、赵钰
联系人:赵钰

第四部分 基金的名称

第五部分 基金的类型

股票型证券投资基金

本基金基于汇丰集团低风险策略构建投资组合,力求为投资者提供相对业绩比较基准更高的相对收益。

第六部分 基金的投资目标

本基金为股票型基金,投资组合包括国内依法发行上市的股票中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票、国债、金融债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规限制基金投资于非本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金可以参与融资融券。

基金的投资组合为:股票投资比例范围为基金资产的80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,股指期货以及在一年以内的政府债券的投资比例不高于基金资产净值的5%。本基金主要使用个股优选策略及波动率策略构建投资组合,并主要使用“个股优选策略及波动率策略”精选的股票不低于非本基金资产净值的90%。

第七部分 基金的投资方向

本基金为股票型基金,投资组合包括国内依法发行上市的股票中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票、国债、金融债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规限制基金投资于非本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金可以参与融资融券。

基金的投资组合为:股票投资比例范围为基金资产的80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,股指期货以及在一年以内的政府债券的投资比例不高于基金资产净值的5%。本基金主要使用个股优选策略及波动率策略构建投资组合,并主要使用“个股优选策略及波动率策略”精选的股票不低于非本基金资产净值的90%。

第八部分 基金的投资策略

本基金通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,根据精选的个股和行业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。

1、个股投资策略

本基金运用的个股优选策略——“估值+盈利”策略是一个二维模型的概念,即以PB、PE、EV/EBITDA等指标代表的估值维度,以及BTT、ROE等指标代表的盈利维度,分别反映个股估值高低(估值维度)和个股盈利能力(盈利维度)。基金管理人力求通过该策略构建投资组合,在这个组合中选出高盈利且具有低估值特性的投资标的构成股票库。该股票库的具体构建步骤如下:

(1)本基金以全市场的股票为基础,进行流动性测算,从而剔除市值过小、流动性较差的股票;

(2)利用公司内部及外部研究资源,对初选股票库中的个股未来的估值性价比和盈利指标进行测算,并构建“估值+盈利+维模型”;

(3)依据二维模型,对所选个股进行回归分析,并根据二维指标进行综合排名,挑选出综合排名靠前的股票。

本基金在个股估值方面,将对上述个股基本面进行重新审核,通过对上市公司的行业特性、盈利模式、经营管理能力及公司治理状况等因素进行综合分析,考察上市公司在行业竞争及持续成长能力、剔除上市公司在公司治理、企业经营及财务报告等方面存在潜在问题的上市公司,形成核心股票库。

2、波动率优化策略

本基金将定期运用汇丰“波动率优化”策略对核心选股库进行优化,“波动率优化”策略的将针对核心选股库的股票的历史波动率、波动性及相关性进行优化,以降低组合波动率的目的,给出组合中个股权重及行业权重的建议。

在实际投资组合构建中,基金管理人依据优化建议,综合考虑上市公司的基本面预期、市场环境预期,构建基金投资组合。基金管理人将根据优化建议,综合考虑上述流程中的具体指标和权重,保持投资组合市场环境适应度变化和挑战,力求在降低组合波动率的前提下,为投资者提供相对收益更高的相对回报收益。

3、债券投资策略

本基金投资于固定收益资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时,充分利用固定收益资产的投资机会,提高组合投资收益,并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益资产的投资上,将采用自上而下的投资策略,通过对未来利率走势预期、收益率曲线变动、收益率曲线平斜率等分析,积极投资,获取超额收益。

准确预测未来利率趋势能为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观政策运行状况,全面分析货币政策、财政政策及利率政策变化情况,把握未来利率走势,在预期利率下降时加大债券投资力度,在预期利率上升时适度缩小仓位,规避利率风险,增加投资收益。

收益增强策略

收益增强策略是指债券期限收益与收益率之间的关系。投资研究部门通过预测收益率曲线形状的变化,调整债券组合中短期品种的比例,使得投资组合收益最大化。

收益类资产分析

在预期和判断同一市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场的同一品种、不同品种的同一板块,并对其进行综合分析,收益类资产分析和行业分析等,在严格控制风险的前提下,采取积极投资策略,获取超额收益。

4、权证投资策略

本基金权证投资以权证发行条款和权证定价模型为基础,结合权证发行价格、行权时间、行权方式、股价波动与权证波动率及权证收益率等要素,运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

5、资产支持证券投资

本基金在严格控制法律法规和基金合同的前提下,秉持稳健投资策略,综合运用久期管理、收益率曲线策略、流动性管理、分散化投资等策略,在严格控制风险的前提下,通过合理配置资产,选择风险收益特征相匹配的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。

第九部分 基金的业绩比较基准

业绩比较基准=沪深300指数*90%+同业存款利率(税后)+10%
沪深300指数由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中国指数有限公司开发的中国A股指数,它的样本选自沪深两市总市值最大的300只股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

因此,“沪深300指数*90%+同业存款利率(税后)+10%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更名,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够反映本基金风险收益特征的指数,或者本基金管理人认为调整业绩比较基准更有利于基金持有人利益,则本基金管理人有权按照基金合同约定,在不与基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等相冲突的前提下,经与基金托管人协商一致后,按照法律法规及基金合同约定,在不召开基金份额持有人大会的情况下,对业绩比较基准进行变更,并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金,属于证券投资基金中预期风险、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。

本基金管理人的董事会及董事承诺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2017年7月19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,保证报告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4月1日起至6月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

8.1 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	78,525,877.69	90.31
2	其中:股票	78,525,877.69	90.31
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售	-	-
10	银行存款	-	-
11	同业拆借	-	-
12	其他	-	-
13	合计	78,525,877.69	90.31

8.2 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	5,563,486.05	6.44
C	制造业	23,265,523.25	26.92
D	电力、热力、燃气及生产和服务	6,276,951.00	7.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,304,108.76	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	3,360,926.66	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务	3,043,642.00	3.52
J	金融业	29,328,317.07	30.01
K	房地产业	2,106,672.80	2.44
L	租赁和商务服务业	3,420,688.00	3.96
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	1,590,984.00	1.84
R	文化、体育和娱乐业	2,664,588.00	3.08
S	综合	-	-
合计		78,525,877.69	90.88

法定代表人:李季
公司网站:http://hsbcjt.cn
客服电话:95511-8
传真:010-88085258
电话:010-88013608
华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号中旅大厦18楼
法定代表人:李雁
联系人:陈琳
电话:0755-82492962(深圳)
客户服务电话:95567
网址:www.htsc.com.cn
珠海金米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
公司网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-88620066
平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26楼
法定代表人:曹凡
联系人:石静璇
电话:021-38931117
传真:021-58991896
客服电话:95511-8
公司网站:stock.pingan.com

第十部分 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、从类基金合同中的基金财产中计提的销售服务费;

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费或仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的投资交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定,履行信息披露义务所发生的费用;

10、按照国家有关规定,在基金合同中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费
E为前一日的基金资产净值

管理费每日计算,逐日累计至每月月末,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、公休日等,支付日期顺延。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费
E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,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、公休日等,支付日期顺延。

3、C类基金份额的销售服务费
本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%,销售服务费计提的计算公式如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为前一日C类基金份额的销售服务费
E为前一日C类基金份额的销售基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人同意,基金管理人可于每个工作日对基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等等。上述“一、基金费用”中第4-10项费用,根据有关法规及《基金合同》规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中列支。

下列费用不列入基金费用:

1、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资产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用
1、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

2、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

3、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

4、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

第十一部分 基金的业绩

本基金自2015年11月16日成立以来,基金份额净值表现如下:

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准标准差③	业绩比较基准跟踪误差④	①-③	②-④
2016/3/11(基金合同生效日)	-12.77%	0.52%	0.93%	0.79%	3.94%	-0.27%
2016/12/31	-	-	-	-	-	-
2017/1/1-2017/6/30	11.16%	0.44%	0.74%	0.51%	1.42%	-0.07%

汇丰晋信大盘波动股票C

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准标准差③	业绩比较基准跟踪误差④	①-③	②-④
2016/3/11(基金合同生效日)	-12.00%	0.52%	0.93%	0.79%	3.16%	-0.27%
2016/12/31	-	-	-	-	-	-
2017/1/1-2017/6/30	11.16%	0.44%	0.74%	0.51%	1.42%	-0.07%

二、本基金自合同生效以来,基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1. 汇丰晋信大盘波动股票A

注:

1.按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,权证投资比例为基金资产净值的0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不高于基金资产净值的5%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合,本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非本基金资产净值的90%。本基金自基金合同生效日起超过6个月内完成建仓。截止2016年9月12日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2.按照基金合同的约定,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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较,按照基金合同约定的计算方法计算,包含本基金所投资股票在报告期内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中证装备产业指数成份股在报告期内产生的股票红利收益。

1. 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、从类基金合同中的基金财产中计提的销售服务费;

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费或仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的投资交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定,履行信息披露义务所发生的费用;

10、按照国家有关规定,在基金合同中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费
E为前一日的基金资产净值

管理费每日计算,逐日累计至每月月末,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、公休日等,支付日期顺延。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费
E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,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、公休日等,支付日期顺延。

3、C类基金份额的销售服务费
本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%,销售服务费计提的计算公式如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为前一日C类基金份额的销售服务费
E为前一日C类基金份额的销售基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人同意,基金管理人可于每个工作日对基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等等。上述“一、基金费用”中第4-10项费用,根据有关法规及《基金合同》规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中列支。

下列费用不列入基金费用:

1、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资产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用
1、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

2、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

3、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

4、基金管理人、基金托管人、销售机构和基金注册登记机构的基金销售费用,按照基金合同及招募说明书的约定执行。

注:

1.按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的80%-95%,除股票以外的其他资产投资比例为5%-20%,权证投资比例为基金资产净值的0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不高于基金资产净值的5%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合,本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非本基金资产净值的90%。本基金自基金合同生效日起超过6个月内完成建仓。截止2016年9月12日,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2.按照基金合同的约定,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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较,按照基金合同约定的计算方法计算,包含本基金所投资股票在报告期内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中证装备产业指数成份股在报告期内产生的股票红利收益。

1. 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、从类基金合同中的基金财产中计提的销售服务费;

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费或仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的投资交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定,履行信息披露义务所发生的费用;

10、按照国家有关规定,在基金合同中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E$$