

---

# 汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 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

送出日期:2018 年 03 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信中小盘股票
基金主代码	540007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11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	65,969,503.00份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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过程中所体现出的高成长性、可持续性以及市值高速扩张所带来的投资机会，以寻求资本的长期增值。</p>
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>行业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、外部研究资源，结合宏观基本面分析等状况，提出重点行业配置比重的建议。</p> <p>(3) 股票投资策略</p> <p>本基金主要采用“自下而上”的方式挑选具有持续潜力、目前股价尚未充分反映公司未来高成长性的中小上市公司股票作为主要投资对象。</p>
业绩比较基准	<p>中证700（中小盘）指数*90%+同业存款利率*10%。</p>

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。
--------	---

### 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
	联系电话	021-20376868
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn
客户服务电话	021-20376888	010-67595096
传真	021-20376999	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	5,895,620.41	-5,561,867.62	98,454,605.50
本期利润	8,139,588.62	-12,350,527.86	50,709,509.89
加权平均基金份额本期利润	0.1106	-0.1444	0.3896
本期基金份额净值增长率	9.04%	-11.06%	8.04%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.2235	0.1221	0.2617

期末基金资产净值	80,714,155.12	88,576,742.11	111,813,628.66
期末基金份额净值	1.2235	1.1221	1.2617

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	-1.95%	0.91%	-2.95%	0.80%	1.00%	0.11%
过去六个月	2.20%	0.84%	2.58%	0.78%	-0.38%	0.06%
过去一年	9.04%	0.79%	2.93%	0.75%	6.11%	0.04%
过去三年	4.77%	1.98%	10.95%	1.78%	-6.18%	0.20%
过去五年	67.21%	1.78%	63.91%	1.57%	3.30%	0.21%
成立至今	24.58%	1.61%	19.15%	1.51%	5.43%	0.10%

注：

过去三个月指2017年10月1日-2017年12月31日

过去六个月指2017年7月1日-2017年12月31日

过去一年指2017年1月1日-2017年12月31日

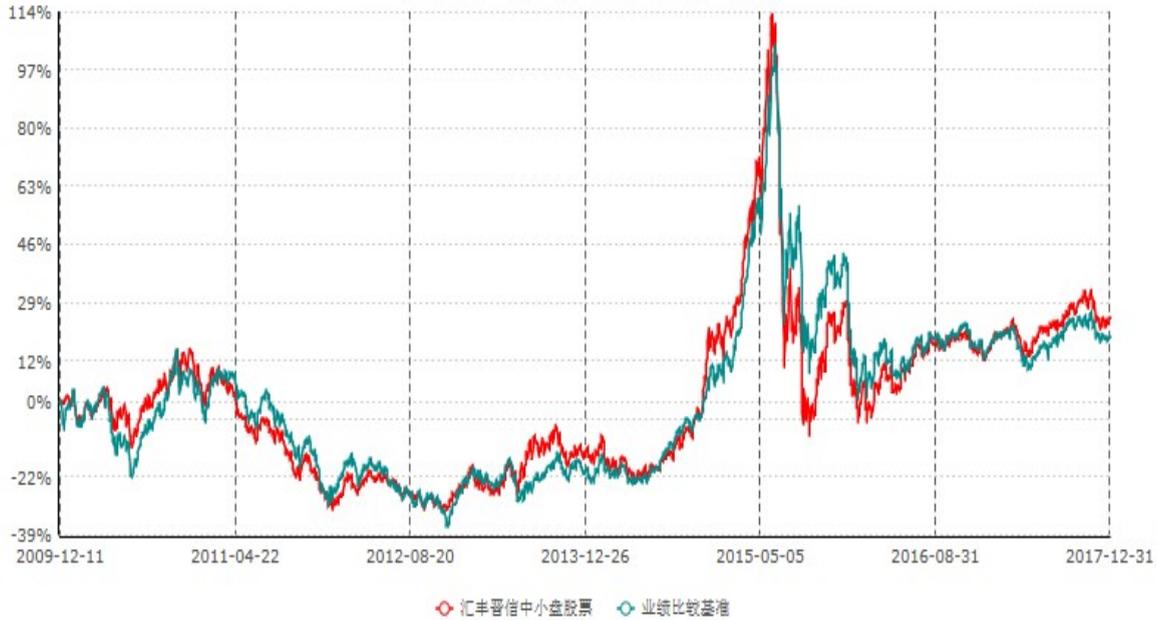
过去三年指2015年1月1日-2017年12月31日

过去五年指2013年1月1日-2017年12月31日

成立至今指2009年12月11日-2017年12月31日

#### 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

汇丰晋信中小盘股票型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  
(2009年12月11日-2017年12月31日)



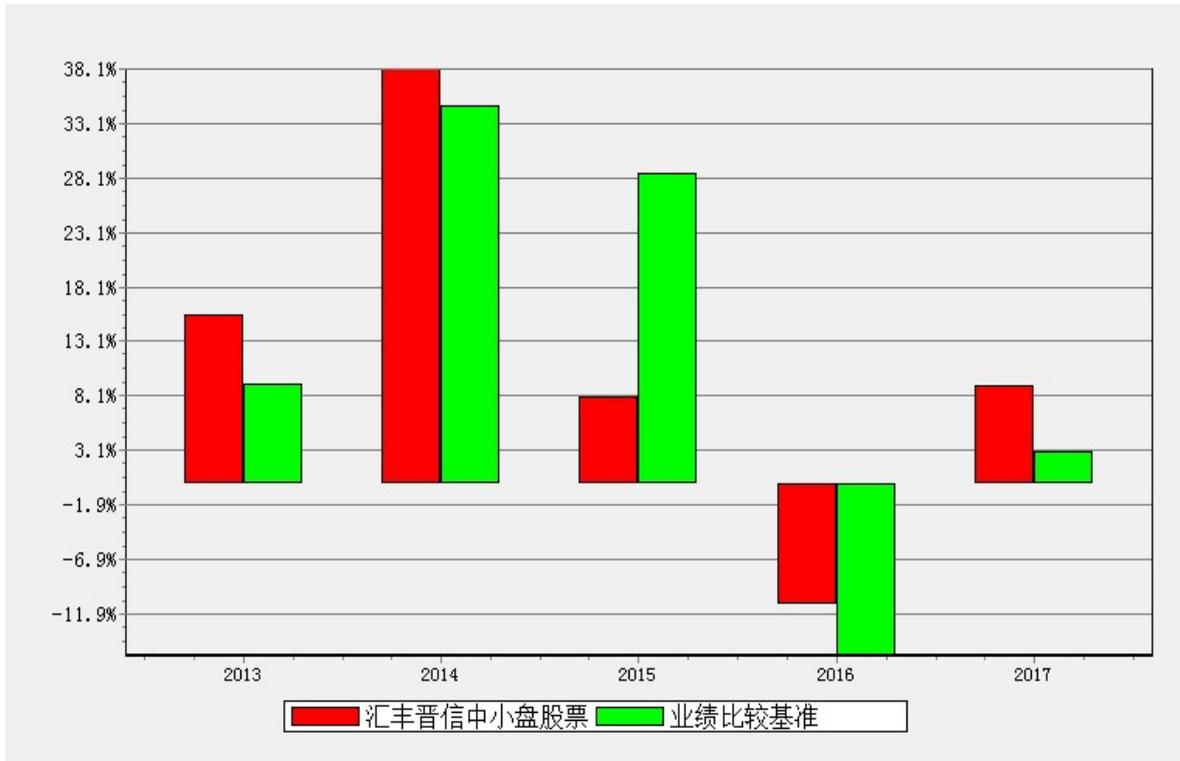
注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，其中，将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小上市公司股票。本基金权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。本基金固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。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2010年6月11日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中证700（中小盘）指数\*90% + 同业存款利率\*10%。

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的计算未包含中证700指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，过去三年本基金未进行利润分配。

## § 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2017年12月31日，公司共管理18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）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（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)、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)、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金(2015年2月11日成立)、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金(2015年9月30日成立)、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(2016年3月11日成立)、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金(2016年11月10日成立)和汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金(2017年6月2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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯玉琦	本基金基金经理	2013-04-13	-	20	侯玉琦先生,工商管理硕士。曾任山西省国信投资集团投资经理,2006年1月加入汇丰晋信基金管理有限公司,先后担任研究员、高级研究员和投资经理、汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理。现任本基金基金经理。

注:1.任职日期为本基金管理人公告侯玉琦先生担任本基金基金经理的日期;

2.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》、《公开募集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 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间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相近交易日内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。

#### 4.3.3 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

2017年A股市场温和上涨，成交量较2016年略有萎缩，沪深300指数全年上涨21.78%，但是行情的分化非常明显。

从行业板块看，按照中信证券分类的29个行业中，食品饮料、家电表现较好，而纺织服装、传媒、计算机等行业相对较差。整体看，价值类表现好于成长类，大盘股表现好于小盘股。全部29个行业中，仅有食品饮料和家电两个行业跑赢了沪深300指数。

从公布的宏观经济数据看，2017年经济保持了平稳增长，全年GDP增速6.9%，高于先前的预期。整体看，经济运行平稳，逐步摆脱了过去的低迷，经济增长的质量逐步提升，产业结构更加合理，过剩产能行业逐步出清，通胀逐步抬升，房价上升得到遏制，为我国产业结构顺利转型和升级铺平道路。

政策层面看，2017年保持了积极的财政政策和稳健中性的货币政策，维护流动性合理稳定，控制杠杆率，防控系统性金融风险成为政策的重点。

操作上，我们认为2017年市场对于业绩的稳定性以及较低的估值更为看重，而流动性的收紧对于一些成长类的板块不利，因此重点持有了估值合理，业绩稳定的价值类个股，低配了成长类的股票。

从行业板块看，2017年重点持有了基本面较好、业绩相对确定的银行、家电、医药等板块，以及有涨价预期的一些化工、有色金属板。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为9.04%，同期业绩比较基准增长率为2.93%，净值表现领先比较基准6.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对2018年经济的整体判断认为经济平稳增长，去杠杆、去库存、去产能不断推进，金融杠杆率下降，房地产库存逐步下降，钢铁、煤炭等产能逐渐出清，产能利用率提升。产业结构不断优化，技术和效率的提升、新经济、消费升级将成为拉动经济的新动力。

对于2018年A股市场，我们判断市场将以震荡市、结构性行情为主流，向下风险较小，本基金重点选择优质的个股作为投资标的。从配置的角度，我们主要采取自下而上的选股思路，重点投资于细分行业优秀的龙头公司，同时保持相对灵活的仓位。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在公司内部监察稽核工作中本着规范运作、防范风险和保护基金份额持有人利益的原则，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司的经营管理、基金的投资运作以及员工行为规范等方面进行日常监控、定期检查和专项检查，

及时发现问题并督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报送监管机构。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1. 通过定期检查和专项检查的方式对公司日常经营活动和基金投资运作进行合规性监控，发现问题及时要求相关部门和相关人员及时解决处理，并跟踪问题的处理结果，对相关员工开展针对性的风险教育，防范在公司经营和基金投资运作中可能发生的风险；

2. 按照法律法规和中国证监会规定，及时、准确、完整地完成了公司和基金的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和基金的各项公开信息。

3. 定期和不定期地向中国证监会、上海证监局、中国证券业协会和人民银行等监管机构报送各类文件报告，确保监管机构文件报备工作的准确性和及时性。

4. 加强对公司业务部门的合规监察工作，并将监察结果报告发给与相关部门主管沟通，对各项制度进行更新，提出改进建议，提请和督促业务部门进行跟踪和改善。

5. 对基金募集申请材料、市场宣传推介材料、基金代销协议、基金交易单元租用协议等文件等进行严密的事前合法合规审核，以及完成公司其他日常法律事务工作。

6. 定期为公司员工举办公司合规制度的培训，并就新颁布法律法规举办专项合规培训，向公司员工宣传合规守法的经营理念，强化公司的合规文化；对投资管理以及销售业务部门员工开展专项培训，以进一步规范和完善基金投资以及销售行为。

7. 根据监管部门的要求，定期完成监察稽核报告，报送中国证监会和公司董事会审阅；

本基金管理人将继续致力于建立一个高效的内部控制体系，一贯本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益，切实保证基金安全、合规运作。

#### 4.7 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控制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业从业资格，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的配合下展开工作，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控委员会会议，通过公司风控委员会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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第21793号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“汇丰晋信中小盘基金”)的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了汇丰晋信中小盘基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇丰晋信中小盘基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇丰晋信中小盘基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，</p>

	<p>并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇丰晋信中小盘基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇丰晋信中小盘基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督汇丰晋信中小盘基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇丰晋信中小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在</p>

	在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致汇丰晋信中小盘基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛 竞	赵 钰
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼	
审计报告日期	2018-03-26	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,419,795.80	12,072,930.29
结算备付金		20,442.19	122,995.40
存出保证金		10,999.02	21,133.08
交易性金融资产	7.4.7.2	70,643,619.00	76,941,152.16
其中：股票投资		70,411,619.00	76,941,152.16

基金投资		-	-
债券投资		232,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,180.01	2,287.08
应收股利		-	-
应收申购款		22,279.77	4,062.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		81,119,315.79	89,164,560.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		67,310.16	44,721.42
应付管理人报酬		102,417.92	115,340.81
应付托管费		17,069.64	19,223.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	35,586.25	105,841.15
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	182,776.70	302,691.55

负债合计		405,160.67	587,818.44
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	65,969,503.00	78,936,761.40
未分配利润	7.4.7.1 0	14,744,652.12	9,639,980.71
所有者权益合计		80,714,155.12	88,576,742.11
负债和所有者权益总计		81,119,315.79	89,164,560.55

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额总额65,969,503.00份，基金份额净值1.2235元。

## 7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日
<b>一、收入</b>		10,217,731.93	-9,882,883.06
1. 利息收入		72,428.70	81,972.38
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	72,372.76	81,972.38
债券利息收入		55.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,868,733.89	-3,211,277.13
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	6,891,764.56	-3,851,347.81
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.1 3	20,318.96	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.1 3.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 5	-	-
股利收益	7.4.7.1 6	956,650.37	640,070.68
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.1 7	2,243,968.21	-6,788,660.24
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.1 8	32,601.13	35,081.93
<b>减：二、费用</b>		2,078,143.31	2,467,644.80
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	1,316,991.12	1,395,850.81
2. 托管费	7.4.10. 2.2	219,498.47	232,641.85
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 9	300,554.57	530,968.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.2 0	241,099.15	308,183.89
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		8,139,588.62	-12,350,527.86

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,139,588.62	-12,350,527.86

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017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)	78,936,761.40	9,639,980.71	88,576,742.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,139,588.62	8,139,588.62
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）	-12,967,258.40	-3,034,917.21	-16,002,175.61
其中：1. 基金申购款	8,522,980.89	1,554,582.29	10,077,563.18
2. 基金赎回款	-21,490,239.29	-4,589,499.50	-26,079,738.79
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）	65,969,503.00	14,744,652.12	80,714,155.12
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016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)	88,619,129.70	23,194,498.96	111,813,628.66
二、本期经营活动产生的基	-	-12,350,527.8	-12,350,527.86

金净值变动数(本期利润)		6	
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)	-9,682,368.30	-1,203,990.39	-10,886,358.69
其中: 1. 基金申购款	16,211,802.95	965,603.96	17,177,406.91
2. 基金赎回款	-25,894,171.25	-2,169,594.35	-28,063,765.60
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)	78,936,761.40	9,639,980.71	88,576,742.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

王栋

赵琳

杨洋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1105号《关于核准汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金募集的批复》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》和《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,233,309,589.22元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所有限公司”)KPMG-B(2009)CR No.0064验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2009年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,233,818,289.91份基金份额,其中认购资金利息折合508,700.69份基金份额。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。基金投资组合的比例范围为：股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于沪深两市上具有良好成长性和竞争力的中小上市公司股票。本基金的业绩比较基准为：中证700(中小盘)指数×90%+同业存款利率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于2018年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本报告期内，本报告所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度财务报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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[2015]101号《关于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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(4) 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。

#### 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（“汇丰晋信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
山西信托股份有限公司（“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
晋商银行股份有限公司(“晋商银行”)	见注释③
汇丰银行(中国)有限公司(“汇丰银行”)	见注释④
恒生银行(中国)有限公司(“恒生银行”)	见注释⑤

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金融投资控股集团有限公司控制。

②中德证券与本基金管理人的股东-山西信托共同受山西金融投资控股集团有限公司控制。

③晋商银行与本基金管理人的股东-山西信托共同受山西金融投资控股集团有限公司控制。

④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。

⑤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。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度均无应支付关联方的佣金。

###### 7.4.8.1.4 债券交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.8.1.5 债券回购交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

### 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 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,316,991.12	1,395,850.81
其中：支付销售机构的客户维护费	350,560.29	391,385.82

注：支付基金管理人汇丰晋信的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	219,498.47	232,641.85

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未投资过本基金。

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本年末与上年末均未持有本基金。

#### 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 2017年01月01日至2017年 12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年1 2月31日	
	期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息收 入
中国建设银行股份有限公司	10,419,795 .80	70,729.60	12,072,930. 29	79,427.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（ 单位： 张）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
1135 03.S H	泰晶 转债	2017 -12- 15	2018 -01- 02	新债 未上 市	100. 00	100. 00	2,320	232, 000. 00	232, 000. 00	-

##### 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
0006 88	建新 矿业	2017 -09- 06	重大 事项	10.9 5	2018 -02- 07	9.86	150,000	1,66 7,34 7.38	1,64 2,50 0.00	-
6003 09	万华 化学	2017 -12-	重大 资产	37.9 4	-	-	36,000	782, 328.	1,36 5,84	-

		05	重组					62	0.00	
--	--	----	----	--	--	--	--	----	------	--

注：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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

本基金本年末未持有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

本基金本年末未持有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

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为67,635,279.00元，属于第二层次的余额为3,008,340.00元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次72,901,933.98元，第二层次4,039,218.18元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本报告期无属于第三层次公允价值余额和变动金额。

本基金上年度可比期间属于第三层次公允价值余额和变动金额如下：

	交易性金融资产 ——股票投资
2016 年 1 月 1 日	2,435,162.60
购买	-
出售	-
转入第三层次	-
转出第三层次	1,707,020.90
当期利得或损失总额	
——计入损益的利得或损失	<u>728,141.70</u>
2016 年 12 月 31 日	<u>-</u>
2016 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2016 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	<u>-</u>

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在

2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	70,411,619.00	86.80
	其中：股票	70,411,619.00	86.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	232,000.00	0.29
	其中：债券	232,000.00	0.29
	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	-	-
	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	10,440,237.99	12.87
8	其他各项资产	35,458.80	0.04
9	合计	81,119,315.79	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,642,500.00	2.03
C	制造业	49,301,923.96	61.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,440,379.44	5.50
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	-	-
J	金融业	13,029,815.60	16.14
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	1,997,000.00	2.47
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	70,411,619.00	87.24

### 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	000661	长春高新	25,443	4,656,069.0	5.77

				0	
2	600062	华润双鹤	180,000	4,455,000.00	5.52
3	002081	金螳螂	289,842	4,440,379.44	5.50
4	600867	通化东宝	183,456	4,199,307.84	5.20
5	000970	中科三环	235,074	3,380,364.12	4.19
6	002035	华帝股份	110,000	3,315,400.00	4.11
7	600066	宇通客车	130,000	3,129,100.00	3.88
8	601555	东吴证券	313,800	3,050,136.00	3.78
9	603738	泰晶科技	122,210	2,967,258.80	3.68
10	601229	上海银行	198,770	2,818,558.60	3.49

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司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	603738	泰晶科技	3,708,327.40	4.19
2	601229	上海银行	3,385,468.00	3.82
3	000661	长春高新	3,326,264.00	3.76
4	000921	海信科龙	3,020,521.60	3.41
5	002589	瑞康医药	2,987,603.51	3.37

6	603698	航天工程	2,947,485.00	3.33
7	000807	云铝股份	2,859,792.00	3.23
8	600066	宇通客车	2,814,913.98	3.18
9	000060	中金岭南	2,618,503.30	2.96
10	600350	山东高速	2,572,993.36	2.90
11	601288	农业银行	2,571,648.00	2.90
12	600109	国金证券	2,518,885.00	2.84
13	000786	北新建材	2,248,641.00	2.54
14	600111	北方稀土	1,987,630.00	2.24
15	600309	万华化学	1,812,394.63	2.05
16	600388	龙净环保	1,782,006.50	2.01
17	000422	湖北宜化	1,753,570.00	1.98
18	600054	黄山旅游	1,719,322.00	1.94
19	000501	鄂武商 A	1,712,684.50	1.93
20	002202	金风科技	1,680,817.30	1.90

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	002508	老板电器	6,646,406.71	7.50
2	000786	北新建材	6,442,863.44	7.27
3	601233	桐昆股份	3,923,465.27	4.43
4	000001	平安银行	3,654,492.17	4.13
5	601117	中国化学	3,509,436.80	3.96
6	600015	华夏银行	3,487,630.11	3.94
7	600111	北方稀土	3,410,024.84	3.85
8	600392	盛和资源	3,382,101.04	3.82
9	600028	中国石化	3,379,373.00	3.82
10	600803	新奥股份	3,198,088.42	3.61

11	000422	湖北宜化	2,879,396.28	3.25
12	002013	中航机电	2,819,710.00	3.18
13	600549	厦门钨业	2,773,730.36	3.13
14	000807	云铝股份	2,716,476.62	3.07
15	002589	瑞康医药	2,583,127.30	2.92
16	300065	海兰信	2,415,000.00	2.73
17	600350	山东高速	2,412,914.35	2.72
18	002475	立讯精密	2,360,377.03	2.66
19	600109	国金证券	2,240,000.00	2.53
20	002050	三花智控	2,089,146.00	2.36
21	002271	东方雨虹	1,981,926.00	2.24
22	600919	江苏银行	1,893,188.00	2.14

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

买入股票成本（成交）总额	88,529,832.07
卖出股票收入（成交）总额	104,195,098.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	232,000.00	0.29

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	232,000.00	0.29

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113503	泰晶转债	2,320	232,000.00	0.29

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	10,999.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,180.01
5	应收申购款	22,279.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,458.80

8.12.4 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。

8.12.5 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不存在流通受限的情况。

8.12.6 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	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,546	25,911.04	1,238,145.53	1.88%	64,731,357.47	98.12%

### 9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	40,635.77	0.0616%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月11日)基金份额总额	2,233,818,289.91
本报告期期初基金份额总额	78,936,761.40
本报告期基金总申购份额	8,522,980.89
减：本报告期基金总赎回份额	21,490,239.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	65,969,503.00

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

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，本公司于2017年1月12日聘任曹庆先生为公司副总经理并已正式对外发布公告。

经公司董事会审议批准，并报中国证券监督管理委员会和上海证监局备案，因督察长古韵女士休产假，总经理王栋先生在2017年8月16日至2018年1月31日期间代行督察长职务。

本报告期内，本公司其他高级管理

人员未发生不能正常履行职责的情况。

2017年9月1日, 中国建设银行发布公告, 聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及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

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过, 并经基金托管人同意, 本基金于2015年4月18日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 并报中国证券监督管理委员会备案。

报告年度预提审计费60000元, 根据与普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)签订的《审计业务约定书》, 应实际支付2017年度审计费60000元。

### 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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	11,347,087.82	5.89%	10,567.54	5.89%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	20,112,131.94	10.45%	18,730.33	10.45%	-
东吴证券	2	61,633,936.36	32.02%	57,399.55	32.02%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	73,166,534.54	38.01%	68,140.11	38.01%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	26,243,286.63	13.63%	24,440.53	13.63%	-

1、报告期内增加的交易单元为：天风证券，中信建投

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。

### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的比例		购成交总额的比例		交总额的比例		交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	132,340.32	100.00%	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇丰晋信基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十八日

