

# 汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

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

## 【重要提示】

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2007年3月9日证监基金字【2007】64号文批准发起设立。本基金基金合同于2007年4月9日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书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2016年10月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

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

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005年11月16日

电话：021-20376868

联系人：周慧

注册资本：2亿元人民币

股权结构：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，硕士学历。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）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理，太原万丰房地产发展有限公司总经理，山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长，山西信托董事长。现任山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

柴宏杰先生，董事，本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任，晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长，山西省国信投资（集团）公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛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。

李选进，董事，硕士学历。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）董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管，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信托股份有限公司董事长。

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。

王栋先生，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生、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、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长，国家发改委经济研究所常务副所长、教授、博士研究生导师。现任清华大学中国经济研究中心研究员。

梅建平先生，独立董事，博士学历。曾任纽约大学金融学副教授、芝加哥大学访问副教授、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项目副院长、金融学教授。现任长江商学院金融学教授。

叶迪奇，独立董事，硕士学历。曾担任汇丰银行（美国）西岸业务副总裁，汇丰银行（香港）零售部主管、汇丰银行中国总代表处中国业务总裁、交通银行副行长、国际金融协会（IIF）亚太区首席代表，现任星展银行（香港）有限公司独立董事。

#### （2）监事会成员基本情况：

焦杨先生，监事，硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理，常务副总经理，山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司运营总监兼资本运营部总经理，山西证券股份有限公司监事会主席，山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

黄碧娟女士，监事，本科学历。曾任汇丰集团银团贷款经理、资本市场部高级经理、大中华地区债务发行部主管、环球银行部香港区常务总监、汇丰银行（中国）有限公司副行政总裁、行长兼行政总裁。现任香港上海汇丰银行有限公司大中华地区行政总裁。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理，汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生，监事，硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资（集团）公司担任交易员及投资经理，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）总经理及其他高级管理人员基本情况：

王栋先生，总经理，硕士学历。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生、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、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

王立荣先生，副总经理，硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监；中银基金管理有限公司基金运营部总监；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。

张毅杰先生，副总经理，硕士学历。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理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务部总监。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

#### （4）本基金基金经理

郭敏女士，硕士研究生。曾任上海证券研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司研究部总监、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

邵骥咏先生，于2009年5月21日至2012年8月18日期间，曾管理本基金。

王春先生，于2007年4月9日至2009年9月1日期间和2012年7月21日至2015年5月23日期间，曾管理本基金。

#### （5）投资委员会成员的姓名和职务

王栋，总经理；曹庆，投资部总监兼汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金和汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金基金经理；郑宇尘，固定收益部总监；丘栋荣，股票投资部总监兼汇丰晋信大盘股票型证券投资基金和汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金基金经理；郭敏，研究部总监兼汇丰晋信动态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) 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：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

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：汤嵩彦

电话：021-95559

## 三、相关服务机构

### （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：021-20376868

传真：021-20376989

联系人：王晶晶

网址：[www.hsbcjt.cn](http://www.hsbcjt.cn)

客户服务中心电话：021-20376888

汇丰晋信基金电子交易平台

网址：<https://etrading.hsbcjt.cn/>

联系人：王晶晶

电话：021-20376957

(2) A 类别基金份额代销机构

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：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：张宏革

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

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

客户服务电话：95533

传真：010-66218888

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：021-66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：刘士余

传真：（010）85109219

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

汇丰银行（中国）有限公司

注册地址：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：廖宜建

公司网站：[www.hsbc.com.cn](http://www.hsbc.com.cn)

客服电话：卓越理财客户 800-820-8828（限中国内地固话）

(+86)-(21)-3888 8828（适用于境外或移动电话）

运筹理财客户 800-820-8878（限中国内地固话）

(+86)-(21)-3888 8878（适用于境外或移动电话）

非汇丰个人客户 800-830-2880（限中国内地固话）

(+86)-(21)-3888 3015（适用于境外或移动电话）

上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：汤嘉惠、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛南新区开元大道256号洛阳银行大厦

办公地址：洛阳市洛南新区开元大道256号洛阳银行大厦

法定代表人：王建甫

客服电话：96699

公司网址：<http://www.bankofluoyang.com.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

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：丰靖

电话：010-65557013

传真：010-65550827

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.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：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务热线：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：马旭

传真：010-85238680

客户服务中心电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：010-68098778

传真：010-68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

客户服务电话：95555

联系人：刘薇

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

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

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

温州银行股份有限公司

住所、办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：（0577）88990082

传真：（0577）88995217

客服电话：（0577）96699

网址：www.wzbank.cn

渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联络人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：400-888-8811

公司网址：www.cbhb.com.cn

上海农村商业银行股份有限公司

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

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999

公司网址：<http://www.srcb.com>

山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城东路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

传真：021-38670161

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636 客服电话：400-8888-111、95565

网址：www.newone.com.cn

中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：<http://www.csc108.com>

广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568430

客服电话：400-8888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-68816000

传真：021-68815009

客户服务电话：10108998、4008888788、或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

传真：021-53858549

客户服务电话：4008888001，021-962503

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：樊昊

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

联系人：杨盛芳

电话：0591-87613888

传真：0591-87546058

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133302  
客户服务电话：95536  
网址：www.guosen.com.cn

中信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层  
办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层  
法定代表人：王东明  
联系人：陈忠  
电话：010-84683893  
传真：010-84865560  
客服电话：010-84588888  
网址：www.cs.ecitic.com

中信证券（山东）有限责任公司  
法定代表人：杨宝林  
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层  
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层  
基金业务联系人：吴忠超  
电话：0532-85022326  
传真：0532-85022605  
客户服务电话：95548  
公司网址：www.citicssd.com

国元证券股份有限公司  
注册地址：合肥市寿春路 179 号  
法定代表人：凤良志  
客服电话：4008-888-777  
公司网址：www.gyzq.com.cn

中国国际金融股份有限公司  
注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层  
办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇 陈曦

客服电话：400 910 1166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

注册资本：15.1 亿元人民币

开放式基金咨询电话：4008001001

开放式基金业务传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045529

传真：010-66045500

客服电话：010-66045678

公司网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山北路 318 号 2 号楼 21-29 楼

办公地址：上海市中山北路 318 号 2 号楼 21-29 楼

法定代表人：潘鑫军

联络人：吴宇、沈燕

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地点：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：张玉静

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

上海天天基金销售有限公司

注册地点：上海浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地点：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫵旻

客户服务电话：4000766123

网址：www.fund123.cn

上海好买基金销售有限公司

注册地点：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：薛年

客户服务电话：400-700-9665

网址：ww.ehowbuy.com

浙江同花顺基金销售有限公司

注册地点：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

公司网站：www.10jqka.com.cn

客服电话：95105-885 0571-56768888

诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地点：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

联系人：姚思轶

公司网站：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

东海证券有限责任公司

注册地点：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：汪汇

公司网站：www.longone.com.cn

客服电话：400-8888-588

中泰证券股份有限公司

注册地点：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155  
传真：0531-68889518  
公司网站：www.zts.com.cn  
客服电话：95538

浙商证券股份有限公司

注册地点：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座  
法定代表人：吴承根  
联系人：许嘉行  
公司网站：www.stocke.com.cn  
客服电话：（浙江省内）967777

华鑫证券有限责任公司

注册地点：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元  
法定代表人：洪家新  
联系人：陈敏  
公司网站：www.cfsc.com.cn  
客服电话：021-32109999；029-68918888

信达证券股份有限公司

注册地点：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人：高冠江  
联系人：唐静  
公司网址：www.cindasc.com  
客服电话：400-800-8899

和讯信息科技有限公司

注册地点：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人：王莉  
联系人：周轶  
公司网站：licaike.hexun.com  
客服电话：4009-200-022

北京展恒基金销售股份有限公司

注册地点：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公区地址为：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

公司网站：www.myfund.com

客服电话：400-888-6661

华安证券股份有限公司

注册地点：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

公司网站：www.hazq.com

客服电话：400-809-6518

长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：021-68751929

联系人：李良

客户服务电话：95579

网址：www.95579.com

东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555147

客户服务电话：4008888993

网址：www.dxzq.net

申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：唐岚

电话：010-88085258

传真：010-88013605

中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层  
1301-1305室、14层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层  
1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

客服电话：400-990-8826

公司网站：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层

法定代表人：赵荣春

公司网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客服电话：400 893 6885

上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼

法定代表人：鲍东华

公司网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客服电话：4008219031

(3) H 类别基金份额香港代表

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited (汇丰投资基金(香港)有限公司)拟担任我公司在香港地区的代表,负责接收香港地区投资者/机构的申购赎回申请、协调基金销售、向香港证监会进行报备和香港基金投资人的信息披露和沟通工作。

汇丰投资基金(香港)有限公司地址:香港皇后大道中1号汇丰总行大厦22楼

电话:852-2284 1118

传真:852-3409 2667

网址:[www.assetmanagement.hsbc.com/hk](http://www.assetmanagement.hsbc.com/hk)

(4) H 类别基金份额香港销售机构

香港上海汇丰银行有限公司(“香港汇丰银行”)、恒生银行有限公司(“香港恒生银行”)拟担任我公司在香港地区的首批基金销售机构(“香港代销机构”),负责向香港投资者提供销售服务。基金销售活动应遵循中港两地监管机构的相关法规要求。

(二) 注册登记人

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

法定代表人:杨小勇

联系人:赵琳

联系电话:021-20376892

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市金杜律师事务所

地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHU A座31层

负责人:王玲

电话:010-58785588

传真:010-58785599

联系人:宋萍萍

联系电话：0755-22163307

经办律师：靳庆军、宋萍萍

#### （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：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-2323 8888

传真电话：021-2323 8800

经办注册会计师：薛竞、赵钰

联系人：赵钰

#### 四、基金的名称

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金将致力于捕捉股票、债券等市场不同阶段中的不同投资机会，无论其处于牛市或者熊市，均通过基金资产在不同市场的合理配置，追求基金资产的长期较高回报。

#### 七、基金的投资方向

投资于上市交易的股票、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。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。同时，为有效管理投资组合，基金可投资于经法律法规或中国证监会允许的各种金融衍生产品，如期权、期货、权证、资产支持证券以及其他相关的衍生工具。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例做适度调整。

## 八、基金的投资策略

### （一）资产配置策略

从全球、区域的宏观层面（经济增长、通货膨胀和利息的预期）出发，通过深入研究和分析中国国民经济的长期增长趋势、宏观政策的中短期变化趋势，产业生命周期的发展趋势、以及不同行业上市公司的赢利变化趋势，全面准确地判断各类资产的风险程度和收益前景。在控制风险的前提下，自上而下的决定投资组合中股票、债券、现金和其他资产的配置比例，包括股票资产中不同行业之间和债券资产中不同券种之间的配置方式。

资产配置决策流程如下：

### （二）类别资产配置

在类属资产配置的基础上，本基金从股票、固定收益和流动性资产三个方面进一步进行类别资产配置。

#### 股票资产

在全球经济的框架下，通过对产业运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析 and 预测，确定经济变量的变动对不同行业的潜在影响。基于各

行业的相对投资价值与投资时机基础上，挑选出具有投资价值和发展潜力的行业。

具体操作中，从产业经济周期因素、国家产业政策因素、产业竞争架构因素和全球产业链因素四个方面进行分析、评估。重点关注成长性行业、垄断性行业和国家扶持行业的投资机会。

#### 固定收益资产

通过对宏观经济增长预期、通货膨胀预期、利率走势预期和央行货币政策预期四个方面的分析和预测，确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。基于各类券种对利率、通胀的反应，确定有效地投资策略。

在此基础上，运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

#### 流动性资产

在确保高流动性的前提下，兼顾收益。动态调整现金、1年期内央行票据和1年期内国债（固息债）比例。

### （三）股票投资策略

在资产配置的基础上，本基金可以在价值/成长、不同行业 and 不同市值之间灵活选择，做到适时而变；在不同市场不同阶段，本基金可以在集中/分散之间灵活转换，做到顺势而为。同时，严格按照基本面因素，自下而上地对个股进行严格筛选，并采用上市公司评分体系和CFROI（投资现金回报率）为核心的财务分析和估值体系对上市公司的治理水平和价值创造能力进行定量筛选，最大程度地筛选出有投资价值的投资品种。

#### 1) 股票初选库

本基金的股票初选库需经过流动性指标的筛选。按照一定换手率标准或日均成交量对上市公司进行初步筛选，剔除交易极不活跃的股票。符合本基金流动性指标标准的股票进入基金股票初选库范围，动态计算个股的流动性指标，并根据个股流动性指标的变化对股票初选库加以调整。

#### 2) 综合相对、绝对估值方法的个股精选体系

本基金对初选股票给予全面的成长、价值分析，优选出价值低估，成长低估的上市公司进行投资。成长指标包括：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；价值指标包括：市净率（P/B）、每股收益、年现金流/市值、股息率等。本基金并不拘泥于单一的价值标准或成长标准，并注重对上市公司治理水平，核心竞争能力的考察，最大程度地筛选出

价值低估的上市公司。

各项指标的标准设置原则如下：

主营业务收入增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

主营业务利润增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

市盈率 (P/E)

以 1 年期银行定期存款税后收益率的倒数作为评价指标的参照物，根据市场平均市盈率 (P/E) 水平和上市公司的业绩增长情况，确定市盈率 (P/E) 的上限。

净资产收益率 (ROE)

以 1 年期银行定期存款税后收益率作为评价指标的参照物，根据 GDP 的增长速度和上市公司整体的净资产收益率情况，确定净资产收益率 (ROE) 的下限。

市净率 (P/B)

以市场平均水平作为评价指标的参照物：以计算日的市场平均水平作为市净率的指导上限。如果一个发行 A 股同时也发行 H 股或 B 股的公司，其 B 股的市值会与 A 股市值相加导出公司市值总额。

每股收益率

最近三年每股收益为正值，上市未满三年的上市公司参照其会计调整报表数据。

年现金流/市值

以市场平均水平作为评价指标的参照物：以计算日的市场平均水平作为年现金流量与市值的比率的指导上限。计算中所采用的现金流量是经营活动产生的现金流量净额。

股息率

以银行活期存款税后收益率作为评价指标的参照物：根据市场平均的股息率水平，确定股息率的下限。

3) 以 CFROI (投资现金回报率) 指标为核心的财务分析和估值体系

本基金借鉴股东汇丰投资集团的全球化投资经验，建立了以 Cash Flow Return on Investment (CFROI)，即投资现金回报率为核心指标的上市公司财务分析和

估值体系。本基金将集中分析上市公司的盈利水平和盈利的持续能力、将利润转换成现金流的能力、产生现金流所需的资本等，也就是重点分析投资现金回报率，并在此基础上对其投资价值形成判断，重点如下：

企业的价值即是其全部资产的经营所产生的未来现金流的净现值，因此对上市公司估值的重点在于预测公司未来的现金流并确定适当的贴现率；

一个赢利的公司如果没有足够的现金流量满足其流动性需求，公司仍然会有倒闭的可能，因此稳定的现金流远比会计利润更能反映公司的真实运营状况；

不同公司间会计政策的不一致导致了他们各自的会计利润不具有可比性，而给予现金流的分析可以调整对会计利润的扭曲。

现金流的基本驱动因素在于投资资本、经济回报、再投资比率、行业竞争力、公司经营和治理水平，因此以投资现金回报率(CFROI)分析为基础的上市公司估值公式如下：

此外，本基金的财务分析体系还包括：相对估值指标分析、财务约束分析、现金分红分析。根据公司的不同特征，本基金管理人还将予以其它财务指标的分析，以构建一个完善的财务分析体系。

#### 4) 公司治理评估与实地调研

通过借鉴汇丰环球投资管理关于上市公司评分体系的运用方法，本基金建立了全面的公司治理评估体系，对公司的治理水平进行全面评估；评估不合格的公司坚决予以规避。同时，本基金通过实地调研对综合评估结果做出实际验证，确保最大程度规避投资风险。

公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定公司盈利能力能否持续的重要因素。在国内上市公司较普遍存在治理结构缺陷的情况下，本基金管理人对个股的选择将尤为注重对上市公司治理结构的评估，以期为投资者挑选出具备持续盈利能力的股票。本基金管理人将主要通过以下五个方面对上市公司治理水平进行评估：

产业结构；

行业展望；

股东价值创造力；

公司战略及管理质量；  
公司治理。

#### （四）债券投资策略：

本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益：

##### 利率趋势预期

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经济运行状况，全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况，把握未来利率走势，在预期利率下降时加大债券投资久期，在预期利率上升时适度缩小久期，规避利率风险，增加投资收益。

##### 收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券期限同收益率之间的关系。投资研究部门通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券投资组合长短期品种的比例获得投资收益。

##### 收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债券）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，投资部门采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的，但是在某种情况下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或市场供求发生变化时，这种稳定关系会被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

##### 公司基本面分析

公司基本面分析是公司债(包括可转债)投资决策的重要决定因素。研究部门对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，准确评价该公司债券的信用风险程度，作出价值判断。对于可转债，通过判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系，从而取得转债购入价格优势或进行套利。

#### （五）权证投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。基

金的权证投资策略主要包括以下几个方面：

- 1) 综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。
- 2) 根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理内在价值的考量，决策买入、持有或沽出权证。
- 3) 通过权证与证券的组合投资，利用权证衍生工具的特性，来达到改善组合风险收益特征的目的。

#### （六）资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。

#### 九、基金的业绩比较基准

业绩比较基准 = 50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、法律法规或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整并及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，我们选定 MSCI 中国 A 股指数、中债新综合指数（全价）作为本基金的业绩比较基准。

本基金的股票投资比例为 30%-95%，业绩比较基准中的资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益中等的基金产品。

#### 十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年10月25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。

本基金投资组合报告的报告期为2016年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

#### 11.1 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 565,271,441.80 54.24

其中:股票 565,271,441.80 54.24

2 基金投资 --

3 固定收益投资 81,079,000.00 7.78

其中:债券 81,079,000.00 7.78

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 190,000,000.00 18.23

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 200,042,915.79 19.20

8 其他资产 5,694,353.82 0.55

9 合计 1,042,087,711.41 100.00

#### 11.2 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 38,657,102.47 3.79

B 采矿业 27,113,384.65 2.66

C 制造业 330,174,719.67 32.39

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 12,988,816.00 1.27

E 建筑业 24,510.48 0.00

F 批发和零售业 35,268,703.49 3.46

G 交通运输、仓储和邮政业 8,689,584.00 0.85

H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	55,452,295.86 5.44
J 金融业	46,613,733.18 4.57
K 房地产业	10,288,592.00 1.01
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	--
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	565,271,441.80 55.45

#### 11.3 报告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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	300017	网宿科技	541,104	37,769,059.20	3.70
2	600584	长电科技	1,820,624	35,338,311.84	3.47
3	600655	豫园商城	3,223,802	35,236,155.86	3.46
4	002422	科伦药业	1,819,018	29,559,042.50	2.90
5	002299	圣农发展	1,138,649	28,500,384.47	2.80
6	000651	格力电器	1,267,600	28,166,072.00	2.76
7	000703	恒逸石化	2,318,381	27,843,755.81	2.73
8	002701	奥瑞金	2,543,900	25,489,878.00	2.50
9	002475	立讯精密	1,075,741	21,751,483.02	2.13
10	601377	兴业证券	2,765,800	20,909,448.00	2.05

#### 11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	国家债券	--
---	------	----

2	央行票据	--
3	金融债券	81,079,000.00 7.95
	其中：政策性金融债	81,079,000.00 7.95
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）	--
8	同业存单	--
9	其他	--
10	合计	81,079,000.00 7.95

11.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	140225	14 国开 25	300,000	30,555,000.00	3.00
2	150302	15 进出 02	300,000	30,132,000.00	2.96
3	140220	14 国开 20	200,000	20,392,000.00	2.00

11.6 报告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。

11.7 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。

11.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11.9.1 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。

#### 11. 9.2 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。

#### 11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 11.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 11.10.2 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。

##### 11.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11.11 投资组合报告附注

##### 11.11.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除四川科伦药业股份有限公司（002422）、兴业证券股份有限公司（601377）外，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。

根据四川科伦药业股份有限公司（以下简称“科伦药业”）于2016年2月23日发布的《科伦药业关于安岳分公司银杏叶片事项的进展公告》，根据国家食品药品监督管理总局的有关要求，四川科伦药业股份有限公司安岳分公司（以下简称“安岳公司”）对旗下产品采取了自查，由于部分产品不合格，安岳公司于2015年5月29日在指定信息披露媒体发布了《关于召回银杏叶片的公告》（公告编号：2015-035号），并在国家食品药品监督管理总局规定期限内完成了不合格产品的召回工作。2016年2月19日，安岳公司收到四川省食品药品监督管理局《行政处罚决定书》（（川）食药监药罚（2016）4号），没收违法所得202,714.80元，并处以货值金额（208,658.00元）两倍的罚款共计人民币417,316.00元。根据科伦药业在公告所述，安岳公司银杏叶片销售收入预计占2015年度的公司营业收入和营业毛利的比重很小，且上述罚没款占公司的营业收入和净利润的比例很小，因此，该品种以及安岳公司本次罚没金额不会对公司的生产经营及年度财务状况产生较大影响。

根据兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）于2016年6月13日公布的《兴业证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会〈调查通知书〉的公告》，兴业证券于2016年6月12日收到中国证券监督管理委员会（以下简称

“中国证监会”）调查通知书(沈稽查调查通字 16005 号)，因兴业证券涉嫌未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。根据兴业证券于 2016 年 7 月 9 日公布的《兴业证券关于收到行政处罚及市场禁入事先告知书的公告》以及于 2016 年 7 月 28 日公布的《兴业证券股份有限公司关于收到行政处罚决定书的公告》，兴业证券及丹东欣泰电气股份有限公司 IPO 申请文件和公开发行募集文件签字保荐代表人兰翔、伍文祥于 2016 年 7 月 8 日和 2016 年 7 月 27 日收到中国证监会《行政处罚及市场禁入事先告知书》（处罚字〔2016〕70 号）和《行政处罚决定书》（〔2016〕91 号），中国证监会决定对兴业证券给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款；对兰翔、伍文祥给予警告，并分别处以 30 万元罚款，撤销证券从业资格。本基金管理人认为，上述事宜对兴业证券整体保荐业务和其他业务影响较小，且上述罚没款占兴业证券总收入和总利润比重较小，不会对本基金投资决策产生重大影响。

本基金管理人会紧密跟踪并及时采取相应投资决策，截至目前，本基金对科伦药业和兴业证券的投资决策流程符合本公司规定。

11.11.2 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。

#### 11.11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	993,315.64
2	应收证券清算款	2,381,639.57
3	应收股利	-
4	应收利息	2,270,945.83
5	应收申购款	48,452.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,694,353.82

#### 11.11.4 报告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。

### 11.11.5 报告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不存在流通受限情况。

### 11.11.6 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。

## 十二、基金的业绩

本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。

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

#### 1. 汇丰晋信动态策略混合 A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2007/4/9-2007/12/31 48.45% 1.74% 38.04% 1.13% 10.41% 0.61%

2008/1/1-2008/12/31 -47.81% 1.81% -27.29% 1.50% -20.52% 0.31%

2009/1/1-2009/12/31 62.55% 1.43% 48.64% 1.01% 13.91% 0.42%

2010/1/1-2010/12/31 12.54% 1.38% -2.79% 0.79% 15.33% 0.59%

2011/1/1-2011/12/31 -25.05% 1.15% -11.25% 0.67% -13.80% 0.48%

2012/1/1-2012/12/31 -3.38% 1.16% 6.30% 0.65% -9.68% 0.51%

2013/1/1-2013/12/31 15.44% 1.57% -0.05% 0.69% 15.49% 0.88%

2014/1/1-2014/12/31 58.96% 1.52% 28.27% 0.59% 30.69% 0.93%

2015/1/1-2015/12/31 38.46% 2.58% 8.22% 1.24% 30.24% 1.34%

2016/1/1-2016/9/30 -8.36% 1.60% -6.55% 0.86% -1.81% 0.74%

#### 2. 汇丰晋信动态策略混合 H

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2016/6/28 (H类基金份额成立) -2016/9/30 1.74% 0.61% 2.97% 0.41% -1.23%  
0.20%

## （二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

### 1. 汇丰晋信动态策略混合 A

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 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2007 年 10 月 9 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 基金合同生效日（2007 年 4 月 9 日）至 2014 年 5 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×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）。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。

### 2. 汇丰晋信动态策略混合 H

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 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

2. 基金合同生效日（2007 年 4 月 9 日）至 2014 年 5 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×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）。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。

### 3. 本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额

## 十三、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）基金的证券交易费用；
- （4）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；

- (6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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、公休假等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 本条第(一)款第(3)至第(7)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### (三) 不列入基金费用的项目

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财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### (四) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基

金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

#### （五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

#### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照中国、香港及投资人所在国家法律法规的规定履行纳税义务。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）更新了“三、基金管理人”之“（二）主要人员情况”部分，更新了董事会成员、监事会成员的相关信息。

（二）对“四、基金托管人”的“一、基金托管人基本情况”进行了更新。

（三）更新了“五、相关服务机构”之“（一）基金份额发售机构”的有关信息。

（四）在“十三、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的内容（报告期：2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日）。

（五）更新了“十四、基金的业绩”部分的内容（自基金合同生效日起至 2016 年 9 月 30 日）。

（六）更新了“二十六、其他应披露事项”部分的内容（自 2016 年 4 月 10 日至 2016 年 10 月 9 日以来涉及本基金的相关公告）。

（七）更新增加了互认基金份额“汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金 H 类份额”的相关内容。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一六年十一月二十三日