汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 27 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 2019 年 3 月 26 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 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信低碳先锋股票
基金主代码	540008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年06月08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	218,028,668.55份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，通过积极把握资本利得机会以拓展收益空间，以寻求资本的长期增值。
投资策略	（1）资产配置策略 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。 （2）行业配置策略 本基金所投资对象主要定位受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，这些上市公司会包含很多一般意义的行业。本基金在行业选择上综合考虑多方面的因素，择优而选。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，对受益于低碳经济领域、行业基本面因素已出现积极变化、景气程度增加，但股票市场反应滞后的行业进行重点配置。同时，本基金将根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会，实现"资本增值"目标。 （3）股票资产投资策略 本基金根据上市公司的基本面情况，首先对股票

	进行初步筛选，将基本面较差、投资价值较低的上市公司剔出基础股票池。在此基础上，按照本基金对于低碳经济概念的识别，我们将依靠研究团队，主要采取自下而上的选股策略，对基础股票池进行二次筛选，筛选出与低碳经济主题相关的上市公司。 根据上市公司与低碳经济主题之间的关系，本基金将低碳经济主题的上市公司细分为两类：1）直接从事或受益于低碳经济主题的上市公司；2）与低碳经济主题密切相关的上市公司。
业绩比较基准	中证环保指数*90%+同业存款利率（税后）*10%
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	陆志俊
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	luzj@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：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼 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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-103,638,845.07	-25,023,368.02	-152,877,633.72
本期利润	-123,124,306.13	-10,016,432.96	-258,461,483.17
加权平均基金份额本期利润	-0.5892	-0.0363	-0.5586
本期基金份额净值增长率	-39.11%	-3.87%	-23.92%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0788	0.4658	0.5461
期末基金资产净值	200,837,614.63	303,497,257.51	466,289,798.15
期末基金份额净值	0.9212	1.5128	1.5737

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	-13.09%	2.28%	-8.98%	1.64%	-4.11%	0.64%
过去六个月	-27.85%	2.10%	-18.18%	1.35%	-9.67%	0.75%

过去一年	-39.11%	2.03%	-35.02%	1.26%	-4.09%	0.77%
过去三年	-55.47%	1.84%	-44.77%	1.33%	-10.70%	0.51%
过去五年	-22.76%	2.07%	-9.37%	1.63%	-13.39%	0.44%
自基金合同生效起至今	0.43%	1.86%	-20.00%	1.48%	20.43%	0.38%

注：

过去三个月指2018年10月1日-2018年12月31日

过去六个月指2018年7月1日-2018年12月31日

过去一年指2018年1月1日－2018年12月31日

过去三年指2016年1月1日－2018年12月31日

过去五年指2014年1月1日－2018年12月31日

自基金合同生效起至今指2010年6月8日－2018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

注：

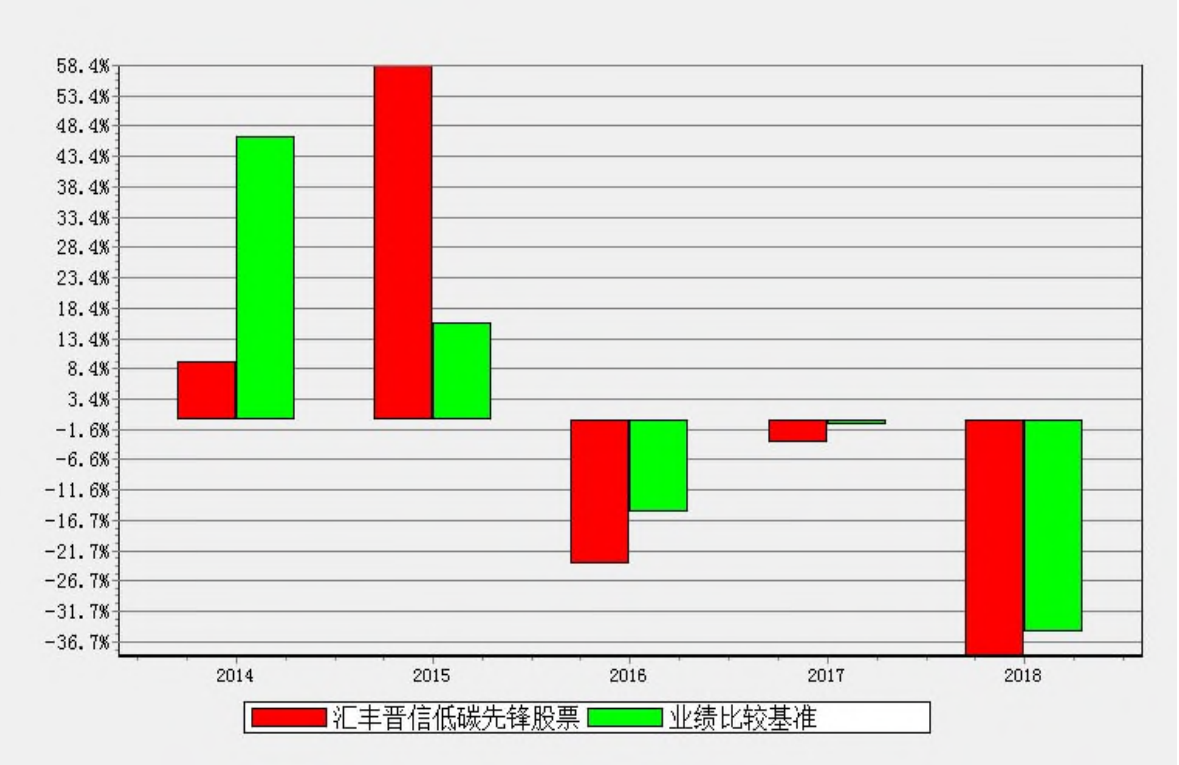
1.按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%。固定收益类证券、现金和其他资产投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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2010年12月8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（2010年6月8日）起至2015年3月31日，本基金的业绩比较基准为"沪深300指数*90% + 同业存款利率*10%"。自2015年4月1日起，本基金的业绩比较基准调整为"中证环保指数*90% + 同业存款利率（税后）*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沪深300指数与中证环保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，本基金过去三年未进行利润分配。

§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2018年12月31日，公司共管理19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）、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）和汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018年11月14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		
方超	本基金基金经理	2015-09-19	-	11.5	曾任汇丰晋信基金管理有限公司交易员、高级交易员、交易副总监、研究员、高级研究员。现任汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期为本基金管理人公告方超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

2018年的A股市场呈下行走势，上证指数出现了24.59%的跌幅，深成指数的跌幅为34%，沪深300指数的跌幅也超过了25%，中小板和创业板综合指数的跌幅则分别达到了37.75%和31%，在此背景下，大小盘个股指数的区别并不十分明显。在两市主要指数均大幅下挫的局面下，中信29个行业分类指数均下跌，其中综合、电子元器件和有色金属三个行业指数的跌幅超过了40%，传媒、机械和基础化工等十一个行业指数的跌幅在30%以上，餐饮旅游和银行板块表现出了一定的相对抗跌性，跌幅在10%左右，另外石油石化和食品饮料板块的跌幅也维持在20%左右。

从年度的维度上来看，2018年市场高开低走，总体呈现下行的走势，一月份随着大金融和地产板块推动市场快速上行，上证指数在1月29日创出了年内高点3587点，之后便在中美贸易摩擦、金融去杠杆、出现股权质押风险和上市公司业绩不断下滑等的交替作用下不断下行。投资者情绪也由年初的亢奋到年中的谨慎并逐渐过渡到年末的相对低迷。市场行情直至年底随着中央民企座谈会的召开以及中央政府一系列减税措施的发布，才逐渐出现缓和。

本基金在2018年的操作中坚持了基金合同规定，依旧集中投资于新能源、新能源汽车和节能环保领域并维持了高仓位投资的操作方式，但由于对市场所出现的调整幅度以及时间跨度的判断不足，基金净值出现了较大幅度的回撤，同时组合的成长股特性和中小创个股居多的构成特点也使得基金净值的波动较大，我们会在今后的工作中对此加强关注。但低碳领域重点行业无论是成长空间抑或是发展速度，均是当前经济中少有的亮点和新动能所在，随着在2018年行业的估值泡沫已经得到了充分的释放，行业的盈利成长特性有望在未来不断显现并得到投资者的认可，本基金还将继续在本领域内挖掘估值成长比值匹配的个股进行投资并获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-39.11%，同期业绩比较基准变动幅度为-35.02%，本基金落后业绩比较基准4.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年我国宏观经济，2018年12月19日至21日召开的中央经济工作会议强调，在充分肯定成绩的同时，要看到经济运行 ″稳中有变，变中有忧″。近十五个季度经济增速均维持在6.5%-7%的区间的状态奠定了我国经济仍在稳定增长的基调，但同时中美之间的贸易摩擦以及世界经济增长相对乏力等外部形势的变化也将给我国经济增长的前景带来一些挑战，另外人口老龄化到来对经济增长所带来的中长期隐忧也在逐渐显现。政府也对上述挑战做出了预防措施：财政政策的及时发力和货币政策的适度宽松、精准滴灌都在不断地给经济增长保驾护航，去杠杆监管政策和方法的微调也在不断稳定金融市场的流动性，更重要的是一系列降费减税和结构性改革的政策所哺育激发出来的经济增长新动能正在不断形成，并有望引领经济换档增长，而这才是长期改革的方向和投资者的信心所在。

回到证券市场，在经历了2018年的下跌之后，2019年的市场应该有望迎来一波复苏性反弹。去年的市场调整以及当前货币政策宽松所带来的利率维持低位使得市场估值水平的下跌空间有限，无论是从不同国家间横向比较还是从自身不同历史时期上纵向比较，目前A股的估值水平均处在较低的位置上，回归均值预计将是大趋势，经济的企稳态势也会使得全市场的企业盈利大致处于稳定状态，不同的只是行业之间和企业之间的波动，所以估值和企业盈利都处在一个对指数上涨相对有利的状态。除此之外，随着科创板的逐步落实，我国证券市场的职能将进一步与经济发展转型紧密联系，而且过去几年监管层的一系列监管政策也对证券市场的一些问题进行了清理，一个回归投资本源的资本市场有望成为投资者以及众多长期资金的配置首选，股市作为资产长期配置的比重毫无疑问将上升。

低碳领域的新能源、新能源汽车和节能环保行业在过去五年间经历了其他行业需要几十年甚至更久才能走完的完整生命周期历程，之所以从成长到衰落的过程如此之快，严重依靠补贴的商业模式是根本原因。新兴产业发展初期的政策扶持给了企业更多的生存空间和发展动力，但过去依靠补贴的经营理念也会使企业缺乏长期发展的竞争力，同时也会受到政府支出规划方向改变的影响，相信在经历了这轮经济周期的波动之后，随着新能源平价上网、个人消费成为新能源汽车消费的主体以及PPP立法等中长期体系和发展方向的确立，低碳行业毫无疑问将迎来发展的新阶段，相关龙头公司的价值也将必然会得到市场的重新认识。

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。

4.7 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。

4.8 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

2018年度，基金托管人在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2018年度，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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(2019)第22154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	汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(以下简称"汇丰晋信低碳先锋基金")的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018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低碳先锋基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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低碳先锋基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	汇丰晋信低碳先锋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，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低碳先锋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低碳先锋基金、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低碳先锋基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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，就可能导致对汇丰晋信低碳先锋基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存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低碳先锋基金不能持续经营。（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	2019-03-26	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	16,502,935.23	18,725,540.46
结算备付金		612,917.55	2,168,150.35

存出保证金		106,304.87	248,015.85
交易性金融资产	7.4.7.2	184,510,583.52	284,279,340.09
其中：股票投资		184,510,583.52	282,658,240.09
基金投资		-	-
债券投资		-	1,621,100.00
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	3,519.64	4,834.50
应收股利		-	-
应收申购款		466,294.90	596,870.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		202,202,555.71	306,022,751.42
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
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		330,762.42	784,558.49
应付管理人报酬		269,131.11	387,761.19
应付托管费		44,855.20	64,626.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	357,907.99	985,598.31
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	362,284.36	302,949.06
负债合计		1,364,941.08	2,525,493.91
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	218,028,668.55	200,617,440.66
未分配利润	7.4.7.10	-17,191,053.92	102,879,816.85
所有者权益合计		200,837,614.63	303,497,257.51
负债和所有者权益总计		202,202,555.71	306,022,751.42

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额218,028,668.55份，基金份额净值0.9212元。

7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		-115,108,465.38	6,098,202.60
1.利息收入		133,892.84	470,511.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	133,637.99	454,697.72
债券利息收入		254.85	142.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	15,671.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填		-95,954,731.20	-9,955,260.96

列）			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-97,370,606.52	-12,264,757.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	95,475.74	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,320,399.58	2,309,496.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-19,485,461.06	15,006,935.06
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	197,834.04	576,016.75
减：二、费用		8,015,840.75	16,114,635.56
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	3,815,521.00	6,628,526.22
2．托管费	7.4.10.2.2	635,920.20	1,104,754.29
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	3,185,638.64	7,961,800.05
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		0.91	-
7．其他费用	7.4.7.2	378,760.00	419,555.00

	0		
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-123,124,306.13	-10,016,432.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-123,124,306.13	-10,016,432.96

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	200,617,440.66	102,879,816.85	303,497,257.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-123,124,306.13	-123,124,306.13
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)	17,411,227.89	3,053,435.36	20,464,663.25
其中：1.基金申购款	112,595,432.17	25,226,251.03	137,821,683.20
2.基金赎回款	-95,184,204.28	-22,172,815.67	-117,357,019.95
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）	218,028,668.55	-17,191,053.92	200,837,614.63
项 目	上年度可比期间 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)	296,310,571.66	169,979,226.49	466,289,798.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,016,432.96	-10,016,432.96
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)	-95,693,131.00	-57,082,976.68	-152,776,107.68
其中：1.基金申购款	185,350,966.08	120,051,562.75	305,402,528.83
2.基金赎回款	-281,044,097.08	-177,134,539.43	-458,178,636.51
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）	200,617,440.66	102,879,816.85	303,497,257.51

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

汇丰晋信低碳先锋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[2010]471号《关于核准汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《汇丰晋信低碳先锋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，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666,375,731.65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(2010)CR No.0032验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月8日正式

生效，基金合同生效日的基金份额总额为666,460,299.86份基金份额，其中认购资金利息折合84,568.21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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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。本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的85%-95%(其中不低于80%的股票资产投资于受益于低碳经济领域的上市公司)，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、现金和其他资产投资比例范围为基金资产的5%-15%，其中现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金主要投资于受益于低碳经济领域的上市公司，80％以上的股票资产属于上述投资方向所确定的内容。自2010年6月8日(基金合同生效日)起至2015年3月31日，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×90%+同业存款利率(税后)×10%。根据《关于汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金变更业绩比较基准以及修改基金合同的公告》，自2015年4月1日起，本基金的业绩比较基准调整为：中证环保指数×90%+同业存款利率(税后)×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2019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》、《汇丰晋信低碳先锋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2018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2018年12月31日的财务状况以及2018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[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
交通银行股份有限公司(″交通银行″)	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过股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在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过权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金在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过债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在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过债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,815,521.00	6,628,526.22
其中：支付销售机构的客户维护费	1,789,078.42	2,246,753.87

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 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	635,920.20	1,104,754.29

注：支付基金托管人交通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报告期末与上年度末均未持有本基金。

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 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	16,502,935.23	115,812.88	18,725,540.46	42,044.46

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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（2018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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2018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184,510,583.52元，无属于第二或第三层次的余额 (2017年12月31日：第一层次270,755,740.09元，第二层次13,523,600.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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)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和债券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，确定相关股票和债券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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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(2017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)除公允价值外，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	184,510,583.52	91.25
	其中：股票	184,510,583.52	91.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	17,115,852.78	8.46
8	其他各项资产	576,119.41	0.28
9	合计	202,202,555.71	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	-	-
C	制造业	158,727,583.52	79.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	12,928,000.00	6.44
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	12,855,000.00	6.40
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	184,510,583.52	91.87

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300073	当升科技	580,000	16,060,200.00	8.00
2	300618	寒锐钴业	200,000	14,816,000.00	7.38
3	002466	天齐锂业	400,000	11,728,000.00	5.84
4	300568	星源材质	500,000	11,095,000.00	5.52
5	603799	华友钴业	350,000	10,538,500.00	5.25
6	300207	欣旺达	1,200,000	10,308,000.00	5.13
7	300409	道氏技术	750,000	9,832,500.00	4.90
8	300037	新宙邦	400,000	9,620,000.00	4.79
9	300014	亿纬锂能	550,088	8,647,383.36	4.31
10	002439	启明星辰	400,000	8,224,000.00	4.09

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	603799	华友钴业	30,504,887.20	10.05
2	300618	寒锐钴业	26,763,062.91	8.82
3	300409	道氏技术	22,469,735.93	7.40
4	300568	星源材质	21,228,096.24	6.99
5	601877	正泰电器	19,826,021.45	6.53
6	603260	合盛硅业	19,683,134.82	6.49
7	300699	光威复材	19,103,237.49	6.29
8	603986	兆易创新	17,126,409.71	5.64
9	300236	上海新阳	16,539,740.10	5.45
10	300037	新宙邦	15,722,183.09	5.18
11	002025	航天电器	15,708,589.64	5.18
12	603026	石大胜华	14,709,850.94	4.85
13	300036	超图软件	14,287,019.94	4.71
14	000066	中国长城	14,086,244.13	4.64
15	002439	启明星辰	13,469,105.24	4.44
16	002632	道明光学	13,121,862.85	4.32
17	600549	厦门钨业	13,017,435.10	4.29
18	002497	雅化集团	12,885,318.62	4.25
19	002179	中航光电	12,723,239.78	4.19
20	300070	碧水源	12,622,181.67	4.16
21	600547	山东黄金	12,213,769.04	4.02
22	600884	杉杉股份	12,042,850.96	3.97
23	000426	兴业矿业	11,512,029.88	3.79
24	000951	中国重汽	11,482,506.03	3.78
25	300212	易华录	11,364,589.45	3.74
26	002372	伟星新材	11,251,504.28	3.71

27	300136	信维通信	11,118,279.28	3.66
28	601899	紫金矿业	10,903,721.60	3.59
29	300197	铁汉生态	10,740,330.00	3.54
30	300207	欣旺达	10,703,335.56	3.53
31	600686	金龙汽车	10,646,050.20	3.51
32	600570	恒生电子	10,518,081.00	3.47
33	002407	多氟多	10,305,834.16	3.40
34	603659	璞泰来	10,201,387.00	3.36
35	601012	隆基股份	10,141,035.83	3.34
36	300014	亿纬锂能	10,126,728.88	3.34
37	600116	三峡水利	10,034,516.94	3.31
38	000681	视觉中国	9,915,660.00	3.27
39	603019	中科曙光	9,682,347.00	3.19
40	600398	海澜之家	9,635,234.94	3.17
41	000977	浪潮信息	9,417,569.76	3.10
42	600438	通威股份	9,115,889.46	3.00
43	603993	洛阳钼业	8,917,843.00	2.94
44	002035	华帝股份	8,876,964.00	2.92
45	002741	光华科技	8,868,842.25	2.92
46	600580	卧龙电气	8,808,889.00	2.90
47	002368	太极股份	8,672,384.64	2.86
48	002192	融捷股份	8,631,541.00	2.84
49	002544	杰赛科技	8,560,065.96	2.82
50	002018	*ST华信	8,525,438.81	2.81
51	600489	中金黄金	8,456,270.97	2.79
52	600028	中国石化	8,367,545.50	2.76
53	600588	用友网络	8,324,506.77	2.74
54	600362	江西铜业	8,217,996.00	2.71
55	002024	苏宁易购	8,135,271.81	2.68
56	600418	江淮汽车	8,087,812.44	2.66
57	002056	横店东磁	8,007,415.39	2.64

58	002518	科士达	7,918,170.09	2.61
59	600487	亨通光电	7,917,176.40	2.61
60	300222	科大智能	7,825,145.99	2.58
61	300339	润和软件	7,817,952.03	2.58
62	600330	天通股份	7,799,136.00	2.57
63	002460	赣锋锂业	7,789,576.42	2.57
64	300133	华策影视	7,756,127.64	2.56
65	000625	长安汽车	7,696,157.00	2.54
66	300355	蒙草生态	7,619,631.00	2.51
67	002594	比亚迪	7,563,697.85	2.49
68	000021	深科技	7,552,373.36	2.49
69	002250	联化科技	7,495,695.56	2.47
70	000938	紫光股份	7,490,087.00	2.47
71	002251	步 步 高	7,473,950.82	2.46
72	002366	台海核电	7,369,134.00	2.43
73	002384	东山精密	7,367,096.55	2.43
74	300438	鹏辉能源	7,257,557.60	2.39
75	002028	思源电气	7,158,262.54	2.36
76	300244	迪安诊断	7,121,144.00	2.35
77	002129	中环股份	6,941,309.00	2.29
78	002466	天齐锂业	6,890,282.00	2.27
79	600875	东方电气	6,873,672.00	2.26
80	000970	中科三环	6,834,735.99	2.25
81	002230	科大讯飞	6,813,740.98	2.25
82	002249	大洋电机	6,809,196.00	2.24
83	600602	云赛智联	6,725,360.58	2.22
84	300310	宜通世纪	6,627,967.50	2.18
85	002475	立讯精密	6,569,204.00	2.16
86	300383	光环新网	6,509,436.00	2.14
87	002281	光迅科技	6,323,008.44	2.08
88	002402	和而泰	6,313,948.00	2.08

89	300188	美亚柏科	6,136,483.20	2.02
90	300373	扬杰科技	6,124,322.00	2.02
91	300166	东方国信	6,106,507.17	2.01

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	603799	华友钴业	31,053,139.64	10.23
2	300197	铁汉生态	27,010,310.46	8.90
3	002497	雅化集团	23,806,388.65	7.84
4	002460	赣锋锂业	22,217,431.00	7.32
5	300438	鹏辉能源	21,989,347.00	7.25
6	600884	杉杉股份	21,469,542.00	7.07
7	603993	洛阳钼业	19,206,055.00	6.33
8	601877	正泰电器	19,039,282.06	6.27
9	002192	融捷股份	17,475,353.60	5.76
10	002407	多氟多	16,970,148.00	5.59
11	603260	合盛硅业	16,844,978.81	5.55
12	300699	光威复材	16,457,885.22	5.42
13	000408	藏格控股	16,091,971.81	5.30
14	002025	航天电器	15,848,317.66	5.22
15	603986	兆易创新	15,135,716.69	4.99
16	000792	盐湖股份	15,130,600.00	4.99
17	600406	国电南瑞	14,781,666.63	4.87
18	300236	上海新阳	14,292,983.00	4.71
19	300014	亿纬锂能	14,204,646.60	4.68
20	300036	超图软件	13,675,417.00	4.51
21	000066	中国长城	13,259,451.47	4.37
22	603026	石大胜华	12,704,150.00	4.19

23	002372	伟星新材	12,630,707.68	4.16
24	601012	隆基股份	12,246,375.00	4.04
25	002179	中航光电	12,179,849.07	4.01
26	002709	天赐材料	12,128,183.41	4.00
27	002632	道明光学	11,634,729.80	3.83
28	600686	金龙汽车	11,528,584.90	3.80
29	600438	通威股份	11,457,634.50	3.78
30	002366	台海核电	11,391,626.00	3.75
31	600398	海澜之家	11,377,484.11	3.75
32	600549	厦门钨业	11,368,482.29	3.75
33	000951	中国重汽	10,518,410.00	3.47
34	600547	山东黄金	10,312,539.22	3.40
35	300070	碧水源	9,826,901.48	3.24
36	601899	紫金矿业	9,737,240.33	3.21
37	600522	中天科技	9,697,901.62	3.20
38	300136	信维通信	9,606,359.87	3.17
39	000681	视觉中国	9,511,307.87	3.13
40	000426	兴业矿业	9,318,257.00	3.07
41	600116	三峡水利	9,238,506.00	3.04
42	300212	易华录	9,188,027.80	3.03
43	000980	众泰汽车	9,178,416.29	3.02
44	600570	恒生电子	9,114,002.51	3.00
45	603659	璞泰来	8,747,471.74	2.88
46	002594	比亚迪	8,587,071.22	2.83
47	002544	杰赛科技	8,448,567.47	2.78
48	300409	道氏技术	8,369,199.09	2.76
49	600487	亨通光电	8,293,417.88	2.73
50	600489	中金黄金	8,223,277.00	2.71
51	603019	中科曙光	8,204,485.00	2.70
52	002024	苏宁易购	7,875,604.00	2.59
53	000021	深科技	7,761,363.98	2.56

54	002741	光华科技	7,736,460.57	2.55
55	002056	横店东磁	7,733,114.20	2.55
56	300133	华策影视	7,660,095.00	2.52
57	600028	中国石化	7,633,860.00	2.52
58	002035	华帝股份	7,576,520.00	2.50
59	600580	卧龙电气	7,504,295.78	2.47
60	002368	太极股份	7,377,827.28	2.43
61	600588	用友网络	7,334,406.17	2.42
62	300568	星源材质	7,305,289.76	2.41
63	600362	江西铜业	7,295,646.00	2.40
64	002251	步 步 高	7,246,218.00	2.39
65	000977	浪潮信息	7,191,726.94	2.37
66	600330	天通股份	7,175,547.00	2.36
67	300317	珈伟新能	7,162,487.45	2.36
68	300222	科大智能	6,991,380.00	2.30
69	002250	联化科技	6,822,614.00	2.25
70	300339	润和软件	6,799,119.99	2.24
71	002018	*ST华信	6,732,992.00	2.22
72	002281	光迅科技	6,686,464.20	2.20
73	002475	立讯精密	6,602,348.51	2.18
74	000938	紫光股份	6,479,615.60	2.13
75	300316	晶盛机电	6,409,270.35	2.11
76	600602	云赛智联	6,364,365.46	2.10
77	002028	思源电气	6,352,935.60	2.09
78	300244	迪安诊断	6,234,640.00	2.05
79	002249	大洋电机	6,159,646.00	2.03
80	002384	东山精密	6,078,222.00	2.00

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	1,061,219,738.42
卖出股票收入（成交）总额	1,042,511,327.41

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序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	106,304.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,519.64
5	应收申购款	466,294.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	576,119.41

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

19,892	10,960.62	734,126.54	0.34%	217,294,542.01	99.66%

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	7,832.13	0.0036%

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年06月08日)基金份额总额	666,460,299.86
本报告期期初基金份额总额	200,617,440.66
本报告期基金总申购份额	112,595,432.17
减：本报告期基金总赎回份额	95,184,204.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	218,028,668.55

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

2018年9月1日，基金管理人发布公告，曹庆先生不再担任公司副总经理。

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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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2018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

本报告期内，中国证监会上海监管局因基金管理人某份宣传推介材料问题对相关高级管理人员采取了监管谈话措施，相关高级管理人员已积极进行整改。除此之外，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	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	166,465,534.53	7.92%	155,028.59	7.92%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	50,356,965.10	2.40%	46,896.81	2.40%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	200,168,034.80	9.53%	186,417.30	9.53%	-
银河证券	2	51,785,826.67	2.46%	48,227.88	2.46%	-
兴业证券	1	72,004,056.33	3.43%	67,057.72	3.43%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	19,809,944.65	0.94%	18,448.91	0.94%	-
川财证券	1	207,552,125.93	9.88%	193,294.04	9.88%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	22,364,463.90	1.06%	20,828.26	1.06%	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	113,951,796.41	5.42%	106,124.00	5.42%	-
汇丰前海	2	49,812,452.21	2.37%	46,390.33	2.37%	-
太平洋证券	2	121,684,054.99	5.79%	113,323.59	5.79%	-
招商证券	2	31,083,531.24	1.48%	28,948.02	1.48%	-
国盛证券	2	121,002,618.36	5.76%	112,689.92	5.76%	-
国泰君安	2	273,489,845.53	13.02%	254,701.18	13.02%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	14,616,847.20	0.70%	13,612.15	0.70%	-
东方财富	2	96,807,247.35	4.61%	90,156.82	4.61%	-
安信证券	2	42,600,399.37	2.03%	39,673.68	2.03%	-
中泰证券	2	96,682,694.77	4.60%	90,040.84	4.60%	-
中信建投	2	80,909,726.08	3.85%	75,351.26	3.85%	-
中信证券	2	108,990,008.99	5.19%	101,502.92	5.19%	-
广发证券	3	158,867,785.99	7.56%	147,953.85	7.56%	-

1、报告期内增加的交易单元:汇丰前海， 西部证券，广发证券，国联证券，国盛证券，国泰君安，太平洋证券，西藏东方财富证券，长江证券，中金公司。报告期内减少的交易单元：中投证券，申万宏源

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	1,716,981.18	100.00%	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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

二〇一九年三月二十七日