

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 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：2016 年 3 月 29 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 2016 年 3 月 28 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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信低碳先锋股票
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6月8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	590,811,196.04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	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>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>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。</p> <p>(3) 股票资产投资策略</p> <p>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除基础股票池。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。</p> <p>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。</p>
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	汤嵩彦
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告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 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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	434,864,622.37	75,017,651.50	220,172,553.34
本期利润	519,114,571.84	74,022,993.20	174,845,808.66
加权平均基金份额本期利润	0.9058	0.1016	0.1986
本期基金份额净值增长率	58.35%	9.52%	41.42%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.8174	0.1777	0.0153
期末基金资产净值	1,222,119,735.55	636,709,396.50	1,344,307,897.47
期末基金份额净值	2.0685	1.3063	1.1927

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	31.13%	2.13%	20.76%	1.80%	10.37%	0.33%
过去六个月	-0.62%	3.51%	-10.68%	2.89%	10.06%	0.62%
过去一年	58.35%	3.04%	15.91%	2.60%	42.44%	0.44%
过去三年	145.26%	2.26%	58.45%	1.78%	86.81%	0.48%
过去五年	85.02%	1.92%	29.91%	1.56%	55.11%	0.36%
自基金合同 生效起至今	125.51%	1.87%	49.14%	1.55%	76.37%	0.32%

注：过去三个月指 2015 年 10 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

过去六个月指 2015 年 7 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

过去一年指 2015 年 1 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

过去三年指 2013 年 1 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

过去五年指 2011 年 1 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

自基金合同生效至今指 2010 年 6 月 8 日—2015 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

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 6 月 8 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票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%。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。

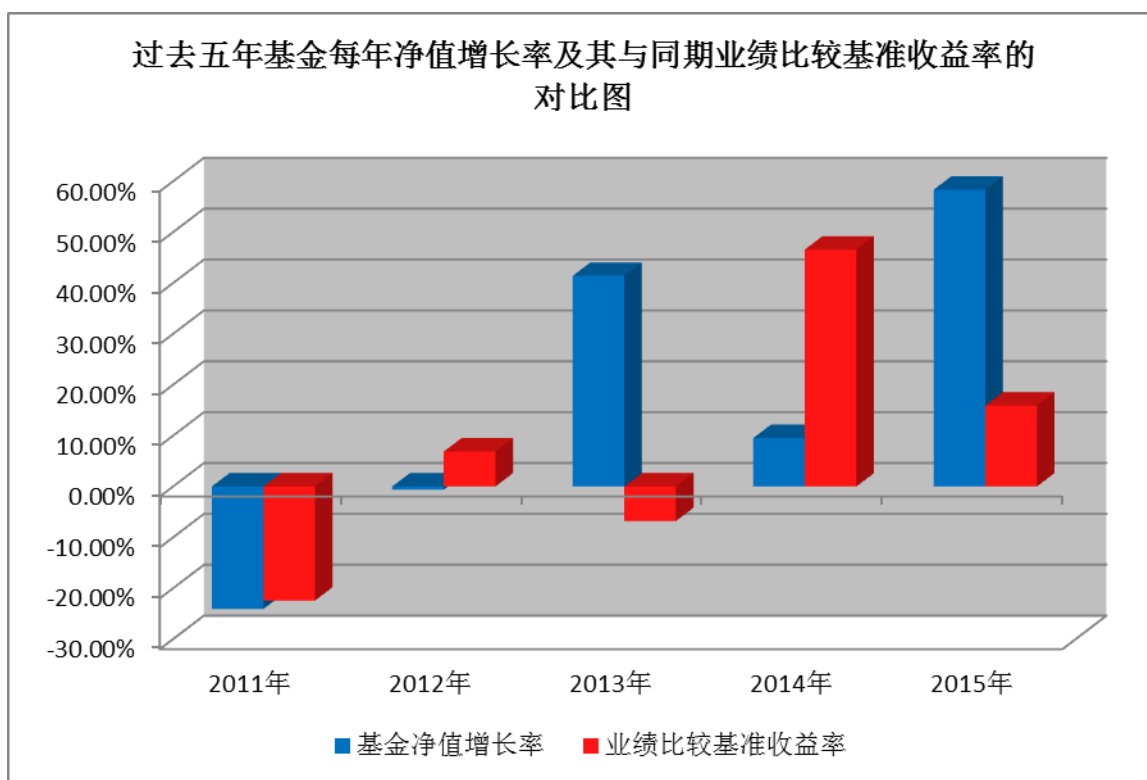
2. 基金合同生效日（2010 年 6 月 8 日）起至 2015 年 3 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数*90% + 同业存款利率*10%”。自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“中证环保指数*90% + 同业存款利率（税后）*10%”。

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

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2013年	-	-	-	-	
2014年	-	-	-	-	
2015年	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：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 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 2015 年 12 月 31 日，公司共管理 15 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）和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）。

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		
曹庆	投资部总监、本基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金基金经	2013 年 12 月 21 日	-	13	曹庆先生，伦敦政治经济学院硕士。曾任东方基金管理有限公司研究员、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、研究副总监、研究总监。现任汇丰晋信基金管理有限公司投资部总监、本基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金基金经理。

	理				
方超	本基金基金经理	2015年9月19日	-	8.5	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曹庆先生、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》、《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间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，或者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

2015 年股票市场的走势可谓极其跌宕起伏。承接始于 2014 年第三季度的上涨行情，2015 年上证指数从年初的 3200 点附近起步，在经历一二月份的震荡整理之后于三月份再启涨势，在赚钱效应的带动下众多个人投资者、机构、上市公司等等的资金和资源均以各种方式进入市场，在几乎没有调整的走势下降上证指数拉升至 6 月中旬的 5178 点，市场满是欢腾之声。但随着监管层对于杠杆资金入市的警惕并开始监管清理，建立在杠杆模式之上的上涨行情来得快，去得更快。上证指数在 6 月中至 7 月中的短短四周时间内从最高点的 5178 点快速、大幅、毫无阻挡的暴跌至最低的 3373 点，指数跌幅高达 35%，创业板综合指数从最高的 4449 点跌至最低 2532 点，跌幅更是高达 43%，不少个股的跌幅更是惨不忍睹，“一波三折”不在少数。此后国家队出手稳定市场，在 7 月中旬至 8 月中旬之间市场走出了区间震荡行情，但随着央行意外的汇率贬值举措，市场在 8 月中旬再次开启一轮快速下跌，上证指数最低跌至 2850 点，至此相对最高点的 5178 点指数已经下跌了接近 45%，在三个月不到的时间内出现如此大的下跌的确堪称史无前例。不过所幸在之后的四季度市场终于走出缓慢上行的态势，市场行情有所复苏。

上证指数在 2015 年经历大幅震荡之后收涨 9.4%，深成指数全年涨幅接近 15%，沪深 300 指数收涨 5.6%，而创业板综合指数的涨幅则高达 106%，风格分化非常明显，而行业板块见的分化也是如此。根据中信行业分类的数据，计算机、餐饮旅游和通信三个板块的涨幅均在 110% 以上，除此之外还有轻工制造、纺织服装、农林牧渔、电子元器件和基础化工等五个板块的涨

幅也在 80%以上。在表现较差的板块中，非银行金融板块全年下跌 18%，煤炭和钢铁板块的跌幅也均在 7%左右，另外石油石化和银行板块也仅仅上涨 3%左右。

在 2015 年的操作中，本基金紧紧围绕低碳这一主题，以行业配置为基础以个股选择为核心，在一季度重点配置了环保节能行业中的环境监测板块，并以此为核心在上半年的上涨行情中重点布局了环境治理行业，取得了明显的超额收益。受股灾影响，本基金 3 季度业绩也出现较大回撤，不过之后在国庆节后开始的反弹行情中，本基金积极布局了新能源汽车这一市场重点关注的行业中表现最佳的锂资源以及相关原材料板块，再次取得了不错表现。综合而言，本基金在 2015 年取得了比较不错的正收益，同时业绩表现也明显战胜了比较基准。

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 58.35%，同期业绩比较基准变动幅度为 15.91%，本基金领先业绩比较基准 42.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

相对于 2016 年一月份的大寒节气之后的这轮大降温的天气而言，2016 年我国股市的寒潮则早从新年的第一个交易日就开始了。从新年起才开始实施的熔断机制在第一个交易日就被触发了，并在四天内两次触发，之后尽管熔断机制很快被暂停但股市的下跌势头却未被暂停住，上证指数在一月份创下历史最大单月跌幅已然没有任何悬念。时至今日冷静看待市场的这轮暴跌，市场涨幅过大带来的股票价值高估是诱因，牛市心态下创造出来的各种杠杆模式是波动的加速器，国内经济增长的疲软导致的企业盈利下滑和人民币汇率的波动则更进一步加大了投资者的情绪动荡。

资本市场永远是变化快，如果将现在的市场与去年年底的市场格局对比，会发现这其中最大的变量似乎就是人民币的汇率波动了，汇率的贬值压力会带来一定的资本流出和资产价格重估的压力，这种波动和预期随着传播媒体的不断扩散而逐渐增大，进一步加剧了市场的波动，同时市场的大幅波动触发之前众多杠杆资金的压力位置，引起连锁反应，造成连续踩踏行为。相同的市场不同的只是投资者的心态，固然人民币的贬值会带来某些资产价格的波动，但从当前我国经济的需要出发，适度的可控的贬值是需要的也是政府所希望达成的目标，也是从中长期有利于我国经济发展的，结合当前我国的宏观经济背景以及世界经济格局，放眼长远也许是一个比较合适的视角。回到国内经济发展前景上，政府在经过长期的观察和思考之后推出了“供给侧改革”这一新的经济发展思路，对传统的产能过剩产业采取破产兼并重组等方式进行止血，同时积极鼓励培育新兴产业创新发展进行造血，双管齐下重构经济新常态以确保经济增长实现增速换挡质量提升，从而从中长期角度给资本市场带来支撑和动力。

风险总是在上涨中累计在下跌中释放，经历这轮快速大幅下跌之后，目前市场的估值水平较之高位已经有了明显的下降，风险已降低很多。对不少传统行业而言这似乎是最坏的时代，但同时这也是很多新兴产业最好的时代，新能源汽车、能源互联网以及环保节能等这些受益于国家产业政策扶持的行业仍将继续维持快速增长，这其中不少优秀的投资标的已经进入了投资

区间。新能源汽车不仅是中国从汽车大锅向汽车强国跨越的重要抓手，并且更是打通“新能源-储能-新能源汽车”这一产业链的关键所在；在发展这一产业链的过程中，能源互联网将起到匹配生产端和用户端需求并不断提高能源传输效率的关键作用；而大力发展新能源汽车和能源互联网，目的则是从根本上解决我国的环保问题，在这一过程中节能产业将因为其经济性特征而得到更多的关注。因此未来低碳产业的内涵将逐渐由低碳生产走向低碳生活和低碳经济，行业发展的前景将十分广阔。本基金将专注于低碳行业的投资，坚持个股选择和板块配置相结合的方式来应对当前复杂的市场局面，争取持续战胜业绩比较基准，为持有人获取理想收益。

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有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开展工作，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开展和落实，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开展和落实，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其适用性的情况下，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

2015 年度，基金托管人在汇丰晋信低碳先锋股票型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

2015 年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信低碳先锋股票型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真实、准确和完整发表意见

2015 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股票型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(2016)第 21315 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：
引言段	我们审计了后附的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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是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管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为，上述汇丰晋信低碳先锋基金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，公允反映了汇丰晋信低碳先锋基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
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)
会计师事务所的地址	中国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	2016 年 3 月 28 日

§ 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：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	39,567.74	499,447.09
结算备付金		107,404,368.78	46,335,027.55
存出保证金		902,759.60	639,595.01
交易性金融资产	7.4.7.2	1,140,412,891.31	602,801,062.02
其中：股票投资		1,140,412,891.31	602,801,062.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	11,527,734.30
应收利息	7.4.7.5	38,673.98	21,346.52
应收股利		-	-
应收申购款		936,837.90	369,798.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,249,735,099.31	662,194,010.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		16,755,247.71	18,321,883.05
应付赎回款		3,879,313.05	3,796,838.39
应付管理人报酬		1,431,000.70	884,671.06
应付托管费		238,500.12	147,445.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,906,430.11	1,908,671.65
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	404,872.07	425,104.74
负债合计		27,615,363.76	25,484,614.06
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	590,811,196.04	487,406,943.08

未分配利润	7.4.7.10	631,308,539.51	149,302,453.42
所有者权益合计		1,222,119,735.55	636,709,396.50
负债和所有者权益总计		1,249,735,099.31	662,194,010.56

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0685 元，基金份额总额 590,811,196.04 份。

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		554,718,304.37	102,249,538.39
1. 利息收入		1,432,458.07	1,090,223.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,408,285.77	1,087,444.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,172.30	2,779.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		466,465,768.75	100,356,101.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	462,179,484.04	96,454,451.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	4,286,284.71	3,901,649.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	84,249,949.47	-994,658.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,570,128.08	1,797,870.88
减：二、费用		35,603,732.53	28,226,545.19
1. 管理人报酬		16,031,631.17	13,172,568.94
2. 托管费		2,671,938.56	2,195,428.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	16,491,102.80	12,429,576.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	409,060.00	428,971.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		519,114,571.84	74,022,993.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		519,114,571.84	74,022,993.20

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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	487,406,943.08	149,302,453.42	636,709,396.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	519,114,571.84	519,114,571.84
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）	103,404,252.96	-37,108,485.75	66,295,767.21
其中：1. 基金申购款	1,169,429,533.58	952,911,104.26	2,122,340,637.84
2. 基金赎回款	-1,066,025,280.62	-990,019,590.01	-2,056,044,870.63
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）	590,811,196.04	631,308,539.51	1,222,119,735.55
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	1,127,121,033.90	217,186,863.57	1,344,307,897.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,022,993.20	74,022,993.20
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）	-639,714,090.82	-141,907,403.35	-781,621,494.17
其中：1. 基金申购款	522,532,455.52	134,109,671.24	656,642,126.76
2. 基金赎回款	-1,162,246,546.34	-276,017,074.59	-1,438,263,620.93
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）	487,406,943.08	149,302,453.42	636,709,396.50

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：

<u>王栋</u>	<u>赵琳</u>	<u>杨洋</u>
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 666,375,731.65 元,业经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,其中股票投资比例为基金资产的 85%-95%,投资于低碳经济领域的股票比例占股票投资的 80%以上;权证投资比例为 0%-3%;固定收益类证券、现金和其他资产投资比例为 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 5%。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,本基金业绩比较基准由原先的“沪深 300 指数 X90%+同业存款利率 X10%”变更为:中证环保指数 X90%+同业存款利率(税后)X10%。

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 2016 年 3 月 28 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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, 股权的股息、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, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额, 自 2015 年 9 月 8 日起, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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	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
汇丰银行（中国）有限公司（“汇丰银行”）	见注释③
恒生银行（中国）有限公司（“恒生银行”）	见注释④

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省国信投资(集团)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省国信投资(集团)公司控制。

③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。

④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 债券交易

本基金在本年度与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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金在本年度与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。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金在本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本年度及上年度可比期间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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,031,631.17	13,172,568.94

其中：支付销售机构的客户维护费	3,433,730.05	5,273,585.94
-----------------	--------------	--------------

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 × 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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,671,938.56	2,195,428.25

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 × 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

本基金管理人在本年度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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	39,567.74	26,999.17	499,447.09	36,008.22

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。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2015 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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（2015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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

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
002340	格林美	2015年12月29日	重大事项	15.20	2016年1月6日	14.35	1,500,000	23,272,775.65	22,800,000.00	-
600168	武汉控股	2015年10月8日	重大事项	9.68	-	-	835,600	8,462,294.00	8,088,608.00	-
300028	金亚科技	2015年6月9日	重大事项	12.14	-	-	161,850	6,679,297.00	1,964,859.00	-

注：本基金截至2015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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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 2015 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 1,107,559,424.31 元,属于第二层次的余额为 30,888,608.00 元,属于第三层次的余额 1,964,859.00 元(2014 年 12 月 31 日:第一层次 602,801,062.02 元,无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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

	交易性金融资产 ——股票投资
2015 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	1,964,859.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
——计入损益的利得或损失	-
2015 年 12 月 31 日	<u>1,964,859.00</u>
2015 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2015 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>-4,714,438.00</u>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市销率定价模型确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 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(2014 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	1,140,412,891.31	91.25
	其中：股票	1,140,412,891.31	91.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	107,443,936.52	8.60
7	其他各项资产	1,878,271.48	0.15
8	合计	1,249,735,099.31	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	51,802,564.10	4.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	608,374,900.58	49.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	170,469,667.30	13.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	40,830,626.71	3.34
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	98,550,000.00	8.06
J	金融业	-	-

K	房地产业	54,180,000.00	4.43
L	租赁和商务服务业	17,690,000.00	1.45
M	科学研究和技术服务业	34,070,836.62	2.79
N	水利、环境和公共设施管理业	64,444,296.00	5.27
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	1,140,412,891.31	93.31

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	601777	力帆股份	6,500,000	112,710,000.00	9.22
2	002421	达实智能	4,500,000	98,550,000.00	8.06
3	600116	三峡水利	4,500,000	97,650,000.00	7.99
4	000920	南方汇通	3,000,000	72,090,000.00	5.90
5	300187	永清环保	1,200,080	64,444,296.00	5.27
6	002546	新联电子	1,800,000	58,806,000.00	4.81
7	600240	华业资本	3,600,000	54,180,000.00	4.43
8	002200	云投生态	2,000,099	51,802,564.10	4.24
9	600135	乐凯胶片	2,000,010	43,320,216.60	3.54
10	603601	再升科技	1,000,000	40,700,000.00	3.33

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	000400	许继电气	130,763,579.40	20.54
2	600406	国电南瑞	109,831,666.18	17.25
3	601777	力帆股份	96,906,500.20	15.22
4	000920	南方汇通	93,636,342.86	14.71
5	002421	达实智能	87,338,108.91	13.72
6	600116	三峡水利	85,629,217.98	13.45
7	002340	格林美	82,898,371.68	13.02
8	300072	三聚环保	82,545,470.06	12.96
9	600875	东方电气	82,197,645.34	12.91
10	600089	特变电工	82,138,865.43	12.90
11	300187	永清环保	75,748,374.24	11.90
12	600240	华业资本	74,284,586.03	11.67
13	002466	天齐锂业	69,079,072.13	10.85
14	300021	大禹节水	69,073,011.77	10.85
15	002200	云投生态	65,216,334.51	10.24
16	600517	置信电气	64,922,414.98	10.20
17	002594	比亚迪	64,295,268.71	10.10
18	300070	碧水源	58,056,322.56	9.12
19	002038	双鹭药业	55,425,460.60	8.70
20	002546	新联电子	51,473,381.36	8.08
21	002450	康得新	50,607,334.49	7.95
22	600098	广州发展	50,042,710.25	7.86
23	600366	宁波韵升	49,832,689.90	7.83
24	002202	金风科技	49,369,365.25	7.75
25	002402	和而泰	49,189,102.10	7.73
26	600703	三安光电	46,110,502.66	7.24
27	300118	东方日升	45,169,626.99	7.09
28	600884	杉杉股份	44,842,361.57	7.04
29	601688	华泰证券	44,738,099.05	7.03
30	002375	亚厦股份	43,931,245.99	6.90
31	002460	赣锋锂业	43,886,527.81	6.89
32	300190	维尔利	43,738,674.81	6.87
33	002580	圣阳股份	43,134,708.80	6.77
34	300274	阳光电源	42,215,902.50	6.63
35	300207	欣旺达	41,031,314.65	6.44
36	000685	中山公用	40,801,618.67	6.41

37	603601	再升科技	40,346,671.06	6.34
38	600292	中电远达	39,624,848.32	6.22
39	600886	国投电力	38,644,377.00	6.07
40	603126	中材节能	38,414,515.93	6.03
41	000612	焦作万方	38,028,705.77	5.97
42	600135	乐凯胶片	37,865,068.11	5.95
43	601288	农业银行	37,552,550.00	5.90
44	600259	广晟有色	36,834,368.04	5.79
45	601877	正泰电器	36,436,455.32	5.72
46	002196	方正电机	36,121,170.39	5.67
47	600580	卧龙电气	36,091,636.64	5.67
48	002431	棕榈园林	35,896,568.37	5.64
49	600388	龙净环保	35,796,543.70	5.62
50	000559	万向钱潮	35,777,074.61	5.62
51	601398	工商银行	35,101,668.00	5.51
52	601233	桐昆股份	35,004,289.23	5.50
53	002216	三全食品	34,840,243.82	5.47
54	002028	思源电气	34,835,901.92	5.47
55	601012	隆基股份	34,522,549.71	5.42
56	000957	中通客车	34,189,679.09	5.37
57	002658	雪迪龙	33,911,244.24	5.33
58	601126	四方股份	33,684,882.46	5.29
59	603799	华友钴业	33,106,679.78	5.20
60	300227	光韵达	32,232,225.77	5.06
61	600573	惠泉啤酒	32,065,381.29	5.04
62	300004	南风股份	31,974,197.35	5.02
63	002573	清新环境	31,546,177.89	4.95
64	002249	大洋电机	31,114,394.84	4.89
65	600699	均胜电子	30,988,361.31	4.87
66	300105	龙源技术	30,891,785.09	4.85
67	000791	甘肃电投	30,744,959.20	4.83
68	600323	瀚蓝环境	30,392,088.20	4.77
69	600596	新安股份	30,019,160.62	4.71
70	600131	岷江水电	29,709,176.14	4.67
71	600516	方大炭素	29,083,309.95	4.57
72	601166	兴业银行	28,991,214.84	4.55

73	300141	和顺电气	28,673,305.80	4.50
74	600409	三友化工	28,615,864.50	4.49
75	002091	江苏国泰	28,601,620.98	4.49
76	601222	林洋能源	28,283,030.77	4.44
77	300090	盛运环保	27,606,292.00	4.34
78	300137	先河环保	27,194,146.24	4.27
79	300197	铁汉生态	26,836,727.20	4.21
80	600979	广安爱众	26,794,371.48	4.21
81	002531	天顺风能	25,702,795.00	4.04
82	002088	鲁阳节能	25,494,240.17	4.00
83	300228	富瑞特装	25,385,864.30	3.99
84	002665	首航节能	24,911,498.42	3.91
85	000049	德赛电池	24,741,838.52	3.89
86	300073	当升科技	24,588,276.59	3.86
87	600509	天富能源	24,423,218.80	3.84
88	600651	飞乐音响	24,063,075.79	3.78
89	600686	金龙汽车	23,934,567.00	3.76
90	600418	江淮汽车	23,611,918.45	3.71
91	300037	新宙邦	23,609,686.93	3.71
92	601988	中国银行	23,600,000.00	3.71
93	600993	马应龙	23,481,526.27	3.69
94	600712	南宁百货	23,371,021.92	3.67
95	002178	延华智能	23,353,271.73	3.67
96	600303	曙光股份	23,249,066.88	3.65
97	300068	南都电源	23,229,079.22	3.65
98	000027	深圳能源	23,182,482.48	3.64
99	002056	横店东磁	22,867,812.97	3.59
100	002339	积成电子	22,862,619.00	3.59
101	000061	农产品	22,547,081.00	3.54
102	603588	高能环境	22,533,501.73	3.54
103	000712	锦龙股份	21,164,125.76	3.32
104	600066	宇通客车	21,094,979.87	3.31
105	601985	中国核电	21,086,974.00	3.31
106	300156	神雾环保	20,632,333.81	3.24
107	601515	东风股份	20,444,586.06	3.21
108	300145	南方泵业	20,419,597.08	3.21

109	002108	沧州明珠	20,356,246.61	3.20
110	002053	云南盐化	20,218,864.90	3.18
111	000413	东旭光电	19,941,316.84	3.13
112	300055	万邦达	19,665,002.69	3.09
113	002557	洽洽食品	19,423,826.18	3.05
114	000939	凯迪生态	18,644,986.11	2.93
115	002121	科陆电子	18,620,670.93	2.92
116	300263	隆华节能	18,571,749.96	2.92
117	300224	正海磁材	18,295,081.87	2.87
118	300335	迪森股份	17,715,414.41	2.78
119	000831	五矿稀土	17,154,065.10	2.69
120	603766	隆鑫通用	17,116,773.85	2.69
121	300203	聚光科技	16,792,343.44	2.64
122	600382	广东明珠	16,728,215.01	2.63
123	600438	通威股份	16,665,288.18	2.62
124	000993	闽东电力	16,440,112.87	2.58
125	000868	安凯客车	16,373,201.00	2.57
126	002259	升达林业	16,344,757.47	2.57
127	600261	阳光照明	16,214,461.70	2.55
128	600803	新奥股份	16,123,431.99	2.53
129	002169	智光电气	15,740,669.12	2.47
130	600312	平高电气	15,710,055.88	2.47
131	002172	澳洋科技	15,704,466.12	2.47
132	300217	东方电热	15,261,179.52	2.40
133	000652	泰达股份	14,917,547.97	2.34
134	002672	东江环保	14,567,611.18	2.29
135	300303	聚飞光电	14,375,374.68	2.26
136	601158	重庆水务	14,353,726.43	2.25
137	002616	长青集团	14,029,898.91	2.20
138	000826	启迪桑德	14,015,645.50	2.20
139	000572	海马汽车	13,997,815.99	2.20
140	600172	黄河旋风	13,761,044.00	2.16
141	300183	东软载波	13,550,343.25	2.13
142	600505	西昌电力	13,059,493.21	2.05
143	600478	科力远	12,916,826.00	2.03
144	600057	象屿股份	12,892,639.76	2.02

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	002658	雪迪龙	135,918,852.82	21.35
2	000400	许继电气	115,938,764.10	18.21
3	002466	天齐锂业	112,154,432.87	17.61
4	600089	特变电工	105,327,774.64	16.54
5	300021	大禹节水	100,463,132.18	15.78
6	300274	阳光电源	97,481,117.73	15.31
7	600875	东方电气	96,009,644.18	15.08
8	600406	国电南瑞	88,354,883.27	13.88
9	600703	三安光电	78,464,428.93	12.32
10	300072	三聚环保	74,894,163.05	11.76
11	002594	比亚迪	72,825,672.51	11.44
12	002460	赣锋锂业	72,462,413.33	11.38
13	002102	冠福股份	70,670,778.58	11.10
14	300207	欣旺达	68,759,920.14	10.80
15	300070	碧水源	66,621,631.48	10.46
16	002450	康得新	62,949,474.24	9.89
17	600517	置信电气	62,842,049.45	9.87
18	002340	格林美	59,849,539.64	9.40
19	002038	双鹭药业	57,233,647.13	8.99
20	601222	林洋能源	56,007,569.86	8.80
21	300118	东方日升	55,639,308.80	8.74
22	600259	广晟有色	52,246,961.94	8.21
23	000685	中山公用	51,633,864.17	8.11
24	601688	华泰证券	51,531,957.13	8.09
25	600098	广州发展	49,932,991.38	7.84
26	300137	先河环保	48,877,158.05	7.68
27	600651	飞乐音响	48,534,711.53	7.62
28	600292	中电远达	47,469,589.71	7.46
29	002375	亚厦股份	46,823,752.45	7.35
30	300303	聚飞光电	45,856,183.19	7.20
31	000831	五矿稀土	45,209,161.42	7.10

32	300203	聚光科技	45,166,958.38	7.09
33	600388	龙净环保	45,084,474.96	7.08
34	002202	金风科技	44,886,840.90	7.05
35	002531	天顺风能	44,277,124.07	6.95
36	002431	棕榈园林	44,231,699.15	6.95
37	300190	维尔利	41,883,795.09	6.58
38	002573	清新环境	39,847,963.45	6.26
39	000612	焦作万方	39,514,146.83	6.21
40	000826	启迪桑德	39,411,123.46	6.19
41	002580	圣阳股份	38,980,799.77	6.12
42	601233	桐昆股份	38,081,649.17	5.98
43	601288	农业银行	37,648,020.00	5.91
44	601166	兴业银行	36,611,843.05	5.75
45	300197	铁汉生态	36,581,934.39	5.75
46	600886	国投电力	36,217,301.02	5.69
47	600516	方大炭素	36,025,000.00	5.66
48	002028	思源电气	35,702,782.38	5.61
49	601398	工商银行	35,573,524.00	5.59
50	002256	彩虹精化	35,547,046.46	5.58
51	601877	正泰电器	35,123,923.50	5.52
52	000957	中通客车	34,361,694.90	5.40
53	002249	大洋电机	34,245,248.70	5.38
54	601126	四方股份	34,067,798.21	5.35
55	002665	首航节能	33,639,461.45	5.28
56	002196	方正电机	33,405,969.45	5.25
57	000559	万向钱潮	33,403,933.50	5.25
58	601012	隆基股份	33,228,744.61	5.22
59	600993	马应龙	33,110,268.87	5.20
60	600884	杉杉股份	32,860,288.70	5.16
61	603799	华友钴业	32,667,572.46	5.13
62	002672	东江环保	31,740,830.91	4.99
63	600573	惠泉啤酒	30,013,338.83	4.71
64	300228	富瑞特装	29,931,171.70	4.70
65	600596	新安股份	29,036,308.12	4.56
66	002216	三全食品	28,988,492.69	4.55
67	000791	甘肃电投	28,118,464.44	4.42
68	600409	三友化工	28,034,197.72	4.40
69	300141	和顺电气	26,877,444.88	4.22

70	600699	均胜电子	26,683,941.62	4.19
71	300169	天晟新材	26,432,535.57	4.15
72	300090	盛运环保	26,317,622.11	4.13
73	600979	广安爱众	26,195,837.87	4.11
74	600712	南宁百货	26,014,380.32	4.09
75	601218	吉鑫科技	25,973,932.37	4.08
76	603588	高能环境	25,744,584.71	4.04
77	002402	和而泰	25,684,996.21	4.03
78	000712	锦龙股份	25,288,990.89	3.97
79	300037	新宙邦	25,095,342.05	3.94
80	603126	中材节能	25,044,487.39	3.93
81	002088	鲁阳节能	25,001,735.15	3.93
82	000027	深圳能源	24,833,105.49	3.90
83	300054	鼎龙股份	24,398,536.16	3.83
84	600686	金龙汽车	24,067,939.00	3.78
85	601988	中国银行	23,400,000.00	3.68
86	000049	德赛电池	23,217,520.42	3.65
87	300055	万邦达	23,131,554.40	3.63
88	000407	胜利股份	23,035,557.99	3.62
89	300156	神雾环保	22,959,525.26	3.61
90	600303	曙光股份	22,897,902.00	3.60
91	002108	沧州明珠	22,875,281.31	3.59
92	300007	汉威电子	22,567,703.90	3.54
93	002557	洽洽食品	22,534,515.53	3.54
94	600418	江淮汽车	22,339,138.49	3.51
95	600366	宁波韵升	21,621,584.04	3.40
96	600066	宇通客车	21,561,942.83	3.39
97	300187	永清环保	21,547,745.73	3.38
98	300004	南风股份	21,314,285.00	3.35
99	002200	云投生态	21,246,849.81	3.34
100	000920	南方汇通	21,207,538.31	3.33
101	000786	北新建材	21,113,390.86	3.32
102	600240	华业资本	21,096,362.90	3.31
103	300224	正海磁材	21,091,500.68	3.31
104	002053	云南盐化	20,664,146.17	3.25
105	600509	天富能源	20,496,832.62	3.22
106	601985	中国核电	20,438,464.98	3.21
107	300145	南方泵业	19,877,757.10	3.12

108	601515	东风股份	18,781,096.69	2.95
109	300335	迪森股份	18,669,521.20	2.93
110	002339	积成电子	18,466,057.94	2.90
111	000413	东旭光电	18,072,085.92	2.84
112	300105	龙源技术	18,064,457.48	2.84
113	002172	澳洋科技	17,789,135.96	2.79
114	603766	隆鑫通用	17,720,557.61	2.78
115	000939	凯迪生态	17,557,704.60	2.76
116	600438	通威股份	17,433,374.00	2.74
117	600261	阳光照明	16,636,781.64	2.61
118	601908	京运通	16,592,216.88	2.61
119	002121	科陆电子	16,552,078.62	2.60
120	002236	大华股份	15,993,737.82	2.51
121	600310	桂东电力	15,968,469.90	2.51
122	600312	平高电气	15,813,274.15	2.48
123	600382	广东明珠	15,742,505.40	2.47
124	300332	天壕节能	15,658,759.42	2.46
125	600478	科力远	15,354,024.29	2.41
126	600352	浙江龙盛	14,974,515.57	2.35
127	600803	新奥股份	14,932,357.49	2.35
128	601158	重庆水务	14,730,497.18	2.31
129	600172	黄河旋风	14,595,939.21	2.29
130	002142	宁波银行	14,395,268.00	2.26
131	002129	中环股份	14,362,281.74	2.26
132	002630	华西能源	14,340,025.83	2.25
133	000661	长春高新	14,206,175.97	2.23
134	000868	安凯客车	14,063,548.08	2.21
135	300217	东方电热	14,047,421.33	2.21
136	300183	东软载波	13,843,747.60	2.17
137	600580	卧龙电气	13,839,097.87	2.17
138	000690	宝新能源	13,768,555.00	2.16
139	002616	长青集团	13,470,391.75	2.12
140	600000	浦发银行	13,450,695.00	2.11
141	601818	光大银行	13,425,228.00	2.11
142	002169	智光电气	13,128,791.00	2.06
143	000598	兴蓉环境	13,084,895.24	2.06
144	600057	象屿股份	12,999,763.25	2.04

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	5,413,943,672.70
卖出股票收入（成交）总额	5,422,761,276.92

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	902,759.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,673.98
5	应收申购款	936,837.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,878,271.48

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
24,242	24,371.39	383,074,938.18	64.84%	207,736,257.86	35.16%

9.3 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	282,798.65	0.0479%

9.4 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的情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 6 月 8 日) 基金份额总额	666,460,299.86
本报告期期初基金份额总额	487,406,943.08
本报告期基金总申购份额	1,169,429,533.58

减:本报告期基金总赎回份额	1,066,025,280.62
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	590,811,196.04

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

2015年3月2日,经公司股东会审议批准,刘叔肆先生不再担任本公司董事,由郭晋普先生、柴宏杰先生担任本公司董事。

2015年9月19日,基金管理人发布公告,方超先生担任本基金基金经理。

2015年11月16日,经公司股东会审议批准,梅建平先生担任本公司独立董事。

2015年12月1日,经公司股东会审议批准,Sridhar Chandrasekharan先生不再担任本公司董事,由李选进先生担任本公司董事。

2015年12月9日,经公司股东会审议批准,Alan Howard Smith先生不再担任本公司独立董事,由叶迪奇先生担任本公司独立董事。

2015年12月26日,基金管理人发布公告,李毅先生不再担任本公司副总经理。

本报告期内,本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

报告期内,基金托管人任命袁庆伟女士为资产托管业务中心总裁,刘树军先生不再担任资产托管业务中心总裁。

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 90000 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 2015 年度审计费 90000 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	
中信建投	1	1,660,855,998.41	15.33%	1,525,730.68	15.28%	-
安信证券	2	1,417,249,776.66	13.08%	1,304,206.28	13.06%	-
川财证券	1	1,465,275,077.64	13.52%	1,356,210.83	13.58%	-
国泰君安	1	1,063,678,555.88	9.82%	985,700.50	9.87%	-
东方证券	1	979,948,706.52	9.04%	898,682.21	9.00%	-
东兴证券	1	719,839,637.03	6.64%	655,349.09	6.56%	-
银河证券	1	569,780,552.70	5.26%	522,405.12	5.23%	-
申万宏源	1	542,691,012.11	5.01%	504,468.72	5.05%	-
华泰证券	2	486,227,234.82	4.49%	452,821.81	4.54%	-
招商证券	2	367,347,361.99	3.39%	337,783.92	3.38%	-
兴业证券	1	356,784,965.01	3.29%	324,816.72	3.25%	-
海通证券	1	269,202,466.78	2.48%	248,812.71	2.49%	-
中银国际	1	218,519,459.61	2.02%	203,507.79	2.04%	-
平安证券	1	189,068,396.84	1.74%	176,079.75	1.76%	-

中信证券	1	186,857,881.01	1.72%	174,021.28	1.74%	-
华创证券	1	163,753,392.55	1.51%	149,081.46	1.49%	-
国金证券	1	130,462,833.18	1.20%	120,054.44	1.20%	-
中金公司	1	33,880,047.00	0.31%	31,354.49	0.31%	-
中投证券	1	13,846,393.88	0.13%	12,605.84	0.13%	-
光大证券	1	1,435,200.00	0.01%	1,306.61	0.01%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
合计	26	10,836,704,949.62	100.00%	9,985,000.25	100.00%	-

注：1、报告期内增加的交易单元为：中信建投证券、川投证券、平安证券、东兴证券。

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	
	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
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	70,000,000.00	46.67%	-
东兴证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	80,000,000.00	53.33%	-
申万宏源	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-
合计	-	-	150,000,000.00	100.00%	-

§ 12 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
2016年3月29日