

# 汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
§2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
3.3 其他指标 .....	Error! Bookmark not defined.
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
§5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
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 .....	15
§6 审计报告 .....	15
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
§7 年度财务报表 .....	16
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
7.4 报表附注 .....	19
§8 投资组合报告 .....	1
8.1 期末基金资产组合情况 .....	1
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	1
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	2
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	3
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	7
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 .....	8
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	8
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 .....	8
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 .....	8
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	8
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	8
8.12 投资组合报告附注 .....	9
§9 基金份额持有人信息 .....	9
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	9

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	10
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的情况 .....	10
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>10</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>10</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	10
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 .....	11
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	11
11.4 基金投资策略的改变 .....	11
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	11
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 .....	11
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	12
11.8 其他重大事件 .....	13
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>22</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>22</b>
13.1 备查文件目录 .....	22
13.2 存放地点 .....	23
13.3 查阅方式 .....	23

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金
基金简称	汇丰晋信龙腾混合
基金主代码	540002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月27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	256,217,063.91份
基金合同存续期	不定期

注：自2015年8月7日起，本基金更名为“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”，基金简称变更为“汇丰晋信龙腾混合”，基金股票投资比例不发生变更。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选受益于中国经济持续高速增长而呈现出可持续竞争优势、未来良好成长性以及持续盈利增长潜力的上市公司，追求超越基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。
投资策略	<p>1. 适度调整的资产配置策略</p> <p>本基金奉行“注重成长、精选个股、长期投资”的投资理念和“自下而上”的股票精选策略。在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2. 以成长指标为核心的股票筛选策略</p> <p>本基金在明确的成长性评估体系基础上，对初选股票给予全面的成长性分析，成长性指标包括：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。同时，再通过严格的基本面分析（CFROI（投资现金回报率）指标为核心的财务分析和估值体系、公司治理结构分析）和公司实地调研，最终挑选出具有可持续竞争优势，未来有良好成长性和盈利持续增长潜力的上市公司。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数*75%+1 年期银行定期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高风险收益特征的基金品种。

### 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
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	上海市浦东新区银城中路188号
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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	杨小勇	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	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
注册登记机构	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

## § 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	329,490,689.64	187,085,029.79	144,333,596.44
本期利润	138,248,925.04	301,097,742.87	203,541,547.79
加权平均基金份额本期利润	0.3791	0.3060	0.2620
本期加权平均净值利润率	20.58%	28.90%	19.96%
本期基金份额净值增长率	17.06%	55.01%	24.97%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	246,847,049.89	343,802,009.15	171,209,522.27
期末可供分配基金份额利润	0.9634	0.6037	0.0820
期末基金资产净值	503,064,113.80	955,161,900.90	2,260,031,013.03
期末基金份额净值	1.9634	1.6772	1.0820
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	359.85%	292.82%	153.41%

注：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；

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);

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	21.68%	1.51%	13.42%	1.26%	8.26%	0.25%
过去六个月	-4.67%	2.89%	-11.90%	2.04%	7.23%	0.85%
过去一年	17.06%	2.56%	15.71%	1.84%	1.35%	0.72%
过去三年	126.77%	1.89%	38.35%	1.31%	88.42%	0.58%
过去五年	70.31%	1.62%	11.00%	1.21%	59.31%	0.41%
自基金合同生效起至今	359.85%	1.72%	114.92%	1.46%	244.93%	0.26%

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 2006 年 9 月 27 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

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

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

(2006 年 9 月 27 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：股票占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中现金或到期日在一年期以内的国债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 6 个月内完成建仓。截止 2007 年 3 月 27 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( 2006 年 9 月 27 日 )起至 2015 年 3 月 31 日 本基金的业绩比较基准为 “ 75% × 富时中国 A600 成长指数收益率 + 25% × 1 年期银行定期存款利率( 税后 ) ”。自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为 “ 75% × MSCI 中国 A 股指数 + 25% × 1 年期银行定期存款利率( 税后 ) ”。

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富时中国 A600 成长指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

4. 2010 年 12 月 16 日，新华富时 600 成长指数正式更名为富时中国 A600 成长指数。

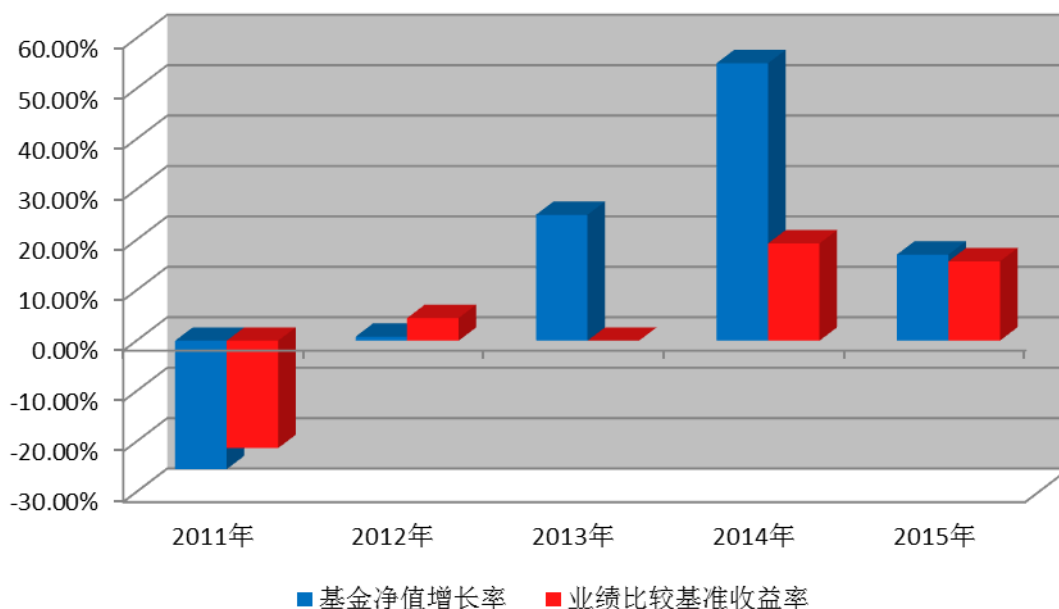
5. 自 2015 年 8 月 7 日起，本基金更名为 “ 汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金 ”，基金简称变更为 “ 汇丰晋信龙腾混合 ”，基金股票投资比例不发生变更。

### 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

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图

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
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
2013	3.8000	790,602,277.78	158,763,269.52	949,365,547.30	
合计	3.8000	790,602,277.78	158,763,269.52	949,365,547.30	

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		
王品	投资部副 总监、本 基金基金 经理	2015年5月 23日	-	15	王品女士，中国药科大学理学硕士。历任兴业证券股份有限公司医药行业研究员，中银国际基金管理公司中银中国基金经理助理、行业研究员，汇丰晋信基金管理公司高级研究员、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信投资部副总监、本基金基金经理。
王春	本基金基 金经理、 汇丰晋信	2013年12月 28日	2015年5月23日	15	王春先生，复旦大学企业

	动态策略 混合型证 券投资基 金基金经 理			管 理 硕 士。曾任 德恒证券 有限责任 公司研究 员；兴业 证券股份 有限公司 投资策略 部经理； 平安资产 管理有限 责任公司 投资经理 兼权益投 资部研究 主管；汇 丰晋信基 金管理有 限公司投 资经理、 汇丰晋信 动态策略 混合型证 券投资基 金基金经 理、本基 金基金经 理、首席 策略分析 师及策略 与金融工 程总监。
--	-----------------------------------	--	--	---

注：1. 任职日期为本基金管理人公告王品女士、王春先生担任本基金基金经理的日期；

2. 离职日期为本基金管理人公告王春先生不再担任本基金基金经理的日期；

3. 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合规守信情况的说明

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年的市场如过山车般的剧烈，上半年在宽松的货币政策环境下，投资者对于经济转型、国企改革寄予了高度的期望，市场各路资金加杠杆蜂拥入市，导致上半年指数出现了巨幅

的上涨，其中，创业板综指的涨幅达到 106.65%，但进入三季度，监管层出手对前期入市的杠杆资金进行了规范，中小企业泡沫化的股票估值随之土崩瓦解，同时，人民币贬值预期进一步增加了市场的忧虑，A 股市场出现快速下跌，沪深 300 指数在三季度下跌了 28.39%。四季度以后，随着与流动性相关的各项利空因素逐步消退，市场出现了明显的反弹。

本基金上半年的投资中兼顾了估值与成长性，主要布局于房地产、航空与医药板块；在市场出现波动时，本基金注重风险控制，尤其关注股票仓位控制，并对风险偏好较高的个股进行了减持；在流动性相关的利空因素消退后，本基金的操作较为积极，逐步增持了一些前期下跌较多但盈利仍然符合市场预期的个股。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

报告期内本基金单位净值增长率为 17.06%，同期业绩比较基准为 15.71%，净值表现领先业绩比较基准 1.35%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

2016 年初，市场在货币政策放松空间有限、人民币贬值加速、注册制推行节奏加快、创业板个股进入估值风险区等政策与市场因素的影响下，再度出现了较大幅度的下跌。展望后市，我们认为，汇率因素将成为影响市场的主导因素，目前汇率市场仍有一定的压力，但积极因素正在逐步出现，我们预计市场将在震荡中企稳。在基金管理方面，我们将择机增持一些行业前景良好、企业盈利稳定增长、估值相对合理的个股，同时，我们将重点关注供给侧改革对相关产业带来的积极影响。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

报告期内，本基金管理人在公司内部监察稽核工作中本着规范运作、防范风险和保护基金份额持有人利益的原则，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司的经营管理、基金的投资运作以及员工行为规范等方面进行日常监控、定期检查和专项检查，及时发现问题并督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报送监管机构。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

2. 按照法律法规和中国证监会规定，及时、准确、完整地履行公司和基金的各项法定信息披露义务，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龙腾混合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龙腾混合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的真实、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龙腾混合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 21309 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	汇丰晋信龙腾混合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龙腾混合型证券投资基金（原汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金，以下简称“汇丰晋信龙腾混合基金”）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 汇丰晋信龙腾混合 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 汇丰晋信龙腾混合基金 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 汇丰晋信龙腾混合基金 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：汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	478,319.26	344,407.53
结算备付金		91,532,304.05	46,716,031.08
存出保证金		817,189.57	515,910.11
交易性金融资产	7.4.7.2	399,624,715.46	910,882,216.71
其中：股票投资		399,119,195.46	900,234,856.71
基金投资		-	-
债券投资		505,520.00	10,647,360.00
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		13,714,904.85	10,077,822.58
应收利息	7.4.7.5	37,119.52	498,966.06
应收股利		-	-
应收申购款		36,433.64	8,147,683.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		506,240,986.35	977,183,037.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-



卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		261,223.20	18,032,821.41
应付管理人报酬		647,939.84	1,121,290.38
应付托管费		107,989.96	186,881.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,769,086.74	2,219,387.31
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	390,632.81	460,755.73
负债合计		3,176,872.55	22,021,136.58
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	256,217,063.91	569,493,244.64
未分配利润	7.4.7.10	246,847,049.89	385,668,656.26
所有者权益合计		503,064,113.80	955,161,900.90
负债和所有者权益总计		506,240,986.35	977,183,037.48

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9634 元，基金份额总额 256,217,063.91

份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

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	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
<b>一、收入</b>		161,925,544.66	333,242,269.59
1. 利息收入		1,810,892.65	5,833,105.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,783,980.70	1,901,524.96
债券利息收入		26,911.95	1,899,872.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,031,708.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		350,504,785.92	211,902,275.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	346,370,292.74	203,220,814.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	232,873.21	893,961.60
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	3,901,619.97	7,787,499.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-191,241,764.60	114,012,713.08
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	851,630.69	1,494,174.70

列)			
减：二、费用		23,676,619.62	32,144,526.72
1. 管理人报酬		10,084,697.80	15,736,457.99
2. 托管费		1,680,783.06	2,622,743.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	11,501,935.14	13,344,690.81
5. 利息支出		-	463.60
其中：卖出回购金融资产支出		-	463.60
6. 其他费用	7.4.7.21	409,203.62	440,171.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		138,248,925.04	301,097,742.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		138,248,925.04	301,097,742.87

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金

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)	569,493,244.64	385,668,656.26	955,161,900.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	138,248,925.04	138,248,925.04
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)	-313,276,180.73	-277,070,531.41	-590,346,712.14
其中：1. 基金申购款	305,813,734.10	239,310,676.11	545,124,410.21
2. 基金赎回款	-619,089,914.83	-516,381,207.52	-1,135,471,122.35
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)	256,217,063.91	246,847,049.89	503,064,113.80
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	2,088,821,490.76	171,209,522.27	2,260,031,013.03

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	301,097,742.87	301,097,742.87
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)	-1,519,328,246.12	-86,638,608.88	-1,605,966,855.00
其中：1.基金申购款	285,843,604.91	98,508,156.00	384,351,760.91
2.基金赎回款	-1,805,171,851.03	-185,146,764.88	-1,990,318,615.91
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)	569,493,244.64	385,668,656.26	955,161,900.90

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

汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金(原名为汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金,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”)证监基金字□第 157 号《关于同意汇丰晋信龙腾股票型开放式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《汇丰晋信龙腾股票型开放式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,业经毕马威华振会计师事务所有限公司 KPMG-B(2006)CR No. 0031 验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,436,388,715.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 218,330.94 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信龙腾混合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公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票占基金资产的 60%-95%;除股票

以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中现金或到期日在一年期以内的国债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。基金合同生效(2006 年 9 月 27 日)起至 2015 年 3 月 31 日，本基金的业绩比较基准为： $75\% \times$  富时中国 A600 成长指数收益率 $+25\% \times$  1 年期银行定期存款利率(税后)。根据《关于汇丰晋信龙腾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： $MSCI$  中国 A 股指数  $\times 75\%+$  一年期银行定期存款利率(税后)  $\times 25\%$ 。

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》、《汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金 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 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，

但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公

允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市销率法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	478,319.26	344,407.53
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	478,319.26	344,407.53

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	392,267,127.09	399,119,195.46	6,852,068.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	416,000.00	89,520.00
	银行间市场	-	-
	合计	416,000.00	89,520.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	392,683,127.09	399,624,715.46	6,941,588.37
项目	上年度末		
	2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	702,204,863.74	900,234,856.71	198,029,992.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	645,360.00	145,360.00
	银行间市场	9,994,000.00	8,000.00
	合计	10,494,000.00	153,360.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	712,698,863.74	910,882,216.71	198,183,352.97

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	137.25	112.93
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	36,329.60	23,098.93
应收债券利息	284.76	475,512.33
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.21	9.67
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	367.70	232.20
合计	37,119.52	498,966.06

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,769,086.74	2,219,064.81
银行间市场应付交易费用	-	322.50
合计	1,769,086.74	2,219,387.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	632.81	40,755.73
预提审计费	90,000.00	120,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	390,632.81	460,755.73

注：此处应付赎回费含应付转出费。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	569,493,244.64	569,493,244.64
本期申购	305,813,734.10	305,813,734.10
本期赎回(以“-”号填列)	-619,089,914.83	-619,089,914.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	256,217,063.91	256,217,063.91

注：此处申购含红利再投入、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	343,802,009.15	41,866,647.11	385,668,656.26
本期利润	329,490,689.64	-191,241,764.60	138,248,925.04
本期基金份额交易产生的变动数	-337,394,952.19	60,324,420.78	-277,070,531.41
其中：基金申购款	246,660,517.17	-7,349,841.06	239,310,676.11
基金赎回款	-584,055,469.36	67,674,261.84	-516,381,207.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	335,897,746.60	-89,050,696.71	246,847,049.89

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	4,504.76	184,532.02
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,765,936.24	1,704,659.12
其他	13,539.70	12,333.82
合计	1,783,980.70	1,901,524.96

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	4,000,793,728.74	4,788,647,488.56
减：卖出股票成本总额	3,654,423,436.00	4,585,426,674.05
买卖股票差价收入	346,370,292.74	203,220,814.51

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	232,873.21	893,961.60
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	232,873.21	893,961.60

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	11,313,012.73	45,708,547.46
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	10,578,000.00	43,376,500.00

减：应收利息总额	502,139.52	1,438,085.86
买卖债券差价收入	232,873.21	893,961.60

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	3,901,619.97	7,787,499.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,901,619.97	7,787,499.77

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	-191,241,764.60	114,012,713.08
——股票投资	-191,177,924.60	113,859,353.08
——债券投资	-63,840.00	153,360.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-191,241,764.60	114,012,713.08

#### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	766,401.43	1,372,694.69
转出基金补偿收入	85,229.26	120,058.81
其他	-	1,421.20
合计	851,630.69	1,494,174.70

注：

1. 本基金的赎回费率为0.3%，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分组成，其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	11,501,935.14	13,343,865.81
银行间市场交易费用	-	825.00
合计	11,501,935.14	13,344,690.81

#### 7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	90,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00

银行间债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇款费用	803.62	1,771.32
其他	400.00	400.00
合计	409,203.62	440,171.32

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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
中德证券有限责任公司(“中德证券”)	见注释
汇丰银行(中国)有限公司(“汇丰银行”)	见注释
恒生银行(中国)有限公司(“恒生银行”)	见注释

注：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。

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。

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。

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本年度与上年度均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本期间及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

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管理费	10,084,697.80	15,736,457.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,146,339.28	1,230,556.22

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

##### 7.4.10.2.2 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	1,680,783.06	2,622,743.00

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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	478,319.26	4,504.76	344,407.53	184,532.02
------	------------	----------	------------	------------

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)。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

##### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债上市	100.00	100.00	1,160	116,000.00	116,000.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。

##### 7.4.12.2 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
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	71.47	-	-	171,330	12,061,255.70	12,244,955.10	-
300028	金亚科技	2015年6月9日	重大事项	12.14	-	-	834,470	27,847,195.23	10,130,465.80	-
300242	明家科技	2015年12月18日	重大事项	49.96	2016年1月22日	44.96	120,600	5,194,475.00	6,025,176.00	-

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。

### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.12.3.1 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。

#### **7.4.12.3.2 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。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小，在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%(2014 年 12 月 31 日：0.07%)。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折

现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	478,319.26	-	-	-	478,319.26
结算备付金	-	-	-	91,532,304.05	-	-	-	91,532,304.05
存出保证金	-	-	-	817,189.57	-	-	-	817,189.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	505,520.00	399,119,195.46	399,624,715.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	13,714,904.85	13,714,904.85
应收利息	-	-	-	-	-	-	37,119.52	37,119.52
应收申购款	-	-	-	-	-	-	36,433.64	36,433.64
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	92,827,812.88	-	505,520.00	412,907,653.47	506,240,986.35
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	261,223.20	261,223.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	647,939.84	647,939.84
应付托管费	-	-	-	-	-	-	107,989.96	107,989.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	1,769,086.74	1,769,086.74
其他负债	-	-	-	-	-	-	390,632.81	390,632.81
负债总计	-	-	-	-	-	-	3,176,872.55	3,176,872.55
利率敏感度缺口	-	-	-	92,827,812.88	-	505,520.00	409,730,780.92	503,064,113.80
上年度末	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2014年12月31日	内		-1年				
资产							
银行存款	-	-	-	344,407.53	-	-	344,407.53
结算备付金	-	-	-	46,716,031.08	-	-	46,716,031.08
存出保证金	-	-	-	515,910.11	-	-	515,910.11
交易性金融资产	-	-	-	10,647,360.00	-	-900,234,856.71	910,882,216.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-10,077,822.58	10,077,822.58
应收利息	-	-	-	-	-	498,966.06	498,966.06
应收申购款	-	-	-	71,570.58	-	-8,076,112.83	8,147,683.41
资产总计	-	-	-	58,295,279.30	-	-918,887,758.18	977,183,037.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-18,032,821.41	18,032,821.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-1,121,290.38	1,121,290.38
应付托管费	-	-	-	-	-	-186,881.75	186,881.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	-2,219,387.31	2,219,387.31
其他负债	-	-	-	-	-	-460,755.73	460,755.73
负债总计	-	-	-	-	-	-22,021,136.58	22,021,136.58
利率敏感度缺口	-	-	-	-58,295,279.30	-	-896,866,621.60	955,161,900.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.10%(2014 年 12 月 31 日：1.11%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中现金或到期日在一年期以内的国债的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)

指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	399,119,195.46	79.34	900,234,856.71	94.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	399,119,195.46	79.34	900,234,856.71	94.25

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（见附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	增加 32,128,752.52	增加 67,384,015.34
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	减少 32,128,752.52	减少 67,384,015.34	

#### 7.4.14 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371,224,118.56元，属于第二层次的余额为18,270,131.10元，属于第三层次的余额为10,130,465.80元(2014年12月31日：第一层次894,742,216.71元，第二层次

16,140,000.00元，无第三层次)。

(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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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	10,130,465.80
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>10,130,465.80</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>-17,716,729.43</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	399,119,195.46	78.84
	其中：股票	399,119,195.46	78.84
2	固定收益投资	505,520.00	0.10
	其中：债券	505,520.00	0.10
	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	92,010,623.31	18.18
7	其他各项资产	14,605,647.58	2.89
8	合计	506,240,986.35	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	-	-
B	采矿业	10,103,520.00	2.01
C	制造业	234,098,056.42	46.53
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	27,882,710.04	5.54
G	交通运输、仓储和邮政业	30,484,613.72	6.06
H	住宿和餐饮业	1,605,289.60	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,640,250.60	3.51
J	金融业	40,021,580.47	7.96



K	房地产业	22,551,712.61	4.48
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	5,133,057.60	1.02
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	9,598,404.40	1.91
S	综合	-	-
	合计	399,119,195.46	79.34

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002531	天顺风能	2,352,778	32,350,697.50	6.43
2	600867	通化东宝	1,114,525	30,281,644.25	6.02
3	000963	华东医药	340,199	27,882,710.04	5.54
4	600816	安信信托	779,097	17,740,038.69	3.53
5	002026	山东威达	996,821	17,563,986.02	3.49
6	002557	洽洽食品	935,769	17,517,595.68	3.48
7	601998	中信银行	2,376,965	17,161,687.30	3.41
8	000089	深圳机场	1,895,192	15,464,766.72	3.07
9	601021	春秋航空	246,227	15,019,847.00	2.99
10	600172	黄河旋风	581,802	14,725,408.62	2.93
11	601233	桐昆股份	1,007,697	13,251,215.55	2.63
12	300137	先河环保	628,619	13,169,568.05	2.62
13	600271	航天信息	171,330	12,244,955.10	2.43
14	600521	华海药业	471,701	11,976,488.39	2.38
15	300028	金亚科技	834,470	10,130,465.80	2.01
16	600028	中国石化	2,037,000	10,103,520.00	2.01
17	000538	云南白药	132,750	9,640,305.00	1.92
18	000042	中洲控股	452,015	9,451,633.65	1.88
19	002131	利欧股份	425,868	8,304,426.00	1.65
20	002354	天神娱乐	86,372	8,289,984.56	1.65
21	000716	黑芝麻	475,900	8,099,818.00	1.61

22	600048	保利地产	741,279	7,887,208.56	1.57
23	300160	秀强股份	192,900	7,725,645.00	1.54
24	300291	华录百纳	216,299	7,700,244.40	1.53
25	300136	信维通信	249,746	7,379,994.30	1.47
26	002657	中金金财	80,645	6,450,793.55	1.28
27	300242	明家科技	120,600	6,025,176.00	1.20
28	000807	云铝股份	735,300	5,286,807.00	1.05
29	600158	中体产业	199,880	5,212,870.40	1.04
30	002033	丽江旅游	291,651	5,133,057.60	1.02
31	601169	北京银行	486,216	5,119,854.48	1.02
32	000060	中金岭南	338,943	4,755,370.29	0.95
33	002236	大华股份	99,033	3,654,317.70	0.73
34	300017	网宿科技	36,000	2,159,640.00	0.43
35	002739	万达院线	15,818	1,898,160.00	0.38
36	600754	锦江股份	31,280	1,605,289.60	0.32
37	000555	神州信息	17,330	729,593.00	0.15
38	300450	先导智能	79	7,851.81	0.00
39	300302	同有科技	95	6,882.75	0.00
40	300376	易事特	57	2,736.57	0.00
41	300379	东方通	16	1,963.04	0.00
42	002076	雪莱特	79	1,424.37	0.00
43	002350	北京科锐	70	1,423.10	0.00
44	300287	飞利信	77	1,393.70	0.00
45	002117	东港股份	16	736.32	0.00

## 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	002531	天顺风能	94,852,283.06	9.93
2	601021	春秋航空	84,283,406.14	8.82
3	300291	华录百纳	75,065,336.78	7.86
4	000042	中洲控股	71,666,771.35	7.50
5	000963	华东医药	67,894,982.76	7.11
6	600037	歌华有线	63,284,340.74	6.63
7	600029	南方航空	63,106,917.44	6.61

8	600115	东方航空	61,482,215.84	6.44
9	000488	晨鸣纸业	59,933,071.31	6.27
10	000538	云南白药	56,211,597.78	5.89
11	601377	兴业证券	52,714,408.13	5.52
12	601998	中信银行	47,977,219.00	5.02
13	600048	保利地产	46,576,155.89	4.88
14	601166	兴业银行	45,529,710.62	4.77
15	002038	双鹭药业	45,130,445.70	4.72
16	601318	中国平安	44,479,562.59	4.66
17	000555	神州信息	43,168,849.99	4.52
18	601169	北京银行	40,975,594.78	4.29
19	600172	黄河旋风	40,942,680.49	4.29
20	600521	华海药业	39,618,979.05	4.15
21	600406	国电南瑞	38,075,509.53	3.99
22	600376	首开股份	38,001,042.00	3.98
23	000800	一汽轿车	34,570,833.00	3.62
24	000524	岭南控股	34,220,402.24	3.58
25	000712	锦龙股份	34,050,306.55	3.56
26	603766	隆鑫通用	33,204,959.09	3.48
27	600687	刚泰控股	33,010,024.95	3.46
28	000625	长安汽车	32,737,070.06	3.43
29	600271	航天信息	32,072,705.48	3.36
30	600158	中体产业	30,800,145.60	3.22
31	300028	金亚科技	29,135,654.02	3.05
32	600651	飞乐音响	28,835,896.08	3.02
33	600835	上海机电	28,142,278.00	2.95
34	002350	北京科锐	28,083,366.26	2.94
35	002739	万达院线	26,704,808.85	2.80
36	002216	三全食品	26,664,613.14	2.79
37	600867	通化东宝	25,592,124.76	2.68
38	002285	世联行	25,159,641.05	2.63
39	002568	百润股份	25,152,454.21	2.63
40	601688	华泰证券	24,054,558.88	2.52
41	000089	深圳机场	23,356,272.54	2.45
42	600161	天坛生物	22,555,627.18	2.36
43	002055	得润电子	22,512,100.00	2.36

44	600559	老白干酒	22,249,818.90	2.33
45	000024	招商地产	22,151,484.60	2.32
46	002279	久其软件	21,689,558.69	2.27
47	300027	华谊兄弟	21,670,058.59	2.27
48	600654	中安消	20,983,544.00	2.20
49	002657	中科金财	20,135,182.60	2.11
50	600340	华夏幸福	20,030,136.00	2.10
51	601398	工商银行	19,875,000.00	2.08
52	300251	光线传媒	19,718,542.04	2.06
53	601233	桐昆股份	19,718,530.97	2.06
54	600498	烽火通信	19,661,816.71	2.06
55	300137	先河环保	19,630,905.26	2.06
56	300017	网宿科技	19,266,703.00	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	600048	保利地产	114,978,095.22	12.04
2	601166	兴业银行	97,479,776.42	10.21
3	601021	春秋航空	88,650,873.85	9.28
4	600029	南方航空	85,615,725.19	8.96
5	002531	天顺风能	84,876,057.42	8.89
6	600115	东方航空	76,109,229.02	7.97
7	601169	北京银行	70,822,826.21	7.41
8	600036	招商银行	61,196,679.32	6.41
9	000042	中洲控股	60,025,928.05	6.28
10	300291	华录百纳	59,175,542.10	6.20
11	601318	中国平安	59,085,501.00	6.19
12	600837	海通证券	55,471,942.34	5.81
13	000488	晨鸣纸业	54,241,430.89	5.68
14	600037	歌华有线	53,887,308.63	5.64
15	600030	中信证券	53,758,872.18	5.63
16	601377	兴业证券	53,188,707.75	5.57
17	601688	华泰证券	50,392,426.04	5.28

18	600000	浦发银行	50,034,008.64	5.24
19	000024	招商地产	48,831,644.97	5.11
20	600406	国电南瑞	48,423,585.88	5.07
21	000538	云南白药	46,889,874.08	4.91
22	600015	华夏银行	46,116,510.74	4.83
23	000555	神州信息	45,197,857.14	4.73
24	603766	隆鑫通用	42,071,159.51	4.40
25	000963	华东医药	42,069,299.31	4.40
26	002038	双鹭药业	41,813,509.14	4.38
27	600651	飞乐音响	41,413,424.31	4.34
28	601668	中国建筑	41,219,507.25	4.32
29	600016	民生银行	40,831,102.32	4.27
30	600376	首开股份	38,784,194.03	4.06
31	000002	万科A	38,536,657.50	4.03
32	000540	中天城投	37,842,384.41	3.96
33	600511	国药股份	35,191,918.94	3.68
34	000800	一汽轿车	34,905,145.14	3.65
35	600687	刚泰控股	33,967,292.92	3.56
36	002216	三全食品	33,636,223.43	3.52
37	000712	锦龙股份	33,393,471.80	3.50
38	601111	中国国航	32,815,589.90	3.44
39	601998	中信银行	31,297,892.88	3.28
40	002350	北京科锐	29,785,093.82	3.12
41	000625	长安汽车	29,633,122.33	3.10
42	600158	中体产业	29,561,770.40	3.09
43	600161	天坛生物	29,080,715.27	3.04
44	600172	黄河旋风	28,511,278.72	2.98
45	002739	万达院线	28,329,066.37	2.97
46	600585	海螺水泥	27,771,555.60	2.91
47	601988	中国银行	27,115,668.30	2.84
48	600521	华海药业	27,050,664.30	2.83
49	000524	岭南控股	26,536,098.91	2.78
50	600522	中天科技	26,198,389.22	2.74
51	600835	上海机电	25,860,711.76	2.71
52	601992	金隅股份	25,832,554.76	2.70
53	600415	小商品城	24,911,462.28	2.61
54	002568	百润股份	24,465,872.66	2.56
55	601555	东吴证券	24,389,216.70	2.55

56	600153	建发股份	24,346,283.82	2.55
57	002285	世联行	23,832,715.61	2.50
58	600559	老白干酒	23,790,992.85	2.49
59	600352	浙江龙盛	23,064,014.21	2.41
60	600642	申能股份	22,678,818.07	2.37
61	002055	得润电子	21,522,091.60	2.25
62	000599	青岛双星	21,200,289.85	2.22
63	600654	中安消	20,844,093.53	2.18
64	600498	烽火通信	20,731,221.70	2.17
65	300027	华谊兄弟	20,573,213.33	2.15
66	000661	长春高新	19,833,089.63	2.08
67	300251	光线传媒	19,752,248.56	2.07
68	601333	广深铁路	19,440,818.85	2.04
69	000783	长江证券	19,293,653.88	2.02
70	002279	久其软件	19,129,643.30	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	3,344,483,008.95
卖出股票收入（成交）总额	4,000,791,038.34

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	505,520.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	505,520.00	0.10

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	3,000	389,520.00	0.08
2	123001	蓝标转债	1,160	116,000.00	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	817,189.57
2	应收证券清算款	13,714,904.85
3	应收股利	-
4	应收利息	37,119.52
5	应收申购款	36,433.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,605,647.58

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	389,520.00	0.08

### 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中不存在流通受限情况。

### 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
10,771	23,787.68	9,109,000.01	3.56%	247,108,063.90	96.44%

## 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	401,078.73	0.1565%

## 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	0-10
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 ( 2006 年 9 月 27 日 ) 基金份额总额	1,436,388,715.89
本报告期期初基金份额总额	569,493,244.64
本报告期基金总申购份额	305,813,734.10
减:本报告期基金总赎回份额	619,089,914.83
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	256,217,063.91

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 5 月 23 日,基金管理人发布公告,王春先生不再担任本基金基金经理,由王品女士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	
国泰君安	1	12,087,861,480.64	28.42%	1,913,513.25	28.38%	-
兴业证券	1	1,955,997,207.71	26.63%	1,798,215.81	26.67%	-
国金证券	1	748,564,338.03	10.19%	681,493.33	10.11%	-
国信证券	1	716,654,067.74	9.76%	663,387.23	9.84%	-
光大证券	1	430,568,508.93	5.86%	392,417.02	5.82%	-
安信证券	1	421,246,322.66	5.73%	383,501.29	5.69%	-
中金公司	1	370,882,656.86	5.05%	343,591.12	5.10%	-
浙商证券	1	336,728,419.17	4.58%	313,593.83	4.65%	-
中信建投	1	216,933,750.23	2.95%	198,394.74	2.94%	-
华泰证券	1	59,787,145.32	0.81%	54,430.08	0.81%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
合计		127,345,223,897.29	100.00%	6,742,537.70	100.00%	-

1、报告期内无增加的交易单元，减少深圳交易单元山西证券。

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

- 实力雄厚，信誉良好；
- 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；
- 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；
- 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；
- 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：

- 研究报告的数量和质量；
- 提供研究服务的主动性；
- 资讯提供的及时性及便利性；
- 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	716,154.00	88.19%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	95,858.73	11.81%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
合计	812,012.73	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月5日
2	基金 2014 年 4 季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月22日
3	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过北京展恒基金销售有限公司开展定期定额费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年1月23日
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于	本基金选定的信息	2015年1月30日

	投资者通过直销柜台认购、申购旗下基金实行费率优惠的公告	披露报纸、管理人网站	
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金开展直销柜台基金转换费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 1 月 30 日
6	汇丰晋信关于在华泰证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 3 日
7	汇丰晋信基金管理有限公司关于在中信证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 5 日
8	汇丰晋信关于在国金证券开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 9 日
9	汇丰晋信关于在中信证券(浙江)开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 2 月 9 日
10	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整基金最低转换转出份额的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
11	汇丰晋信关于在中信证券(山东)开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
12	汇丰晋信关于旗下基金通过数米基金开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 2 日
13	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金通过招商证券开展网上交易申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 13 日

14	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 17 日
15	关于汇丰晋信龙腾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	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 30 日
16	基金 2014 年年度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 31 日
17	汇丰晋信关于旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 3 月 31 日
18	汇丰晋信基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 1 日
19	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整开放式基金业务规则的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 1 日
20	汇丰晋信关于旗下基金通过工商银行开展网银申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 1 日
21	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 9 日
22	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 10 日
23	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 18 日

	告	站	
24	基金 2015 年 1 季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 4 月 21 日
25	汇丰晋信龙腾基金更新招募说明书 (2015 年第 1 号)	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 11 日
26	汇丰晋信关于旗下开放式基金通过诺亚正行 (上海) 基金销售投资顾问有限公司开展申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 11 日
27	汇丰晋信关于暂停旗下基金通过汇丰银行 (中国) 有限公司开展申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 11 日
28	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 22 日
29	汇丰晋信龙腾股票型证券投资基金基金经理变更公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 23 日
30	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 26 日
31	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 28 日
32	汇丰晋信关于通过农业银行网上银行、手机银行开展基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 5 月 30 日

33	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月9日
34	汇丰晋信关于在工商银行开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月9日
35	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月17日
36	关于防范不法人员发布虚假客服电话进行诈骗的重要提示	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月19日
37	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月20日
38	汇丰晋信关于在中金公司开通汇丰晋信旗下开放式基金转换业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月26日
39	汇丰晋信关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月29日
40	汇丰晋信关于新增东兴证券为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月29日
41	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年6月29日
42	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月1日



		站	
43	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金网费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月1日
44	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月1日
45	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月3日
46	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月7日
47	关于投资旗下基金相关事宜的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月7日
48	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月8日
49	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月9日
50	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月11日
51	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015年7月14日
52	汇丰晋信旗下基金 2015 年度第	本基金选定的信息	2015年7月18日

	二季度报告	披露报纸、管理人网站	
53	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 7 月 21 日
54	汇丰晋信关于旗下基金参加浦发银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 7 月 31 日
55	关于汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金名称变更的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 7 日
56	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 15 日
57	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 15 日
58	汇丰晋信关于旗下基金参加中金公司基金申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 19 日
59	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 22 日
60	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 25 日
61	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 26 日

62	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 28 日
63	基金 2015 半年报	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 8 月 29 日
64	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 9 月 8 日
65	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 9 月 23 日
66	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 9 月 25 日
67	汇丰晋信基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 9 月 30 日
68	汇丰晋信关于旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司开展定期定额申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 13 日
69	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 17 日
70	关于汇丰晋信旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 20 日
71	汇丰晋信关于提示基金直销客户及时更新身份证件或者身份证明	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 21 日

	文件并接受或重新接受风险承受能力调查的公告	站	
72	基金 2015 年 3 季度报告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 27 日
73	关于汇丰晋信旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 10 月 30 日
74	龙腾基金更新招募说明书(2015 年第 2 号)	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 11 月 11 日
75	汇丰晋信关于新增申万宏源西部为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 11 月 18 日
76	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过申万宏源西部开展申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 11 月 18 日
77	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过申万宏源西部证券有限公司开办汇丰晋信旗下基金定期定额投资业务的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 11 月 18 日
78	汇丰晋信基金管理有限公司关于公司董事会成员变更的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 12 月 19 日
79	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 12 月 26 日
80	汇丰晋信关于旗下基金通过平安银行开展申购费率及定期定额投	本基金选定的信息披露报纸、管理人网	2015 年 12 月 31 日

	资申购费率优惠活动的公告	站	
81	关于指数熔断机制实施后公司旗下相关类别公募基金开放时间调整的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
82	汇丰晋信关于旗下基金通过汇丰银行（中国）有限公司开展定期定额申购费率优惠的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
83	汇丰晋信旗下部分基金关于参加工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	本基金选定的信息披露报纸、管理人网站	2015 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会批准汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金设立的文件
- 2) 汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金合同
- 3) 汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金招募说明书
- 4) 汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金托管协议
- 5) 汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 6) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8) 报告期内汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 9) 中国证监会要求的其他文件

注：自 2015 年 8 月 7 日起，本基金更名为“汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金”，基金简称变更为“汇丰晋信龙腾混合”，基金股票投资比例不发生变更。

### 13.2 存放地点

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 楼本基金管理人办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司  
2016 年 3 月 29 日