

# 汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：2017 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 2017 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信低碳先锋股票
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	296,310,571.66 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</p>

	低碳经济主题的上市公司细分为两类：1) 直接从事或受益于低碳经济主题的上市公司；2) 与低碳经济主题密切相关的上市公司。
业绩比较基准	中证环保指数*90%+同业存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	陆志俊
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-152,877,633.72	434,864,622.37	75,017,651.50
本期利润	-258,461,483.17	519,114,571.84	74,022,993.20
加权平均基金份额本期利润	-0.5586	0.9058	0.1016
本期基金份额净值增长率	-23.92%	58.35%	9.52%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配基金份额利润	0.5461	0.8174	0.1777
期末基金资产净值	466,289,798.15	1,222,119,735.55	636,709,396.50
期末基金份额净值	1.5737	2.0685	1.3063

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	-5.12%	1.06%	-0.73%	0.76%	-4.39%	0.30%
过去六个月	-9.00%	1.11%	1.85%	0.86%	-10.85%	0.25%
过去一年	-23.92%	2.12%	-15.38%	1.72%	-8.54%	0.40%
过去三年	31.94%	2.29%	43.17%	1.91%	-11.23%	0.38%
过去五年	85.42%	2.08%	42.43%	1.66%	42.99%	0.42%
成立至今	71.57%	1.91%	25.39%	1.58%	46.18%	0.33%

注：

过去三个月指 2016 年 10 月 1 日—2016 年 12 月 31 日

过去六个月指 2016 年 7 月 1 日—2016 年 12 月 31 日

过去一年指 2016 年 1 月 1 日—2016 年 12 月 31 日

过去三年指 2014 年 1 月 1 日—2016 年 12 月 31 日

过去五年指 2012 年 1 月 1 日—2016 年 12 月 31 日

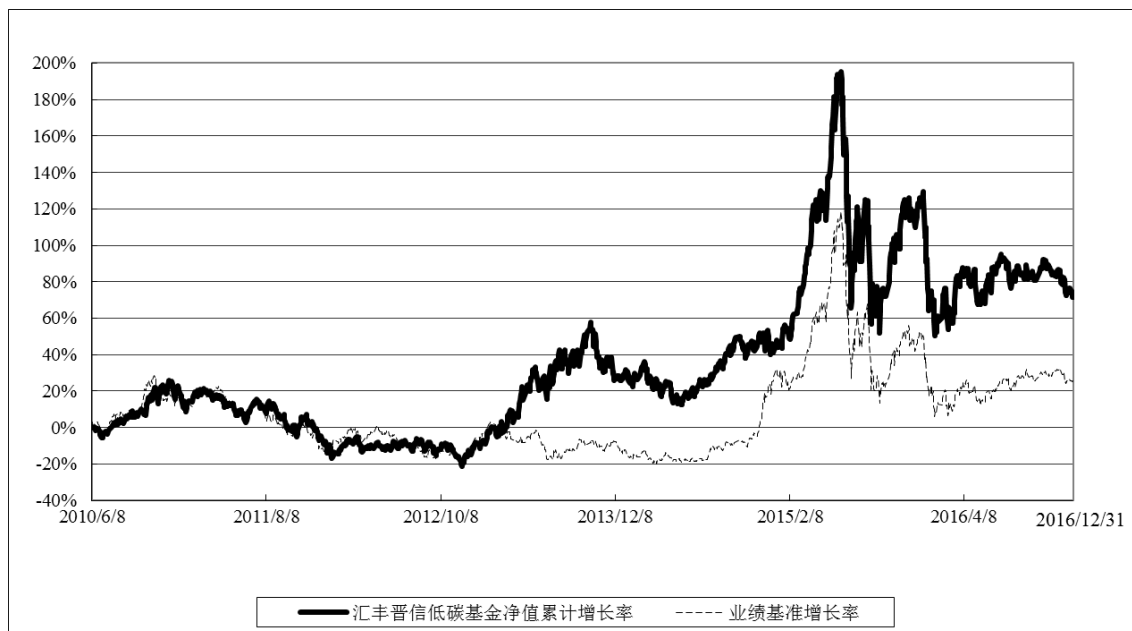
成立至今指 2010 年 6 月 8 日—2016 年 12 月 31 日

### 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 2016 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。

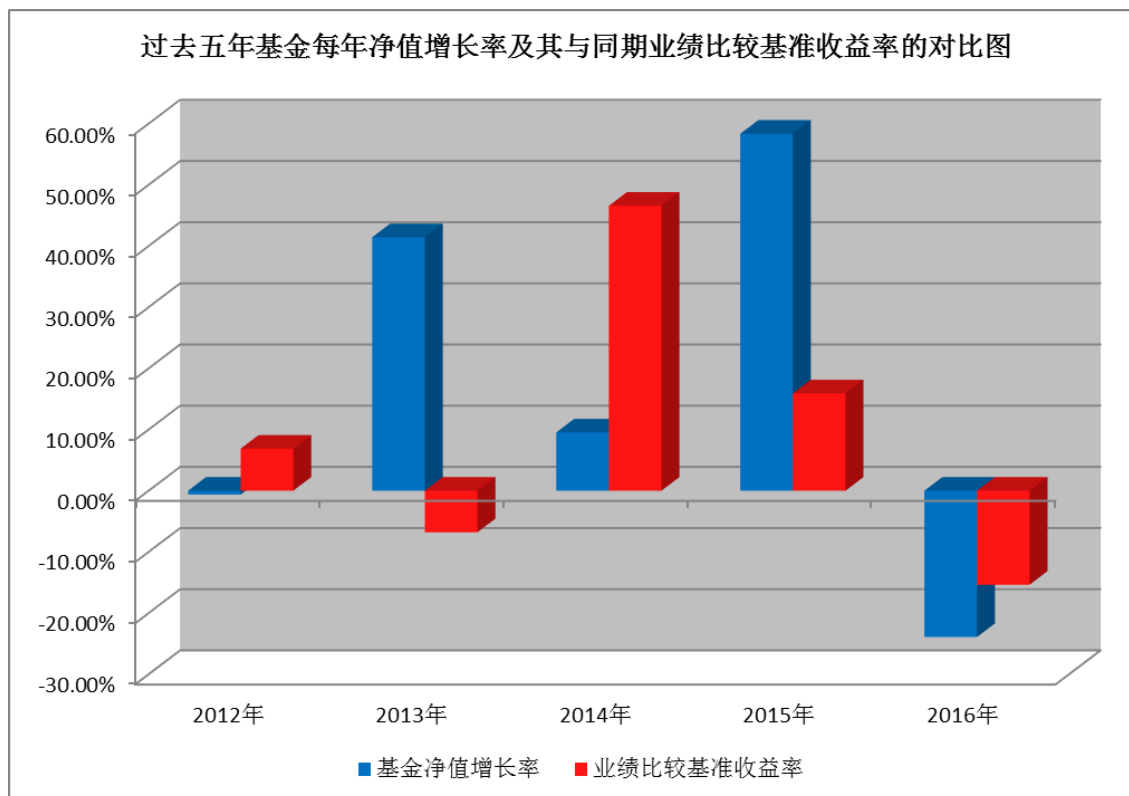
2. 基金合同生效日（2010 年 6 月 8 日）起至 2015 年 3 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数\*90% + 同业存款利率\*10%”。自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“中证环保指数\*90% + 同业存款利率（税后）\*10%”。

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

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在上海。截止 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 17 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金（2008 年 12 月 3 日成立）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、

汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011 年 7 月 27 日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 日成立）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014 年 11 月 26 日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015 年 9 月 30 日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016 年 3 月 11 日成立）和汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016 年 11 月 10 日成立）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方超	本基金基金经理	2015 年 9 月 19 日	-	9.5	曾任汇丰晋信基金管理有限公司交易员、高级交易员、交易副总监、研究员、高级研究员。现任汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理。
曹庆	副总经理、投资部总监、汇丰晋信龙腾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、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金经理	2013 年 12 月 21 日	2016 年 4 月 30 日	14	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、本基金、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金和汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金基金经理。现任汇丰晋信基金管理有限公司副总经理、投资部总监、汇丰晋信龙腾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、汇丰晋信沪港深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. 离任日期为本基金管理人公告曹庆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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

公司对公平交易的控制方法包括：1、交易所市场的公平交易均通过恒生投资交易系统实现，通过开启公平交易程序，由恒生投资交易系统强制执行；2、银行间交易由执行交易员按照价格优先、比例分配的公平交易的原则实行分配，确保各投资组合获得公平的交易机会；3、对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、使用恒生投资交易系统的公平交易分析模块，定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理

的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。公司对不同投资组合间同向交易的平均溢价率、溢价金额占投资组合平均净值百分比、正溢价率占比等指标进行专项计算分析，计算分析结果显示：以上各指标值均在合理正常的范围之内，未发现不同投资组合间相近交易日内的同向交易存在不公平及存在利益输送的行为。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或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

2016 年的 A 股市场基本呈现了低开低走的状态，在年初遭遇熔断大幅指数大幅下挫之后，之后基本维持低位反复震荡的状态，期间虽有一定程度的热点板块轮动局面，但整体机会比较缺乏，市场波动幅度不断减小，成交活跃程度也在不断走低。全年来看上证综合指数下跌了 12.3%，深成指下跌了 19.6%，创业板综合指数更是下跌了 20.3%。从行业指数上更能看出市场在面临风险时对于安全性和确定性的偏好，食品饮料作为最传统的防御性板块全年上涨了 7.5%，家电板块作为业绩成长较为确定的板块之一上涨了 1.7%，银行板块上涨了 0.6%，同时供给侧改革的代表煤炭板块全年也小幅上涨 0.3%，除此之外所有板块均为下跌。其中成长板块的典型代表传媒和计算机板块的跌幅均在 36% 左右，同时餐饮旅游，交通运输和国防军工等行业的跌幅也都在 20% 以上。

在过去一年的投资过程中，本基金恪守了基金契约要求，维持了高仓位高弹性的股票型基金特征，坚持以低碳领域为主要投资方向，积极在新能源、新能源汽车、节能环保等行业上挖掘具有投资价值的个股标的。经历年初的熔断之后，本基金在上半年的市场中及时把握了电力设备和新能源汽车的板块行情，获取了一定的相对收益，但在下半年的市场中随着市场波动性不断降低，所集中关注的行业板块又都处于市场风险不偏好的成长股和中小盘风格上，整体表现一般。

#### 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-23.92%，同期业绩比较基准变动幅度为-15.38%，本基金落后业绩比较基准 8.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年的宏观经济，从相关的前瞻性指标来看，我国的经济形式已经有所企稳，目前预计企业盈利改善的趋势有望持续至一季度末。内生增长的角度来看，政府持续积极推进供给侧改革，通过淘汰落后产能的方式改善供需格局的方式，尽管短期内可能使经济遭遇阵痛，但有助于不断提升中长期经济健康成长的动能和潜力。从外延扩张的角度来看，我国一带一路战略的不断推进，有助于缓解国内需求增长不快的压力，积极寻求其他国家相关的增长机会。目前预计 2017 年中国经济增长增速维持稳定，全年 GDP 的增长基本有望保持在 6.5%附近。

从流动性来看，受制于高房价、汇率贬值的压力以及物价上行压力，今年的整体货币政策预计保持中性，进一步宽松的可能性已经受限，甚至不排除国内的货币政策进入实质紧缩阶段的可能。国际环境上来看，美联储近期不断明确了加息的预期，认为加息是收紧金融环境的最佳方法，同时美联储主席还表示在加息走上正轨之后将缩减其资产负债表，这一表态无疑将进一步导致全球性的货币政策的收紧。

近一阶段以来，随着油价的触底反弹，低碳相关领域的一些行业的关注度持续回升，同时随着市场对于油价上行的共识越来越高，新能源和新能源汽车领域的关注度将不断提升。中国是过去两年低油价周期的最大受益者，因此也有可能再次成为未来高油价的受害者，越来越多的购油外汇消耗便是其中最为明显和直接的一项。应对这一问题，治标的解决方法是积极加大对于海外油气资产的收购，但最根本的解决我国对外能源依赖问题的方法是而且只有是不断加大对于新能源和新能源汽车产业的发展，而且这也是解决我国目前越来越严重的雾霾问题的根本方法。除了行业发展前景的进一步清晰，行业的估值水平也随着市场的调整逐渐回归了正常，很多新兴领域的成长板块个股的估值水平均已经回到历史平均水平的位置，而当前行业发展趋势的确定性和景气度都远远高于当时的状况，新兴产业的投资机会正在逐渐显现。低碳基金将继续专注于天然气、新能源和新能源汽车等低碳核心领域，通过不断积极挖掘具有行业景气度和估值合理性的优质标的进行长期投资来获取收益。

#### 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贯彻和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

#### 五、督察长

监督和检查公司关于估值各项工作的贯彻和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。

1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、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**

2016 年度，基金托管人在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

2016 年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 年度，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20056 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	<p>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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
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	2017 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	643,250.69	39,567.74
结算备付金		59,085,319.43	107,404,368.78
存出保证金		767,318.45	902,759.60
交易性金融资产	7.4.7.2	441,156,863.32	1,140,412,891.31
其中：股票投资		441,156,863.32	1,140,412,891.31
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,987.26	38,673.98
应收股利		-	-
应收申购款		124,568.84	936,837.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		501,793,307.99	1,249,735,099.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015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		-	16,755,247.71
应付赎回款		32,403,508.59	3,879,313.05
应付管理人报酬		648,557.57	1,431,000.70
应付托管费		108,092.93	238,500.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,820,937.19	4,906,430.11
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	522,413.56	404,872.07
负债合计		35,503,509.84	27,615,363.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	296,310,571.66	590,811,196.04
未分配利润	7.4.7.10	169,979,226.49	631,308,539.51
所有者权益合计		466,289,798.15	1,222,119,735.55
负债和所有者权益总计		501,793,307.99	1,249,735,099.31

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5737 元，基金份额总额 296,310,571.66 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-217,288,845.14	554,718,304.37
1. 利息收入		998,581.78	1,432,458.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	998,581.78	1,408,285.77
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
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-113,876,628.38	466,465,768.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-118,331,436.34	462,179,484.04
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	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,454,807.96	4,286,284.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-105,583,849.45	84,249,949.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,173,050.91	2,570,128.08
<b>减：二、费用</b>		41,172,638.03	35,603,732.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,471,975.75	16,031,631.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,911,996.06	2,671,938.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	27,369,162.12	16,491,102.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	419,504.10	409,060.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-258,461,483.17	519,114,571.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-258,461,483.17	519,114,571.84

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	590,811,196.04	631,308,539.51	1,222,119,735.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-258,461,483.17	-258,461,483.17
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）	-294,500,624.38	-202,867,829.85	-497,368,454.23
其中：1. 基金申购款	274,501,363.42	166,551,826.55	441,053,189.97
2. 基金赎回款	-569,001,987.80	-369,419,656.40	-938,421,644.20
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）	296,310,571.66	169,979,226.49	466,289,798.15
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王栋	_____ 赵琳	_____ 杨洋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]471号《关于核准汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金募集的批复》核准,由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集666,375,731.65元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所有限公司”)KPMG-B(2010)CR No. 0032验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为666,460,299.86份基金份额,其中认购资金利息折合84,568.21份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具,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2017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 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内, 本报告所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度财务报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1)2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。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金融投资控股集团有限公司控制。

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

③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

本基金在本年度与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,471,975.75	16,031,631.17
其中：支付销售机构的客户维护费	2,602,622.98	3,433,730.05

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,911,996.06	2,671,938.56

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

本基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未投资过本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末与上年末均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	643,250.69	3,797.37	39,567.74	26,999.17

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 2016 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(2015 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	2,244	51,971.04	51,971.04	-
603689	皖天	2016 年	2017 年	新股流	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-



	然气	12月30日	1月10日	通受限						
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

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，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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
600875	东方	2016	重大	10.79	2017年03	10.90	800,000	8,404,773.34	8,632,000.00	-

	电气	年 12 月 9 日	事项		月 28 日				
--	----	---------------	----	--	--------	--	--	--	--

注：本基金截至 2016 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 2016 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 432,070,879.60 元，属于第二层次的余额为 9,085,983.72 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,107,559,424.31 元，第二层次 30,888,608.00 元，第三层次 1,964,859.00 元)。

###### (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
2016 年 1 月 1 日	1,964,859.00
购买	-
出售	-
转入第三层次	-
转出第三层次	1,377,343.50
当期利得或损失总额	
——计入损益的利得或损失	587,515.50
2016 年 12 月 31 日	<u>-</u>
2016 年 12 月 31 日仍持有的资产	
计入 2016 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	<u>-</u>
	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在对应证券复牌前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 2016 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(2015 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	441,156,863.32	87.92
	其中：股票	441,156,863.32	87.92
2	基金投资		
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	59,728,570.12	11.90
8	其他资产	907,874.55	0.18
9	合计	501,793,307.99	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	369,300,039.75	79.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,471,617.66	8.04
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	18,422,958.68	3.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	234,875.00	0.05
J	金融业	106,780.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,605,000.00	3.35
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	441,156,863.32	94.61

## 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	600116	三峡水利	3,200,000	30,240,000.00	6.49

2	000957	中通客车	1,500,000	23,805,000.00	5.11
3	300037	新宙邦	450,000	22,185,000.00	4.76
4	300014	亿纬锂能	700,000	20,440,000.00	4.38
5	300064	豫金刚石	1,800,000	20,430,000.00	4.38
6	002108	沧州明珠	1,000,000	20,370,000.00	4.37
7	002460	赣锋锂业	700,000	18,557,000.00	3.98
8	002466	天齐锂业	550,000	17,847,500.00	3.83
9	300073	当升科技	400,000	17,228,000.00	3.69
10	600686	金龙汽车	1,150,000	16,341,500.00	3.50

## 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	002466	天齐锂业	139,985,375.43	11.45
2	600116	三峡水利	129,356,600.75	10.58
3	002460	赣锋锂业	121,702,793.29	9.96
4	000957	中通客车	117,856,532.72	9.64
5	002108	沧州明珠	116,473,434.81	9.53
6	600900	长江电力	116,073,588.48	9.50
7	600240	华业资本	111,103,973.57	9.09
8	300037	新宙邦	108,531,310.65	8.88
9	002224	三力士	100,540,387.16	8.23
10	600884	杉杉股份	98,935,972.14	8.10
11	002357	富临运业	93,541,682.38	7.65
12	300014	亿纬锂能	91,170,739.56	7.46
13	002196	方正电机	88,078,129.26	7.21
14	000826	启迪桑德	81,636,262.17	6.68
15	002586	围海股份	80,185,909.43	6.56
16	600366	宁波韵升	79,455,097.86	6.50
17	002074	国轩高科	77,944,072.41	6.38
18	000559	万向钱潮	76,703,650.90	6.28
19	600699	均胜电子	76,307,743.77	6.24
20	300197	铁汉生态	74,716,729.61	6.11

21	000909	数源科技	72,567,854.65	5.94
22	002364	中恒电气	70,743,753.80	5.79
23	600418	江淮汽车	69,125,815.70	5.66
24	300224	正海磁材	64,679,165.27	5.29
25	600068	葛洲坝	63,513,462.03	5.20
26	600803	新奥股份	62,582,323.13	5.12
27	002407	多氟多	61,066,542.31	5.00
28	300068	南都电源	60,553,465.87	4.95
29	300073	当升科技	60,431,252.61	4.94
30	000049	德赛电池	60,173,279.70	4.92
31	000988	华工科技	59,714,092.47	4.89
32	600303	曙光股份	59,711,574.12	4.89
33	002055	得润电子	59,252,039.93	4.85
34	002009	天奇股份	59,184,947.16	4.84
35	600100	同方股份	57,415,735.36	4.70
36	002008	大族激光	52,998,260.34	4.34
37	601766	中国中车	52,839,968.66	4.32
38	002454	松芝股份	52,302,139.47	4.28
39	300064	豫金刚石	51,673,961.46	4.23
40	002284	亚太股份	51,083,866.39	4.18
41	002070	众和股份	50,349,886.57	4.12
42	002298	中电鑫龙	50,301,101.96	4.12
43	600104	上汽集团	50,063,962.62	4.10
44	002230	科大讯飞	49,915,506.88	4.08
45	300100	双林股份	49,483,063.19	4.05
46	600110	诺德股份	49,279,972.61	4.03
47	600651	飞乐音响	48,293,454.23	3.95
48	300070	碧水源	47,449,418.59	3.88
49	600135	乐凯胶片	47,196,863.58	3.86
50	600505	西昌电力	46,288,583.91	3.79
51	002176	江特电机	46,141,975.67	3.78
52	000598	兴蓉环境	45,193,459.97	3.70
53	600875	东方电气	44,943,527.93	3.68
54	601777	力帆股份	44,542,906.38	3.64
55	300190	维尔利	44,036,692.70	3.60
56	600580	卧龙电气	43,358,780.13	3.55

57	600958	东方证券	42,765,090.66	3.50
58	300376	易事特	42,636,551.94	3.49
59	002446	盛路通信	42,534,441.50	3.48
60	002366	台海核电	42,260,067.83	3.46
61	000768	中航飞机	42,204,036.62	3.45
62	600841	上柴股份	41,583,957.27	3.40
63	600686	金龙汽车	41,561,565.43	3.40
64	000960	锡业股份	41,232,278.61	3.37
65	600886	国投电力	40,844,467.64	3.34
66	600848	上海临港	40,643,761.39	3.33
67	600461	洪城水业	39,837,323.23	3.26
68	000951	中国重汽	39,671,681.12	3.25
69	000400	许继电气	38,974,966.44	3.19
70	300212	易华录	38,662,964.78	3.16
71	601688	华泰证券	38,588,840.79	3.16
72	002405	四维图新	38,255,258.38	3.13
73	002448	中原内配	37,914,497.85	3.10
74	603601	再升科技	37,784,959.06	3.09
75	002594	比亚迪	36,592,248.56	2.99
76	002546	新联电子	36,547,213.64	2.99
77	600131	岷江水电	36,204,892.86	2.96
78	300140	启源装备	36,194,763.82	2.96
79	000958	东方能源	35,821,632.16	2.93
80	002709	天赐材料	35,542,570.83	2.91
81	600292	远达环保	35,506,491.46	2.91
82	600893	中航动力	35,439,351.61	2.90
83	600500	中化国际	35,217,649.15	2.88
84	000738	中航动控	34,824,370.62	2.85
85	600416	湘电股份	34,751,746.57	2.84
86	002249	大洋电机	34,736,256.12	2.84
87	300055	万邦达	34,432,561.67	2.82
88	600549	厦门钨业	34,405,497.36	2.82
89	600995	文山电力	34,040,438.23	2.79
90	601158	重庆水务	33,937,530.80	2.78
91	002081	金螳螂	33,628,599.78	2.75
92	601727	上海电气	33,290,493.41	2.72



93	600885	宏发股份	33,220,596.31	2.72
94	600522	中天科技	33,144,050.81	2.71
95	600118	中国卫星	32,525,600.49	2.66
96	300020	银江股份	31,832,603.50	2.60
97	300284	苏交科	31,591,054.00	2.58
98	601088	中国神华	31,568,781.10	2.58
99	603993	洛阳钼业	30,598,637.16	2.50
100	600391	成发科技	30,490,117.49	2.49
101	600066	宇通客车	30,398,583.72	2.49
102	601139	深圳燃气	30,020,323.11	2.46
103	000567	海德股份	29,743,078.29	2.43
104	300021	大禹节水	29,672,756.97	2.43
105	600166	福田汽车	28,917,848.58	2.37
106	002013	中航机电	28,758,068.36	2.35
107	600970	中材国际	28,656,726.01	2.34
108	600406	国电南瑞	28,505,988.41	2.33
109	002221	东华能源	28,281,334.22	2.31
110	002658	雪迪龙	28,250,802.69	2.31
111	000605	渤海股份	28,210,413.80	2.31
112	002200	云投生态	28,173,074.31	2.31
113	002011	盾安环境	27,580,168.27	2.26
114	600787	中储股份	27,545,307.00	2.25
115	300263	隆华节能	27,353,680.33	2.24
116	300227	光韵达	27,329,934.71	2.24
117	002664	信质电机	27,224,037.15	2.23
118	300187	永清环保	27,078,021.06	2.22
119	300012	华测检测	27,035,943.74	2.21
120	002245	澳洋顺昌	26,864,502.00	2.20
121	600008	首创股份	26,643,682.36	2.18
122	600621	华鑫股份	26,578,368.92	2.17
123	600979	广安爱众	26,351,079.56	2.16
124	600590	泰豪科技	26,332,945.09	2.15
125	300161	华中数控	26,253,318.02	2.15
126	600006	东风汽车	26,213,959.63	2.14
127	601669	中国电建	26,050,762.09	2.13
128	002580	圣阳股份	25,822,087.45	2.11

129	002088	鲁阳节能	25,709,630.72	2.10
130	300217	东方电热	25,546,241.24	2.09
131	603766	隆鑫通用	25,542,970.92	2.09
132	000970	中科三环	25,409,440.82	2.08
133	300422	博世科	25,261,983.07	2.07
134	002421	达实智能	25,198,845.08	2.06
135	600030	中信证券	24,941,991.44	2.04
136	603100	川仪股份	24,667,002.57	2.02
137	000555	神州信息	24,520,507.46	2.01

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600116	三峡水利	221,957,782.69	18.16
2	600240	华业资本	154,391,811.21	12.63
3	002466	天齐锂业	125,004,120.57	10.23
4	600900	长江电力	113,430,350.74	9.28
5	600884	杉杉股份	112,852,354.08	9.23
6	600366	宁波韵升	110,432,623.67	9.04
7	000957	中通客车	104,728,926.54	8.57
8	601777	力帆股份	102,025,278.56	8.35
9	002108	沧州明珠	101,746,626.39	8.33
10	002224	三力士	101,194,108.37	8.28
11	002460	赣锋锂业	101,163,524.54	8.28
12	002357	富临运业	99,684,877.12	8.16
13	002421	达实智能	96,177,896.68	7.87
14	002546	新联电子	93,462,339.51	7.65
15	002196	方正电机	91,280,935.93	7.47
16	300037	新宙邦	83,153,954.82	6.80
17	002074	国轩高科	82,674,105.17	6.76
18	002586	围海股份	81,863,903.32	6.70
19	603601	再升科技	81,157,588.93	6.64
20	300187	永清环保	80,873,411.09	6.62
21	600699	均胜电子	80,549,480.99	6.59

22	300197	铁汉生态	79,935,635.78	6.54
23	600135	乐凯胶片	75,773,282.81	6.20
24	002200	云投生态	75,424,183.90	6.17
25	000559	万向钱潮	75,076,026.14	6.14
26	000909	数源科技	74,093,064.44	6.06
27	300014	亿纬锂能	73,399,958.92	6.01
28	002364	中恒电气	71,998,337.84	5.89
29	300068	南都电源	70,651,813.04	5.78
30	000826	启迪桑德	70,010,847.79	5.73
31	600418	江淮汽车	65,598,727.89	5.37
32	300224	正海磁材	65,517,252.40	5.36
33	600068	葛洲坝	65,475,598.09	5.36
34	002407	多氟多	65,148,586.83	5.33
35	600303	曙光股份	64,592,120.78	5.29
36	002055	得润电子	62,451,029.61	5.11
37	600580	卧龙电气	59,326,678.68	4.85
38	000049	德赛电池	58,038,010.96	4.75
39	600100	同方股份	56,484,336.15	4.62
40	600803	新奥股份	56,154,788.78	4.59
41	000920	南方汇通	55,741,911.10	4.56
42	002008	大族激光	53,509,034.49	4.38
43	300070	碧水源	52,741,517.79	4.32
44	000988	华工科技	52,644,914.30	4.31
45	600131	岷江水电	52,522,322.37	4.30
46	300073	当升科技	51,767,129.78	4.24
47	002284	亚太股份	51,072,677.41	4.18
48	600104	上汽集团	50,893,222.65	4.16
49	002454	松芝股份	50,697,095.17	4.15
50	601766	中国中车	50,171,459.12	4.11
51	002070	众和股份	49,804,668.80	4.08
52	300100	双林股份	49,571,038.05	4.06
53	002230	科大讯飞	49,504,890.54	4.05
54	600505	西昌电力	48,507,777.15	3.97
55	002298	中电鑫龙	47,207,022.27	3.86
56	002009	天奇股份	46,364,703.86	3.79
57	600651	飞乐音响	46,049,215.87	3.77
58	600958	东方证券	45,975,942.69	3.76
59	300227	光韵达	45,515,290.92	3.72

60	000598	兴蓉环境	44,664,792.32	3.65
61	300376	易事特	44,568,937.52	3.65
62	600841	上柴股份	41,977,378.76	3.43
63	600110	诺德股份	41,283,909.13	3.38
64	600461	洪城水业	41,207,079.20	3.37
65	600886	国投电力	40,803,508.30	3.34
66	000768	中航飞机	40,460,721.94	3.31
67	000960	锡业股份	40,318,709.42	3.30
68	002446	盛路通信	40,248,833.54	3.29
69	300190	维尔利	40,044,106.86	3.28
70	000951	中国重汽	39,820,532.92	3.26
71	002405	四维图新	39,504,410.73	3.23
72	300140	启源装备	39,014,058.84	3.19
73	002176	江特电机	38,561,300.10	3.16
74	300212	易华录	37,720,918.97	3.09
75	600848	上海临港	37,150,596.83	3.04
76	002081	金螳螂	37,081,572.62	3.03
77	601688	华泰证券	37,045,239.65	3.03
78	002448	中原内配	36,574,247.00	2.99
79	600292	远达环保	36,525,527.24	2.99
80	600522	中天科技	36,146,323.39	2.96
81	002366	台海核电	36,039,210.47	2.95
82	600875	东方电气	35,982,231.46	2.94
83	600549	厦门钨业	35,689,053.86	2.92
84	000958	东方能源	35,543,079.17	2.91
85	600323	瀚蓝环境	35,403,676.27	2.90
86	000738	中航动控	35,126,345.57	2.87
87	600893	中航动力	34,908,858.54	2.86
88	601158	重庆水务	34,180,933.76	2.80
89	002594	比亚迪	34,110,291.55	2.79
90	300055	万邦达	33,772,644.55	2.76
91	300263	隆华节能	33,106,520.00	2.71
92	600885	宏发股份	32,577,321.16	2.67
93	002249	大洋电机	32,511,813.71	2.66
94	600995	文山电力	32,472,293.91	2.66
95	600621	华鑫股份	32,315,354.08	2.64
96	600391	成发科技	32,185,738.04	2.63
97	600118	中国卫星	32,035,667.06	2.62

98	601727	上海电气	31,787,661.55	2.60
99	000567	海德股份	31,703,698.60	2.59
100	300021	大禹节水	31,581,155.04	2.58
101	601088	中国神华	31,432,868.31	2.57
102	600168	武汉控股	31,371,688.13	2.57
103	300284	苏交科	30,772,200.25	2.52
104	601139	深圳燃气	30,759,213.50	2.52
105	002402	和而泰	30,280,221.18	2.48
106	603993	洛阳钼业	30,200,349.85	2.47
107	300064	豫金刚石	30,118,619.58	2.46
108	002664	信质电机	30,085,817.94	2.46
109	002221	东华能源	29,962,589.40	2.45
110	002178	延华智能	29,590,684.93	2.42
111	600066	宇通客车	29,466,770.78	2.41
112	000605	渤海股份	29,424,652.75	2.41
113	002658	雪迪龙	29,416,941.94	2.41
114	002013	中航机电	29,241,057.33	2.39
115	300105	龙源技术	29,154,084.82	2.39
116	002011	盾安环境	28,612,587.98	2.34
117	600008	首创股份	28,610,587.90	2.34
118	600970	中材国际	28,498,046.64	2.33
119	300020	银江股份	28,120,364.81	2.30
120	600166	福田汽车	27,942,628.90	2.29
121	600590	泰豪科技	26,581,834.32	2.18
122	600006	东风汽车	26,568,664.35	2.17
123	600406	国电南瑞	26,347,303.57	2.16
124	603766	隆鑫通用	26,075,002.00	2.13
125	300161	华中数控	25,983,510.35	2.13
126	300012	华测检测	25,927,022.55	2.12
127	300217	东方电热	25,908,692.90	2.12
128	002088	鲁阳节能	25,806,712.87	2.11
129	600030	中信证券	25,697,155.14	2.10
130	601669	中国电建	25,487,845.97	2.09
131	000970	中科三环	25,312,796.01	2.07
132	300422	博世科	25,213,139.18	2.06
133	300124	汇川技术	25,167,686.45	2.06
134	002580	圣阳股份	24,946,442.39	2.04
135	600686	金龙汽车	24,935,765.34	2.04

136	600500	中化国际	24,906,639.00	2.04
137	600979	广安爱众	24,870,891.03	2.04
138	601877	正泰电器	24,495,809.07	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	8,689,319,926.88
卖出股票收入（成交）总额	9,164,660,669.08

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	767,318.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,987.26
5	应收申购款	124,568.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	907,874.55

### 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
23,840	12,429.13	68,542,729.72	23.13%	227,767,841.94	76.87%

### 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	23,356.88	0.0079%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年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	590,811,196.04
本报告期基金总申购份额	274,501,363.42
减:本报告期基金总赎回份额	569,001,987.80
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	296,310,571.66

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

2016年4月30日，基金管理人发布公告，曹庆先生不再担任本基金基金经理。

经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，本公司于2017年1月12日聘任曹庆先生为公司副总经理并已正式对外发布公告。

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于 2015 年 4 月 18 日将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 100000 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 2016 年度审计费 100000 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	2	2,468,772,713.60	13.83%	2,299,162.81	13.83%	-
中信证券	1	1,933,656,667.09	10.83%	1,800,819.05	10.83%	-
安信证券	2	1,653,767,358.69	9.27%	1,540,155.52	9.27%	-
招商证券	2	1,601,089,915.05	8.97%	1,491,096.74	8.97%	-
华创证券	1	1,174,227,964.11	6.58%	1,093,559.95	6.58%	-
国金证券	1	1,144,340,505.07	6.41%	1,065,728.74	6.41%	-
川财证券	1	1,103,877,857.08	6.19%	1,028,041.72	6.19%	-
兴业证券	1	1,019,461,028.71	5.71%	949,422.43	5.71%	-
华泰证券	2	832,285,731.81	4.66%	775,105.54	4.66%	-
海通证券	1	804,513,866.59	4.51%	749,236.02	4.51%	-
申万宏源	2	733,696,053.52	4.11%	683,290.37	4.11%	-
平安证券	1	616,918,924.19	3.46%	574,537.52	3.46%	-
东方证券	1	512,262,195.71	2.87%	477,070.24	2.87%	-
东兴证券	1	498,429,135.29	2.79%	464,186.83	2.79%	-

中信建投	1	483,055,581.67	2.71%	449,869.10	2.71%	-
广发证券	1	320,646,720.49	1.80%	298,618.26	1.80%	-
光大证券	1	255,505,765.55	1.43%	237,952.11	1.43%	-
中投证券	1	190,804,151.54	1.07%	177,696.62	1.07%	-
中金公司	1	186,500,990.74	1.04%	173,688.09	1.04%	-
银河证券	1	182,898,652.55	1.02%	170,333.40	1.02%	-
西南证券	1	130,650,101.93	0.73%	121,673.89	0.73%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
合计	28	17,847,361,880.98	100.00%	16,621,244.95	100.00%	-

注：1、报告期内增加的交易单元为：西南证券、国泰君安。

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## § 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  
2017年3月29日