

汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2016 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信科技先锋股票
基金主代码	540010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	434,702,858.39份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于科技主题的优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金在股票投资的比例中必须有不少于80%的比例需投资于科技主题的股票。</p> <p>本基金所指的科技主题，主要分为两类：1) 处于信息化升级领域的上市公司；2) 科技创新类上市公司。</p> <p>本基金主要投资处于科技主题中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。在子行业的配置上，本基金将综合考虑多方面的因素。具体而言，可分为三个步骤：首先，行业研究员通过对各子行业面临的国家财政税收等政策、竞争格局、估值水平进行研判，结合各行业的发展现状及发展前景，动态调整各自所属行业投资评级和配置建议；其次，行业比较分析师综合内、外部研究资源，比较各子行业的相对投资价值，提出重点行业配置比重的建议；最后，基金经理将根据行业研究员、行业比较分析师的建议结合市场投资环境的预期与判断确定子行业的配置比重，对子行业基本面因素已出现积极变化但股票市场反应滞后的子行业进行重点配置。</p> <p>科技主题的上市公司包含很多一般意义的行业，其发展阶段也有所不同。在个股的精选上，本基金将着重选择那些产品已经过前期的技术和产业准备、下游需求在政策刺激下将大幅增长、具有良好业绩成长性的上市公司。因此，本基金将从上市公司的成长性、科技研发能力、估值水平等方面对科技主题的上市公司进行综合评价</p>
业绩比较基准	中证TMT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

	期风险和预期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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	田青
	联系电话	021-20376868	010-67595096
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20376888	010-67595096
传真		021-20376999	010-66275853

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 中国建设银行股份有限公司：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

§ 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	187,327,357.29	45,512,361.54	134,077,455.13
本期利润	204,804,953.81	490,554.70	124,601,660.42
加权平均基金份额本期利润	0.4852	0.0008	0.2448
本期基金份额净值增长率	80.14%	4.61%	48.67%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.9791	0.4057	0.1701
期末基金资产净值	1,123,781,070.36	391,149,103.54	1,197,057,917.41
期末基金份额净值	2.5852	1.4351	1.3719

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	40.40%	2.51%	29.88%	2.14%	10.52%	0.37%
过去六个月	-1.09%	3.85%	-6.23%	3.02%	5.14%	0.83%
过去一年	80.14%	3.54%	21.15%	2.73%	58.99%	0.81%
过去三年	180.15%	2.51%	65.80%	1.85%	114.35%	0.66%
自基金合同生效起至今	158.52%	2.16%	42.14%	1.66%	116.38%	0.50%

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

自基金合同生效起至今指 2011 年 7 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

汇丰晋信科技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

(2011 年 7 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：

- 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%，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 80% 以上的股票资产投资于科技主题的上市公司。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 2012 年 1 月 20 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

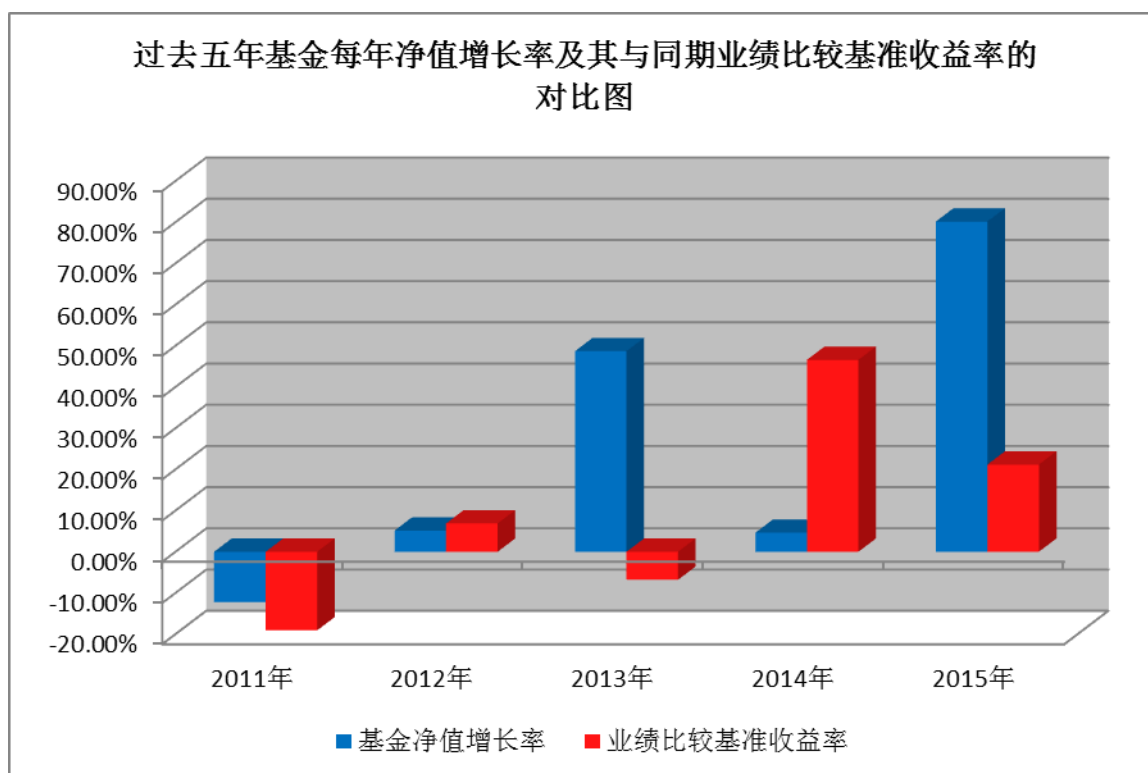
2. 基金合同生效日（2011 年 7 月 27 日）起至 2015 年 3 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数*90% + 同业存款利率*10%”。自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“中证 TMT 指数*90% + 同业存款利率（税后）*10%”。

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 指数和中证 TMT 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

3.2.3 自基金合同生效以来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

汇丰晋信科技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



注：①本基金的基金合同于 2011 年 7 月 27 日生效，截至 2015 年 12 月 31 日，基金运作未滿五年。

②本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-

2013年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

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		
陈平	本基金基金经理	2015年7月25日	-	4	陈平先生，南京大学金融学硕士。曾任南京证券研究所研究员、国金证券研究所研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员。现任本基金基金经理。
李元博	本基金基金经理	2014年6月21日	2015年7月25日	6	李元博先生，硕士研究生。曾任湘财证券有限责任公司研究员、天治基金管理有限公司研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研

					究员、本基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------

注：1. 任职日期为本基金管理人公告陈平先生、李元博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李元博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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析。公司对不同投资组合间同向交易的平均

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

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或者直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年 A 股市场总体是大起大落的行情。2014 年央行降息之后，牛市启动，上证综指从年初至 6 月高点涨幅为 60%，代表成长股的创业板涨幅则高达 170%。6 月份自证监会清查配资开始，市场开始急速下跌。经历过“股灾 1.0”和“股灾 2.0”之后，上证综指高点至年末跌幅为 32%，创业板跌幅也是 32%。2016 年开年后下跌趋势延续，全市场快速杀跌，遭遇“股灾 3.0”。

本基金坚持科技先锋基金契约规定的投资方向，主要投资在 TMT 行业的个股中。2015 年上半年牛市环境中，本基金保持了较高的仓位，主要投资方向为空间较大、未来前景较好的个股中，对估值要求不高，主要配置行业为计算机（互联网+），科技基金的年初至高点涨幅为 162%。之后的下跌过程中降低仓位并降低了高估值的计算机的配置，增加了低估值、业绩增长确定的电子等行业的配置。此后在 9 月至年末的反弹中，再次提高仓位并增加传媒和计算机的行业配置。

2015 年全年，科技基金净值上涨 80.14%，明显跑赢业绩比较基准，同时也取得了较好的正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 80.14%，同期业绩比较基准变动幅度为 21.15%，本基金领先业绩比较基准 58.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济方面：CPI 预计仍将维持低位，通胀不是主要矛盾。最新的 PMI 数据显示宏观经济增速仍然处于下行的趋势中，复苏乏力。总体流动性预计还是保持宽松，但宽松的空间有所收窄。财政政策预计会宽松以支持经济。地产、基建等支持政策逐渐见效的话，经济有望逐渐企稳。除了需求管理之外，供给侧改革正被提到越来越重要的位置。目前人民币快速贬值，外汇市场仍需保持关注。

市场方面：业绩方面，市场对经济走势预期比较一致，仍然是在缓慢下降寻底中。估值方面，10 月份反弹之后，市场估值重回高位，上涨乏力。无风险利率和风险补偿是估值的基础决定因素，与市场估值负相关。虽然流动性总体上流动性还是宽松，但宽松空间收窄，无风险利率决定的估值部分小幅下降。同时外汇市场波动引发风险偏好的快速下降（即风险补偿要求的提升）。无风险利率是稳定的，风险偏好是善变的。2015 年 9 月同样是风险偏好非常低的时候，比起 2015 年 9 月，总体估值应该更低，因此本轮下跌之后的均衡低位应该低于 2015 年 9 月附近的位置。由于总体宽松的环境不变，除非发生金融危机，否则不应过于悲观。

行业走势：基本面方面，我们仍然希望找到与处于下行趋势的宏观经济相关度不高、不依赖于外部扶持、依靠自身力量就能发展得很好、取得高成长的成长性行业和个股。TMT 中这样的行业和个股还是比较多的。具体到 TMT 的 4 个行业，传媒行业景气度较高，不少属于持续高成长的类别；计算机行业有分化，偏软偏互联网部分有新故事，业绩也具有爆发性；电子行业尚无新的产品能起到智能移动终端那种级别的拉动作用，景气度将有所下降；通信行业总体呈现收入低增长状态，利润增速尚可，重点寻找转型标的。

估值方面，目前由于市场估值体系快速下移，估值较高的成长股大幅杀跌。下跌的同时，高估值的风险也得到有效的释放，也给了再次以合适的估值去买入前景好、成长快的个股的机会。当市场企稳反弹的时候，成长股预计还将有较好的表现。

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、完整地公司各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和基金的各项公开信息。

3. 定期和不定期地向中国证监会、上海证监局、中国证券业协会和人民银行等监管机构报送各类文件报告，确保监管机构文件报备工作的准确性和及时性。

4. 加强对公司业务部门的合规监察工作，并将监察结果报告发给与相关部门主管沟通，对各项制度进行更新，提出改进建议，提请和督促业务部门进行跟踪和改善。

5. 对基金募集申请材料、市场宣传推介材料、基金代销协议、基金交易单元租用协议等文件等进行严密的事前合法合规审核，以及完成公司其他日常法律事务工作。

6. 定期为公司员工举办公司合规制度的培训，并就新颁布法律法规举办专项合规培训，向公司员工宣传合规守法的经营理念，强化公司的合规文化；对投资管理以及销售业务部门员工开展专项培训，以进一步规范和完善基金投资以及销售行为。

7. 根据监管部门的要求，定期完成监察稽核报告，报送中国证监会和公司董事会审阅；本基金管理人将继续致力于建立一个高效的内部控制体系，一贯本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益，切实保证基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下开展工作，其中：

一、基金运营部

1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。

2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。

3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。

二、基金投资部

基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。

三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

四、风险控制部

根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的贯彻和落实，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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 21317 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	汇丰晋信科技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科技先锋股票型证券投资基金(以下简称“汇丰晋信科技先锋基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是汇丰晋信科技先锋基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政

	策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述汇丰晋信科技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科技先锋基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	119,508,245.56	41,234,878.16
结算备付金		563,048.57	2,267,482.95
存出保证金		748,080.65	691,555.87
交易性金融资产	7.4.7.2	1,018,908,873.49	363,477,237.15
其中：股票投资		1,018,908,873.49	363,477,237.15
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		-	2,712,182.71
应收利息	7.4.7.5	15,844.40	8,379.15
应收股利		-	-
应收申购款		5,581,064.56	3,167,339.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,145,325,157.23	413,559,055.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		15,795,154.82	6,197,885.25
应付赎回款		3,138,310.08	12,736,592.12
应付管理人报酬		1,276,623.85	590,513.78
应付托管费		212,770.66	98,418.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	738,069.38	2,327,109.85
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	383,158.08	459,432.22
负债合计		21,544,086.87	22,409,952.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	434,702,858.39	272,565,913.03
未分配利润	7.4.7.10	689,078,211.97	118,583,190.51
所有者权益合计		1,123,781,070.36	391,149,103.54
负债和所有者权益总计		1,145,325,157.23	413,559,055.74

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5852 元，基金份额总额

434,702,858.39 份。

7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		238,525,640.96	38,554,059.14
1. 利息收入		967,091.34	743,256.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	781,389.97	729,492.42
债券利息收入		185,701.37	930.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	12,833.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		215,419,115.47	80,583,042.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	211,520,346.65	77,149,182.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-12,130.00	238,716.59
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	3,910,898.82	3,195,143.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	17,477,596.52	-45,021,806.84

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	4,661,837.63	2,249,567.76
减：二、费用		33,720,687.15	38,063,504.44
1. 管理人报酬		15,004,801.05	12,670,652.56
2. 托管费		2,500,800.08	2,111,775.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	15,813,057.36	22,834,901.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	402,028.66	446,174.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		204,804,953.81	490,554.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		204,804,953.81	490,554.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	272,565,913.03	118,583,190.51	391,149,103.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	204,804,953.81	204,804,953.81
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）	162,136,945.36	365,690,067.65	527,827,013.01
其中：1. 基金申购款	1,683,342,401.90	2,573,897,958.37	4,257,240,360.27
2. 基金赎回款	-1,521,205,456.54	-2,208,207,890.72	-3,729,413,347.26
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）	434,702,858.39	689,078,211.97	1,123,781,070.36
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		

中国证监会的相关规定)。基金的投资组合的比例为：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%，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 80%以上的股票资产投资于科技主题的上市公司。基金合同生效日(2011 年 7 月 27 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%；根据《关于汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金变更业绩比较基准以及修改基金合同的公告》，自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为：中证 TMT 指数×90%+同业存款利率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于 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》、《汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期内，本报告所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度财务报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债

券的差价收入不予征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
山西信托股份有限公司(“山西信托”)	基金管理人的股东
汇丰环球投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
山西证券股份有限公司(“山西证券”)	见注释①
中德证券有限责任公司(“中德证券”)	见注释②
汇丰银行(中国)有限公司(“汇丰银行”)	见注释③
恒生银行(中国)有限公司(“恒生银行”)	见注释④

注：①山西证券与本基金管理人的股东——山西信托共同受山西省国信投资(集团)公司控制。

②中德证券与本基金管理人的股东——山西信托共同受山西省国信投资(集团)公司控制。

③汇丰银行与本基金管理人的股东——汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

④恒生银行与本基金管理人的股东——汇丰投资管理共同受汇丰控股有限公司控制。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本年度与上年度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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,004,801.05	12,670,652.56
其中：支付销售机构的客户维护费	4,402,737.07	4,117,244.31

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1.5%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×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,500,800.08	2,111,775.51

注：支付基金托管人建设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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本年度与上年度可比期间均未投资过本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末与上年末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	119,508,245.56	691,391.92	41,234,878.16	619,576.59

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
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	741,651	32,541,284.94	37,052,883.96	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项	50.58	2016年3月10日	44.33	695,824	30,624,983.75	35,194,777.92	-
300336	新文化	2015年12月24日	重大事项	42.00	-	-	789,015	19,471,291.99	33,138,630.00	-
300028	金亚科技	2015年6月9日	重大事项	12.14	-	-	2,674,034	96,216,110.85	32,462,772.76	-
002049	同方	2015	重大	63.22	2016	54.14	469,850	17,759,223.38	29,703,917.00	-

	国芯	年 12月 11日	事项		年 3月 11日					
002465	海格通信	2015年 12月 30日	重大事项	16.69	2016年 2月 4日	15.02	552,400	7,035,422.86	9,219,556.00	-
300104	乐视网	2015年 12月 7日	重大事项	58.80	-	-	101,300	5,647,298.00	5,956,440.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为836,179,895.85元，属于第二层次的余额为150,266,204.88元，属于第三层次的余额为32,462,772.76元(2014年12月31日：第一层次317,832,398.55元，第二层次45,644,838.6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。

(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	32,462,772.76
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>32,462,772.76</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>-63,753,338.09</u>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市销率定价模型确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,018,908,873.49	88.96
	其中：股票	1,018,908,873.49	88.96
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	120,071,294.13	10.48
7	其他各项资产	6,344,989.61	0.55
8	合计	1,145,325,157.23	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	-	-
C	制造业	447,933,575.26	39.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	361,847,176.72	32.20

J	金融业	-	-
K	房地产业	30,429,097.44	2.71
L	租赁和商务服务业	44,787,670.80	3.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	133,911,353.27	11.92
S	综合	-	-
	合计	1,018,908,873.49	90.67

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	000555	神州信息	1,267,639	53,367,601.90	4.75
2	300133	华策影视	1,468,913	43,758,918.27	3.89
3	300271	华宇软件	868,299	41,226,836.52	3.67
4	600172	黄河旋风	1,601,350	40,530,168.50	3.61
5	300136	信维通信	1,290,638	38,138,352.90	3.39
6	300242	明家科技	741,651	37,052,883.96	3.30
7	002236	大华股份	985,937	36,381,075.30	3.24
8	300324	旋极信息	695,824	35,194,777.92	3.13
9	000977	浪潮信息	1,107,300	35,112,483.00	3.12
10	300251	光线传媒	1,154,500	34,969,805.00	3.11

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	000555	神州信息	222,769,342.36	56.95
2	300104	乐视网	146,220,756.04	37.38
3	300033	同花顺	144,366,233.72	36.91
4	002375	亚厦股份	140,443,275.72	35.91
5	300168	万达信息	140,429,319.65	35.90
6	300324	旋极信息	111,547,734.96	28.52
7	002285	世联行	108,184,039.38	27.66
8	300028	金亚科技	102,241,204.68	26.14
9	300271	华宇软件	101,361,384.72	25.91
10	002657	中科金财	99,568,616.90	25.46
11	300336	新文化	85,424,215.40	21.84
12	300226	上海钢联	84,513,252.96	21.61
13	002439	启明星辰	81,235,576.16	20.77
14	300253	卫宁软件	78,279,054.69	20.01
15	600172	黄河旋风	78,160,708.80	19.98
16	300207	欣旺达	75,647,101.77	19.34
17	002405	四维图新	73,347,404.86	18.75
18	600570	恒生电子	70,673,653.90	18.07
19	002184	海得控制	70,222,473.65	17.95
20	002279	久其软件	67,446,142.75	17.24
21	600498	烽火通信	62,896,162.26	16.08
22	002117	东港股份	62,438,619.45	15.96
23	002475	立讯精密	62,070,209.78	15.87
24	002344	海宁皮城	61,272,274.04	15.66
25	002251	步步高	61,113,969.21	15.62
26	002235	安妮股份	56,146,032.12	14.35
27	300352	北信源	54,131,721.46	13.84
28	002315	焦点科技	52,293,813.40	13.37
29	600728	佳都科技	51,590,822.16	13.19
30	300177	中海达	50,979,965.60	13.03
31	300133	华策影视	49,968,484.19	12.77
32	600037	歌华有线	48,969,244.84	12.52
33	600016	民生银行	48,940,387.67	12.51
34	300353	东土科技	48,728,098.67	12.46

35	002358	森源电气	46,883,803.80	11.99
36	300378	鼎捷软件	45,913,414.80	11.74
37	000831	五矿稀土	44,964,459.42	11.50
38	300234	开尔新材	44,107,643.96	11.28
39	300299	富春通信	43,836,774.12	11.21
40	300242	明家科技	43,175,877.83	11.04
41	300130	新国都	43,039,214.19	11.00
42	300257	开山股份	42,292,742.74	10.81
43	300018	中元华电	42,173,100.39	10.78
44	002151	北斗星通	41,971,147.39	10.73
45	600015	华夏银行	41,268,196.82	10.55
46	601601	中国太保	41,246,174.99	10.54
47	600476	湘邮科技	40,330,846.53	10.31
48	601818	光大银行	39,838,918.00	10.19
49	000410	沈阳机床	39,772,350.00	10.17
50	603015	弘讯科技	39,666,944.60	10.14
51	002049	同方国芯	38,826,043.07	9.93
52	300339	润和软件	38,589,676.04	9.87
53	300136	信维通信	38,480,039.00	9.84
54	002236	大华股份	38,429,924.89	9.82
55	000599	青岛双星	37,507,961.62	9.59
56	000977	浪潮信息	37,312,012.07	9.54
57	300059	东方财富	35,898,482.78	9.18
58	300017	网宿科技	35,589,314.90	9.10
59	002381	双箭股份	35,584,808.91	9.10
60	300251	光线传媒	35,549,325.60	9.09
61	002152	广电运通	35,445,516.86	9.06
62	300170	汉得信息	35,113,633.69	8.98
63	300369	绿盟科技	34,658,035.00	8.86
64	002642	荣之联	33,383,752.30	8.53
65	002268	卫士通	33,362,498.00	8.53
66	002253	川大智胜	32,334,665.78	8.27
67	002038	双鹭药业	31,933,834.91	8.16
68	600036	招商银行	31,779,680.66	8.12
69	300113	顺网科技	31,423,301.81	8.03
70	601169	北京银行	30,889,844.00	7.90

71	300295	三六五网	30,482,159.19	7.79
72	002594	比亚迪	30,420,728.80	7.78
73	300380	安硕信息	29,643,968.00	7.58
74	601398	工商银行	29,524,413.42	7.55
75	601688	华泰证券	27,410,339.99	7.01
76	600718	东软集团	27,289,146.68	6.98
77	002197	证通电子	26,678,576.61	6.82
78	002131	利欧股份	26,184,270.24	6.69
79	002655	共达电声	25,459,360.40	6.51
80	002414	高德红外	25,359,401.53	6.48
81	300078	思创医惠	25,221,736.70	6.45
82	002216	三全食品	24,092,979.00	6.16
83	300058	蓝色光标	23,820,372.40	6.09
84	002008	大族激光	23,800,296.89	6.08
85	002153	石基信息	22,391,912.20	5.72
86	300377	赢时胜	22,258,839.00	5.69
87	000816	智慧农业	21,558,416.60	5.51
88	002400	省广股份	20,892,234.28	5.34
89	002354	天神娱乐	20,013,475.23	5.12
90	300071	华谊嘉信	19,817,916.72	5.07
91	002366	台海核电	19,718,815.93	5.04
92	600391	成发科技	19,695,919.29	5.04
93	002185	华天科技	19,317,305.00	4.94
94	300101	振芯科技	19,305,297.60	4.94
95	300085	银之杰	18,743,952.00	4.79
96	002178	延华智能	18,606,240.08	4.76
97	002099	海翔药业	18,369,276.30	4.70
98	300182	捷成股份	18,250,881.00	4.67
99	600446	金证股份	18,099,660.01	4.63
100	002465	海格通信	17,701,033.15	4.53
101	002073	软控股份	17,523,714.79	4.48
102	002712	思美传媒	17,287,270.00	4.42
103	600180	瑞茂通	17,093,256.80	4.37
104	002070	众和股份	16,694,418.00	4.27
105	300212	易华录	16,476,798.23	4.21
106	300032	金龙机电	16,088,842.16	4.11

107	300246	宝莱特	15,931,578.00	4.07
108	300287	飞利信	15,783,775.60	4.04
109	002410	广联达	15,701,947.00	4.01
110	300392	腾信股份	15,333,576.50	3.92
111	600687	刚泰控股	15,266,374.00	3.90
112	600392	盛和资源	15,154,667.77	3.87
113	002739	万达院线	14,978,078.20	3.83
114	300166	东方国信	14,708,848.22	3.76
115	600986	科达股份	13,863,801.01	3.54
116	600651	飞乐音响	12,528,071.00	3.20
117	300224	正海磁材	12,286,288.10	3.14
118	002312	三泰控股	11,601,679.67	2.97
119	300083	劲胜精密	11,472,121.96	2.93
120	601233	桐昆股份	11,271,736.04	2.88
121	600571	信雅达	11,244,243.68	2.87
122	002074	国轩高科	10,696,966.10	2.73
123	000002	万科A	10,369,378.00	2.65
124	300306	远方光电	10,332,741.50	2.64
125	002170	芭田股份	10,039,795.40	2.57
126	603005	晶方科技	9,954,754.16	2.55
127	601088	中国神华	9,659,998.00	2.47
128	600185	格力地产	9,166,624.00	2.34
129	600406	国电南瑞	9,079,005.40	2.32
130	600536	中国软件	8,713,463.00	2.23
131	300221	银禧科技	8,626,778.23	2.21
132	002277	友阿股份	8,237,721.36	2.11

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	300104	乐视网	159,216,315.51	40.70
2	300033	同花顺	156,097,713.74	39.91
3	300168	万达信息	152,904,819.10	39.09

4	000555	神州信息	144,596,955.12	36.97
5	002375	亚厦股份	126,085,225.64	32.23
6	300271	华宇软件	120,608,607.32	30.83
7	002439	启明星辰	108,471,057.93	27.73
8	300253	卫宁软件	99,480,940.42	25.43
9	002184	海得控制	88,905,322.16	22.73
10	002657	中科金财	88,782,846.58	22.70
11	300299	富春通信	83,194,108.57	21.27
12	300226	上海钢联	83,022,751.12	21.23
13	300336	新文化	78,106,987.10	19.97
14	300059	东方财富	72,417,032.60	18.51
15	300324	旋极信息	69,073,920.43	17.66
16	002285	世联行	68,318,536.54	17.47
17	002117	东港股份	65,846,962.42	16.83
18	300207	欣旺达	65,800,051.99	16.82
19	300378	鼎捷软件	61,568,873.26	15.74
20	300130	新国都	59,674,489.86	15.26
21	600570	恒生电子	57,302,999.58	14.65
22	600037	歌华有线	53,886,581.74	13.78
23	300353	东土科技	53,684,321.25	13.72
24	600728	佳都科技	53,610,192.26	13.71
25	000831	五矿稀土	53,354,700.44	13.64
26	002197	证通电子	51,779,680.73	13.24
27	002235	安妮股份	51,310,812.25	13.12
28	300166	东方国信	51,152,138.68	13.08
29	300369	绿盟科技	50,701,165.54	12.96
30	603015	弘讯科技	50,678,792.25	12.96
31	300177	中海达	49,660,608.36	12.70
32	600016	民生银行	49,508,106.06	12.66
33	300380	安硕信息	49,502,656.42	12.66
34	002405	四维图新	48,777,184.09	12.47
35	600476	湘邮科技	46,585,111.00	11.91
36	300234	开尔新材	45,488,769.99	11.63
37	002151	北斗星通	43,656,631.08	11.16
38	300007	汉威电子	43,437,770.33	11.11
39	600498	烽火通信	42,640,751.54	10.90
40	002496	辉丰股份	42,615,147.54	10.89
41	300322	硕贝德	42,302,783.68	10.82

42	300295	三六五网	40,686,538.55	10.40
43	601818	光大银行	40,289,126.03	10.30
44	601601	中国太保	40,148,900.00	10.26
45	300257	开山股份	39,963,243.83	10.22
46	000410	沈阳机床	39,737,806.65	10.16
47	300170	汉得信息	39,433,311.86	10.08
48	002279	久其软件	39,300,368.84	10.05
49	600015	华夏银行	38,790,800.40	9.92
50	002358	森源电气	37,416,779.30	9.57
51	600172	黄河旋风	36,925,829.80	9.44
52	002170	芭田股份	36,593,239.87	9.36
53	002642	荣之联	36,272,775.11	9.27
54	002152	广电运通	36,044,237.48	9.21
55	000599	青岛双星	35,955,677.20	9.19
56	002251	步步高	34,835,049.62	8.91
57	002344	海宁皮城	34,506,560.80	8.82
58	002475	立讯精密	34,155,574.38	8.73
59	002414	高德红外	33,756,304.87	8.63
60	300085	银之杰	33,528,720.21	8.57
61	300352	北信源	33,155,377.30	8.48
62	002038	双鹭药业	32,665,443.07	8.35
63	002381	双箭股份	31,337,691.13	8.01
64	600036	招商银行	30,230,089.22	7.73
65	300101	振芯科技	30,170,490.96	7.71
66	601169	北京银行	29,434,416.81	7.53
67	300018	中元华电	28,565,738.00	7.30
68	601398	工商银行	28,384,682.70	7.26
69	600180	瑞茂通	28,320,608.10	7.24
70	002253	川大智胜	28,239,100.14	7.22
71	600446	金证股份	27,800,181.86	7.11
72	300169	天晟新材	27,509,307.26	7.03
73	000816	智慧农业	27,405,917.22	7.01
74	600718	东软集团	26,701,652.16	6.83
75	002594	比亚迪	26,598,536.16	6.80
76	601688	华泰证券	26,516,211.74	6.78
77	300377	赢时胜	26,207,382.07	6.70
78	002178	延华智能	26,012,325.60	6.65
79	002185	华天科技	25,858,506.22	6.61

80	300058	蓝色光标	23,893,204.57	6.11
81	002008	大族激光	23,739,327.99	6.07
82	002315	焦点科技	23,723,979.00	6.07
83	002153	石基信息	23,652,886.39	6.05
84	300212	易华录	23,269,104.82	5.95
85	002216	三全食品	22,953,446.01	5.87
86	300113	顺网科技	22,847,770.20	5.84
87	002099	海翔药业	22,085,828.25	5.65
88	300339	润和软件	22,009,550.02	5.63
89	002073	软控股份	21,176,353.92	5.41
90	002410	广联达	20,980,276.75	5.36
91	300287	飞利信	20,570,450.00	5.26
92	002366	台海核电	20,016,172.68	5.12
93	300392	腾信股份	18,367,261.28	4.70
94	300162	雷曼股份	17,357,487.32	4.44
95	002712	思美传媒	17,311,926.90	4.43
96	002049	同方国芯	16,830,968.39	4.30
97	300246	宝莱特	16,770,374.20	4.29
98	600687	刚泰控股	16,031,524.30	4.10
99	300242	明家科技	15,067,318.30	3.85
100	600986	科达股份	14,670,163.18	3.75
101	600392	盛和资源	14,129,949.80	3.61
102	300224	正海磁材	14,108,681.07	3.61
103	002312	三泰控股	12,535,805.80	3.20
104	300083	劲胜精密	11,803,528.16	3.02
105	300136	信维通信	11,752,742.82	3.00
106	601233	桐昆股份	11,492,935.06	2.94
107	002070	众和股份	11,286,558.72	2.89
108	600571	信雅达	11,285,122.43	2.89
109	002465	海格通信	10,690,194.50	2.73
110	603005	晶方科技	10,485,084.25	2.68
111	300221	银禧科技	10,423,134.80	2.66
112	000793	华闻传媒	10,228,209.40	2.61
113	600485	信威集团	10,124,516.39	2.59
114	002074	国轩高科	10,096,692.35	2.58
115	300028	金亚科技	9,885,384.53	2.53
116	300306	远方光电	9,801,371.80	2.51
117	000002	万科A	9,726,294.06	2.49

118	601088	中国神华	9,400,926.16	2.40
119	300032	金龙机电	8,960,616.05	2.29
120	600720	祁连山	8,448,270.90	2.16
121	600536	中国软件	8,291,960.40	2.12
122	002277	友阿股份	8,284,514.53	2.12
123	300010	立思辰	7,913,259.05	2.02
124	002577	雷柏科技	7,908,384.88	2.02

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,470,894,039.54
卖出股票收入（成交）总额	5,047,566,378.04

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	748,080.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,844.40
5	应收申购款	5,581,064.56

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,344,989.61

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300242	明家科技	37,052,883.96	3.30	重大事项
2	300324	旋极信息	35,194,777.92	3.13	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,195	22,646.67	178,714,550.51	41.11%	255,988,307.88	58.89%

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	156,367.94	0.0360%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年7月27日）基金份额总额	575,248,357.46
本报告期期初基金份额总额	272,565,913.03
本报告期基金总申购份额	1,683,342,401.90
减:本报告期基金总赎回份额	1,521,205,456.54
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	434,702,858.39

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7月25日，基金管理人发布公告，李元博先生不再担任本基金基金经理，由陈平先生担任本基金基金经理。

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

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

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

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

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

2015 年 1 月 4 日，基金托管人发布任免通知，张力铮担任中国建设银行投资托管业务部副总经理。

2015 年 9 月 18 日，基金托管人发布任免通知，纪伟不再担任中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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 70000 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 70000 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	
海通证券	1	2,577,762,454.69	24.52%	2,346,796.20	24.44%	-
安信证券	2	1,855,566,198.73	17.65%	1,693,896.97	17.64%	-
中信证券	1	1,142,960,304.75	10.87%	1,041,593.30	10.85%	-
中金公司	2	1,014,097,150.38	9.64%	925,579.31	9.64%	-
国泰君安	1	771,770,861.37	7.34%	708,341.24	7.38%	-
中信建投	1	735,820,960.37	7.00%	676,609.60	7.05%	-
国信证券	2	648,143,980.95	6.16%	590,070.52	6.15%	-
中投证券	1	543,538,450.78	5.17%	494,837.65	5.15%	-
方正证券	1	448,875,037.58	4.27%	412,961.10	4.30%	-
华泰证券	1	368,276,260.57	3.50%	339,274.74	3.53%	-
申万宏源	1	190,673,128.94	1.81%	173,854.43	1.81%	-
国金证券	1	120,505,158.64	1.15%	109,707.43	1.14%	-
光大证券	1	96,321,245.47	0.92%	88,274.27	0.92%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
合计	17	10,514,311,193.22	100.00%	9,601,796.76	100.00%	-

1、报告期内增加的交易单元为：中信建投、方正证券

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

- a. 实力雄厚，信誉良好；
- b. 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好，过去三年未有任何违规经营记录；
- c. 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
- d. 公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；
- e. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：

- a. 研究报告的数量和质量；

- b. 提供研究服务的主动性；
- c. 资讯提供的及时性及便利性；
- d. 其他可评价的考核标准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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
2016年3月29日