
汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金 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	汇丰晋信动态策略混合	
基金主代码	540003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 4 月 9 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	566, 523, 696. 70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇丰晋信动态策略混合 A	汇丰晋信动态策略混合 H
下属分级基金的交易代码:	540003	960003
报告期末下属分级基金的份额总额	566, 353, 406. 64 份	170, 290. 06 份

注：本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将致力于捕捉股票、债券等市场不同阶段中的不同投资机会，无论其处于牛市或者熊市，均通过基金资产在不同市场的合理配置，追求基金资产的长期较高回报。
投资策略	<p>1. 积极主动的资产配置策略</p> <p>本基金奉行“恰当时机、恰当比重、恰当选股”的投资理念和“自上而下”与“自下而上”的双重选股策略。在投资决策中，本基金结合全球经济增长、通货膨胀和利息的预期，预测中国股票、债券市场的未来走势，在长期投资的基础上，将战略资产配置与择时相结合，灵活、主动的调整基金资产在股票、固定收益和现金上的配置比例。同时，在各类资产中，本基金根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产品种具体投资品种的种类和数量。</p> <p>2. 综合相对、绝对估值方法的股票筛选策略</p> <p>本基金不拘泥于单一的价值标准或成长标准，对股票给予全面的成长、价值分析，优选出价值低估，成长低估的上市公司进行投资。成长指标包括：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；价值指标包括：市净率（P/B）、每股收益、年现金流/市值、股息率等。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，最大程度地筛选出有投资价值的投资品种。</p>
业绩比较基准	50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中预期风险、收益中等的基金产品。

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	
	汇丰晋信动态策略混合 A	汇丰晋信动态策略混合 H	汇丰晋信动态策略混合 A	汇丰晋信动态策略混合 H	汇丰晋信动态策略混合 A	汇丰晋信动态策略混合 H
本期已实现收益	-29,620,774.78	1,679.31	731,734,620.80	-	300,700,099.07	-
本期利润	-44,955,845.48	-2,397.60	339,834,548.86	-	543,008,150.56	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0812	-0.0302	0.6514	-	0.5444	-
本期基金份额净值增长率	-8.30%	1.80%	38.46%	-	58.96%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	0.6021	0.3803	1.3504	-	0.4481	-
期末可供分配基金份额利润	0.6021	0.3803	1.3504	-	0.4481	-
期末基金资产净值	907,367,501.21	173,352.40	851,981,879.67	-	1,513,612,965.50	-
期末基金份额净值	1.6021	1.0180	2.3504	-	1.6975	-

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。

4、本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额

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

汇丰晋信动态策略混合 A

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	0.07%	0.53%	-0.85%	0.38%	0.92%	0.15%
过去六个月	1.17%	0.57%	1.49%	0.40%	-0.32%	0.17%
过去一年	-8.30%	1.41%	-7.45%	0.77%	-0.85%	0.64%
过去三年	101.84%	1.91%	27.59%	0.91%	74.25%	1.00%
过去五年	125.11%	1.72%	35.57%	0.82%	89.54%	0.90%
自基金合同生效起至今	139.13%	1.62%	32.48%	0.95%	106.65%	0.67%

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

自基金合同生效起至今指 2007 年 4 月 9 日—2016 年 12 月 31 日

汇丰晋信动态策略混合 H

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	0.06%	0.53%	-0.85%	0.38%	0.91%	0.15%
过去六个月	0.97%	0.57%	1.49%	0.40%	-0.52%	0.17%
成立至今	1.80%	0.57%	2.13%	0.40%	-0.33%	0.17%

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

成立至今指 2016 年 6 月 28 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

汇丰晋信动态策略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

1. 汇丰晋信动态策略混合 A

(2007 年 4 月 9 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：股票占基金资产的 30%–95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%–70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券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六个月内完成建仓。截止 2007 年 10 月 9 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

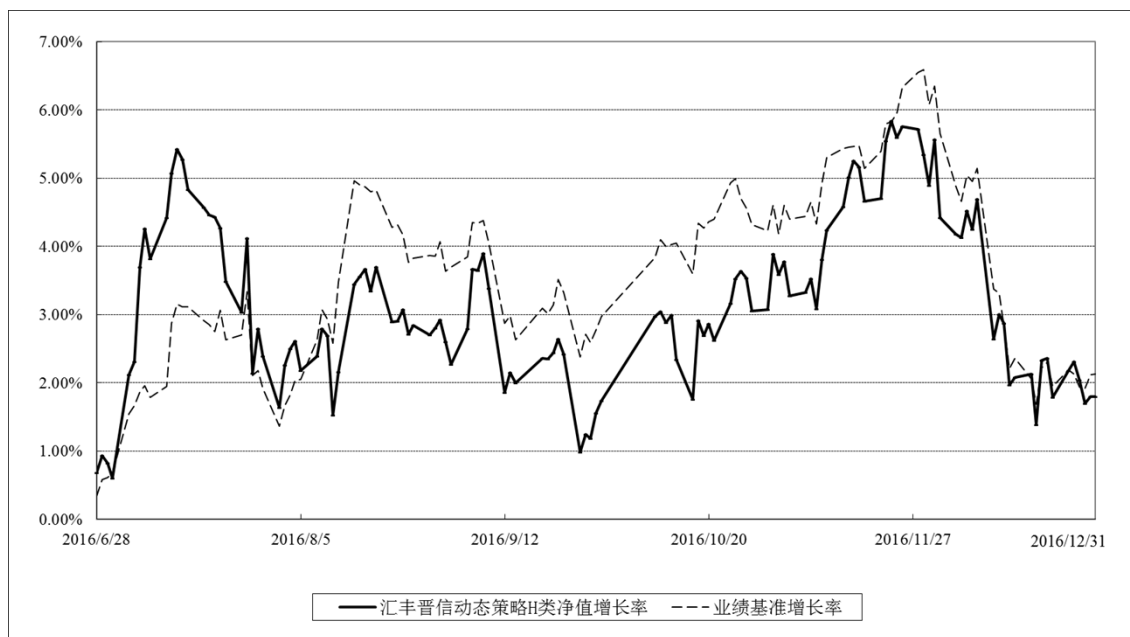
2. 基金合同生效日（2007 年 4 月 9 日）起至 2014 年 5 月 31 日，本基金的业绩比较基准为

“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中信标普全债指数收益率”（MSCI 中国 A 股指数成份股在报告期产生的股票红利收益已计入指数收益率的计算中）。自 2014 年 6 月 1 日起，本基金

的业绩比较基准调整为“50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。

2. 汇丰晋信动态策略混合 H

(2016 年 6 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：

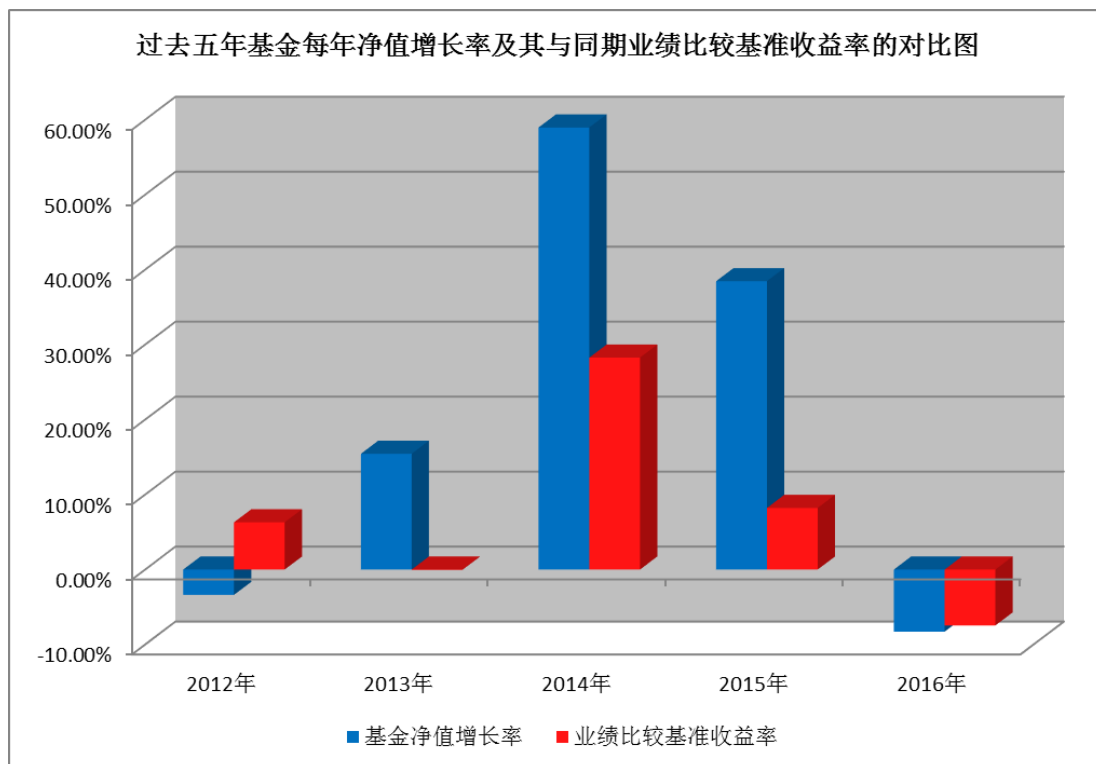
1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。
2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = “50%×MSCI 中国 A 股指数收益率+50%×中债新综合指数收益率（全价）”。
3. 本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额。

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

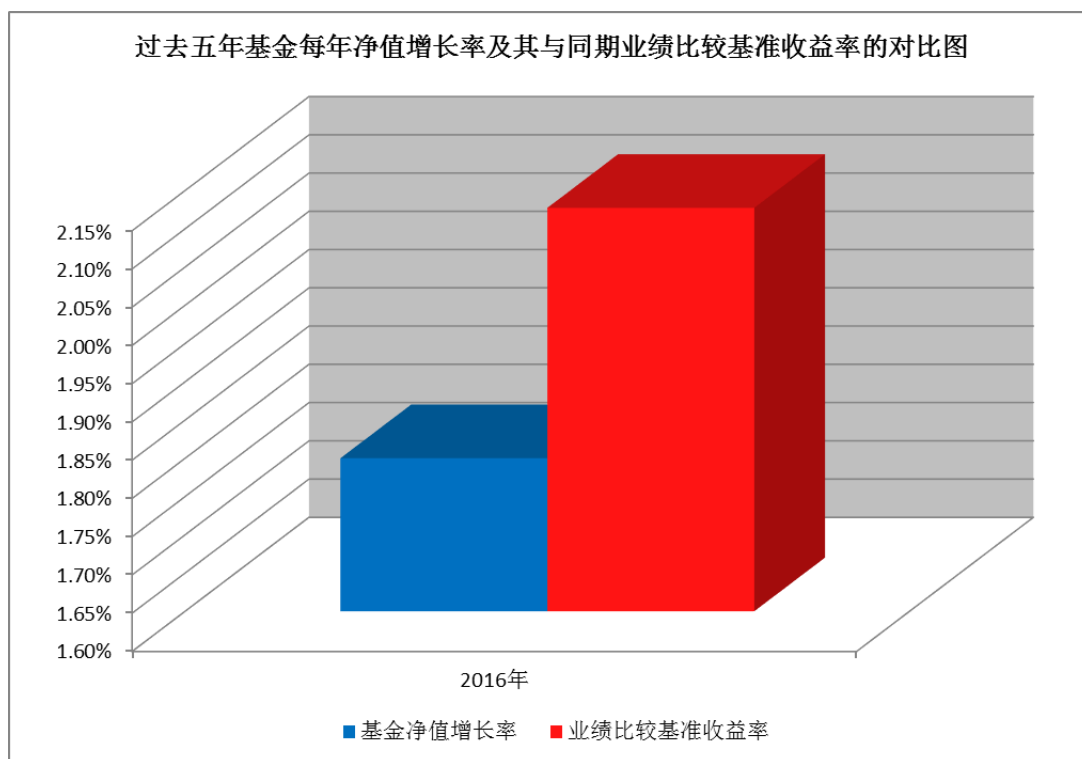
汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图

1. 汇丰晋信动态策略混合 A



2. 汇丰晋信动态策略混合 H



注：本基金自 2016 年 6 月 28 日起增加 H 类份额，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 H 类份额运作未满五年。本基金 H 类份额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

单位：人民币元

汇丰晋信动态策略混合 A					
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
2016	5.2000	519,079,669.25	100,037,021.22	619,116,690.47	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	5.2000	519,079,669.25	100,037,021.22	619,116,690.47	

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 H 类份额未进行利润分配。

§ 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		

郭敏	研究部总监、本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	10	硕士研究生。曾任上海证券研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司研究部总监、本基金基金经理。
----	---------------	-----------------	---	----	--

注：1. 任职日期为本基金管理人公告郭敏女士担任本基金基金经理的日期；

2. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2016 年股票市场整体呈现震荡向下的走势，各指数均出现下跌。其中，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%。从市场节奏来看，市场年初快速下跌，1 月底之后缓慢上行。从行业表现来看，传媒、计算机、餐饮旅游是跌幅最大的行业，食品饮料、家电和银行是表现最好的行业。

从国内经济数据来看，宏观经济整体表现符合预期。PPI 结束连续下滑的态势，四季度环比增速明显回升，并在 9 月份全部工业品的同比增速首次转正，至 12 月末 PPI 同比增速回升至 5.5%。PPI 的回升带动企业盈利改善，特别是上游行业受益于价格的上涨，盈利能力显著提升。从工业增加值数据来看，12 月末同比增速回升至 6%，整体盈利仍处于改善趋势中。

本基金 2016 年整体超配股票资产，寻找年初在下跌过程中的被错杀的机会。全年超配农业、TMT、食品饮料、石化等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类净值变化幅度为-8.30%，同期业绩比较基准为-7.45%，本基金 A 类落后同期比较基准为 0.85%；本基金 H 类本报告期内净值变化幅度为 1.80%，同期业绩比较基准为 2.13%，本基金 H 类落后同期比较基准为 0.33%。

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，从经济的前瞻性指标来看，经济已经有所企稳，企业盈利改善的趋势预计至少能持续至一季度末。同时，政府持续推进供给侧改革，通过淘汰落后产能的方式改善供需格局的方式，可能使经济短期遭遇阵痛，但中长期经济的前景依然向好。此外，PPP 以及一带一路战略的推进，有助于缓解经济的下行压力。预计 2017 年中国经济增长增速维持稳定，全年 GDP 的增长有望保持在 6.5%附近。

从流动性来看，受制与高房价、汇率贬值的压力以及 PPI 上行压力，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。从无风险利率的来看，我们认为由于上文提及因素以及金融机构去杠杆等因素，利率下行空间有限。从需求角度来看，IPO 提速、战略新兴版以及增发规模增长将增加供给，资金的需求增加。因此，从整体市场流动性来看，我们认为全年来看流动性整体维持中性偏紧的格局。

从估值来看，考虑到企业盈利的改善，目前的估值水平仍处于历史均值附近。考虑到宏观环境的平稳，我们认为仍有一定的收益空间。从自上而下的大类资产配置角度，我们认为股票资产的吸引力大于债券，因此我们维持全年超配权益资产的策略。

从行业选择来看，我们倾向于选择行业景气度较高的子行业，相关 ROE 能潜在提升可能性的板块。我们相对看好金融、医药、石化、电子等相关板块的机会。同时我们关注供给侧改革受益的相关行业以及稳定增长估值合理的蓝筹股。并从自下而上的角度选择 PEG 小于 0.6 的成长股的投资机会。

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 A 类份额于 2016 年 3 月 31 日实施分红，根据基金相关法律法规和基金合同的要求，每 10 份 A 类份额派发现金红利 5.20 元，其中现金形式的分红金额为 519,079,669.25 元，红利再投资形式的分红金额为 100,037,021.22 元，利润分配共计 619,116,690.47 元。

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动态策略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

2016 年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信动态策略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 A 类份额进行了 1 次收益分配，分配金额为 619,116,690.47 元，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动态策略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(2017)第 20055 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	汇丰晋信动态策略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动态策略混合型证券投资基金(以下简称“汇丰晋信动态策略基金”)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动态策略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，上述汇丰晋信动态策略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动态策略基金 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。	
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：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	964,856.13	823,668.58
结算备付金		116,754,030.82	82,351,014.34
存出保证金		717,194.94	1,485,117.84
交易性金融资产	7.4.7.2	806,819,008.30	751,264,766.75
其中：股票投资		697,068,008.30	701,128,766.75
基金投资		-	-
债券投资		109,751,000.00	50,136,000.00
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		-	19,846,755.98
应收利息	7.4.7.5	2,070,336.42	1,007,565.36
应收股利		-	-
应收申购款		14,528.70	708,481.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		927,339,955.31	857,487,370.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		15,532,792.80	865,714.35
应付赎回款		655,121.28	617,442.60
应付管理人报酬		1,230,052.68	1,087,859.00
应付托管费		205,008.77	181,309.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,773,652.32	2,350,838.05
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	402,473.85	402,327.03
负债合计		19,799,101.70	5,505,490.88
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	566,461,990.45	362,482,413.74
未分配利润	7.4.7.10	341,078,863.16	489,499,465.93
所有者权益合计		907,540,853.61	851,981,879.67
负债和所有者权益总计		927,339,955.31	857,487,370.55

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额为 566,523,696.70 份，其中 A 类基金份额净值 1.6021 元，基金份额 566,353,406.64 份；H 类基金份额净值 1.0180 元，基金份额 170,290.06 份。

7.2 利润表

会计主体：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

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 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
一、收入		-15,712,246.25	374,667,697.38
1.利息收入		7,043,823.93	3,229,033.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,101,788.80	2,356,224.22
债券利息收入		2,941,253.24	765,990.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,000,781.89	106,818.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,089,810.20	761,745,964.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-14,754,198.71	756,732,692.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-440,273.84	679,249.84

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	6,104,662.35	4,334,022.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-15,339,147.61	-391,900,071.94
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	1,672,887.63	1,592,771.62
减：二、费用		29,245,996.83	34,833,148.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,785,250.78	15,165,329.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,297,541.78	2,527,554.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	12,724,257.85	16,719,563.48
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	438,946.42	420,701.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,958,243.08	339,834,548.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,958,243.08	339,834,548.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金

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）	362,482,413.74	489,499,465.93	851,981,879.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-44,958,243.08	-44,958,243.08
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	203,979,576.71	515,654,330.78	719,633,907.49

列)			
其中：1. 基金申购款	1, 076, 044, 066. 47	981, 897, 208. 62	2, 057, 941, 275. 09
2. 基金赎回款	-872, 064, 489. 76	-466, 242, 877. 84	-1, 338, 307, 367. 60
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）	-	-619, 116, 690. 47	-619, 116, 690. 47
五、期末所有者权益（基金净值）	566, 461, 990. 45	341, 078, 863. 16	907, 540, 853. 61
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）	891, 673, 055. 67	621, 939, 909. 83	1, 513, 612, 965. 50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	339, 834, 548. 86	339, 834, 548. 86
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）	-529, 190, 641. 93	-472, 274, 992. 76	-1, 001, 465, 634. 69
其中：1. 基金申购款	138, 573, 479. 82	134, 154, 455. 83	272, 727, 935. 65
2. 基金赎回款	-667, 764, 121. 75	-606, 429, 448. 59	-1, 274, 193, 570. 34
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）	362, 482, 413. 74	489, 499, 465. 93	851, 981, 879. 67

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
基金管理人负责人

赵琳
主管会计工作负责人

杨洋
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金(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”)证监基金字[2007]64号《关于同意汇丰晋信动态策略混合型证券投资

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《汇丰晋信动态策略混合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 5,264,523,342.19 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(2007)CR No.0020 验资报告予以验资。经向中国证监会备案，《汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 4 月 9 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,265,643,757.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,120,414.94 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《关于汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金增设基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自 2016 年 6 月 28 日起，本基金根据销售对象的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额，称为 A 类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信动态策略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(A 股及监管机构允许投资的其他种类和其他市场的股票)、债券(包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债等)、短期金融工具(包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、银行存款、短期融资券等)、现金资产、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 30%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-70%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：50%XMSCI 中国 A 股指数收益率+50%X 中债新综合指数收益率(全价)。

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》、《汇丰晋信动态策略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 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[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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) 于 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) 对于内地投资者持有的基金类别, 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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

(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 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
当期发生的基金应支付的管理费	13,785,250.78	15,165,329.15
其中：支付销售机构的客户维护费	1,925,014.96	2,717,424.50

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	2,297,541.78	2,527,554.79

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

单位：人民币元

本期

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	21,409,895.30	-	-	-	-

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

份额单位：份

汇丰晋信动态策略混合 A				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山西信托	2,013,406.88	0.36%	2,013,406.88	0.56%

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	964,856.13	6,571.90	823,668.58	10,178.22

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 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

7.4.9.1.1 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	
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	3,491	80,851.56	80,851.56	
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	
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	
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	2017 年 1 月	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	

		26 日	3 日							
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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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 696,594,602.74 元，属于第二层次的余额为 110,224,405.56 元，无属于第三层次的余额。(2015 年 12 月 31 日：第一层次 485,790,073.55 元，第二层次 246,121,882.16 元，第三层次 19,352,811.04 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	19,352,811.04
购买	-
出售	-
转入第三层次	-
转出第三层次	13,566,097.36
当期利得或损失总额	
——计入损益的利得或损失	<u>5,786,713.68</u>
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	19,352,811.04

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	19,352,811.04

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	-39,173,585.96

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 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	697,068,008.30	75.17
	其中：股票	697,068,008.30	75.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	109,751,000.00	11.84
	其中：债券	109,751,000.00	11.84
	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	117,718,886.95	12.69
8	其他资产	2,802,060.06	0.30
9	合计	927,339,955.31	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	39,008,110.60	4.30
C	制造业	423,534,363.48	46.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,898,237.66	0.98
E	建筑业	14,700,112.23	1.62
F	批发和零售业	9,026,035.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	9,674,496.00	1.07
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	0.03
J	金融业	181,430,878.33	19.99
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	10,560,900.00	1.16
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	697,068,008.30	76.81

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	601233	桐昆股份	2,974,410	42,712,527.60	4.71
2	600015	华夏银行	3,897,954	42,292,800.90	4.66
3	600597	光明乳业	2,907,100	37,966,726.00	4.18
4	600062	华润双鹤	1,498,400	33,309,432.00	3.67
5	600329	中新药业	1,885,300	32,879,632.00	3.62
6	002475	立讯精密	1,524,541	31,634,225.75	3.49
7	601818	光大银行	7,963,838	31,138,606.58	3.43
8	000049	德赛电池	719,605	30,259,390.25	3.33
9	600028	中国石化	5,578,660	30,180,550.60	3.33
10	002422	科伦药业	1,819,018	29,322,570.16	3.23

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	002299	圣农发展	114,626,983.22	13.45
2	600597	光明乳业	85,474,041.89	10.03
3	601233	桐昆股份	83,986,243.13	9.86
4	601688	华泰证券	70,126,154.28	8.23
5	600028	中国石化	56,943,330.20	6.68
6	601998	中信银行	55,862,093.82	6.56
7	600655	豫园商城	52,304,168.50	6.14
8	601988	中国银行	51,721,245.98	6.07
9	000876	新希望	51,704,302.92	6.07
10	000957	中通客车	51,178,770.65	6.01
11	601012	隆基股份	50,680,423.99	5.95
12	600015	华夏银行	50,642,871.52	5.94
13	601818	光大银行	48,617,987.20	5.71
14	000488	晨鸣纸业	47,591,391.58	5.59
15	603993	洛阳钼业	44,956,359.36	5.28
16	600489	中金黄金	44,140,240.46	5.18

17	002176	江特电机	42,401,627.49	4.98
18	601377	兴业证券	42,214,833.78	4.95
19	002081	金螳螂	39,727,926.55	4.66
20	000568	泸州老窖	39,685,036.65	4.66
21	601628	中国人寿	39,513,938.42	4.64
22	600584	长电科技	38,552,412.40	4.53
23	002103	广博股份	38,081,220.86	4.47
24	601633	长城汽车	37,776,586.78	4.43
25	600109	国金证券	37,156,479.83	4.36
26	000703	恒逸石化	36,934,733.69	4.34
27	600172	黄河旋风	36,005,296.43	4.23
28	002425	凯撒文化	35,849,241.72	4.21
29	600884	杉杉股份	35,452,825.98	4.16
30	002422	科伦药业	35,147,804.21	4.13
31	600062	华润双鹤	34,551,632.80	4.06
32	600329	中新药业	33,823,606.00	3.97
33	000049	德赛电池	32,502,418.46	3.81
34	002298	中电鑫龙	31,895,352.54	3.74
35	002548	金新农	31,864,873.01	3.74
36	300336	新文化	31,552,243.29	3.70
37	002267	陕天然气	31,394,274.02	3.68
38	002475	立讯精密	31,210,791.20	3.66
39	600195	中牧股份	30,857,970.70	3.62
40	601211	国泰君安	30,557,598.84	3.59
41	000651	格力电器	30,384,169.00	3.57
42	603609	禾丰牧业	30,316,126.53	3.56
43	002458	益生股份	29,708,373.86	3.49
44	002701	奥瑞金	29,439,883.18	3.46
45	600038	中直股份	29,019,351.43	3.41
46	300161	华中数控	28,631,049.11	3.36
47	002358	森源电气	28,611,700.39	3.36
48	300302	同有科技	27,963,883.94	3.28
49	000001	平安银行	27,562,889.65	3.24
50	603799	华友钴业	27,506,106.64	3.23
51	600201	生物股份	25,655,911.83	3.01
52	601336	新华保险	25,085,125.60	2.94

53	002364	中恒电气	24,957,934.31	2.93
54	002117	东港股份	24,908,811.50	2.92
55	002321	华英农业	24,719,380.08	2.90
56	002224	三力士	24,622,383.28	2.89
57	000758	中色股份	24,038,089.72	2.82
58	000421	南京公用	23,109,026.43	2.71
59	000937	冀中能源	22,715,736.06	2.67
60	601069	西部黄金	22,597,273.16	2.65
61	002655	共达电声	22,500,882.54	2.64
62	002235	安妮股份	22,389,533.24	2.63
63	601899	紫金矿业	22,265,555.00	2.61
64	000975	银泰资源	21,062,444.30	2.47
65	000426	兴业矿业	20,916,324.00	2.46
66	002171	楚江新材	20,904,035.15	2.45
67	002671	龙泉股份	20,872,630.60	2.45
68	600030	中信证券	20,611,535.60	2.42
69	600108	亚盛集团	20,600,625.00	2.42
70	600875	东方电气	20,590,161.00	2.42
71	002026	山东威达	20,512,325.51	2.41
72	000157	中联重科	20,394,751.30	2.39
73	300113	顺网科技	20,277,729.71	2.38
74	600688	上海石化	20,274,550.68	2.38
75	000800	一汽轿车	20,191,244.70	2.37
76	600617	国新能源	20,169,669.73	2.37
77	002648	卫星石化	20,120,301.39	2.36
78	002586	围海股份	19,525,426.19	2.29
79	300146	汤臣倍健	19,439,370.57	2.28
80	002357	富临运业	19,345,186.39	2.27
81	002231	奥维通信	19,320,960.40	2.27
82	002221	东华能源	19,252,909.07	2.26
83	601288	农业银行	19,106,514.00	2.24
84	000422	湖北宜化	18,863,913.11	2.21
85	600782	新钢股份	18,697,075.86	2.19
86	600720	祁连山	18,465,233.15	2.17
87	600232	金鹰股份	18,189,402.00	2.13
88	300271	华宇软件	17,905,933.27	2.10

89	600559	老白干酒	17,718,708.36	2.08
90	002329	皇氏集团	17,655,336.64	2.07
91	000059	华锦股份	17,189,814.00	2.02
92	002468	申通快递	17,108,271.55	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	002299	圣农发展	123,509,255.54	14.50
2	000488	晨鸣纸业	75,500,099.78	8.86
3	000876	新希望	53,975,257.02	6.34
4	601012	隆基股份	53,669,957.94	6.30
5	601988	中国银行	53,603,955.94	6.29
6	600584	长电科技	50,802,480.87	5.96
7	600655	豫园商城	50,571,261.17	5.94
8	600597	光明乳业	49,609,515.59	5.82
9	601998	中信银行	47,881,660.94	5.62
10	000957	中通客车	47,598,455.17	5.59
11	000568	泸州老窖	47,430,728.93	5.57
12	601233	桐昆股份	45,303,421.16	5.32
13	601688	华泰证券	45,148,698.29	5.30
14	002081	金螳螂	44,975,197.83	5.28
15	600489	中金黄金	43,044,025.84	5.05
16	300017	网宿科技	41,625,785.52	4.89
17	002103	广博股份	41,561,979.06	4.88
18	000703	恒逸石化	40,134,308.96	4.71
19	601818	光大银行	39,836,343.18	4.68
20	601633	长城汽车	38,600,046.17	4.53
21	002425	凯撒文化	37,639,118.63	4.42
22	600172	黄河旋风	37,239,140.71	4.37
23	603993	洛阳钼业	36,672,651.08	4.30
24	002176	江特电机	36,520,144.86	4.29
25	002235	安妮股份	36,467,395.96	4.28
26	600195	中牧股份	35,962,523.44	4.22
27	600109	国金证券	34,960,712.71	4.10

28	601377	兴业证券	34,682,601.35	4.07
29	300028	金亚科技	34,632,257.71	4.06
30	600884	杉杉股份	34,203,408.21	4.01
31	002298	中电鑫龙	33,864,463.65	3.97
32	600015	华夏银行	33,505,605.63	3.93
33	601515	东风股份	33,093,872.82	3.88
34	002548	金新农	32,621,729.42	3.83
35	603609	禾丰牧业	31,318,153.87	3.68
36	002267	陕天然气	31,117,323.05	3.65
37	601211	国泰君安	31,012,380.00	3.64
38	000651	格力电器	30,974,608.26	3.64
39	300242	明家联合	30,794,429.52	3.61
40	600872	中炬高新	30,645,298.32	3.60
41	000673	当代东方	30,578,847.83	3.59
42	600153	建发股份	30,421,427.85	3.57
43	600038	中直股份	30,030,482.65	3.52
44	002358	森源电气	29,093,690.61	3.41
45	002458	益生股份	29,059,510.30	3.41
46	603799	华友钴业	28,260,422.52	3.32
47	002049	紫光国芯	28,118,867.00	3.30
48	002364	中恒电气	27,663,519.34	3.25
49	002321	华英农业	27,272,217.07	3.20
50	002224	三力士	26,838,726.56	3.15
51	000001	平安银行	26,454,290.00	3.11
52	600201	生物股份	25,965,947.84	3.05
53	300302	同有科技	25,724,389.94	3.02
54	600028	中国石化	25,708,846.97	3.02
55	000758	中色股份	25,652,487.86	3.01
56	002117	东港股份	25,025,880.55	2.94
57	002405	四维图新	24,925,487.09	2.93
58	601069	西部黄金	24,500,664.30	2.88
59	600271	航天信息	24,491,261.38	2.87
60	300133	华策影视	24,451,685.46	2.87
61	002655	共达电声	24,441,324.06	2.87
62	300336	新文化	24,439,388.79	2.87
63	000937	冀中能源	24,171,583.14	2.84
64	601336	新华保险	23,935,542.61	2.81
65	300161	华中数控	23,441,042.35	2.75

66	000421	南京公用	23,301,755.99	2.74
67	002586	围海股份	22,490,734.25	2.64
68	000793	华闻传媒	22,009,423.35	2.58
69	600521	华海药业	21,998,065.62	2.58
70	300076	GQY 视讯	21,951,183.08	2.58
71	000426	兴业矿业	21,852,280.70	2.56
72	002171	楚江新材	21,807,506.42	2.56
73	002400	省广股份	21,633,537.09	2.54
74	000157	中联重科	21,342,129.73	2.50
75	300113	顺网科技	21,299,225.41	2.50
76	002357	富临运业	21,101,644.20	2.48
77	600875	东方电气	21,008,724.64	2.47
78	002026	山东威达	20,792,885.55	2.44
79	601899	紫金矿业	20,723,147.16	2.43
80	002408	齐翔腾达	20,583,088.31	2.42
81	600108	亚盛集团	20,523,552.30	2.41
82	600030	中信证券	20,440,982.80	2.40
83	000975	银泰资源	20,350,352.32	2.39
84	002648	卫星石化	19,938,113.99	2.34
85	002221	东华能源	19,863,367.35	2.33
86	002671	龙泉股份	19,616,398.52	2.30
87	600232	金鹰股份	19,435,749.72	2.28
88	300146	汤臣倍健	18,731,496.46	2.20
89	300251	光线传媒	18,301,324.00	2.15
90	600617	国新能源	18,025,234.93	2.12
91	000059	华锦股份	18,015,552.00	2.11
92	600754	锦江股份	17,984,047.35	2.11
93	300271	华宇软件	17,777,768.23	2.09
94	600366	宁波韵升	17,745,770.37	2.08
95	002468	申通快递	17,556,625.03	2.06
96	600702	沱牌舍得	17,537,479.79	2.06
97	002234	民和股份	17,366,155.57	2.04
98	002262	恩华药业	17,115,351.91	2.01
99	601567	三星医疗	17,108,914.00	2.01
100	002329	皇氏集团	17,075,281.22	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	4,204,374,153.94
卖出股票收入（成交）总额	4,179,090,680.71

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	29,328,000.00	3.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,423,000.00	8.86
	其中：政策性金融债	80,423,000.00	8.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,751,000.00	12.09

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	140225	14 国开 25	300,000	30,231,000.00	3.33
2	150302	15 进出 02	300,000	30,024,000.00	3.31
3	160017	16 付息国债 17	300,000	29,328,000.00	3.23
4	140220	14 国开 20	200,000	20,168,000.00	2.22

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除四川科伦药业股份有限公司（002422）外，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。

根据四川科伦药业股份有限公司（以下简称“科伦药业”）于 2016 年 2 月 23 日发布的《科伦药业关于安岳分公司银杏叶片事项的进展公告》，根据国家食品药品监督管理总局的有关要求，四川科伦药业股份有限公司安岳分公司（以下简称“安岳公司”）对旗下产品采取了自查，由于部分产品不合格，安岳公司于 2015 年 5 月 29 日在指定信息披露媒体发布了《关于召回银杏叶片的公告》（公告编号：2015-035 号），并在国家食品药品监督管理总局规定期限内完成了不合格产品的召回工作。2016 年 2 月 19 日，安岳公司收到四川省食品药品监督管理局《行政处罚决定书》（（川）食药监药罚（2016）4 号），没收违法所得 202,714.80 元，并处以货值金额（208,658.00 元）两倍的罚款共计人民币 417,316.00 元。根据科伦药业在公告所述，安岳公

司银杏叶片销售收入预计占 2015 年度的公司营业收入和营业毛利的比重很小，且上述罚没款占公司的营业收入和净利润的比例很小，因此，该品种以及安岳公司本次罚没金额不会对公司的生产经营及年度财务状况产生较大影响。

本基金管理人会紧密跟踪并及时采取相应投资决策，截至目前，本基金对科伦药业的投资决策流程符合本公司规定。

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	717,194.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,070,336.42
5	应收申购款	14,528.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,802,060.06

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

份额 级别	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
汇丰晋信动态策略混合 A	13,413	42,224.22	168,233,132.59	29.70%	398,120,274.05	70.30%
汇丰晋信动态策略混合 H	2	85,145.03	170,290.06	100.00%	-	-
合计	13,415	42,230.61	168,403,422.65	29.73%	398,120,274.05	70.27%

注：本基金 H 类份额的投资者均为个人投资者。依据香港市场的特点，香港投资者持有的本基金 H 类别份额将由香港销售机构代表香港投资者名义持有，同时，香港销售机构以名义持有人的形式出现在注册登记机构的持有人名册中。基金管理人无法得知具体的投资者信息，此处本基金 H 类份额持有人户数为 H 类份额名义持有人户数。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇丰晋信动态策略混合 A	402,306.58	0.0710%
	汇丰晋信动态策略混合 H	0.00	0.0000%
	合计	402,306.58	0.0710%

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	份额级别	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	汇丰晋信动态策略混合 A	10~50
	汇丰晋信动态策略混合 H	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信动态策略混合 A	0~10
	汇丰晋信动态策略混合 H	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇丰晋信动态策略混合 A	汇丰晋信动态策略混合 H
基金合同生效日（2007 年 4 月 9 日）基金份额总额	5,265,643,757.13	-
本报告期期初基金份额总额	362,482,413.74	-
本报告期基金总申购份额	1,075,935,482.66	170,290.06
减:本报告期基金总赎回份额	872,064,489.76	-
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	566,353,406.64	170,290.06

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

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 日将为其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）更换为普华

永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），并报中国证券监督管理委员会备案。

报告年度预提审计费 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	
国信证券	21	1,842,507,810.57	22.00%	1,715,928.42	22.00%	-
长江证券	11	1,555,645,043.50	18.57%	1,448,772.84	18.57%	-
广发证券	11	1,175,649,582.85	14.04%	1,094,880.88	14.04%	-
中信证券	21	1,145,328,670.43	13.67%	1,066,644.92	13.67%	-
兴业证券	1	940,604,938.50	11.23%	875,987.09	11.23%	-
瑞银证券	1	519,161,743.06	6.20%	483,493.97	6.20%	-
华泰证券	1	459,868,479.33	5.49%	428,277.36	5.49%	-
中信建投	1	323,129,655.73	3.86%	300,929.43	3.86%	-
中金公司	1	245,447,183.54	2.93%	228,584.28	2.93%	-
申万宏源	1	92,829,737.03	1.11%	86,451.92	1.11%	-
东方证券	1	75,825,723.47	0.91%	70,616.24	0.91%	-
合计	138	138,375,998,568.01	100.00%	7,800,567.35	100.00%	-

注：1、报告期内无增加的交易单元

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
国信证券	-	-	248,000,000.00	3.50%	-	-
长江证券	-	-	3,910,000,000.00	55.24%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	84,620.20	100.00%	680,000,000.00	9.61%	-	-
华泰证券	-	-	2,240,000,000.00	31.65%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
合计	84,620.20	100.00%	7,078,000,000.00	100.00%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇丰晋信基金管理有限公司
2017年3月29日