

华商新量化灵活配置混合型证券投资 基金招募说明书更新（摘要）

（2016年第1号）

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

华商新量化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2014年3月28日证监许可[2014]336号文核准募集，本基金基金合同于2014年6月5日生效。

投资有风险，投资人申购基金时应当认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2015年12月5日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 名称：华商基金管理有限公司
- 住所：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
- 办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
- 法定代表人：李晓安
- 成立时间：2005年12月20日

6、注册资本：壹亿元

7、电话：010—58573600 传真：010—58573520

8、联系人：周亚红

9、股权结构

股东名称	出资比例
华龙证券股份有限公司	46%
中国华电集团财务有限公司	34%
济钢集团有限公司	20%

10、客户服务电话：010-58573300 400-700-8880（免长途费）

11、管理基金情况：目前管理华商领先企业混合型证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商稳固添利债券型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商新趋势灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商新动力灵活配置混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金。

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

李晓安：董事长。男，清华大学 EMBA。现任华龙证券股份有限公司董事长兼党委书记；历任天水市信托投资公司副总经理、总经理、党委书记，天水市

财政局副局长、局长、党组书记。

田洪宝, 董事。男, 经济学专业研究生学历, 曾就职临沂电业局, 任用电所副主任、副局长、党委委员; 潍坊电业局, 任副局长; 山东潍坊发电厂, 任工会主席、党委委员、副厂长; 北京第二热电厂, 任厂长、党委委员; 华电(北京)热电有限公司, 任总经理、党委委员; 中国华电集团公司, 任计划发展部副主任、规划发展部副主任, 期间兼任浙江华电三门发电厂筹建处主任; 华电陕西能源有限公司, 任执行董事、总经理、党组副书记。现任中国华电集团资本控股有限公司执行董事、总经理、党组成员, 兼任陕西华电安康发电有限公司董事长。

张俊芳: 董事。男, 硕士研究生学历, 教授级高级政工师。现任济钢集团有限公司党委副书记、纪委书记、董事; 曾就职于山东省广饶县第六中学、济南钢铁总厂职工大学、济南钢铁总厂; 历任济钢集团有限公司党委委员, 党办、公司办主任, 工会主席, 副总经理, 党委副书记, 董事。

韩鹏: 董事。男, 工商管理硕士。现任华龙证券股份有限公司总经理, 曾就职于甘肃经济管理干部学院、兰州信托上海武昌路营业部、闽发证券公司, 历任华龙证券有限责任公司资产管理部总经理、总裁助理兼投资总监。

徐国兴: 董事。男, 工商管理硕士。现任华龙证券股份有限公司副总经理, 曾就职于招商银行兰州分行、甘肃省国税局、中国化工集团, 历任华龙证券有限责任公司委托投资部总经理、投资副总监。

刘晖: 董事。男, 大专学历, 经济师。现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理、党组成员; 曾就职于黑龙江省火电第二工程公司, 历任团委干事、团委副书记、宣传副部长、办公室副主任、党总支书记; 黑龙江电力股份有限公司, 任金融产业部经理; 黑龙江龙电典当公司, 任总经理; 华信保险经纪有限公司, 任副总经理、总经理。

梁永强: 董事。男, 经济学博士。现任华商基金管理有限公司总经理、基金经理, 曾就职于华龙证券有限公司, 历任华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理。

曲飞: 独立董事。男, 硕士研究生学历、高级工程师。现任北京亿路特通新

材料有限公司董事长，北京亿阳汇智通科技股份有限公司副董事长，南京长江第三大桥有限公司副董事长，亿阳集团股份有限公司董事、副总裁；曾就职于江苏盐城悦达集团、亿阳集团经贸公司；亿阳交通股份有限公司，任副总裁、总裁；亿阳信通股份有限公司，任董事、副总裁。

马光远：独立董事。男，经济学博士。现任北京中视旭晨文化传媒有限公司法律合规高级战略顾问，中央电视台财经评论员。曾就职于浙江省嘉兴市乡镇企业局、北京市境外融投资管理中心、北京市国有资产经营有限责任公司。

方国春：独立董事。男，博士研究生学历，经济师。现任英大泰和人寿保险股份有限公司业务总监兼法律合规部总经理；曾就职于国家教育委员会政策法规司，任副处长；中国光大国际信托投资公司，任总经理助理；国家留学基金委中澳项目办公室，任副主任；长城人寿保险股份有限公司，任项目中心经理；历任英大泰和人寿保险股份有限公司法律合规部主任、人力资源部主任、职工监事。

戚向东：独立董事。男，本科学历，研究员、高级会计师。现已退休，曾就职于河北省宣化钢铁公司，任管理干部；河北省冶金工业厅，任经济研究室主任；冶金工业部经济调节司，任副司长；国家冶金局体改法规司，任副司长；中国钢铁工业协会，任常务副秘书长；冶金经济发展研究中心，任党委书记。

2、监事会成员

苏金奎：监事。男，本科学历，会计师。现任华龙证券股份有限公司总会计师；曾就职于金昌市农业银行、化工部化工机械研究院、上海恒科科技有限公司；历任华龙证券有限公司投资银行部职员、计划财务部会计、副总经理、总经理。

李亦军：监事。女，会计专业硕士、高级会计师。现任中国华电资本控股有限公司机构与风险管理部部门经理；曾就职于北京北奥有限公司、中进会计师事务所（后并入信永中和会计师事务所）、中瑞华恒会计师事务所；历任华电集团财务有限公司计划财务部部门经理，华电集团资本控股有限公司企业融资部部门经理。

徐亮天：监事。男，硕士研究生学历，高级会计师。现任济钢集团有限公司财务处处长，历任济钢集团有限公司财务处物价科科员、成本科科员、科长、财务处副处长等职务。

3、总经理及其他高级管理人员

梁永强：董事、总经理。男，经济学博士。2004年7月加入华商基金管理公司筹备组，公司成立后历任投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理，现任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商主题精选混合型证券投资基金基金经理、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商未来主题混合型证券投资基金基金经理。曾就职于华龙证券有限公司投资银行部，担任研究员、高级研究员。

周亚红：督察长。女，经济学博士。2011年7月加入华商基金管理有限公司，曾任云南财经大学金融系副教授，博时基金管理有限公司研究员、TA主管、产品设计师、渠道主管、市场部副总经理，国金通用基金管理有限公司（筹）总经理助理等职务。

陆涛：副总经理。男，2006年5月加入华商基金管理有限公司，历任运营保障部总经理、公司总经理助理兼运营总监。曾任裕翔科技有限责任公司系统管理员，博时基金管理有限公司高级系统管理员。

刘宏：副总经理。男，特许金融分析师（CFA），2002年7月至2007年2月，就职于中国移动通信集团公司，任项目经理；2007年2月至2008年3月，就职于云南国际信托有限公司，担任高级分析员；2008年4月加入华商基金管理有限公司，历任华商动态阿尔法灵活配置混合型基金基金经理助理，华商产业升级混合型基金基金经理，投资管理部副总经理。现任华商价值精选混合型证券投资基金基金经理，华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理，华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，公司副总经理、投资管理部总经理。

4、基金经理

邓默，男，数学博士，中国籍，具有基金从业资格，2011年6月加入华商基金管理有限公司，从事金融工程与产品设计工作，2015年1月6日至2015年6月30日任公司量化投资部总经理助理，现任产品创新部副总经理。2015年9月9日起担任华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年9月9日起担任华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年9月9日起担任华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王东旋，男，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，2011年5月加入华商基金管理有限公司，现任量化投资部总经理助理，自2015年3月4日至2015

年 9 月 8 日担任华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2015 年 9 月 9 日起担任华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 9 月 9 日起担任华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 9 月 9 日起担任华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

费鹏, 男, 房地产金融博士, 自 2014 年 6 月 5 日至 2015 年 11 月 5 日担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度, 投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

梁永强: 华商基金管理有限公司董事、总经理、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商主题精选混合型证券投资基金基金经理、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商未来主题混合型证券投资基金基金经理、投资决策委员会主席;

刘宏: 华商基金管理有限公司副总经理、投资管理部总经理、华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理、华商价值精选混合型证券投资基金基金经理, 华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,;

梁伟泓: 华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、华商收益增强债券型证券投资基金基金经理、华商双债丰利债券型证券投资基金基金经理、华商双翼平衡混合型证券投资基金基金经理;

张杨: 华商基金管理有限公司证券交易部副总经理。

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一) 基本情况

名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行)

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

成立时间: 2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个、综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代

理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2015 年 9 月末，中国建设银行已托管 537 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完

整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

名称：华商基金管理有限公司

住所：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

法定代表人：李晓安

直销中心：华商基金管理有限公司

电话：010-58573768

传真：010-58573737

网址：www.hsfund.com

2、代销机构：

(1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：蒋松云

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(4) 招商银行股份有限公司

注册地点：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(5) 中信银行股份有限公司

注册地点：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：郭伟

电话：010-65558888

传真：010-65550827

客服电话：95558

公司网址:bank.ecitic.com

(6) 南京银行股份有限公司

注册地址：南京市中山路 288 号

办公地址：南京市中山路 288 号

法定代表人：林复

联系人：刘晔

服务热线：400-88-96400

网址：www.njcb.com.cn

(7) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

(8) 温州银行股份有限公司

住所：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

客服电话：浙江省内 96699，上海地区 962699

公司网址：www.wzbank.com.cn

(9) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址：乌鲁木齐市扬子江路 339 号商行科技大厦 7 楼

法定代表人：农惠臣

电话：0991-8824667

联系人：何佳

客服电话：96518

网址：www.uccb.com.cn

(10) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客服热线：400-689-8888、0931-96668

网址：www.hlzqgs.com

(11) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺、朱雅崑

客服电话：400-8888-666、95521

网址：www.gtja.com

(12) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：权唐

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(13)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

联系人:林生迎

客服电话:95565、4008888111

网址:www.newone.com.cn

(14)广发证券股份有限公司

注册地址：广东广州天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575 或致电各营业网点

网址：www.gf.com.cn

(15)中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(16)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

电话：010-66568450

传真：010-66568990

联系人：邓颜

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(17)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553、400-8888-001

网址：www.htsec.com

(18)申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：钱达琛

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

(19)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(20)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

开放式基金咨询电话：4008001001

开放式基金业务传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

(21)中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系电话：0571-85776114

传真：0571-86078823

联系人：李珊

公司网站：www.bigsun.com.cn

客户服务中心电话：0571-95548

(22)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777

联系人：庞晓芸

服务热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

(23)山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：400-666-1618，95573

网址：www.i618.com.cn

(24)中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 A 座 21 层(266061)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 A 座 21 层(266061)

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：95548

网址：wuzc@zxwt.com.cn

(25)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址: www.cindasc.com

(26)光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

联系人: 刘晨、李芳芳

客服电话: 95525、4008888788、10108998

网址: www.ebscn.com

(27)东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 杨树财

客户服务电话:4006000686

网址: www.nesc.cn

(28)国联证券股份有限公司

注册地址: 无锡市县前东街 168 号国联大厦

办公地址: 无锡太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人: 雷建辉

电话: 0510-82831662

联系人: 沈刚

客服电话: 95570

网址: www.glsc.com.cn

(29)浙商证券股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场

法定代表人: 吴承根

电话: 0571-87901963

传真：0571-87901955

联系人：胡岩

客服热线：4006-967777

网址：www.stocke.com.cn

(30)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16—20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16—20 层（518048）

法定代表人：谢永林

电话：0755-22621866

传真：021—58991896

联系人：石静武

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com.cn

(31)华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

客户服务电话：96518（安徽省内）、4008096518（全国）（基金业务咨询电话）

网址：www.hazq.com

(32)东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：乔芳

电话：0769-22100155

传真：0769-22100155

服务热线：0769-961130

网址: www.dgzq.com.cn

(33) 国都证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 常喆

电话: 010-84183333

传真: 010-84183311-3389

联系人: 黄静

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(34) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 朱科敏

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

联系人: 梁旭

客服电话: 95531; 400-888-8588

网址: www.longone.com.cn

(35) 国盛证券有限责任公司

注册地址: 江西省南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)

办公地址: 江西省南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)

法定代表人: 曾小普

电话 0791-86289667

传真 0791-86281485

客服电话: 4008222111

公司网址: www.gsstock.com

(36) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区 (新市区) 北京南路 358 号大成国际大厦

20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦

20 楼 2005 室（邮编:830002）

法定代表人：李季

电话：010-88085858

联系人：李巍

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(37)中泰证券股份有限公司

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

公司网址：www.ats.com.cn

(38)世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

网址：www.csc.com.cn

(39)华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87841160

传真：0591-87841150

联系人：张宗锐

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网址：www.hfzq.com.cn

(40)中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

(41)日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城區锡林南路 18 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层(100031)

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈文彬

客服电话：010-83991716

网址：www.rxzq.com.cn

(42)江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(43)国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪

客服电话：4006600109

网址：www.gjzq.com.cn

(44)长城国瑞证券有限公司

注册地址：福建省厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七层

办公地址：福建省厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七层

法定代表人：王勇

客服电话：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

(45)广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(46)华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

联系人：王道

客服电话：4001099918、021-32109999, 029-68918888

网址：www.cfsc.com.cn

(47)东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

办公地址：苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客服电话：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

(48)东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

电话：010-66555316

传真：010-66555133

联系人：汤漫川

客服电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net.cn

(49)国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755－82130833

传真：0755－82133952

联系人：周杨

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

(50)天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045152

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(51)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

客户服务电话：4006788887

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(52)杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：陈柏青

电话：0571-81147394

传真：0571-26698533

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

(53)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市高翔路 526 弄 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021—20691861

联系人：单丙焯

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(54)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

上海市虹口区欧阳路 196 号（法兰桥创意园）26 号楼 2 楼

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(55)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号（杨树浦路 340 号）C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38509639

传真：021-38509777

联系人：徐诚

客户服务电话：400—821—5399

网址：www.noah-fund.com

(56)中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层

法定代表人：姜新

客户服务电话：95162

网址：www.cifcofund.com

(57)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-59601366—7024

传真：010-62020355

联系人：马林

客服电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

(58)上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(59)万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 3201
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人：王斐
联系电话：010-59497361
传真：010-64788016
联系人：付少帅
客服电话：400-059-8888
公司网址：www.wy-fund.com

(60)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼
法定代表人：凌顺平
电话：0571-88911818
传真：0571-88910240
联系人：吴强
客户服务电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com

(61)宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809
法定代表人：沈伟桦
电话：010-52855713
传真：010-85894285
联系人：王巨明
客服电话：400 6099 200
网址：www.yixinfund.com

(62)一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室
办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：010-88312877

传真：010-88312099

联系人：段京璐

客服电话：400-0011-566

网址：www.yilucaifu.com

(63)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303

法人代表：王岩

联系人：胡明会

电话：010-59200855

传真：010-59200800

网址：www.tdyhfund.com

客服电话：400-819-9868

(64)北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

法人代表：梁蓉

联系人：张晶晶

电话：010-66154828

传真：010-88067526

客服电话：010-88067525

网址：www.5irich.com

(65)泰信财富投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

办公地址：北京市海淀区西四环北路69号一层

法定代表人：穆宏轩

电话：88460066

联系人：房珊珊

客户服务电话：88495118 转 8027

网址：fangshanshan126@126.com

（二）注册登记机构

名称：华商基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

法定代表人：李晓安

电话：010-58573572

传真：010-58573580

联系人：马砚峰

网址：www.hsfund.com

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：刘佳 张兰

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：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

法人代表：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：单峰、周祎

联系人：周祎

四、基金的名称

本基金名称：华商新量化灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金充分利用量化投资策略和量化工具，严格控制下行风险，实现基金资产的持续稳健增长。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的投资组合比例为：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）投资比例为基金资产的0—95%；债券、权证、现金、货币市场工具和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占基金资产的5%—100%，其中权证占基金资产净值的0%—3%，中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于10%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执

行。

八、基金的投资策略

本基金所指的“新量化”是指本基金所采用的量化投资策略不仅局限于传统的多因子量化策略。具体来说，本基金管理人采用自主开发的量化系统风险判定模型对中短期市场的系统性风险进行判断，从而决定本基金在股票、债券和现金等金融工具上的投资比例，并充分利用股指期货作为对冲工具；在股票选择方面，本基金采用量化择股系统和基本面研究相结合的方式对股票进行选择和投资，多维度地分析股票的投资价值，精选具有较高投资价值的上市公司构建本基金的多头组合。

1、大类资产配置策略

本基金通过量化策略和工具，对宏观政策、微观行业、市场情绪等方面进行全面研究，再辅以量化系统风险判定模型来确定中短期市场系统风险。通过风险判定模型来调整仓位，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例，适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。

本基金的择时主要依据风险判定模型的结果，综合考量研究机构的市场判断和本公司研究团队的研究结果，同时对量化指标进行不断更新，并对世界前沿的量化技术进行分析和使用，以辅助基金管理人对市场的评判。

2、股票投资策略

本基金采用“自下而上”的量化投资系统选择股票，并辅以“定性”的基本面研究来二次确认。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。具体来说，本基金股票投资策略主要是以量化择股系统和基本面研究相结合的方式，根据市场的变化，灵活运用多种量化模型策略（如多因子模型、技术分析策略、个股统计分析策略、统计套利策略、定向增发策略、事件驱动策略等），从而提高组合收益，以期达到投资策略的多元化，降低组合的波动。

根据量化择股系统筛选出的个股，再从基本面分析入手，主要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能

力、运营效率、财务结构、现金流情况等公司基本面因素，对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

3、债券投资策略

本基金的债券投资以配置为主。在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

本基金的股指期货投资基于市场系统风险模型的中短期风险判断，在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低仓位后，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。当市场向好时，管理人可择机在股指期货市场建立能够使得组合 β 值稳定的头寸从而避免现货快速建仓带来的流动性冲击，然后在保持组合风险敞口不变的前提下，在缓慢的现货市场建仓过程中有节奏地将期货头寸逐步平仓，充分利用股指期货提高资金使用效率。

5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债属于高收益债品种之一，其特点是信用风险高、收益率高、债券流动性较低。目前我国的中小企业私募债仍处于起步阶段，仅有小部分中小企业私募债有评级机构评级；与高信用风险相对应的是中小企业私募债较高的票面利率和到期收益率；由于中小企业私募债在我国目前市场规模较小，市场参与者较少，单只债券的规模也较小，且有持有人数上限限制，因此债券的流动性较差，随着我国信用债市场的发展，中小企业私募债的规模将会急剧的扩大，流动性也将得到改善，但从长期来看中小企业私募债的流动性仍将低于信用评级在投资级以上的品种，这是其品种本身固有的风险点之一。

本基金在对我国中小企业私募债市场发展动态紧密跟踪基础之上，依据独立的中小企业私募债风险评估体系，配备专业的研究力量，并执行相应的内控制度，

更加审慎地分析单只中小企业私募债的信用风险及流动性风险,进行中小企业私募债投资。在中小企业私募债组合的管理上,将使用更加严格的风控标准,严格限制单只债券持有比例的上限,采用更分散化的投资组合,更短的组合到期期限来控制组合的信用风险和流动性风险。

6、其他投资品种投资策略

(1) 权证投资策略:本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

(2) 衍生品投资策略:本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是:

沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

本基金为混合型证券投资基金,股票投资比例为 0-95%,因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为 60%,其余为债券投资部分。

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:

- 1、沪深 300 指数编制合理、透明、运用广泛,具有较强的代表性和权威性。
- 2、上证国债指数以国债为样本,按照发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。
- 3、作为混合型基金,选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称,或法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或市场中出现更适用于本基金的比较基准指数,本基金无需召开基金份额持有人大会,但应征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准,并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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。

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 2015 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告的财务所载财务数据截止至 2015 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

截止 2015 年 9 月 30 日，华商新量化灵活配置混合型证券投资基金资产净值为 1,010,719,665.63 元，份额净值为 1.369 元，累计份额净值为 1.369 元。

其投资组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	919,182,657.97	88.93
	其中：股票	919,182,657.97	88.93
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	108,664,828.12	10.51
8	其他资产	5,812,312.53	0.56
9	合计	1,033,659,798.62	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2015年9月30日

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	75,814,201.84	7.50
B	采矿业	129,310,818.64	12.79
C	制造业	592,152,211.97	58.59
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	37,742,764.80	3.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	43,371,675.60	4.29
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	40,790,985.12	4.04
S	综合	-	-
	合计	919,182,657.97	90.94

3. 报告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

2015年9月30日

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	2,985,300	64,661,598.00	6.40
2	000799	*ST酒鬼	3,851,835	55,196,795.55	5.46
3	600189	吉林森工	4,702,588	52,198,726.80	5.16
4	600141	兴发集团	3,627,564	43,530,768.00	4.31
5	600706	曲江文旅	3,086,952	43,371,675.60	4.29
6	600506	香梨股份	2,731,061	41,075,157.44	4.06
7	600880	博瑞传播	4,765,302	40,790,985.12	4.04
8	600216	浙江医药	4,553,726	39,845,102.50	3.94
9	000905	厦门港务	3,931,538	37,742,764.80	3.73
10	600547	山东黄金	2,313,971	37,625,168.46	3.72

4. 报告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。

5. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告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。

7. 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. 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，在风险可控的前提下，根据量化风险模型统计分析，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 宜宾五粮液股份有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 6 月 1 日收到深圳证券交易所公司管理部《关于对宜宾五粮液股份有限公司的监管函》及四川证监局《关于高管减持股票相关事项的关注函》。2015 年 4 月 22 日，公司副总经理叶伟泉先生股票账户以 27.92 元的价格减持其持有的公司股票 16,000 股，本次减持后持有股份 82,519 股，其减持股票的行为系由其家属操作所致。2015 年 4 月 29 日，公司披露 2015 年第一季度报告。叶伟泉先生本次减持股票的行为，违反了《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》（2015 年修订）第 3.8.15 条：“上市公司董事、监事、高级管理人员、证券事务代表及前述人员的配偶在下列期间不得买卖本公司股票及其衍生品种：（一）公司定期报告公告前三十日内，因特殊原因推迟年度报告、半年度报告公告日期的，自原预约公告日前三十日起算，至公告前一日”之规定。公司知悉此事后，高度重视，及时了解相关情况，对叶伟泉先生违规减持股票的行为进行了严肃的批评教育，并责成其进行深刻书面检讨。2015 年 5 月 4 日，公司向深圳证券交易所公司监管员汇报了此事项的相关情况；2015 年 5 月 19 日，叶伟泉先生专程到四川证监局说明相关情况。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,475,797.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,827.18

5	应收申购款	4,321,687.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,812,312.53

11.4 报告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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000858	五粮液	64,661,598.00	6.40	重大事项停牌
2	000799	*ST 酒鬼	55,196,795.55	5.46	重大事项停牌
3	600189	吉林森工	52,198,726.80	5.16	重大事项停牌
4	600141	兴发集团	43,530,768.00	4.31	重大事项停牌
5	600880	博瑞传播	40,790,985.12	4.04	重大事项停牌
6	600547	山东黄金	37,625,168.46	3.72	重大事项停牌

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

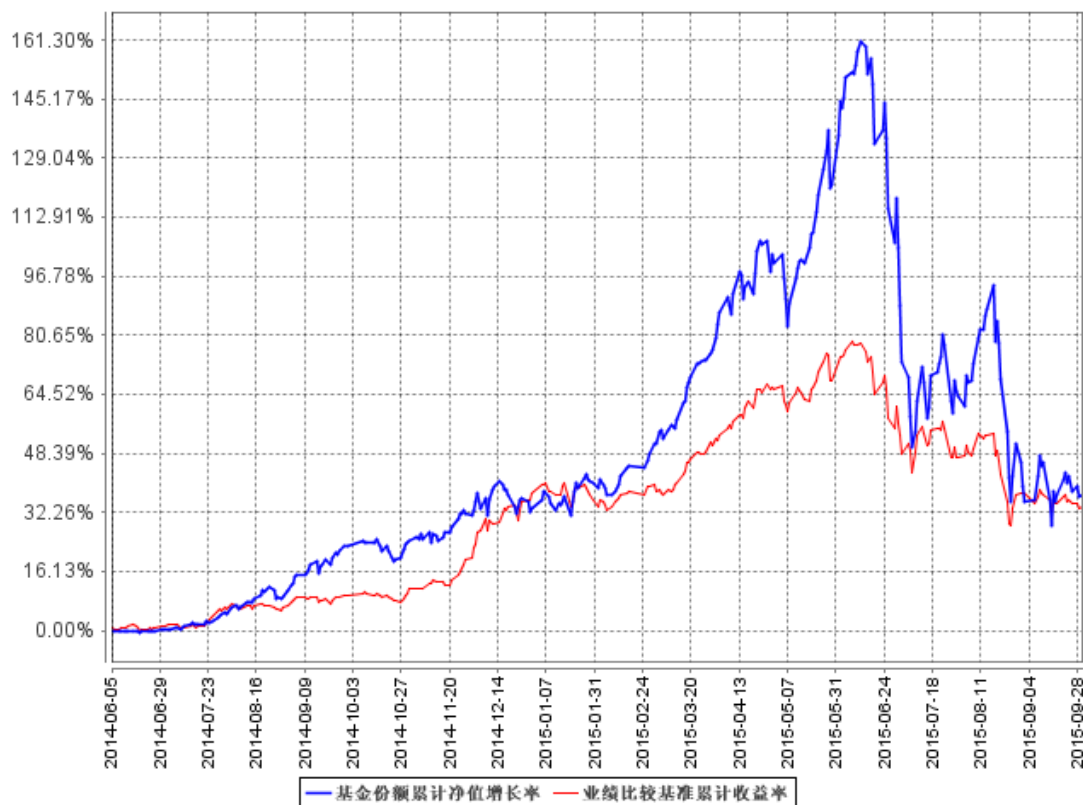
十二、基金的业绩

1. 本报告期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	净值增长率①	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
基金成立日至 2014/12/31	33.30%	1.04%	37.50%	0.76%	-4.20%	0.28%
2015/01/01 至 2015/06/30	63.47%	2.25%	17.30%	1.36%	46.17%	0.89%
2015/07/01 至 2015/09/30	-37.17%	4.29%	-16.99%	2.01%	-20.18%	2.28%

1.1.1 自基金合同生效以来基金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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同生效日为2014年6月5日。

②根据《华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）投资比例为基金资产的0—95%；债券、权证、现金、货币市场工具和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占基金资产的5—100%，其中权证占基金资产净值的0%—3%，中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于10%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

十三、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （1）基金管理人的管理费。
- （2）基金托管人的托管费。
- （3）基金份额持有人大会费用。
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费。
- （6）基金的证券交易费用。
- （7）基金的银行汇划费用。
- （8）基金的开户费用、账户维护费。

（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“1、基金费用的种类中第（3）—（9）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

（3）《基金合同》生效前的相关费用。

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（二）基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有

关法律法规的要求，我公司结合华商新量化灵活配置混合型证券投资基金的运行情况，对其原招募说明书进行了更新，主要更新的内容说明如下：

(1)更新了“重要提示”部分的相关内容。

(2)更新了“三、基金管理人”的相关信息。

(3)更新了“四、基金托管人”的相关信息。

(4)更新了“五、相关服务机构”中代销机构相关信息。

(5)在“九、基金的投资”中根据本基金的实际运作情况，更新了最近一期投资组合报告的内容，并更新了最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

(6)在“二十一、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

华商基金管理有限公司

2016年1月18日