

# 华商新动力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2号）

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

华商新动力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2015年7月13日证监许可[2015]1618号文注册，本基金基金合同于2015年9月17日正式生效。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2016年9月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6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

- 1、名称：华商基金管理有限公司
- 2、住所：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层
- 3、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
- 4、法定代表人：李晓安
- 5、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、华商新量化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、华商健康生活灵活配置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、华商新趋势优选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、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金、华商保本1号混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金。

## （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，历任华龙证券股份有限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，历任华龙证券股份有限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。

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长、成本科科长、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

周海栋：男，管理学硕士，中国籍，具有基金从业资格；2003年7月至2004年10月就职于上海慧旭药物研究所任研究员；2004年10月至2005年8月就职于上海拓引数码技术有限公司任项目经理；2008年1月至2010年6月就职于中国国际金融有限公司任研究员；2010年6月加入华商基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、机构投资部投资经理。2012年3月起至2014年5月5日担任华商策略精选灵活配置混合型基金基金经理助理，2014年5月5日起担任华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年5月14日起担任华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年9月17日起担任华商新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年8月5日起担任华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘萌萌，男，工学博士，中国籍，具有基金从业资格，2011年7月，加入华商基金管理有限公司，任行业研究员。2015年7月21日至2016年4月11日担任华商价值精选混合型证券投资基金基金经理助理，2016年4月12日起担任华商价值精选混合型证券投资基金基金经理，2016年8月5日起担任华商新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 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、华商保本1号混合型证券投资基金基金经理、华商稳定增利债券型证券投资基金基金经理；

蔡建军：华商基金管理有限公司研究发展部副总经理，华商健康生活灵活配置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。

### （三）基金管理人职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制季度、半年度和年度基金报告；

13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

- 17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
  - （3）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
  - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）侵占、挪用基金财产；



(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 向基金管理人、基金托管人出资；

(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### (五) 基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着敬业、诚信和谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易，不利用职务之便为自己、或任何第三者谋取利益；

3、不违反现行有效的法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (六) 基金管理人的内部风险控制制度

##### 1、内部控制制度

###### (1)内部控制的原则

1)健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

2)有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

3)独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

4)相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

5)成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

###### (2)内部控制的主要内容

###### 1)控制环境

①控制环境构成公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过

营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主透明的决策程序和管理议事规则、高效严谨的业务执行系统、以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度，严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度，确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2)风险评估

内部稽核人员定期评估公司风险状况，范围包括所有可能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

## 3)组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

### ①第一层次风险控制

在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。

公司设督察长。督察长作为风险控制委员会的执行机构，对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。

### ②第二层次风险控制

第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理小组、投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。

监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

### ③第三层次风险控制

第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

### 4)制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

①内部控制制度包括内部控制大纲、业务控制制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

②内部管理控制制度包括财务管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

③业务控制制度包括投资管理制度、基金销售管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、信息技术管理制度和突发事件管理制度。

### 5)信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

## 2、基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

### （二）主要人员情况

截至 2015 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2015 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 496 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上

海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013年七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后，2014年中国工商银行资产托管部第八次通过ISAE3402(原SAS70)审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调



规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）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

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资是否符合有关法律法规的规定及基金合同的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

### 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](http://www.hsfund.com)

##### 2、代销机构：

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

联系人：洪渊

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com](http://www.icbc.com)

(2) 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姐 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(3) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 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](http://bank.pingan.com)

(5) 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](http://www.uccb.com.cn)

（6）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](http://www.hlzqgs.com)

（7）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](http://www.gtja.com)

（8）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](http://www.csc108.com)

（9）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

客服电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（10）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](http://www.newone.com.cn)

（11）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：张佑君

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（12）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：010-66568292

传真：010-66568990

联系人：邓颜

客服电话：4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（13）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](http://www.htsec.com)

（14）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 40 层

法定代表人：李梅

电话：021-33388215

传真：021-33388224

联系人：王叔胤

客服电话：95523 或 4008895523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（15）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

（16）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：王连志

开放式基金咨询电话：4008001001

开放式基金业务传真：0755-82558355

联系人：陈剑红

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

（17）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

（18）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

联系人：赵艳青

客服电话：95548

网址：www.citicssd.com

（19）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：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（20）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 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](http://www.ebscn.com)

（21）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](http://www.nesc.cn)

（22）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

（23）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：李婷

客服热线：95345

网址：www.stocke.com.cn

（24）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：021-38637436

传真：021-58991896

联系人：周一涵

电话：021—38631117

传真：021-58991896

联系人：石静武

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

（25）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）

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

（26）国海证券股份有限公司

注册地址: 广西桂林市辅星路 13 号

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅峰

联系人: 牛孟宇

电话: 0755—83709350

传真: 0755—83704850

客服电话: 95563

网址: [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

（27）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](http://www.dgzq.com.cn)

（28）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: 王少华

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](http://www.guodu.com)

（29） 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：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-888-8588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（30） 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：马跃进

电话 0791-86289667

传真 0791-86281485

客服电话：4008222111

公司网址：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

（31） 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：韩志谦

联系人：王怀春

客服电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（32） 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

（33）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：4008-323-000

网址：www.csc.com.cn

（34）华福证券股份有限公司

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—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

（35）财通证券股份有限公司

注册地点：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

法定代表人：沈继宁

联系人：章力彬

联系电话：0571-87825100

传真：0571-87818329

客服电话：95336,4008695336

网址：www.ctsec.com

（36）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

（37）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

（38）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、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

（39）华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：（021）68778790

传真：（021）68777992

服务热线：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

（40）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、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主塔 19、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：梁微

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

电话：（010）66045182

传真：（010）66045518

联系人：谭磊

客服电话：（010）66045678

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

（45）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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（46）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：0571-81137494

传真：0571-26698533

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（47）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](http://www.erichfund.com)

（48）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](http://www.ehowbuy.com)

（49）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](http://www.noah-fund.com)

（50）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](http://www.cifcofund.com)

（51）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

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

（52）众升财富（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：李招弟

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

联系人：李艳

客服电话：400-059-8888

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（53）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：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：吴强

客户服务电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（54）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](http://www.yixinfund.com)

（55） 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](http://www.yilucaifu.com)

（56） 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：张旭

电话：010-66154828

传真：010-88067526

客服电话：400-6262-818

网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

（57） 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;010-88460066

联系人：房珊珊

客户服务电话:400-881-5596

网址：[fangshanshan126@126.com](mailto:fangshanshan126@126.com)

（58） 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：400 910 1166

网址：www.cicc.com.cn

（二）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 14 楼

办公地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：廖海、刘佳

（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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法人代表：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：周祎

经办会计师：单峰、周祎

## 四、基金的名称

本基金名称：华商新动力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

本基金将重点挖掘中国经济发展的新动力，精选质地优秀且具备估值优势的上市公司，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。

## 七、基金的投资范围

本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法发行上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，投资于新动力方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具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

本基金的投资框架为三维立体体系：宏观市场的策略体系、行业选择体系与个股筛选体系。依据市场风格的判断进行大类资产配置、优势行业的选择进行行

业配置和投资标的筛选进行个股配置，三位一体的结合起来，构建出本基金的投资组合。

### 1、大类资产配置

本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，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，适时动态地调整各金融工具的投资比例。

### 2、行业配置策略

本基金在实际投资过程，主要投资“新动力”方向上的行业与股票。

#### （1）新动力的涵义和范畴

本基金中的新动力，是指创造和应用新科技、新工艺，新的产业模式和商业模式，增强企业市场价值，调整产业方向，提高产品质量和服务理念的过程。新动力的投资方向主要包含：科技创新方向、新兴产业方向以及商业模式创新方向。凡具有上述特征的上市公司，均可纳入本基金新动力相关股票的涵盖范围内。

#### （2）新动力的行业筛选

本基金关注的“新动力”主要包括以下几个方面：

第一，重点关注科技创新。科学技术是第一生产力，科技创新是社会和经济发展最根本的动力。本基金将通过对新科技成果在技术、需求、产业以及政策等方面因素的综合分析，深入挖掘其所蕴含的价值潜力。在此基础上，考虑相应科技成果对其产业链上下游的影响力以及带动性，选择深度受益行业和公司作为重点配置方向。

第二，积极寻找新兴产业。新兴产业一方面指战略新兴产业，是指我国在转变经济发展方式、调整经济产业结构方面进行的战略性布局。根据《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》中的规定，本基金所投资的战略性新兴产业主要包括但不限于：节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料以及新能源汽车等产业。另一方面，本基金的新兴产业也会围绕社会需求和代际人口的变化，寻找投资机会，围绕老龄化和新时代年轻人不同的生活

娱乐方式，去发现新兴的产业机会。

第三，深入研究商业模式。深入研究商业模式的变化，是指在业态发展进程中，以新的经营方式、新的经营技术、新的经营手段取代传统的经营方式和技术手段。尤其是互联网的出现，对于传统商业和服务形式的转变。目前这些新的商业模式主要集中在四大产业领域，所涉及到的投资主题包括但不限于服务业、文化传媒、电子商务和移动互联网为代表的战略新兴产业，以及工业 4.0 为代表的高端制造业。

此外，本基金将深入研究技术进步、社会组织方式的变化、需求演变以及产业价值链分解融合等因素在促使新业态形成中的重要作用，并判断各种新兴商业模式的市场潜力以及拉动效力。重点配置市场潜力巨大，拉动效力强劲的新兴商业模式相关产业。

在不同的经济发展阶段，由于特定的社会需求以及当时的政策导向等多种因素的共同作用下，新动力所代表的产业方向会发生变化，本基金将根据具体情况对其构成进行动态调整。

### 3、个股精选策略

本基金主要在“新动力”方向上精选个股，构建股票组合。

本基金最核心的价值在于公司的选择。在新的经济背景下，产业发展逻辑跟过去存在着巨大的不同，而产业内不同的企业将比老经济模式下，体现出更大的区别。判断投资价值，从原来的重方向变为未来的重个体。我们将在新动力的行业范畴内的个股，认真分析和判断技术创新、商业模式、企业家精神等影响我们投资的核心因素，来构建我们的投资组合。

具体来说，本基金是通过对公司定性的因素与定量的因素的综合考察来优选投资标的，通过对安全边际与绝对收益的重视及其收益实现方式的积累来实现有限风险下的较高收益。

公司选择首先要考察其技术优势、治理结构、商业模式、核心竞争力等定性的因素。其次要考察过去与未来的成长性，成长性与估值的偏差，企业所处的生命周期等因素。通过定性定量指标的结合来综合判定公司的选择更为优质的成长股。

通过技术优势的考察，我们选择具有技术壁垒和创新优势的企业。通过治理

结构的考察，我们选择那些股东利益最大化的经营管理团队。通过商业模式的考察，我们选择那些有制度生命力与制度比较优势的企业。通过核心竞争力的考察，我们选择那些有能力获得更高、更长久、更稳定的收益的企业。

定量的指标要考察过去，更要考察未来。要考察简单的成长性，也要结合成长性与估值的平衡。要考虑成长的速度，也要考察成长所处的生命周期阶段。

#### 4. 债券投资策略

##### （1）普通债券投资策略

普通债券投资过程中，期限配置对于组合的风险收益特征起主导作用。本基金普通债券资产投资策略为：

以基本面分析为基础，实现对债券组合期限结构的积极配置，构建优化的资产组合。

上述投资策略实施的总体思路是：

1) 通过对宏观经济、利率走势等基本面分析，从整体上把握今后一段时间内债券市场的变化趋势；

2) 利用收益率曲线的情景分析，测算不同期限债券在不同情景下的回报；

3) 根据债券的风险收益情况，构建本基金的普通债券投资组合。

##### （2）可转换债券投资策略

本基金可转换债券资产投资策略为：选取债/股性适中和基本面良好的转债，同时通过对发行人转股意愿的分析，把握获利机会。具体投资策略包括：

##### 1) 债/股性分析

转债投资宜侧重平衡性配置，兼顾债/股性。本基金投资范围包括普通债券和股票等，可转债作为一个独特的资产类属，应兼顾债/股性，而并不是简单的普通债券或股票的替代品，平衡型的转债品种是攻防兼备的投资选择。

##### 2) 基本面分析

未来几年转债投资的个券选择比行业选择更重要。在把握行业周期性特征的同时，为获得较高的超额收益，选择具有明显行业竞争优势的龙头企业将更为重要，资产管理人将重点关注和发掘这些企业中股价估值合理的转债发行公司。

#### 5. 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。

在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸的同时，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。

此外，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金资产组合将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略，稳定收益。

#### 6.其他投资品种投资策略

**权证投资策略：**本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易、避险交易组合以及合同许可投资比例范围内的价值显著低估的权证品种。

**资产支持证券投资策略：**在控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从五个方面综合定价，选择低估的品种进行投资。五个方面包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

**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。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：

中证 800 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%

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 65%，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、中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。本基金管理人认为，该业绩比较基准在当前市场中能够反映本基金的风险收益特征。

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，本基金可以在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，无需召开基金份额持有人大会。

## 十、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

（七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值；

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益；

4、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

## 十一、基金投资组合报告

本基金按照《基金法》、《信息披露办法》及中国证监会的其他规定中关于投资组合报告的要求披露基金的投资组合。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

截至 2016 年 6 月 30 日，华商新动力灵活配置混合型证券投资基金资产净值为 132,241,518.77 元，份额净值为 0.965 元，累计份额净值为 0.965 元。

其投资组合情况如下：

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	107,481,981.91	80.39
	其中：股票	107,481,981.91	80.39
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	25,846,261.65	19.33
7	其他各项资产	373,416.16	0.28
8	合计	133,701,659.72	100.00

### 2. 期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 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（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,414,466.57	35.85
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	10,508,763.01	7.95
G	交通运输、仓储和邮政业	12,414,680.98	9.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,255,704.30	13.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,927,189.45	6.75
L	租赁和商务服务业	9,961,177.60	7.53
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	107,481,981.91	81.28

## 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有沪港通股票投资组合。

## 3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300324	旋极信息	466,050	10,001,433.00	7.56
2	002188	巴士在线	344,320	9,961,177.60	7.53
3	002520	日发精机	451,635	6,666,132.60	5.04
4	002761	多喜爱	160,000	6,460,800.00	4.89
5	600622	嘉宝集团	400,000	5,500,000.00	4.16

6	600079	人福医药	320,096	5,368,009.92	4.06
7	002042	华孚色纺	473,193	4,892,815.62	3.70
8	002410	广联达	339,991	4,861,871.30	3.68
9	600029	南方航空	598,754	4,227,203.24	3.20
10	300142	沃森生物	500,000	4,070,000.00	3.08
11	601111	中国国航	600,000	4,056,000.00	3.07
12	002727	一心堂	160,050	4,001,250.00	3.03
13	300159	新研股份	200,000	3,610,000.00	2.73
14	000631	顺发恒业	703,735	3,427,189.45	2.59
15	300418	昆仑万维	120,000	3,392,400.00	2.57
16	002494	华斯股份	211,393	3,266,021.85	2.47
17	000028	国药一致	50,000	3,255,000.00	2.46
18	600337	美克家居	250,001	3,252,513.01	2.46
19	600315	上海家化	96,000	2,768,640.00	2.09
20	002020	京新药业	199,834	2,471,946.58	1.87
21	002329	皇氏集团	150,000	2,248,500.00	1.70
22	603885	吉祥航空	80,000	2,100,000.00	1.59
23	600115	东方航空	307,334	2,031,477.74	1.54
24	300054	鼎龙股份	80,000	2,001,600.00	1.51
25	601339	百隆东方	300,000	1,905,000.00	1.44
26	002626	金达威	100,000	1,685,000.00	1.27

#### 4. 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 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	002761	多喜爱	6,798,280.73	3.62
2	600622	嘉宝集团	6,231,201.02	3.32
3	000631	顺发恒业	5,964,526.92	3.18
4	600115	东方航空	5,725,890.00	3.05
5	002776	柏堡龙	5,601,446.66	2.98
6	000797	中国武夷	4,860,822.23	2.59
7	300142	沃森生物	4,774,186.68	2.54
8	600258	首旅酒店	4,743,976.71	2.53
9	603799	华友钴业	4,423,142.23	2.36

10	601111	中国国航	4,370,496.00	2.33
11	002042	华孚色纺	4,285,048.00	2.28
12	300418	昆仑万维	4,011,900.38	2.14
13	002020	京新药业	3,880,275.94	2.07
14	300054	鼎龙股份	3,818,677.58	2.03
15	002494	华斯股份	3,704,438.97	1.97
16	000028	国药一致	3,570,917.00	1.90
17	600029	南方航空	3,486,822.00	1.86
18	300059	东方财富	3,436,881.00	1.83
19	300159	新研股份	3,369,029.28	1.79
20	002157	正邦科技	3,273,697.00	1.74

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

#### 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	300324	旋极信息	7,107,756.13	3.78
2	002776	柏堡龙	6,988,861.00	3.72
3	000961	中南建设	5,750,748.62	3.06
4	603799	华友钴业	5,563,338.63	2.96
5	000615	京汉股份	5,528,071.00	2.94
6	002157	正邦科技	5,218,038.13	2.78
7	000797	中国武夷	5,050,873.89	2.69
8	002727	一心堂	4,658,513.41	2.48
9	600258	首旅酒店	4,203,204.96	2.24
10	600420	现代制药	4,012,800.00	2.14
11	600337	美克家居	3,859,827.53	2.06
12	000881	大连国际	3,541,376.69	1.89
13	002042	华孚色纺	3,530,897.21	1.88
14	300059	东方财富	3,518,374.16	1.87
15	600115	东方航空	3,372,476.51	1.80
16	000669	金鸿能源	3,326,983.00	1.77
17	002512	达华智能	3,107,476.00	1.65
18	000631	顺发恒业	3,100,122.23	1.65
19	600376	首开股份	3,070,728.00	1.64

20	600717	天津港	3,031,000.00	1.61
----	--------	-----	--------------	------

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

#### 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	158,662,954.19
卖出股票收入（成交）总额	144,319,860.15

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

#### 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。

#### 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。

#### 7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8. 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投资。

#### 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投资。

#### 10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 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。

##### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 11.1 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。

## 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。

## 11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 12. 投资组合报告附注

### 12.1

华孚色纺股份有限公司分别于 2015 年 12 月 10 日和 2016 年 2 月 1 日收到中国证券监督管理委员会安徽监管局和深交所发布的行政监管措施决定书（[2015]8 号）——《关于对华孚色纺股份有限公司高管陈亮采取出具警示函措施的决定》和对时任华孚色纺国内营销副总监陈亮给予通报批评处分的决定。当事人陈亮，时任华孚色纺国内营销副总监。于 2015 年 8 月 31 日卖出华孚色纺股票 5,000 股，涉及金额 42,800 元。陈亮的减持行为违反了中国证券监督管理委员会公告〔2015〕18 号中有关“从即日起 6 个月内，上市公司控股股东和持股 5% 以上股东及董事、监事、高级管理人员不得通过二级市场减持本公司股份”的规定以及深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条、第 3.1.8 条的规定和《中小板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 1.3 条、第 3.8.1 条的规定。此行为属于个人行为，未经上市公司批准。

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。

### 12.2

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。

### 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	56,904.57
2	应收证券清算款	303,771.48
3	应收股利	-
4	应收利息	5,501.16
5	应收申购款	7,238.95
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,416.16

#### 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。

#### 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	300142	沃森生物	4,070,000.00	3.08	重大事项停牌

#### 12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### （九）基金净值表现

##### 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

（截止至 2016 年 6 月 30 日）

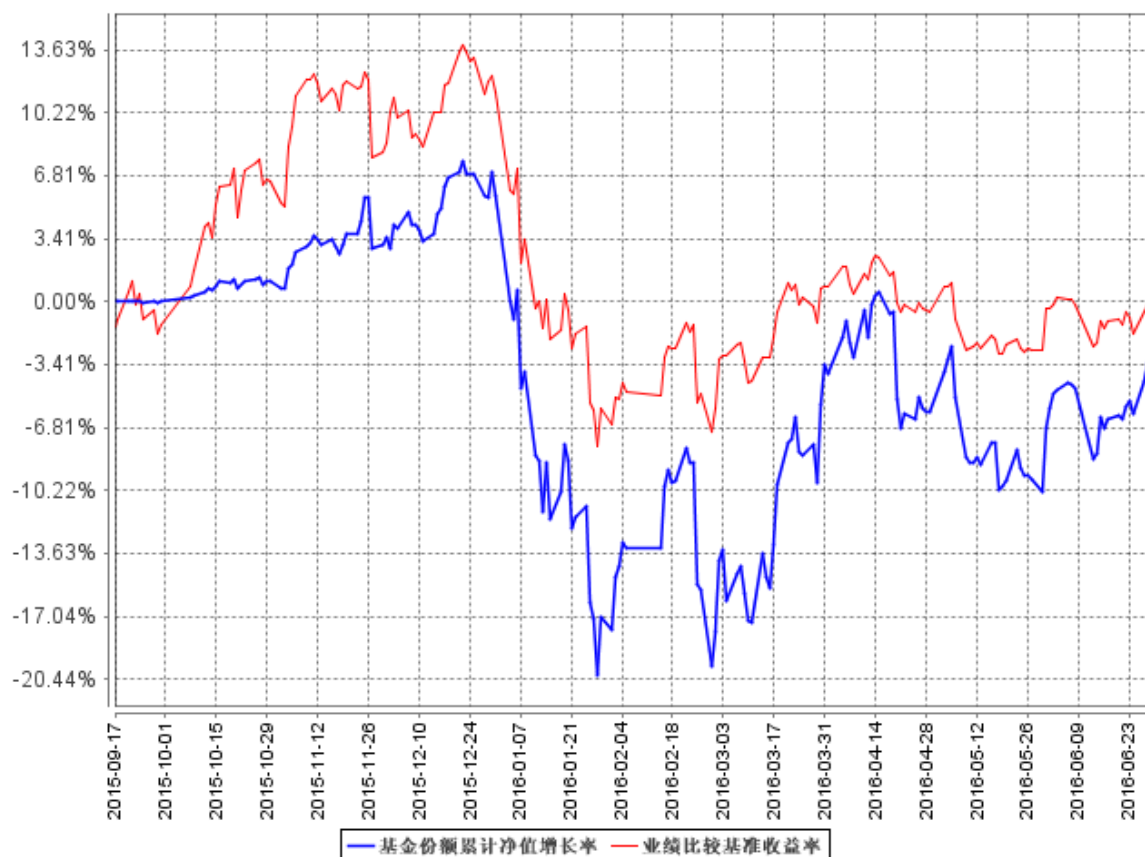
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2015年9月17日 -2015年12月31日	5.70%	0.58%	11.34%	1.11%	-5.64%	-0.53%
2016年1月1日 - 2016年6月30日	-8.70%	2.23%	-10.07%	1.32%	1.37%	0.91%

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
2015年9月17日 -2015年12月31日	5.70%	0.58%	11.34%	1.11%	-5.64%	-0.53%
2016年1月1日 - 2016年6月30日	-8.70%	2.23%	-10.07%	1.32%	1.37%	0.91%



## 2.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 2015 年 9 月 17 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《华商新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他依法发行上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以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）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，投资于新动力方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具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。

## 十二、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、期货交易费用。
- （7）基金的银行汇划费用。
- （8）基金的开户费用、账户维护费用。
- （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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### （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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要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 日前在指定媒介上刊登公告。

#### （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。

## 十三、对招募说明书更新部分的说明

（一）更新了“重要提示”部分的相关内容。

（二）更新了“三、基金管理人”的相关信息。

（三）更新了“四、基金托管人”的相关信息。

（四）更新了“五、相关服务机构”中代销机构信息。

(五) 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，及最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

(六) 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10月31日