

# 华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 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.....	44
7.7 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.....	44
7.8 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.....	44
7.9 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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.3 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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华商优势行业混合
基金主代码	000390
交易代码	000390
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 11 日
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
报告期末基金份额总额	595,663,114.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以对经济周期、产业周期判断为基础，深入研究不同经济周期下产业周期的变化，准确把握在产业周期变化过程中表现相对强势的行业和主题板块，通过超配优势行业和板块、精选这些行业和板块中成长性良好的优质股票来构建组合，实现基金资产的持续稳健增长。
投资策略	本基金通过主动判断经济周期，以经典经济周期对资本市场形成方向影响为基础，结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场方向，进行积极的资产配置。本基金遵循行业间优势配置、各行业内部优选个股相结合的股票投资策略，其中行业间优势配置是以宏观经济、产业周期、行业成长性、行业竞争力和估值等五个指标为基础，综合评判行业所处的状况和未来发展趋势，筛选出经济周期不同阶段的优势行业，这些优势行业具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越各行业平均收益率的投资收益；行业内优选个股是以若干财务指标、成长性、估值、在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间、是否具有主题型投资机会等定性指标与定量指标为基础，筛选出经济周期与行业发展的不同阶段下，具有较高投资价值、持续成长性较好的优势个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
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。

### 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	华商基金管理有限公司		中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周亚红	田青
	联系电话	010-58573600	010-67595096
	电子邮箱	zhouyh@hsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话	4007008880		010-67595096
传真	010-58573520		010-66275853
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		北京市西城区金融大街 25 号
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		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100035		100033
法定代表人	李晓安		王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hsfund.com">http://www.hsfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	532,134,876.39
本期利润	552,362,585.32
加权平均基金份额本期利润	0.7566
本期加权平均净值利润率	52.61%
本期基金份额净值增长率	68.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	187,649,377.39
期末可供分配基金份额利润	0.3150

期末基金资产净值	783,312,491.80
期末基金份额净值	1.315
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	100.14%

注：1. 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益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。

3. 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

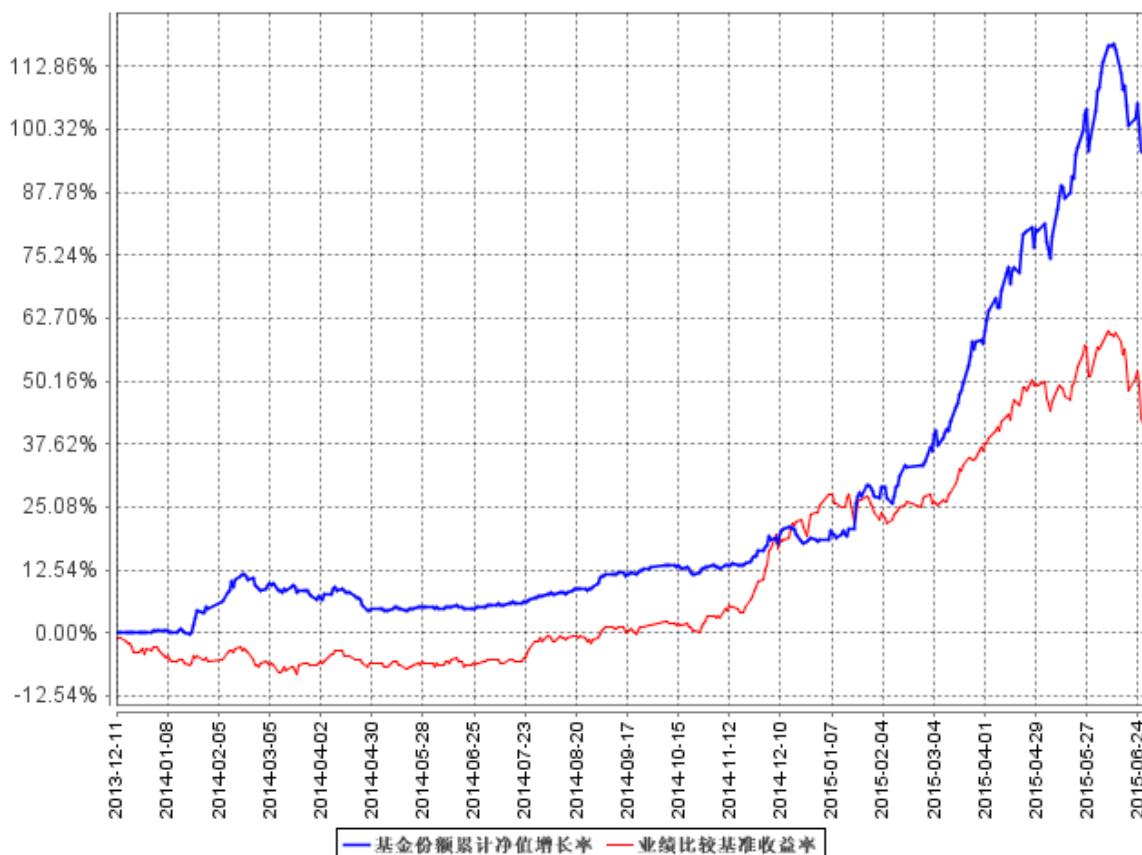
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.90%	1.61%	-3.74%	1.93%	4.64%	-0.32%
过去三个月	27.08%	1.55%	6.69%	1.44%	20.39%	0.11%
过去六个月	68.68%	1.35%	16.10%	1.25%	52.58%	0.10%
过去一年	90.27%	0.99%	54.20%	1.01%	36.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	100.14%	0.86%	45.52%	0.89%	54.62%	-0.03%

### 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

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 2013 年 12 月 11 日。

②根据《华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、中小企业私募债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%，其中本基金投资所定义的优势行业主题类股票占比不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、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%，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。



## §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

华商基金管理有限公司由华龙证券股份有限公司、中国华电集团财务有限公司、济钢集团有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字【2005】160 号文批准设立，于 2005 年 12 月 20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币。公司注册地北京。

截至 2015 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理二十六只基金产品，分别为华商领先企业混合型开放式证券投资基金、华商盛世成长股票型证券投资基金、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、华商产业升级股票型证券投资基金、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、华商价值精选股票型证券投资基金、华商主题精选股票型证券投资基金、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、华商未来主题股票型证券投资基金、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、华商双翼平衡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。

#### 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		
吴鹏飞	基金经理	2013 年 12 月 11 日	-	12	男，经济学博士，中国籍，具有基金从业资格。 2003 年 7 月至 2004 年 12 月在渤海证券有限责任公司担任行业研究员；2004 年 12 月至 2006 年 7 月在国泰君安证券有限责任公司担任行业研究员；2006 年 7 月至 2008 年 7 月在嘉实基金管理有限公司担任行业研究

					<p>员；2008年7月至2009年12月在渤海证券有限责任公司担任研究所副所长；2009年12月至2010年4月在浙商证券有限责任公司担任研究所所长；2010年4月至2013年3月在泰康资产管理有限责任公司担任投资经理；2015年4月9日起至今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。</p>
田明圣	<p>基金经理，公司副总经理兼研究总监，研究发展部总经理，投资决策委员会委员</p>	<p>2013年12月11日</p>	-	10	<p>男，经济学博士，中国籍，具有基金从业资格；2005年1月至2006年1月就职于中石油财务公司从事金融与会计研究；2006年1月至2006年5月在华商基金管理有限公司从事产品设计和研究；2006年6月至2007年7月在西南证券投资银行部从事研究工作。2007年7月加入华商基金管理有限公司，2010年7月28日至今担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理；2013年2月1日至今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；2013年3月18日至今担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2012年9月6日至2013年12月30日担任华商中证500指数分级基金基金经理。</p>

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

### 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

上半年以来市场总体上涨，一季度全行业基本持续上涨，二季度的行情波动非常大。初期，市场呈现加速上扬格局，杠杆资金加剧了市场的风险放大，整个市场各个主要板块都同时经历了快速的迅猛上涨。进入到2015年6月初，市场反向运行，杠杆效果反向运转。这是国内市场第

一次系统展现杠杆作用的过程。目前，政府等部门已经介入救市。

报告期内，华商优势行业基金进行了大约 3 亿元的分红。同时，我们在 5000 点位置，做了比较大幅度的减仓，这是我们一季度盈利，二季度保住盈利与防御性比较好的原因所在。基金投资组合的行业配置，从方向上看，仓位相对集中在防御板块：蓝筹、银行、电力等板块。二季度后期，我们适度增加了弹性配置，增加了医疗、服务、传媒等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.315 元，份额累计净值为 1.925 元，本报告期内本基金份额净值增长率为 68.68%，同期业绩比较基准的收益率为 16.10%，本基金份额净值增长率高于同期业绩比较基准收益率 52.58 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来的市场波动与基本面关系不大，与人性的贪婪恐惧有关，杠杆加剧放大了这种效果。到目前，市场去杠杆的过程还没有结束。我们预计，在下半年，市场去杠杆的过程将会结束，市场重新回到基本面驱动上来。由于这次杠杆的影响，未来市场的波动将明显降低，投资分化将是主特点。符合产业转型的公司与行业，将成为我们投资的主方向。

基于上述判断，华商优势行业基金将把股票仓位控制在适度的水平，并结合风险控制目标，保持基金仓位的灵活性。同时，我们仍然积极坚持选股的策略，仍然将以转型、创新为主要方向，结合逐渐落地的改革措施，进一步精挑细选符合转型方向的个股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金遵循下列 6.4 报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司总经理任估值委员会负责人，委员包括投资总监、基金运营部经理、基金会计主管、研究发展部经理（若负责人认为必要，可适当增减委员会委员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括监察稽核部和基金事务相关人员（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括监察稽核部和基金事务相关人员（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 基金运营部基金会计应实时监控股票停牌情况，对于连续 5 个交易日不存在活跃市场的股票及时提示研究发展部并发出预警；

2. 由研究发展部估值小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考证券业协会的意见或第三方意见后确定估值方法，并确定估值所用的行业指数和指数日收益率；

3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交风险内控小组；

4. 风险内控小组审核该投资品种估值方法的适用性和公允性，出具审核意见并提交公司管理层；

5. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行审查，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

风险内控小组和估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议，风险内控小组审核并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由风险内控小组对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，风险内控小组应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，自本基金合同生效之日起每半年后的对日（若该日为非工作日则顺延至下一工作日）收盘后，若每份基金份额可供分配利润金额高于 0.04 元（含），则本基金以该日作为收益分配基准日，并在 15 个工作日之内进行收益分配，届时见基金管理人公告，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%。本报告期内收益分配情况如下：

本基金以截至 2015 年 6 月 11 日的基金可分配收益 506,663,679.59 元为基准，以 2015 年

6 月 25 日为权益登记日、除息日，于 2015 年 6 月 29 日向本基金的基金持有人派发第一次分红，每 10 份基金份额派发红利 4.80 元。

#### 4.8 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 317,968,890.12 元。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	95,199,563.85	74,579,653.39

结算备付金		44,068,819.89	33,771,641.99
存出保证金		1,088,181.63	568,181.39
交易性金融资产	6.4.7.2	610,450,106.16	269,921,333.15
其中：股票投资		610,450,106.16	269,921,333.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	105,000,000.00	300,000,000.00
应收证券清算款		78,399,326.21	29,137,199.98
应收利息	6.4.7.5	118,463.30	74,874.24
应收股利		-	-
应收申购款		1,903,568.94	151,156.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		936,228,029.98	708,204,040.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		48,248,453.52	20,729,294.50
应付赎回款		96,223,834.68	476,238.75
应付管理人报酬		1,443,462.32	1,015,065.97
应付托管费		240,577.07	169,177.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,419,135.36	2,951,762.11
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	340,075.23	111,101.73
负债合计		152,915,538.18	25,452,640.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	595,663,114.41	645,868,720.53
未分配利润	6.4.7.10	187,649,377.39	36,882,679.36
所有者权益合计		783,312,491.80	682,751,399.89
负债和所有者权益总计		936,228,029.98	708,204,040.63

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.315 元，基金份额总额 595,663,114.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		579,170,276.95	99,203,586.84
1.利息收入		1,615,064.42	10,646,056.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	789,353.64	1,060,490.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		825,710.78	9,585,566.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		555,183,997.79	83,723,487.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	542,960,615.28	82,415,270.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	10,007,720.00	-
股利收益	6.4.7.16	2,215,662.51	1,308,217.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,227,708.93	674,291.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,143,505.81	4,159,750.97
<b>减：二、费用</b>		26,807,691.63	21,285,509.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,739,481.16	9,477,456.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,289,913.53	1,579,576.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,556,399.19	10,028,976.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	221,897.75	199,500.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		552,362,585.32	77,918,077.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		552,362,585.32	77,918,077.37

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金



本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	645,868,720.53	36,882,679.36	682,751,399.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	552,362,585.32	552,362,585.32
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）	-50,205,606.12	-83,626,997.17	-133,832,603.29
其中：1.基金申购款	452,184,436.83	159,586,591.50	611,771,028.33
2.基金赎回款	-502,390,042.95	-243,213,588.67	-745,603,631.62
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）	-	-317,968,890.12	-317,968,890.12
五、期末所有者权益（基金净值）	595,663,114.41	187,649,377.39	783,312,491.80
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	639,551,738.41	1,610,063.29	641,161,801.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	77,918,077.37	77,918,077.37
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）	929,994,191.03	-6,305,535.27	923,688,655.76
其中：1.基金申购款	1,830,114,084.39	50,105,534.84	1,880,219,619.23
2.基金赎回款	-900,119,893.36	-56,411,070.11	-956,530,963.47
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）	-	-20,855,341.23	-20,855,341.23
五、期末所有者权益（基金净值）	1,569,545,929.44	52,367,264.16	1,621,913,193.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
王锋

\_\_\_\_\_  
程蕾

\_\_\_\_\_  
程蕾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华商优势行业灵活配置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”)证监许可[2013]第 1185 号《关于核准华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华商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《华商优势行业灵活配置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 639,497,523.42 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 782 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 639,551,738.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 54,214.99 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商优势行业灵活配置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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、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。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的 0%-95%,其中本基金投资所定义的优势行业主题类股票占比不低于非现金基金资产的 80%;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%,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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 55%+上证国债指数收益率 $\times$ 45%。

### 6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商收益增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策的变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正的说明。

### 6.4.6 税项

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	95,199,563.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	95,199,563.85

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	581,267,567.15	610,450,106.16	29,182,539.01
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	581,267,567.15	610,450,106.16	29,182,539.01
----	----------------	----------------	---------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	105,000,000.00	-
合计	105,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	82,688.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,965.54
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	29,312.50
应收申购款利息	6.77
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	489.70
合计	118,463.30

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,419,135.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,419,135.36

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	136,759.74
预提费用	203,315.49
合计	340,075.23

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	645,868,720.53	645,868,720.53
本期申购	452,184,436.83	452,184,436.83
本期赎回(以“-”号填列)	-502,390,042.95	-502,390,042.95
本期末	595,663,114.41	595,663,114.41

注：本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,000,099.61	-13,117,420.25	36,882,679.36
本期利润	532,134,876.39	20,227,708.93	552,362,585.32
本期基金份额交易产生的变动数	-73,989,425.65	-9,637,571.52	-83,626,997.17
其中：基金申购款	114,969,156.67	44,617,434.83	159,586,591.50
基金赎回款	-188,958,582.32	-54,255,006.35	-243,213,588.67
本期已分配利润	-317,968,890.12	-	-317,968,890.12
本期末	190,176,660.23	-2,527,282.84	187,649,377.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	626,100.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	23,266.14
结算备付金利息收入	139,987.02
其他	-
合计	789,353.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,773,922,601.59
减：卖出股票成本总额	5,230,961,986.31
买卖股票差价收入	542,960,615.28

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生债券投资收益。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	10,007,720.00

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,215,662.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,215,662.51

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,227,708.93
——股票投资	20,227,708.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	20,227,708.93

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,143,505.81
合计	2,143,505.81

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	17,556,399.19
银行间市场交易费用	-
合计	17,556,399.19

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元



项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	148,767.52
银行费用	18,582.26
合计	221,897.75

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期内无其他或有事项的说明。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无资产负债表日后事项的说明。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华商基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国华电集团财务有限公司	基金管理人的股东
济钢集团有限公司	基金管理人的股东

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华龙证券	2,337,712,261.79	20.64%	668,160,991.18	10.12%

## 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华龙证券	656,000,000.00	7.67%	7,069,300,000.00	10.96%

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华龙证券	2,128,251.80	20.64%	1,408,816.61	21.95%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华龙证券	608,294.74	10.12%	153,649.23	6.06%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,739,481.16	9,477,456.51
其中：支付销售机构的客户维护费	375,731.17	1,799,002.39

注：支付给基金管理人华商基金管理有限公司的基金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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,289,913.53	1,579,576.01

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间没有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	95,199,563.85	626,100.48	1,229,422,667.15	614,332.42

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内没有其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 6 月 25 日	-	2015 年 6 月 25 日	4.8000	309,279,609.48	8,689,280.64	317,968,890.12	
合计	-	-	-	4.8000	309,279,609.48	8,689,280.64	317,968,890.12	

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000150	宜华健康	2015 年 4 月 15 日	重大事项停牌	52.70	-	-	842,955	17,529,770.88	44,423,728.50	-
000650	仁和药业	2015 年 6 月 12 日	重大事项停牌	17.17	-	-	78	770.81	1,339.26	-
600333	长春燃气	2015 年 5 月 29 日	重大事项停牌	11.47	2015 年 7 月 9 日	10.77	2,000,081	18,958,101.16	22,940,929.07	-
600882	华联矿业	2015 年 5 月 19 日	重大事项停牌	13.57	-	-	1,172,500	15,205,404.90	15,910,825.00	-

注：1. 本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 本基金持有的“长春燃气”股票自 2015 年 5 月 29 日起因重大事项停牌，根据中国证券监督管理委员会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，为合理确定“长春燃气”股票的公允价值，自 2015 年 6 月 12 日起采用“指数收益法”对其进行

估值。

3. 本基金持有的“华联矿业”股票自 2015 年 5 月 19 日起因重大事项停牌，根据中国证券监督管理委员会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，为合理确定“长春燃气”股票的公允价值，自 2015 年 6 月 4 日起采用“指数收益法”对其进行估值。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 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余额，因此没有作为抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 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余额，因此没有作为抵押的债券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为灵活配置混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型, 日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估, 并通过相应决策, 将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况, 导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行, 与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算, 违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险, 且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日, 本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日: 同)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险, 本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	不计息	合计
资产			
银行存款	95,199,563.85	-	95,199,563.85
结算备付金	44,068,819.89	-	44,068,819.89
存出保证金	1,088,181.63	-	1,088,181.63
交易性金融资产	-	610,450,106.16	610,450,106.16
买入返售金融资产	105,000,000.00	-	105,000,000.00

应收证券清算款	-	78,399,326.21	78,399,326.21
应收利息	-	118,463.30	118,463.30
应收申购款	10,497.02	1,893,071.92	1,903,568.94
资产总计	245,367,062.39	690,860,967.59	936,228,029.98
负债			
应付证券清算款	-	48,248,453.52	48,248,453.52
应付赎回款	-	96,223,834.68	96,223,834.68
应付管理人报酬	-	1,443,462.32	1,443,462.32
应付托管费	-	240,577.07	240,577.07
应付交易费用	-	6,419,135.36	6,419,135.36
其他负债	-	340,075.23	340,075.23
负债总计	-	152,915,538.18	152,915,538.18
利率敏感度缺口	245,367,062.39	537,945,429.41	783,312,491.80
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	不计息	合计
资产			
银行存款	74,579,653.39	-	74,579,653.39
结算备付金	33,771,641.99	-	33,771,641.99
存出保证金	568,181.39	-	568,181.39
交易性金融资产	-	269,921,333.15	269,921,333.15
买入返售证券	300,000,000.00	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	29,137,199.98	29,137,199.98
应收利息	-	74,874.24	74,874.24
应收申购款	198.81	150,957.68	151,156.49
资产总计	408,919,675.58	299,284,365.05	708,204,040.63
负债			
应付证券清算款	-	20,729,294.50	20,729,294.50
应付赎回款	-	476,238.75	476,238.75
应付管理人报酬	-	1,015,065.97	1,015,065.97
应付托管费	-	169,177.68	169,177.68
应付交易费用	-	2,951,762.11	2,951,762.11
其他负债	-	111,101.73	111,101.73
负债总计	-	25,452,640.74	25,452,640.74
利率敏感度缺口	408,919,675.58	273,831,724.31	682,751,399.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金坚持“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”选股策略相结合的原则，通过主动判断经济周期，以经典经济周期对资本市场形成方向影响为基础，结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场方向，进行积极的资产配置。通过对股票市场的判断，在市场衰退末期、复苏和繁荣周期阶段，积极增加权益类股票投资比例；在市场衰退阶段，主动降低权益类股票投资比例，同时增加债券仓位，以最大限度地降低投资组合的风险，提高组合收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中本基金投资所定义的优势行业主题类股票占比不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的 5%-100%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	610,450,106.16	77.93	269,921,333.15	39.53
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	610,450,106.16	77.93	269,921,333.15	39.53

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末(2015年6月30日)	上年度末(2014年12月31日)
	沪深 300 指数上升 5%	16,339,777.27	7,745,427.16
	沪深 300 指数下降 5%	-16,339,777.27	-7,745,427.16

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	610,450,106.16	65.20
	其中:股票	610,450,106.16	65.20
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	105,000,000.00	11.22
	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	139,268,383.74	14.88
7	其他各项资产	81,509,540.08	8.71
8	合计	936,228,029.98	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	486,933.15	0.06
B	采矿业	88,658,166.73	11.32

C	制造业	350,661,925.29	44.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,842,612.75	1.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,638,701.10	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,909,059.05	4.97
J	金融业	56,508,442.61	7.21
K	房地产业	44,425,107.90	5.67
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	5,317,406.28	0.68
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	1,751.30	0.00
S	综合	-	-
	合计	610,450,106.16	77.93

### 7.3 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	000150	宜华健康	842,955	44,423,728.50	5.67
2	000423	东阿阿胶	649,923	35,420,803.50	4.52
3	002422	科伦药业	800,105	32,036,204.20	4.09
4	002625	龙生股份	399,917	30,641,640.54	3.91
5	600016	民生银行	3,000,000	29,820,000.00	3.81
6	600197	伊力特	1,885,979	29,326,973.45	3.74
7	600028	中国石化	3,999,960	28,239,717.60	3.61
8	601328	交通银行	3,238,735	26,687,176.40	3.41
9	603166	福达股份	744,330	25,820,807.70	3.30
10	600688	上海石化	2,252,900	24,173,617.00	3.09
11	600333	长春燃气	2,000,081	22,940,929.07	2.93
12	600570	恒生电子	180,029	20,172,249.45	2.58
13	600600	青岛啤酒	432,038	20,128,650.42	2.57

14	600871	石化油服	1,500,050	19,410,647.00	2.48
15	603567	珍宝岛	349,920	18,892,180.80	2.41
16	300399	京天利	130,000	18,735,600.00	2.39
17	601600	中国铝业	2,000,000	18,660,000.00	2.38
18	600381	青海春天	700,012	18,249,312.84	2.33
19	601808	中海油服	600,031	16,764,866.14	2.14
20	002603	以岭药业	799,941	16,126,810.56	2.06
21	600882	华联矿业	1,172,500	15,910,825.00	2.03
22	603883	老百姓	200,000	14,638,000.00	1.87
23	002737	葵花药业	300,000	14,022,000.00	1.79
24	600332	白云山	400,080	13,786,756.80	1.76
25	603198	迎驾贡酒	449,999	12,761,971.64	1.63
26	002267	陕天然气	699,975	10,842,612.75	1.38
27	603669	灵康药业	300,000	9,996,000.00	1.28
28	600583	海油工程	500,057	8,330,949.62	1.06
29	300463	迈克生物	70,000	6,143,200.00	0.78
30	603568	伟明环保	144,366	5,316,999.78	0.68
31	300475	聚隆科技	49,019	1,511,255.77	0.19
32	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.06
33	300452	山河药辅	71	6,226.70	0.00
34	600679	金山开发	148	3,168.68	0.00
35	002041	登海种业	150	2,653.50	0.00
36	600079	人福医药	59	2,185.95	0.00
37	002071	长城影视	83	1,751.30	0.00
38	300414	中光防雷	20	1,678.40	0.00
39	000911	南宁糖业	82	1,405.48	0.00
40	000002	万科A	95	1,379.40	0.00
41	000650	仁和药业	78	1,339.26	0.00
42	600080	金花股份	92	1,226.36	0.00
43	601929	吉视传媒	80	1,209.60	0.00
44	000400	许继电气	45	1,132.20	0.00
45	000933	神火股份	104	979.68	0.00
46	601009	南京银行	40	912.00	0.00
47	000048	康达尔	35	885.50	0.00
48	000407	胜利股份	99	883.08	0.00
49	600188	兖州煤业	55	756.25	0.00
50	600983	惠而浦	47	746.83	0.00
51	000554	泰山石油	38	701.10	0.00
52	000999	华润三九	14	425.46	0.00

53	000430	张家界	30	406.50	0.00
54	600403	大有能源	44	393.36	0.00
55	600429	三元股份	34	383.86	0.00
56	600036	招商银行	18	336.96	0.00
57	002290	禾盛新材	4	143.56	0.00
58	601166	兴业银行	1	17.25	0.00
59	600123	兰花科创	1	11.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600016	民生银行	210,691,913.23	30.86
2	000423	东阿阿胶	138,736,293.02	20.32
3	300399	京天利	114,555,867.49	16.78
4	002422	科伦药业	113,919,333.99	16.69
5	601929	吉视传媒	109,244,693.95	16.00
6	000400	许继电气	105,037,327.73	15.38
7	600332	白云山	99,696,127.68	14.60
8	000650	仁和药业	97,983,733.00	14.35
9	601328	交通银行	96,819,823.65	14.18
10	600079	DR 人福医	95,023,173.50	13.92
11	600983	惠而浦	88,931,167.87	13.03
12	002071	长城影视	85,916,179.40	12.58
13	600600	青岛啤酒	85,443,243.52	12.51
14	002041	登海种业	84,832,467.28	12.43
15	600381	青海春天	82,211,356.18	12.04
16	601988	中国银行	74,767,045.00	10.95
17	002353	杰瑞股份	71,475,771.84	10.47
18	600028	中国石化	63,942,171.79	9.37
19	601006	大秦铁路	62,191,481.18	9.11
20	600108	亚盛集团	61,357,352.32	8.99
21	000999	华润三九	61,341,825.83	8.98
22	600197	伊力特	60,828,554.95	8.91
23	000911	南宁糖业	60,345,523.39	8.84

24	600570	恒生电子	58,620,497.54	8.59
25	601166	兴业银行	58,532,028.27	8.57
26	600583	海油工程	56,473,726.10	8.27
27	601808	中海油服	51,325,206.81	7.52
28	601169	北京银行	50,121,607.40	7.34
29	002292	奥飞动漫	50,042,449.13	7.33
30	000407	胜利股份	48,405,219.97	7.09
31	000933	神火股份	48,254,106.93	7.07
32	600333	长春燃气	47,079,409.51	6.90
33	002382	蓝帆医疗	46,838,629.95	6.86
34	000797	中国武夷	44,716,116.86	6.55
35	600371	万向德农	43,371,498.12	6.35
36	600679	金山开发	43,221,619.84	6.33
37	601318	中国平安	42,583,557.02	6.24
38	600839	四川长虹	40,336,520.68	5.91
39	600403	大有能源	39,812,262.47	5.83
40	600661	新南洋	39,599,701.54	5.80
41	600103	青山纸业	39,442,459.16	5.78
42	601001	大同煤业	38,738,477.58	5.67
43	002606	大连电瓷	38,672,198.73	5.66
44	600373	中文传媒	37,354,397.21	5.47
45	000048	康达尔	37,208,828.50	5.45
46	000150	宜华健康	36,893,045.84	5.40
47	000826	桑德环境	36,859,188.24	5.40
48	600383	金地集团	35,478,596.06	5.20
49	600080	金花股份	35,385,399.02	5.18
50	600680	上海普天	35,196,852.13	5.16
51	000998	隆平高科	34,369,617.76	5.03
52	600900	长江电力	34,255,172.83	5.02
53	600490	鹏欣资源	33,722,907.00	4.94
54	002727	一心堂	33,558,990.82	4.92
55	000888	峨眉山 A	33,510,019.31	4.91
56	000001	平安银行	33,503,143.85	4.91
57	600188	兖州煤业	33,201,549.57	4.86
58	600871	石化油服	33,173,873.85	4.86
59	600702	沱牌舍得	32,362,397.99	4.74

60	000002	万 科 A	32,003,190.35	4.69
61	600036	招商银行	31,207,984.65	4.57
62	000541	佛山照明	30,114,678.47	4.41
63	000554	泰山石油	29,951,890.53	4.39
64	002029	七 匹 狼	29,753,659.85	4.36
65	000430	张家界	29,631,765.32	4.34
66	601628	中国人寿	29,575,223.00	4.33
67	600654	中安消	29,279,786.16	4.29
68	002625	龙生股份	28,960,378.60	4.24
69	600251	冠农股份	28,864,693.43	4.23
70	000409	山东地矿	28,173,047.04	4.13
71	002028	思源电气	27,939,104.74	4.09
72	600536	中国软件	27,465,757.00	4.02
73	300090	盛运环保	27,451,867.40	4.02
74	300347	泰格医药	27,034,819.37	3.96
75	600429	三元股份	26,829,417.33	3.93
76	300303	聚飞光电	26,113,704.46	3.82
77	300263	隆华节能	25,669,498.76	3.76
78	600688	上海石化	24,904,216.41	3.65
79	600123	兰花科创	24,703,946.63	3.62
80	002033	丽江旅游	24,250,860.54	3.55
81	603166	福达股份	24,124,447.29	3.53
82	000937	冀中能源	23,658,845.13	3.47
83	600633	浙报传媒	23,656,291.35	3.46
84	600000	浦发银行	23,290,571.17	3.41
85	600978	宜华木业	23,117,925.93	3.39
86	002181	粤 传 媒	22,813,832.82	3.34
87	300146	汤臣倍健	22,755,834.18	3.33
88	002639	雪人股份	22,630,187.33	3.31
89	000869	张 裕 A	22,237,119.58	3.26
90	300072	三聚环保	22,166,250.17	3.25
91	002128	露天煤业	21,783,808.99	3.19
92	002627	宜昌交运	21,484,183.92	3.15
93	002191	劲嘉股份	21,204,645.61	3.11
94	000623	吉林敖东	21,092,972.09	3.09
95	601009	南京银行	20,959,921.72	3.07

96	300015	爱尔眼科	19,753,935.23	2.89
97	600576	万好万家	19,752,235.77	2.89
98	600767	运盛医疗	19,573,683.55	2.87
99	002648	卫星石化	19,552,430.82	2.86
100	300273	和佳股份	19,221,922.51	2.82
101	000536	华映科技	18,996,228.77	2.78
102	300005	探路者	18,852,680.08	2.76
103	600880	博瑞传播	18,635,626.89	2.73
104	300305	裕兴股份	18,574,969.43	2.72
105	601600	中国铝业	18,530,186.42	2.71
106	600312	平高电气	18,525,700.29	2.71
107	300036	超图软件	18,419,247.51	2.70
108	600209	罗顿发展	18,407,576.76	2.70
109	002462	嘉事堂	18,407,003.71	2.70
110	000728	国元证券	18,041,179.89	2.64
111	300094	国联水产	17,962,139.01	2.63
112	600718	东软集团	17,341,401.39	2.54
113	600962	*ST 中鲁	17,334,221.22	2.54
114	600358	国旅联合	17,137,694.02	2.51
115	300157	恒泰艾普	16,826,893.01	2.46
116	300189	神农大丰	16,217,708.76	2.38
117	603567	珍宝岛	16,064,336.15	2.35
118	600127	金健米业	15,800,515.77	2.31
119	601818	光大银行	15,757,000.00	2.31
120	002278	神开股份	15,489,123.09	2.27
121	600508	上海能源	15,373,371.16	2.25
122	600882	华联矿业	15,205,404.90	2.23
123	000617	石油济柴	14,479,320.51	2.12
124	600217	*ST 秦岭	14,153,485.86	2.07
125	000712	锦龙股份	14,098,610.72	2.06
126	002707	众信旅游	14,010,800.84	2.05
127	002603	以岭药业	13,959,599.18	2.04
128	002566	益盛药业	13,845,085.75	2.03
129	600485	信威集团	13,843,266.47	2.03

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。



7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600016	民生银行	183,919,919.24	26.94
2	000650	仁和药业	123,564,194.41	18.10
3	601929	吉视传媒	117,880,361.38	17.27
4	000423	东阿阿胶	116,197,543.58	17.02
5	000400	许继电气	114,430,611.94	16.76
6	600079	DR 人福医	112,910,762.13	16.54
7	300399	京天利	98,286,777.77	14.40
8	002041	登海种业	97,948,399.04	14.35
9	002422	科伦药业	97,347,017.72	14.26
10	600332	白云山	91,223,843.17	13.36
11	002071	长城影视	89,384,994.43	13.09
12	600983	惠而浦	87,978,284.76	12.89
13	601328	交通银行	84,660,677.52	12.40
14	002382	蓝帆医疗	83,181,252.83	12.18
15	600570	恒生电子	79,559,897.17	11.65
16	002353	杰瑞股份	77,180,509.55	11.30
17	000999	华润三九	76,708,066.69	11.24
18	601988	中国银行	75,273,316.00	11.02
19	600371	万向德农	73,603,937.07	10.78
20	600600	青岛啤酒	71,433,353.19	10.46
21	601006	大秦铁路	69,340,118.79	10.16
22	600108	亚盛集团	64,755,442.45	9.48
23	000911	南宁糖业	62,215,083.76	9.11
24	000407	胜利股份	60,265,546.56	8.83
25	002292	奥飞动漫	60,088,096.18	8.80
26	000797	中国武夷	59,014,579.67	8.64
27	601166	兴业银行	58,265,231.00	8.53
28	600103	青山纸业	54,791,604.57	8.03
29	000826	桑德环境	53,699,482.86	7.87
30	600381	青海春天	51,359,590.92	7.52
31	601169	北京银行	49,682,019.72	7.28
32	600583	海油工程	46,087,299.64	6.75
33	002727	一心堂	45,992,019.76	6.74
34	000933	神火股份	45,675,229.54	6.69
35	600839	四川长虹	45,304,883.25	6.64

36	300090	盛运环保	44,417,384.25	6.51
37	601318	中国平安	44,365,074.55	6.50
38	600679	金山开发	43,337,889.69	6.35
39	000150	宜华健康	42,479,102.38	6.22
40	000048	康达尔	41,293,508.24	6.05
41	002606	大连电瓷	41,154,214.40	6.03
42	000409	山东地矿	41,111,236.37	6.02
43	600661	新南洋	40,145,785.43	5.88
44	600900	长江电力	38,948,923.48	5.70
45	600680	上海普天	38,600,281.07	5.65
46	002029	七匹狼	38,516,783.98	5.64
47	600654	中安消	38,497,384.05	5.64
48	600962	*ST 中鲁	38,357,795.86	5.62
49	600403	大有能源	38,031,913.76	5.57
50	600373	中文传媒	38,011,705.55	5.57
51	600080	金花股份	37,511,107.76	5.49
52	600251	冠农股份	37,088,297.61	5.43
53	000430	张家界	37,017,022.01	5.42
54	601001	大同煤业	36,698,109.11	5.38
55	000888	峨眉山 A	36,631,790.79	5.37
56	600383	金地集团	36,504,608.80	5.35
57	600028	中国石化	35,959,264.80	5.27
58	600490	鹏欣资源	35,104,379.10	5.14
59	600333	长春燃气	35,098,553.27	5.14
60	600217	*ST 秦岭	35,020,794.48	5.13
61	000998	隆平高科	34,120,287.00	5.00
62	300347	泰格医药	33,657,895.74	4.93
63	600702	沱牌舍得	33,371,735.01	4.89
64	600576	万好万家	33,105,498.77	4.85
65	600188	兖州煤业	32,610,800.43	4.78
66	600036	招商银行	32,003,140.16	4.69
67	600085	同仁堂	31,893,133.40	4.67
68	000001	平安银行	31,726,740.73	4.65
69	600429	三元股份	31,508,912.18	4.61
70	300263	隆华节能	31,222,628.58	4.57
71	300303	聚飞光电	31,098,054.99	4.55
72	300005	探路者	31,081,874.67	4.55
73	000002	万 科 A	30,997,073.56	4.54

74	601808	中海油服	30,701,156.15	4.50
75	600197	伊力特	30,123,722.01	4.41
76	601628	中国人寿	29,797,879.75	4.36
77	000541	佛山照明	29,541,171.20	4.33
78	002639	雪人股份	29,213,877.19	4.28
79	002028	思源电气	28,605,463.64	4.19
80	600536	中国软件	28,376,924.20	4.16
81	600488	天药股份	28,214,649.95	4.13
82	300015	爱尔眼科	28,003,957.41	4.10
83	300144	宋城演艺	27,977,764.65	4.10
84	600976	健民集团	27,091,218.25	3.97
85	000554	泰山石油	26,856,398.76	3.93
86	300273	和佳股份	26,775,692.92	3.92
87	600978	宜华木业	26,497,016.91	3.88
88	300146	汤臣倍健	26,034,741.33	3.81
89	002462	嘉事堂	25,773,744.68	3.77
90	600297	广汇汽车	25,039,680.70	3.67
91	600633	浙报传媒	24,002,779.56	3.52
92	002033	丽江旅游	23,904,592.90	3.50
93	600123	兰花科创	23,874,713.95	3.50
94	002627	宜昌交运	23,784,627.16	3.48
95	000937	冀中能源	23,163,240.55	3.39
96	600000	浦发银行	23,151,329.90	3.39
97	300305	裕兴股份	23,121,203.97	3.39
98	300189	神农大丰	23,109,909.02	3.38
99	300094	国联水产	23,008,460.02	3.37
100	002181	粤传媒	22,145,061.76	3.24
101	601009	南京银行	21,930,663.05	3.21
102	000869	张裕A	21,710,359.56	3.18
103	300072	三聚环保	21,318,393.88	3.12
104	600767	运盛医疗	21,140,268.31	3.10
105	600613	神奇制药	21,110,922.99	3.09
106	600358	国旅联合	21,078,043.77	3.09
107	600824	益民集团	20,877,270.89	3.06
108	002191	劲嘉股份	20,839,625.32	3.05
109	002128	露天煤业	20,709,292.06	3.03
110	600763	通策医疗	20,184,215.11	2.96
111	300036	超图软件	19,808,216.14	2.90

112	600871	石化油服	19,425,592.57	2.85
113	000623	吉林敖东	19,381,929.85	2.84
114	600127	金健米业	19,284,620.09	2.82
115	000728	国元证券	18,698,849.96	2.74
116	600880	博瑞传播	18,658,463.32	2.73
117	600209	罗顿发展	18,531,205.40	2.71
118	600312	平高电气	18,369,316.28	2.69
119	000536	华映科技	18,310,198.85	2.68
120	002648	卫星石化	18,073,877.40	2.65
121	002707	众信旅游	17,439,946.36	2.55
122	002290	禾盛新材	16,600,656.60	2.43
123	600718	东软集团	16,436,197.00	2.41
124	300157	恒泰艾普	16,420,296.26	2.41
125	601818	光大银行	15,751,860.05	2.31
126	002278	神开股份	15,252,048.02	2.23
127	600508	上海能源	15,250,138.00	2.23
128	600666	奥瑞德	14,852,172.95	2.18
129	000712	锦龙股份	14,003,234.48	2.05
130	600485	信威集团	13,839,235.82	2.03
131	002566	益盛药业	13,761,119.37	2.02

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。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,551,263,050.39
卖出股票收入（成交）总额	5,773,922,601.59

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。

### 7.5 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投资。

### 7.6 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投资。

### 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					10,007,720.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

2014 年 4 月 14 日，科伦药业收到中国证券监督管理委员会四川监管局（以下简称“四川监管局”）下发的《关于对四川科伦药业股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2014]4 号），指出公司董事长兼实际控制人刘革新对成都久易贸易有限公司（以下简称“久易贸易”）的重大业务活动可以实施控制，久易贸易与公司存在关联关系。公司未按规定披露与久易贸易及其子公司之间的关联关系和关联交易，对公司提出相应的整改要求。2014 年 6 月 3 日，科伦药业收

到中国证监会《行政处罚决定书》（[2014]49 号），指出公司：1、披露其与君健塑胶原股东惠丰投资没有关联交易的信息不真实，2、《2010 年年度报告》和《2011 年年度报告》未披露与君健塑胶原关系和关联交易。中国证监会对科伦药业信息披露违法行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。

2014 年 7 月 4 日，科伦药业收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（成稽调查通字 147014 号），公司正在接受相关部门对公司与成都久易贸易有限公司及其子公司之间的交易涉及的信息披露等相关事项进行调查。2015 年 1 月 28 日，科伦药业收到中国证监会四川监管局《行政处罚事先告知书》（[2015]1 号），指出公司存在违法事实：1、公司与成都久易贸易有限公司存在关联关系，但未按照规定依法及时履行临时报告义务；2、在相关年度报告中披露相关关联交易的情况。科伦药业未依法履行披露相关关联交易的情况，信息披露存在重大遗漏。并对公司做出处罚，以及提出相应的整改要求。2015 年 2 月 16 日，科伦药业收到中国银行间市场交易商协会（以下简称“银行间协会”）《非金融企业债务融资工具市场自律处分意见书》（【2015】2 号），经查科伦药业在债务融资工具“11 科伦 MTN1”、“12 科伦 MTN1”注册发行阶段及存续期间存在以下违反银行间市场相关自律规则指引的行为：一是科伦药业未在债务融资工具“11 科伦 MTN1”募集说明书中披露与崇州君健塑胶原有限责任公司（以下简称“君健塑胶”）的关联关系，相关交易未作为关联交易披露；未在债务融资工具“11 科伦 MTN1”、“12 科伦 MTN1”募集说明书中披露与成都久易贸易有限公司（以下简称“久易贸易”）及久易贸易子公司伊犁伊北煤炭有限公司（以下简称“伊北煤炭”）、伊犁恒辉淀粉有限公司（以下简称“恒辉淀粉”）的关联关系，相关交易未作为关联交易披露。二是科伦药业未在 2010 年年报和 2011 年年报中披露与君健塑胶原的关联关系，相关交易未作为关联交易披露，未在 2011 年年报、2012 年年报中披露与久易公司、伊北煤炭、恒辉淀粉的关系，相关交易未作为关联交易披露。并对公司做出处罚，以及提出相应的整改要求。

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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 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	1,088,181.63

2	应收证券清算款	78,399,326.21
3	应收股利	-
4	应收利息	118,463.30
5	应收申购款	1,903,568.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,509,540.08

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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	000150	宜华健康	44,423,728.50	5.67	重大事项停牌

#### 7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
17,493	34,051.51	531,927,363.43	89.30%	63,735,750.98	10.70%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	118,135.24	0.0198%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月11日）基金份额总额	639,551,738.41
本报告期期初基金份额总额	645,868,720.53
本报告期基金总申购份额	452,184,436.83
减：本报告期基金总赎回份额	502,390,042.95
本报告期末基金份额总额	595,663,114.41

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期未发生基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。



### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立日（2013 年 12 月 11 日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员未发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中信证券	1	3,542,351,418.50	31.28%	3,224,963.80	31.28%	-
中信建投证券	1	2,527,232,519.16	22.32%	2,300,787.46	22.32%	-
华龙证券	2	2,337,712,261.79	20.64%	2,128,251.80	20.64%	-
申银万国证券	1	1,710,416,995.48	15.11%	1,557,161.03	15.11%	-
海通证券	1	1,011,067,225.22	8.93%	920,476.70	8.93%	-
川财证券	1	194,619,350.65	1.72%	177,182.46	1.72%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

#### （1）选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

#### （2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风

险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存监察稽核部备案。

### 10.7.2 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	4,906,300,000.00	57.33%	-	-
华龙证券	-	-	656,000,000.00	7.67%	-	-
申银万国证券	-	-	2,005,900,000.00	23.44%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	989,500,000.00	11.56%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额申购业务并参加定期定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 19 日
2	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 22 日
3	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 26 日

4	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 26 日
5	华商基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 2 日
6	华商基金管理有限公司关于旗下基金开通中国工商银行股份有限公司基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
8	华商基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金和特定客户资产管理计划调整交易所固定收益品种估值方法的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 30 日
9	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 31 日
10	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 31 日
11	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 4 月 21 日
12	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增泰信财富投资管理有限公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 4 月 22 日
13	华商基金管理有限公司关于旗下部分	上海证券报、中国证券	2015 年 5 月 28 日

	基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告	报、证券时报、公司网站	
14	华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 6 月 1 日
15	华商基金管理有限公司关于旗下基金实施特定申购费率的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 6 月 18 日
16	华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年度第一次分红公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 6 月 23 日
17	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增中国国际金融股份有限公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 6 月 29 日
18	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 6 月 30 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

## 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 11.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

华商基金管理有限公司  
2015 年 8 月 29 日