

# 华商稳健双利债券型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 月 25 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 2016 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.....	5
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.....	11
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.....	12
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.....	13
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>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	错误! 未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<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	华商稳健双利债券型证券投资基金	
基金简称	华商稳健双利债券	
基金主代码	630007	
交易代码	630007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 8 月 9 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	384,025,908.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华商稳健双利债券 A	华商稳健双利债券 B
下属分级基金的交易代码:	630007	630107
报告期末下属分级基金的份额总额	115,760,711.31 份	268,265,197.38 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金试图通过主要投资于债券品种，适当投资二级市场股票和新股申购，力争较平稳的为基金持有人创造持续收益，最终实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金首先通过自上而下的策略分析，确定基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购、二级市场股票投资之间的大类配置；然后通过自下而上的研究发掘市场失衡中的个券、个股机会，经过风险收益配比分析，加入投资组合，在控制风险的前提下争取获得超越业绩比较基准的超额收益。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	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
	联系电话	010-58573600
	电子邮箱	zhouyh@hsfund.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	北京市西城区金融大街 25 号

	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	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	http://www.hsfund.com
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

基金级别	华商稳健双利债券 A	华商稳健双利债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-26,821,003.50	-56,294,146.81
本期利润	-38,921,040.59	-72,548,977.12
加权平均基金份额本期利润	-0.1654	-0.1488
本期加权平均净值利润率	-11.76%	-10.80%
本期基金份额净值增长率	-8.84%	-9.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	10,174,126.25	17,210,482.40
期末可供分配基金份额利润	0.0879	0.0642
期末基金资产净值	159,931,074.33	363,110,686.75
期末基金份额净值	1.382	1.354
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	46.03%	42.23%

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

华商稳健双利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.19%	0.63%	0.04%	-0.27%	0.15%
过去三个月	-2.74%	0.37%	0.41%	0.05%	-3.15%	0.32%
过去六个月	-8.84%	0.65%	1.58%	0.05%	-10.42%	0.60%
过去一年	-13.89%	0.84%	5.86%	0.06%	-19.75%	0.78%
过去三年	32.76%	0.75%	16.97%	0.10%	15.79%	0.65%
自基金合同生效起至今	46.03%	0.59%	27.72%	0.08%	18.31%	0.51%

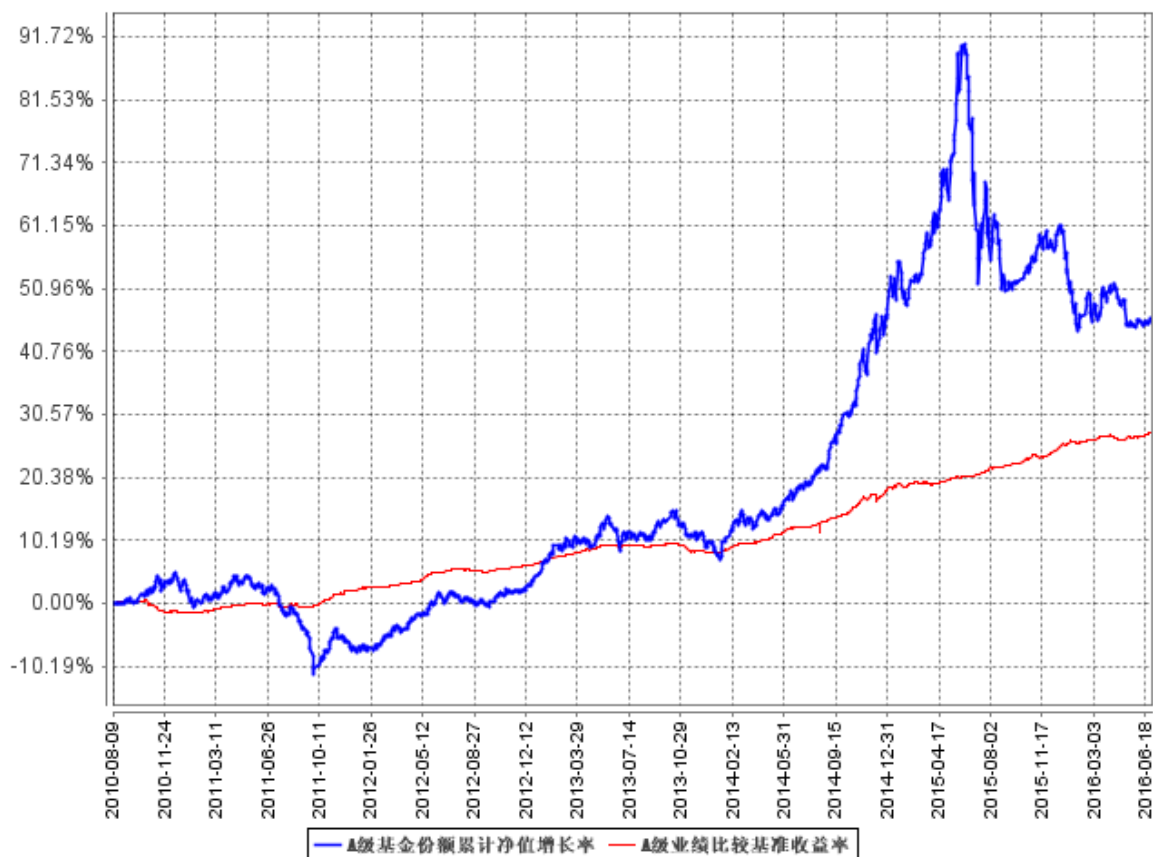
华商稳健双利债券 B

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	0.37%	0.20%	0.63%	0.04%	-0.26%	0.16%
过去三个月	-2.87%	0.36%	0.41%	0.05%	-3.28%	0.31%
过去六个月	-9.07%	0.65%	1.58%	0.05%	-10.65%	0.60%
过去一年	-14.30%	0.84%	5.86%	0.06%	-20.16%	0.78%
过去三年	30.95%	0.75%	16.97%	0.10%	13.98%	0.65%
自基金合同生效起至今	42.23%	0.59%	27.72%	0.08%	14.51%	0.51%

注：鉴于中信标普指数信息服务（北京）有限公司终止维护和发布中信标普全债指数、中信国债指数，按照基金合同的约定，经基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，自2015年9月8日起，华商稳健双利债券型证券投资基金的业绩比较基准由“中信标普全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。

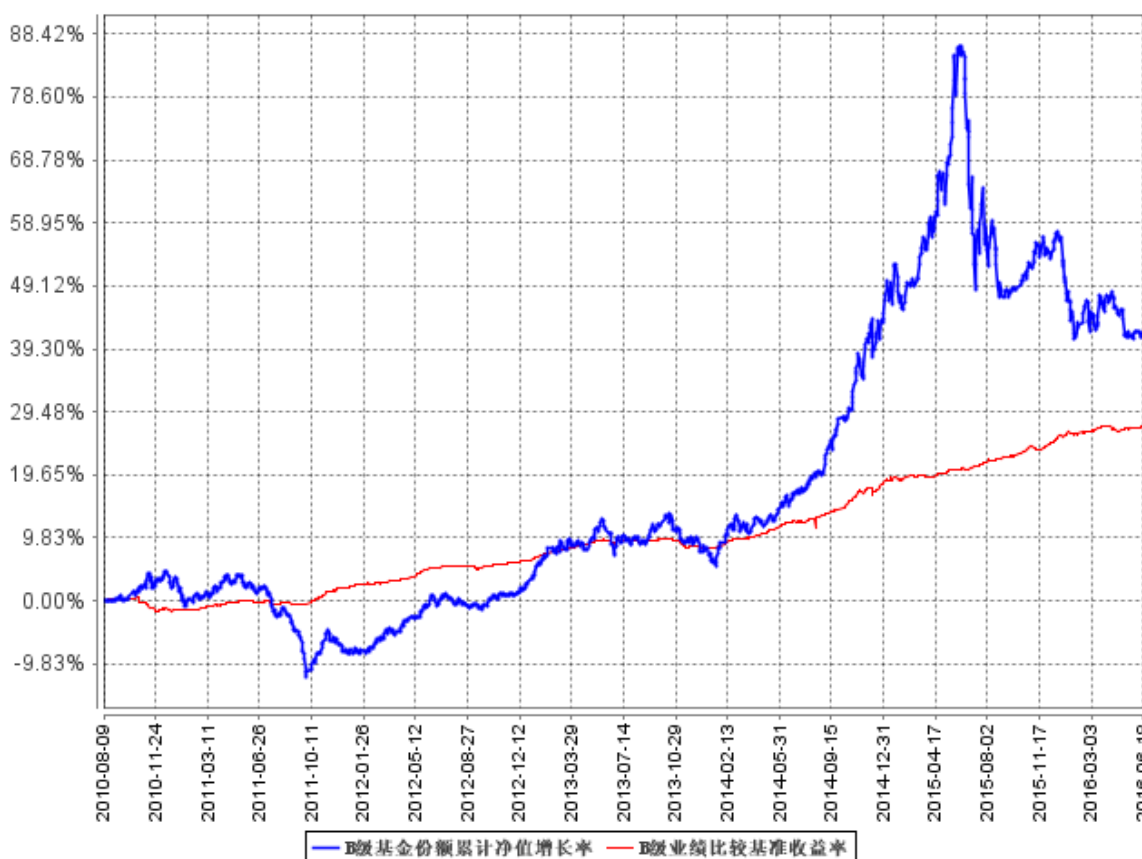
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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





**B级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 2010 年 8 月 9 日。

②根据《华商稳健双利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券回购、央行票据、国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券，本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票、权证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：债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中可转换债券比例不高于基金资产净值的 30%；股票等权益类品种投资比例不高于基金资产的 20%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的证券债券。本基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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 2016 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理三十四只基金产品，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、华商信用增强债券型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商新动力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。

#### 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		
张永志	基金经理	2010 年 8 月 9 日	-	10	男，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格；1999 年 9 月至 2003 年 7 月 在工商银行青岛市市北一支行担任科长职务；2006 年 1 月至 2007 年 5 月，在海通证券担任债券部交易员；2007 年 5 月进入华商基金管理有限公司，2007 年 5 月至 2009 年 1 月担任华商基金管理有限公司交易员，2009 年 1 月至 2010 年 8 月担任华商收益增强

					债券型证券投资基金基金经理助理, 2011 年 3 月 15 日起担任华商稳定增利债券型证券投资基金基金经理, 2015 年 2 月 17 日起担任华商稳固添利债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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，通过交易系统中的公平交易程序，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

2016 年一季度中国经济短暂复苏，前 3 月工业经济脉冲反弹，通胀水平相对去年有所回升，随后经济复苏被证伪，二季度经济呈现前高后低的状况，4 月公布的 PPI、出口数据、工业增加值等经济数据整体较好，但固定资产投资和工业企业利润总额增速数据有所下滑，5 月公布的经济数据开始全面下行，通胀数据回落至 2% 附近。2016 年年初债市在需求大于供给的作用下延续上涨，10 年国开触及 3%，但随后信贷高增和央行货币不再大幅宽松的影响下，收益率缓慢上行；4 月后，由于营改增和信用违约频发，市场出现调整，基金遭遇赎回，造成利率债和信用债的明显调整。直到 5 月营改增细化方案出台，城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理，债市恐慌情绪减退，利率债收益率基本平稳。进入 6 月利率债收益率加速下行，10 年国开债利率从 3.3% 下降到 3.2%，10 年国债利率从 3% 下降到 2.86%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，华商稳健双利债券型证券投资基金 A 类份额净值为 1.382 元，份额累计净值为 1.443 元，本报告期内华商稳健双利债券型证券投资基金 A 类份额净值增长率为 -8.84%，同期业绩比较基准的收益率为 1.58%，本基金份额净值增长率低于同期业绩比较基准的收益率 10.42 个百分点；华商稳健双利债券型证券投资基金 B 类份额净值为 1.354 元，份额累计净值为 1.408 元，本报告期内华商稳健双利债券型证券投资基金 B 类份额净值增长率为 -9.07%，同期业绩比较基准的收益率为 1.58%，本基金份额净值增长率低于同期业绩比较基准的收益率 10.65 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

近期由于经济数据回落以及海外超预期事件，利率下行明显，从基本面上来看推动利率下行的主要因素仍是资本回报率偏低，私人部门投资动能以及融资需求偏弱。而未来真正带动私人部门投资明显回升，仍需通过改革的落实，化解过剩产能，把生产要素投入到更为有效的部门。综合来看利率债从交易盘仓位和短期内资本回报率难有大幅回升来看，商业银行资产负债部门大概

率仍将进一步加大债券资产配置的比例，利率债利率具备进一步下行的空间。信用债方面，未来到期量加大同时过剩行业信用风险仍高企，因此精挑细选和短久期还是近期信用策略。

英国公投结果指向退欧，无论对英国、欧盟还是全球经济格局而言都将影响深远；主要国家的逆全球化倾向与央行货币宽松将继续持续；与此同时，国内货币政策易松难紧、未来 3 个月 CPI 通胀率将持续下行，这些都为国内债券市场提供了较好的宏观环境支持。当下，长端利率债已经基本消化了利好信息，宏观环境继续有利，但收益率进一步下行需要有央行超于预期的放松政策进行配合、推动短端利率的进一步下行。季末因素消失后资金面或将恢复宽裕，三季度债市行情看震荡偏下行为主。目前经济增长乏力，人民币不断走弱，国际市场动荡，避险情绪追逐安全资产，股市的市场面临的外部环境较差，目前已经进入了震荡区间的高点，对后市持谨慎的态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员由基金运营部负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人、基金会计组成，小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值小组采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未进行利润分配。

#### 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，本基金未实施利润分配。

#### 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：华商稳健双利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,627,640.25	24,953,422.32
结算备付金		8,742,561.87	21,297,990.71
存出保证金		293,650.63	396,628.36
交易性金融资产	6.4.7.2	667,699,591.77	1,352,863,388.22
其中：股票投资		85,511,856.77	234,444,184.34
基金投资		-	-

债券投资		582,187,735.00	1,118,419,203.88
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	-	-
应收证券清算款		-	7,773,732.01
应收利息	6.4.7.5	8,927,106.54	14,257,034.54
应收股利		-	-
应收申购款		128,752.36	121,492,854.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		689,419,303.42	1,543,035,050.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		160,000,000.00	218,000,000.00
应付证券清算款		30,620.49	-
应付赎回款		406,703.23	1,117,611.00
应付管理人报酬		323,218.93	641,443.13
应付托管费		92,348.27	183,269.49
应付销售服务费		120,897.59	220,020.51
应付交易费用	6.4.7.7	187,914.74	429,551.82
应交税费		4,999,951.68	4,999,951.68
应付利息		26,145.53	6,659.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	189,741.88	84,403.38
负债合计		166,377,542.34	225,682,910.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	384,025,908.69	878,729,327.01
未分配利润	6.4.7.10	139,015,852.39	438,622,813.16
所有者权益合计		523,041,761.08	1,317,352,140.17
负债和所有者权益总计		689,419,303.42	1,543,035,050.29

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额为 384,025,908.69 份。A 类基金份额净值 1.382 元，基金份额总额 115,760,711.31 份；B 类基金份额净值 1.354 元，基金份额总额 268,265,197.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华商稳健双利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
<b>一、收入</b>		-101,587,170.81	102,677,814.09
1.利息收入		15,981,621.39	28,149,190.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	407,359.17	875,861.49
债券利息收入		15,518,503.90	27,273,328.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		55,758.32	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-89,301,092.42	101,255,667.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-42,002,584.76	61,496,262.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-47,444,802.87	38,012,962.58
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	146,295.21	1,746,443.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-28,354,867.40	-26,950,184.83
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	87,167.62	223,140.83
<b>减：二、费用</b>		9,882,846.90	16,041,978.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,524,552.85	4,588,523.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,007,015.08	1,311,006.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,350,413.46	907,595.16
4. 交易费用	6.4.7.19	1,737,422.36	1,705,668.93
5. 利息支出		2,015,815.60	7,299,965.15
其中：卖出回购金融资产支出		2,015,815.60	7,299,965.15
6. 其他费用	6.4.7.20	247,627.55	229,219.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-111,470,017.71	86,635,835.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-111,470,017.71	86,635,835.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商稳健双利债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元



项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	878,729,327.01	438,622,813.16	1,317,352,140.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-111,470,017.71	-111,470,017.71
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)	-494,703,418.32	-188,136,943.06	-682,840,361.38
其中：1.基金申购款	432,720,012.40	175,353,792.94	608,073,805.34
2.基金赎回款	-927,423,430.72	-363,490,736.00	-1,290,914,166.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	384,025,908.69	139,015,852.39	523,041,761.08
项目	上年度可比期间 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)	557,899,280.71	217,689,745.89	775,589,026.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,635,835.30	86,635,835.30
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)	790,501,743.59	497,515,790.51	1,288,017,534.10
其中：1.基金申购款	2,001,328,760.62	1,197,529,428.65	3,198,858,189.27
2.基金赎回款	-1,210,827,017.03	-700,013,638.14	-1,910,840,655.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	1,348,401,024.30	801,841,371.70	2,150,242,396.00
---------------------	------------------	----------------	------------------

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：

<u>梁永强</u>	<u>程蕾</u>	<u>程蕾</u>
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

华商稳健双利债券型证券投资基金(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[2010]第 590 号《关于核准华商稳健双利债券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《华商稳健双利债券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 1,987,002,518.22 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 180 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商稳健双利债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 8 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,987,313,185.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 310,667.47 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《华商稳健双利债券型证券投资基金基金合同》和《华商稳健双利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购、赎回时收取认购、申购、赎回费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商稳健双利债券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,包括债券回购、央行票据、国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券,本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票、权证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,本基金投资于债券等固定收益类资产的投资比例不低于

基金资产的 80%，其中可转换债券比例不高于基金资产净值的 30%；股票等权益类品种投资比例不高于基金资产的 20%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%；并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 7 日，本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数收益率。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 7 日发布的《关于华商基金管理有限公司修改华商稳健双利债券型证券投资基金业绩比较基准的公告》，自 2015 年 9 月 7 日起，本基金的业绩比较基准变更为：中证综合债指数收益率。

#### **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”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商稳健双利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 重要会计政策和会计估计**

本基金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。

#### **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**

本基金本报告期内会计政策未发生变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期内会计估计未发生变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内未发生差错更正。

#### **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，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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,627,640.25
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,627,640.25

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,484,225.87	85,511,856.77	-972,369.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	538,750,241.80	532,146,735.00	-6,603,506.80

	银行间市场	49,992,130.54	50,041,000.00	48,869.46
	合计	588,742,372.34	582,187,735.00	-6,554,637.34
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	675,226,598.21	667,699,591.77	-7,527,006.44

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,615.33
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	4,621.92
应收债券利息	8,920,736.81
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.38
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	132.10
合计	8,927,106.54

### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	184,160.34
银行间市场应付交易费用	3,754.40
合计	187,914.74

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	780.38
预提费用	188,961.50
合计	189,741.88

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华商稳健双利债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	338,927,951.82	338,927,951.82
本期申购	56,025,704.71	56,025,704.71
本期赎回(以“-”号填列)	-279,192,945.22	-279,192,945.22
本期末	115,760,711.31	115,760,711.31

金额单位：人民币元

华商稳健双利债券 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	539,801,375.19	539,801,375.19
本期申购	376,694,307.69	376,694,307.69
本期赎回(以“-”号填列)	-648,230,485.50	-648,230,485.50
本期末	268,265,197.38	268,265,197.38

注：本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华商稳健双利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,212,153.45	108,543,042.44	174,755,195.89
本期利润	-26,821,003.50	-12,100,037.09	-38,921,040.59
本期基金份额交易产生的变动数	-29,217,023.70	-62,446,768.58	-91,663,792.28
其中：基金申购款	8,050,006.16	14,942,503.02	22,992,509.18

基金赎回款	-37,267,029.86	-77,389,271.60	-114,656,301.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,174,126.25	33,996,236.77	44,170,363.02

单位：人民币元

华商稳健双利债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,480,651.50	170,386,965.77	263,867,617.27
本期利润	-56,294,146.81	-16,254,830.31	-72,548,977.12
本期基金份额交易产生的变动数	-19,976,022.29	-76,497,128.49	-96,473,150.78
其中：基金申购款	60,883,727.98	91,477,555.78	152,361,283.76
基金赎回款	-80,859,750.27	-167,974,684.27	-248,834,434.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,210,482.40	77,635,006.97	94,845,489.37

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	160,491.29
定期存款利息收入	20,902.78
其他存款利息收入	32,359.66
结算备付金利息收入	190,930.66
其他	2,674.78
合计	407,359.17

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	588,378,484.08
减：卖出股票成本总额	630,381,068.84
买卖股票差价收入	-42,002,584.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-47,444,802.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-47,444,802.87

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,893,551,292.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,915,594,353.69
减：应收利息总额	25,401,741.59
买卖债券差价收入	-47,444,802.87

#### 6.4.7.13.3 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

本基金本报告期内未发生衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	146,295.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	146,295.21

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-28,354,867.40



——股票投资	-18,788,901.28
——债券投资	-9,565,966.12
——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	-28,354,867.40

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	87,167.62
其他	-
合计	87,167.62

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金财产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,706,722.36
银行间市场交易费用	30,700.00
合计	1,737,422.36

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	149,179.94
上清所证书使用费	200.00
银行费用	22,466.05
帐户维护费	36,000.00
其他	-
合计	247,627.55

## 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

本报告期与本基金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（“华商基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,088,616,126.63	100.00%	1,137,754,291.30	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	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 成交总额的比例
华龙证券	1,498,539,228.70	100.00%	1,656,469,573.06	100.00%

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	22,872,900,000.00	100.00%	56,905,100,000.00	100.00%

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	1,013,829.85	100.00%	184,160.34	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	1,035,814.18	100.00%	548,419.03	100.00%

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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,524,552.85	4,588,523.21

其中：支付销售机构的客户维护费	317,866.02	740,328.79
-----------------	------------	------------

注：支付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 0.70% 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×0.70%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,007,015.08	1,311,006.65

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 0.20% 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×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商稳健双利债券 A	华商稳健双利债券 B	合计
华商基金管理有限公司	-	1,170,491.29	1,170,491.29
华龙证券股份有限公司	-	248.95	248.95
中国建设银行股份有限公司	-	61,848.22	61,848.22
合计	-	1,232,588.46	1,232,588.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商稳健双利债券 A	华商稳健双利债券 B	合计
华商基金管理有限公司	-	447,526.33	447,526.33
华龙证券股份有限公司	-	361.87	361.87
中国建设银行股份有限公司	-	131,114.71	131,114.71
合计	-	579,002.91	579,002.91

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。基金销售服务费按前一日 B 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 B 类基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	3,627,640.25	160,491.29	94,897,643.19	402,662.12

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本基金本报告期末无其他关联交易事项的说明。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2016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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	4,990	499,000.00	499,000.00	-

### 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
000693	ST 华泽	2016年3月1日	重大事项停牌	13.61	-	-	800,001	12,050,567.57	10,888,013.61	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项停牌	24.43	2016年7月4日	21.11	270,100	4,973,211.60	6,598,543.00	-
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大事项停牌	7.58	2016年7月11日	8.09	500,000	4,544,378.00	3,790,000.00	-
000619	海螺型材	2016年5月16日	重大事项停牌	11.35	2016年7月13日	11.50	100,000	1,125,355.00	1,135,000.00	-
300142	沃森生物	2016年3月22日	重大事项停牌	8.14	-	-	96	814.53	781.44	-

注：1. 本基金截至 2016 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“ST 华泽”股票自 2015 年 3 月 1 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“ST 华泽”股票的公允价值，自 2016 年 3 月 7 日起采用“指数收益法”对其进行估值。

3. 本基金持有的“沃森生物”股票自 2016 年 3 月 22 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“沃森生物”股票的公允价值，自 2016 年 3 月 24 日起采用估值模型对其进行估值。具体调整公告已于 2016 年 3 月 24 日在我公司网站发布。

### 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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 160,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 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

本基金为债券型证券投资基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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，力争较平稳的为基金持有人创造持续收益，最终实现基金资产的长期稳健增值。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	10,041,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	365,988,400.00	50,055,000.00
合计	376,029,400.00	50,055,000.00

注：以上未评级的债券为国债、银行间政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	43,062,802.30	368,336,731.60
AAA 以下	111,979,427.90	426,398,599.68
未评级	51,116,104.80	273,628,872.60
合计	206,158,335.00	1,068,364,203.88

注：以上未评级的债券投资为国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 160,000,000.00 元将在 1 个月内到期且计息外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,627,640.25	-	-	-	3,627,640.25
结算备付金	8,742,561.87	-	-	-	8,742,561.87
存出保证金	293,650.63	-	-	-	293,650.63

交易性金融资产	446,589,213.30	63,534,416.90	72,064,104.80	85,511,856.77	667,699,591.77
衍生金融资产	0.00	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	8,927,106.54	8,927,106.54
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	2,000.00	-	-	126,752.36	128,752.36
其他资产	0.00	-	-	-	0.00
资产总计	459,255,066.05	63,534,416.90	72,064,104.80	94,565,715.67	689,419,303.42
负债					
短期借款	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融负债	0.00	-	-	-	0.00
衍生金融负债	0.00	-	-	-	0.00
卖出回购金融资产款	160,000,000.00	-	-	-	160,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	30,620.49	30,620.49
应付赎回款	-	-	-	406,703.23	406,703.23
应付管理人报酬	-	-	-	323,218.93	323,218.93
应付托管费	-	-	-	92,348.27	92,348.27
应付销售服务费	-	-	-	120,897.59	120,897.59
应付交易费用	-	-	-	187,914.74	187,914.74
应交税费	-	-	-	4,999,951.68	4,999,951.68
应付利息	-	-	-	26,145.53	26,145.53
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	189,741.88	189,741.88
负债总计	160,000,000.00	0.00	0.00	6,377,542.34	166,377,542.34
利率敏感度缺口	299,255,066.05	63,534,416.90	72,064,104.80	88,188,173.33	523,041,761.08
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,953,422.32	-	-	-	24,953,422.32
结算备付金	21,297,990.71	-	-	-	21,297,990.71
存出保证金	396,628.36	-	-	-	396,628.36
交易性金融资	51,251,536.60	545,569,610.28	521,598,057.00	234,444,184.34	1,352,863,388.22

产					
应收证券清算款	-	-	-	7,773,732.01	7,773,732.01
应收利息	-	-	-	14,257,034.54	14,257,034.54
应收申购款	121,002,000.00	-	-	490,854.13	121,492,854.13
资产总计	218,901,577.99	545,569,610.28	521,598,057.00	256,965,805.02	1,543,035,050.29
负债					
卖出回购金融资产款	218,000,000.00	-	-	-	218,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,117,611.00	1,117,611.00
应付管理人报酬	-	-	-	641,443.13	641,443.13
应付托管费	-	-	-	183,269.49	183,269.49
应付销售服务费	-	-	-	220,020.51	220,020.51
应付交易费用	-	-	-	429,551.82	429,551.82
应付利息	-	-	-	6,659.11	6,659.11
应交税费	-	-	-	4,999,951.68	4,999,951.68
其他负债	-	-	-	84,403.38	84,403.38
负债总计	218,000,000.00	-	-	7,682,910.12	225,682,910.12
利率敏感度缺口	901,577.99	545,569,610.28	521,598,057.00	249,282,894.90	1,317,352,140.17

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

假设	除市场利率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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	2,808,065.66	10,308,733.14
	市场利率上升 25 个基点	-2,777,850.11	-10,133,459.64

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理方法，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等方面问题的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并应用量化模型进行优化计算，根据计算结果和风险的评估、建议适时、动态地调整基金资产在股票、债券、现金三大类资产的配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中可转换债券比例不高于基金资产净值的 30%；股票等权益类品种投资比例不高于基金资产的 20%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	85,511,856.77	16.35	234,444,184.34	17.80
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	85,511,856.77	16.35	234,444,184.34	17.80

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 16.35%(2015 年 12 月 31 日：17.80%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

## § 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	85,511,856.77	12.40
	其中：股票	85,511,856.77	12.40
2	固定收益投资	582,187,735.00	84.45
	其中：债券	582,187,735.00	84.45
	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	12,370,202.12	1.79
7	其他各项资产	9,349,509.53	1.36
8	合计	689,419,303.42	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	30,677,496.11	5.87
C	制造业	27,915,071.42	5.34
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	4,095,000.00	0.78
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,824,289.24	4.36
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	-	-
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	85,511,856.77	16.35

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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	000693	ST 华泽	800,001	10,888,013.61	2.08
2	000807	云铝股份	1,197,200	7,841,660.00	1.50
3	000615	京汉股份	398,649	7,315,209.15	1.40
4	000002	万科 A	270,100	6,598,543.00	1.26
5	000758	中色股份	797,094	6,177,478.50	1.18
6	000959	首钢股份	1,592,600	5,892,620.00	1.13
7	600569	安阳钢铁	2,000,000	5,160,000.00	0.99
8	600266	北京城建	398,400	4,976,016.00	0.95
9	600395	盘江股份	600,000	4,956,000.00	0.95
10	300084	海默科技	398,200	4,866,004.00	0.93
11	002311	海大集团	300,000	4,731,000.00	0.90
12	300022	吉峰农机	500,000	4,095,000.00	0.78
13	600759	洲际油气	500,000	3,790,000.00	0.72

14	600622	嘉宝集团	200,000	2,750,000.00	0.53
15	000060	中金岭南	200,000	2,086,000.00	0.40
16	000965	天保基建	200,000	1,184,000.00	0.23
17	000619	海螺型材	100,000	1,135,000.00	0.22
18	600782	新钢股份	200,000	1,066,000.00	0.20
19	002335	科华恒盛	24	1,164.48	0.00
20	600499	科达洁能	50	845.50	0.00
21	300142	沃森生物	96	781.44	0.00
22	000631	顺发恒业	107	521.09	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	000693	ST 华泽	27,225,256.81	2.07
2	000625	长安汽车	25,675,084.78	1.95
3	600569	安阳钢铁	21,986,503.68	1.67
4	600395	盘江股份	21,491,403.87	1.63
5	000060	中金岭南	18,345,143.10	1.39
6	600372	中航电子	17,800,163.32	1.35
7	600258	首旅酒店	16,449,732.20	1.25
8	000615	京汉股份	15,585,747.74	1.18
9	600570	恒生电子	14,838,957.38	1.13
10	000631	顺发恒业	14,837,554.94	1.13
11	002373	千方科技	14,014,970.30	1.06
12	000983	西山煤电	13,898,007.00	1.05
13	600115	东方航空	13,680,207.50	1.04
14	600987	航民股份	12,907,145.59	0.98
15	002714	牧原股份	12,238,281.00	0.93
16	002179	中航光电	12,174,281.80	0.92
17	000807	云铝股份	10,892,673.00	0.83
18	600376	首开股份	10,302,307.28	0.78
19	600067	冠城大通	9,303,313.00	0.71
20	000703	恒逸石化	8,974,027.48	0.68

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	000625	长安汽车	27,097,859.33	2.06
2	000631	顺发恒业	22,894,759.64	1.74
3	600372	中航电子	18,675,552.63	1.42
4	000615	京汉股份	18,184,454.28	1.38
5	000693	ST 华泽	16,827,484.66	1.28
6	600570	恒生电子	15,941,240.04	1.21
7	600395	盘江股份	15,719,126.90	1.19
8	300142	沃森生物	15,353,909.19	1.17
9	000060	中金岭南	14,387,461.59	1.09
10	002373	千方科技	14,081,184.58	1.07
11	600258	首旅酒店	14,050,472.54	1.07
12	600987	航民股份	13,989,924.30	1.06
13	300296	利亚德	13,838,956.35	1.05
14	002714	牧原股份	13,232,525.00	1.00
15	002179	中航光电	12,867,124.81	0.98
16	600115	东方航空	12,331,956.00	0.94
17	002188	巴士在线	11,995,089.31	0.91
18	000983	西山煤电	11,937,625.53	0.91
19	600569	安阳钢铁	10,905,816.70	0.83
20	002335	科华恒盛	10,889,959.01	0.83

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	500,237,642.55
卖出股票收入（成交）总额	588,378,484.08

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

金额单位：人民币元



序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	377,104,504.80	72.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,000,000.00	7.65
	其中：政策性金融债	40,000,000.00	7.65
4	企业债券	94,523,416.90	18.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	70,559,813.30	13.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	582,187,735.00	111.31

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019518	15 国债 18	1,360,000	135,986,400.00	26.00
2	019529	16 国债 01	800,000	80,008,000.00	15.30
3	019538	16 国债 10	500,000	50,150,000.00	9.59
4	019527	15 国债 27	500,000	50,030,000.00	9.57
5	150215	15 国开 15	400,000	40,000,000.00	7.65

## 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

## 7.10.2 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。

## 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

华泽钴镍公告于 2015 年 10 月 13 日收到中国证券监督管理委员会四川监管局[2015]17、[2015]18、[2015]19 号行政监管措施决定书，主要内容包括以下三点：一、《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2015]17 号）：华泽钴镍公司存在以下问题：1）现金流量表编制与列报存在问题；2）部分仓储费用、运输费用未及时入账；3）2014 年年报应付票据分类、销售收入明细披露有误；二、《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司采取责令公开说明措施的决定》（[2015]18 号）主要内容如下：1）2013 年末陕西臻泰融佳工贸有限公司（以下简称“臻泰融佳”）向你公司子公司陕西华泽镍钴金属有限公司（以下简称“陕西华泽”）出具商业承兑汇票中，部分商业承兑汇票无承兑人签章。2）陕西华泽应付账款明细账显示，部分企业与公司存在无交易实质的银行存款及票据往来；三、《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司控股股东王辉、王涛采取出具警示函措施的决定》（[2015]19 号）主要内容如下：根据王辉、王涛与成都华泽钴镍材料股份有限公司签订的《盈利预测补偿协议》及相关补充协议，2013 年因未完成并购重组业绩承诺应补偿 45,219,258 股，在补偿承诺期限届满前，上述股份应被锁定，且不拥有表决权、不享有股利分配的权利，经上市公司股东大会通过后应依法予以注销。经查，王辉、王涛合计持有华泽钴镍 191,633,200 股，其中有 191,620,000 股已被用于质押贷款，未质押股份仅 13,200 股，远低于应补偿的股份数量，若无法偿还主债务或触及质押强制平仓线，可能使质押股份由质权人优先受偿或被强制平仓，导致承诺难以履行，增加其他投资者的风险。根据《上市公司监管指引第 4 号——上市公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及上市公司承诺及履行》（证监会公告[2013]55 号）的规定，现对王辉、王涛二人予以警示。公司于 2015 年 11 月 18 日公告就 17 号、18 号文的整改反馈，确立了相应事件整改负责人及整改期限。公司于 2016 年 1 月 9 日公告公司控股股东王辉、王涛收到中国证券监督管理委员会四川监管局行政监管措施决定书，要求此二人于 2016 年 1 月 19 日到四川证监局接受监管谈话。公司公告于 2015 年 11 月 23 日接到中国证券监督管理委员会调查通知书，因公司涉嫌信息披露不实等证券违法违规，决定对公司进行立案调查。此后，公司分别于 2016 年 3 月 16 日和 2016 年 3 月 19 日公告，公司控股股东王涛及财务总监郭立红收到中国证监会调查通知书的公告。2016 年 6 月 17 日公司收到中国证监会四川监管局的行政监管措施决定书，主要内容包括：

1)《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司采取责令改正措施的决定》。公司全资子公司陕西华泽向关联方陕西星王集团开具了 3 亿元的商业承兑汇票，承兑人为华泽钴镍，构成事实上的关联担保行为，而公司未依法履行信息披露义务。公司应在收到决定书之日起 30 个工作日内报送整改报告。2)《关于对王涛、王应虎采取监管谈话措施的决定》。上述关联担保事项，王涛、王应虎作为相关企业的法人代表，同时作为华泽钴镍董事，未能履行信息披露义务。被监管机构采取监管谈话的措施。3)《关于对王涛、王辉采取责令改正措施的决定》。华泽钴镍在借壳成都聚友时，签订了盈利预测补偿协议。而公司 2013 年度与 2015 年年度实现的净利润数未达到承诺业绩，根据盈利补偿协议，王涛、王辉二人应将所持全部 191633241 股华泽钴镍股份向华泽钴镍进行补偿，但二人至今尚未履行承诺，且所持大部分股份被质押，全部股份已被司法冻结。现责令二人改正，及时将应补偿股份向华泽钴镍进行补偿，并将进入诚信档案，在收到本决定之日起十个工作日内，

上报书面整改报告并及时披露。2016 年 6 月 29 日，华泽钴镍接到中国证监会调查通知书，因公司关联交易和关联担保涉嫌违反证券法律法规，中国证监会决定对公司立案调查。

2015 年 7 月 25 日，京汉股份原湖北金环股份有限公司（以下简称“公司”）第二大股东湖北化纤开发有限公司（以下简称“化纤开发”）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》（鄂证调查通字 011 号）：因化纤开发涉嫌违规减持“湖北金环”股份，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对 化纤开发立案调查。鉴于公司已经被借壳，二股东减持不会对公司的实际经营产生大的影响。2015 年 11 月 4 日，公司收到股东湖北化纤开发有限公司（以下简称“湖北化纤”）转来的中国证券监督管理委员会《行政处罚决定》【（2015）42 号】。主要对湖北化纤违法减持的行为进行了立案调查、审理，并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。当事人湖北化纤、刘新河均未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。

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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	293,650.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,927,106.54
5	应收申购款	128,752.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,349,509.53

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132001	14 宝钢 EB	27,648.00	0.01

### 7.11.5 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	000693	ST 华泽	10,888,013.61	2.08	重大事项停牌
2	000002	万 科 A	6,598,543.00	1.26	重大事项停牌

### 7.11.6 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华 商 稳 健 双 利 债 券 A	3,448	33,573.29	53,976,024.17	46.63%	61,784,687.14	53.37%
华 商 稳 健 双 利 债 券 B	2,822	95,062.08	207,096,365.70	77.20%	61,168,831.68	22.80%
合计	6,270	61,248.15	261,072,389.87	67.98%	122,953,518.82	32.02%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华商稳健双利债券 A	13,730.98	0.0119%
	华商稳健双利债券 B	0.00	0.0000%
	合计	13,730.98	0.0036%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华商稳健双利债券 A	0
	华商稳健双利债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华商稳健双利债券 A	0~10
	华商稳健双利债券 B	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华商稳健双利债券 A	华商稳健双利债券 B
基金合同生效日（2010 年 8 月 9 日）基金份额总额	712,681,476.34	1,274,631,709.35
本报告期期初基金份额总额	338,927,951.82	539,801,375.19
本报告期基金总申购份额	56,025,704.71	376,694,307.69
减：本报告期基金总赎回份额	279,192,945.22	648,230,485.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	115,760,711.31	268,265,197.38

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

### 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

自本基金成立日（2010 年 8 月 9 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没有发生受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
华龙证券	2	1,088,616,126.63	100.00%	1,013,829.85	100.00%	-

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	成交金额	占当期权证成交总额

				的比例		的比例
华龙证券	1,498,539,228.70	100.00%	22,872,900,000.00	100.00%	-	-

### 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	华商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	华商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
3	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 15 日
4	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 18 日
5	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 18 日
6	华商基金管理有限公司关于开展直销平台基金转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 20 日
7	华商稳健双利债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
8	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增上海汇付金融服务有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
9	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 29 日

10	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
11	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
12	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 1 日
13	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和耕传承基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 1 日
14	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 5 日
15	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 18 日
16	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 26 日
17	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 1 日
18	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 (2016/3/3)	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 3 日
19	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 8 日
20	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 10 日
21	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金新增徽商期货有限责任公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 16 日
22	华商基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 3 月 16 日



	旗下部分基金参加徽商期货有限责任公司费率优惠活动的公告	券报、证券时报、公司网站	
23	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 19 日
24	华商稳健双利债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 24 日
25	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 24 日
26	华商稳健双利债券型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 24 日
27	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整沃森生物股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 25 日
28	华商稳健双利债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
29	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增开源证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
30	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务(深圳)有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
31	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
32	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
33	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加奕丰金融服务(深圳)有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日

34	华商稳健双利债券型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
35	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 1 日
36	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 5 日
37	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 6 日
38	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 7 日
39	华商稳健双利债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 20 日
40	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 21 日
41	华商基金管理有限公司关于关闭网上交易支付宝支付渠道的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 29 日
42	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 (2016/5/7)	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 7 日
43	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
44	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中证金牛(北京)投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 13 日
45	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行基金通费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 13 日
46	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大连网金	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2016 年 5 月 16 日

	金融信息服务有限公司费率优惠活动的公告	司网站	
47	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 16 日
48	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 5 月 19 日
49	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 1 日
50	华商基金管理有限公司关于旗下基金新增北京广源达信投资管理有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
51	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京广源达信投资管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
52	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 20 日
53	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 28 日
54	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 6 月 28 日
55	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 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稳健双利债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商稳健双利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商稳健双利债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商稳健双利债券型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
6. 报告期内华商稳健双利债券型证券投资基金在制定报刊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  
2016 年 8 月 26 日