

# 华商新常态灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要 (2017 年第 1 号)

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

华商新常态灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2015 年 5 月 29 日证监许可[2015]1066 号文注册，本基金基金合同于 2015 年 6 月 29 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

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

本招募说明摘要所载内容截止日为 2016 年 12 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日。（财务数据未经审计）

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

1、名称：华商基金管理有限公司

2、住所：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

3、办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

4、法定代表人：李晓安

5、成立时间：2005 年 12 月 20 日

6、注册资本：壹亿元

7、电话：010—58573600 传真：010—58573520

8、联系人：周亚红

9、股权结构

股东名称 出资比例

华龙证券股份有限公司 46%

中国华电集团财务有限公司 34%

济钢集团有限公司 20%

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

11、管理基金情况：目前管理华商领先企业混合型证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商稳固添利债券型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商新动力灵活配置混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金、华商保本 1 号混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金。

（二）基金管理人主要人员情况

## 1. 董事会成员

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

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

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

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

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

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

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

曲飞：独立董事。男，硕士研究生学历、高级工程师。现任北京亿路特通新材料有限公司董事长，北京亿阳汇智通科技股份有限公司副董事长，南京长江第三大桥有限公司副董事长，亿阳集团股份有限公司董事、副总裁；曾就职于江苏盐城悦达集团、亿阳集团经贸公司；亿阳交通股份有限公司，任副总裁、总裁；亿阳

信通股份有限公司，任董事、副总裁。

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

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

## 2、监事会成员

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

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

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

## 3、总经理及其他高级管理人员

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

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

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

博时基金管理有限公司高级系统管理员。

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

#### 4、基金经理

高兵：男，软件工程硕士，中国籍，具有基金从业资格。2007年8月至2010年2月就职于普华永道中天会计师事务所，任高级审计师；2010年2月加入华商基金管理有限公司，历任行业研究员及基金经理助理；2013年8月5日至2015年4月7日担任华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理助理；2015年4月8日至2016年8月19日担任华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理；2015年12月18日起担任华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年1月18日起担任华商产业升级混合型证券投资基金基金经理；2016年8月5日起担任华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月23日起担任华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

吴鹏飞：男，2015年6月29日至2016年8月29日担任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

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

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

梁伟泓：华商基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资管理部副总经理、华商收益增强债券型证券投资基金基金经理、华商双债丰利债券型证券投资基金基金经理、华商双翼平衡混合型证券投资基金基金经理、华商保本1号混合型证券投资基金基金经理、华商稳定增利债券型证券投资基金基金经理；

蔡建军：华商基金管理有限公司研究发展部副总经理，华商健康生活灵活配置混

合型证券投资基金基金经理、华商价值精选混合型证券投资基金基金经理。

张杨：华商基金管理有限公司证券交易部副总经理。

上述人员之间无近亲属关系。

### （三）基金管理人职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

#### （四）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
  - （3）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
  - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）侵占、挪用基金财产；
  - （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
  - （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
  - （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。
- 3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营;
- (2) 违反基金合同或托管协议;
- (3) 故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益;
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6) 玩忽职守、滥用职权;
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其它股票投资;
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易;
- (10) 违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
- (11) 贬损同行,以提高自己;
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- (13) 以不正当手段谋求业务发展;
- (14) 有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
- (15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资;
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动;
- (7) 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

#### (五) 基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着敬业、诚信和谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
- 2、不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易,不利用职务之便为自己、或任何第三者谋取利益;
- 3、不违反现行有效的法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,

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

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （六）基金管理人的内部风险控制制度

##### 1、内部控制制度

###### （1）内部控制的原则

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

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

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

4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

###### （2）内部控制的主要内容

###### 1) 控制环境

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

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

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

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

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

## 2) 风险评估

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

## 3) 组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

### ①第一层次风险控制

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

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

### ②第二层次风险控制

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

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

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

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

### ③第三层次风险控制

第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

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

## 4) 制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

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

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

③业务控制制度包括投资管理制度、基金销售管理制度、风险控制制度、资料档

案管理制度、信息技术管理制度和突发事件管理制度。

#### 5) 信息与沟通

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

### 2、基金管理人关于内部控制的声明

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

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

### (二) 主要人员情况

截至 2016 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 190 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### (三) 基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金

公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 587 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年中国工商银行资产托管部第九次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

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

##### 2、内部风险控制组织结构

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

### 3、内部风险控制原则

- （1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
- （2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。
- （3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。
- （4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
- （5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。
- （6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### 4、内部风险控制措施实施

- （1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。
- （2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。
- （3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。
- （4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

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

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

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

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

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

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的

核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

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

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构:

名称: 华商基金管理有限公司

住所: 北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

办公地址: 北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

法定代表人: 李晓安

直销中心: 华商基金管理有限公司

电话: 010-58573768

传真: 010-58573737

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

##### 2、代销机构(以下排名不分先后):

###### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

联系人: 洪渊

客服电话: 95588

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

###### (2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

客服电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### (3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(4) 招商银行股份有限公司

注册地点：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客服电话：95528

网站：www.spdb.com.cn

(6) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

(7) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址：乌鲁木齐市扬子江路 339 号商行科技大厦 7 楼

法定代表人：农惠臣

电话：0991-8824667

联系人：何佳

客服电话：96518

网址：www.uccb.com.cn

(8) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客服热线：400-689-8888、0931-96668

网址：www.hlzqgs.com

(9) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺、朱雅崑

客服电话：400-8888-666、95521

网址：www.gtja.com

(10) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

开放式基金业务传真：（010）65182261

联系人：权唐

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(11) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话:0755-82960167

传真:0755-82943636

联系人:黄婵君

客服电话:95565?4008888111

网址:www.newone.com.cn

(12) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人: 张佑君

联系电话: 010-60838888

传真: 010-60833739

联系人: 顾凌

网址: www.cs.ecitic.com

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈共炎

电话: 010-66568450

传真: 010-66568990

联系人: 邓颜

客服电话: 4008-888-888

网址: www.chinastock.com.cn

(14) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客服电话: 95553、400-8888-001

网址: www.htsec.com

(15) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：李玉婷

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

(16) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(17) 安信证券股份有限公司

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

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

法定代表人：王连志

电话：4008001001

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

(18) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系电话：0571-85776114

传真：0571-86078823

联系人：李珊

公司网站：www.bigsun.com.cn

客户服务中心电话：0571-95548

(19) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

电话：025-84457777

联系人：庞晓芸

服务热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

(20) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：400-666-1618，95573

网址：www.i618.com.cn

(21) 中信证券（山东）有限责任公司

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

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

联系人：赵艳青

客服电话：95548

网址：www.citicssd.com

(22) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081000

传真：010-63081344

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(23) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：95525、4008888788、10108998

网址：www.ebscn.com

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(25) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

联系电话：0510-82831662

客服电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(26) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901963

传真：0571-87901955

联系人：李婷

客服热线：95345

网址：www.stocke.com.cn

(27) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16—20 层

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

法定代表人：谢永林

电话：021-38637436

传真：021-58991896

联系人：周一涵

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(28) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

客户服务电话：96518（安徽省内）、4008096518（全国）

网址：www.hazq.com

(29) 东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：乔芳

电话：0769-22100155

传真：0769-22100155

服务热线：0769-961130

网址：www.dgzq.com.cn

(30) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

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

(31) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 赵俊

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

联系人: 王一彦

客服电话: 95531; 400-888-8588

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

(32) 国盛证券有限责任公司

注册地址: 南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)

办公地址: 南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)

法定代表人: 马跃进

联系人: 俞驰

联系电话: 0791-86283080

传真 0791-86281485

客服电话: 4008222111

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

(33) 申万宏源西部有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区 (新市区) 北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区 (新市区) 北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室 (邮编: 830002)

法定代表人: 韩志谦

联系人: 李玉婷

联系电话: 010-88085858

客服电话: 4008-000-562

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

(34) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：021-20315137

客服电话：95538

网址：www.ats.com.cn

(35) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

联系人：袁媛

客服电话：4008-323-000

网址：www.csc.com.cn

(36) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87841160

传真：0591-87841150

联系人：张宗锐

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网址：www.hfzq.com.cn

(37) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(38) 财通证券股份有限公司

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

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

法定代表人：沈继宁

联系人：章力彬

联系电话：0571-87825100

传真：0571-87818329

客服电话：95336 , 4008696336

网址：www.ctsec.com

(39) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(40) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：（021）68778790

传真：（021）68777992

服务热线：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(41) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳、范春艳

客服电话：95377

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

(42) 广州证券股份有限公司

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

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

法定代表人: 邱三发

电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

联系人: 梁微

客服电话: 95396

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

(43) 华鑫证券有限责任公司

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

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人: 俞洋

电话: 021-64339000

联系人: 王逍

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

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

(44) 东吴证券股份有限公司

注册地址: 苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

办公地址: 苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人: 范力

电话: 0512-65581136

传真: 0512-65588021

联系人: 方晓丹

客服电话: 4008601555

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

(45) 东兴证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人: 魏庆华

电话: 010-66555316

传真：010-66555133

联系人：汤漫川

客服电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net.cn

(46) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

电话：（010）66045182

传真：（010）66045518

联系人：谭磊

客服电话：010-66045678

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

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

(47) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

客户服务电话：4006788887

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

(48) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

电话：0571-81147394

传真：0571-26697013

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

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

(49) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市高翔路 526 弄 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691942

传真：021-20691861

联系人：黄辉

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(50) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

上海市虹口区欧阳路 196 号（法兰桥创意园）26 号楼 2 楼

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(51) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38509639

传真：021-38509777

联系人：王建辉

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(52) 中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层

法定代表人：姜新

客户服务电话：95162

网址：www.cifcofund.com

(53) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

联系人：马林

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

(54) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

联系人：李艳

客服电话：400-059-8888

网址：www.zscffund.com

(55) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：吴强

客户服务电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(56) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：魏晨

客服电话：400 6099 200

网址：www.yixinfund.com

(57) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：010-88312877

传真：010-88312099

联系人：段京璐

客服电话：400-0011-566

网址：www.yilucaifu.com

(58) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法人代表：梁蓉

联系人：李婷婷

电话：010-66154828

传真：010-63583991

客服电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

(59) 泰信财富投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间

办公地址：北京市海淀区西四环北路 69 号一层

法定代表人：穆宏轩

电话：88460066

联系人：房珊珊

客户服务电话：400-881-5596

网址：fangshanshan126@126.com

## （二）登记机构

名称：华商基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

法定代表人：李晓安

电话：010-58573572

传真：010-58573580

联系人：马砚峰

网址：www.hsfund.com

### （三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：廖海、刘佳

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法人代表：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：单峰、周祎

联系人：周祎

## 四、基金的名称

华商新常态灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

基金类型：契约型开放式

## 六、基金的投资目标

本基金将密切关注中国经济“新常态”下的投资机会，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短

期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## 八、基金的投资策略

本基金坚持“自上而下”、“自下而上”相结合的投资视角，在实际投资过程中充分体现“新常态”这个核心理念，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。

### 1、大类资产配置策略

总体来说，新常态有几个主要特点：速度——“从高速增长转为中高速增长”，结构——“经济结构不断优化升级”，动力——“从要素驱动、投资驱动转向创新驱动”。

新常态将给中国带来新的发展机遇，这包括：

——经济增速虽然放缓，实际增量依然可观。7%左右的增长，无论是速度还是体量，在全球也是名列前茅的。

——经济增长更趋平稳，增长动力更为多元。国家正在协同推进新型工业化、信息化、城镇化、农业现代化，中国经济更多依赖国内消费需求拉动，避免依赖出口的外部风险。

——经济结构优化升级，发展前景更加稳定。消费对中国经济的贡献率将稳步提升，高新技术产业和装备制造业增速逐步高于工业平均增速，中国经济结构正在变得“质量更好，结构更优”。

本基金采用“自上而下”的分析视角，充分考量“新常态”下中国经济的发展前景和产业结构的调整变化情况，结合国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。

在行业选择方面，本基金主要投资于新兴制造业、文化体育产业、TMT 产业、环保产业、媒体产业（传媒）等，这些行业更加契合新常态经济环境下的市场需求。

## 2、股票投资策略

本基金坚持“自上而下”、“自下而上”相结合的投资视角，在实际投资过程中充分体现“新常态”这个核心理念及“新常态”的八个更加注重，即：

更加注重满足人民群众需要，更加注重市场和消费心理分析，更加注重引导社会预期，更加注重加强产权和知识产权保护，更加注重发挥企业家才能，更加注重加强教育和提升人力资本素质，更加注重建设生态文明，更加注重科技进步和全面创新。

首先，通过对中国宏观经济进入“新常态”下的运行特征进行全面深入地跟踪、分析以及判断，寻找符合“新常态”八个更加注重定义下的投资方向。其次，在“新常态”的投资方向上，积极关注行业和产业的生命周期，寻找“新常态”下中国经济转型中最受益的行业以及主题投资机会。最后，对相应行业及主题中业绩具有长期稳定成长性、二级市场估值合理、公司治理结构完善并且竞争优势突出的优质上市公司股票进行积极主动的配置。

### （1）“新常态”下的投资方向

认识新常态，适应新常态，引领新常态，是当前和今后一个时期我国经济发展的大逻辑。我国经济正在向形态更高级、分工更复杂、结构更合理的阶段演化，经济发展进入新常态，正从高速增长转向中高速增长，经济发展方式正从规模速度型粗放增长转向质量效率型集约增长，经济结构正从增量扩能为主转向调整存量、做优增量并存的深度调整，经济发展动力正从传统增长点转向新的增长点。

从投资需求看，中国经济经历了 30 多年高强度大规模开发建设后，传统产业相对饱和，但基础设施互联互通和一些新技术、新产品、新业态、新商业模式的投资机会大量涌现，对创新投融资方式提出了新要求。

从出口和国际收支看，国际金融危机发生前国际市场空间扩张很快，出口成为拉动我国经济快速发展的重要动能。现在全球总需求正在缓慢回升，但我国低成本比较优势也发生了转化；同时我国出口竞争优势依然存在，高水平引进来、大规模走出去正在同步发生，必须加紧培育新的比较优势，使出口继续对经济发展发挥支撑作用。

从生产能力和产业组织方式看，过去供给不足是长期困扰我们的一个主要矛盾，现在传统产业供给能力大幅超出需求，产业结构必须优化升级，企业兼并重组、生产相对集中不可避免，新兴产业、服务业、小微企业作用更加凸显，生产小型

化、智能化、专业化将成为产业组织新特征。

本基金将深入研究“新常态”下投资需求、出口和国际收支以及生产能力和产业组织方式等方面变化，并判断各种变化对市场的影响以及效应，重点配置市场潜力巨大，拉动效应强劲的相关产业。

## （2）个股选择策略

在以“新常态”八个注重为前提的条件下，本基金将通过定量筛选和定性分析相结合的方式考察和筛选具有综合性比较优势的品种。本基金将选择业绩具有长期稳定成长性、二级市场估值合理、公司治理结构完善并且竞争优势突出的优质上市公司股票进行积极主动的配置。

### A、成长性

本基金将主要通过财务指标分析以及实地调研来判断上市公司未来业绩的高成长性以及可持续性。对于具有稳定高成长性的上市公司，本基金将进行重点关注。本基金参考的财务主表包括：营业利润同比增长率、经营性现金流同比增长率、净利润同比增长率以及营业收入同比增长率等。

### B、估值水平

对于成长型公司来说，本基金在关注市值空间的同时，也充分考量估值，因此估值过高会对其投资价值产生较大影响。本基金将结合上市公司所处行业、业务模式特征等因素，综合采用市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）等相对估值法，进一步筛选估值相对合理的上市公司股票进行配置。

### C、公司治理结构

公司治理结构是保证上市公司持续、稳定、健康发展的重要条件，是保证上市公司谋求股东价值最大化的重要因素。本基金将从定性方面考虑公司与资产市场的利益是否一致；公司的发展是否得到政策的鼓励；公司的发展布局 and 战略的合理性和可行性；公司管理层的领导能力和执行能力；公司在资源、技术、品牌以及公司企业文化方面所具备的优势等。

### D、竞争优势

企业在行业中的相对竞争力是决定企业成败的关键。企业在行业中的相对竞争优势取决于技术创新能力、发展战略、经营管理水平等多方面因素。本基金将重点考量具有以下一项或多项特征的上市公司：

- ① 具有较强技术创新能力；
- ② 已建立起市场化经营机制、决策效率高、对市场变化反应灵敏并内控有力；
- ③ 具有与行业竞争结构相适应的、清晰的竞争战略；

④ 主营业务突出且稳定；

⑤ 在行业内拥有成本优势、规模优势、品牌优势、特许经营权或其它特定优势；

### 3、债券投资策略

在资本市场日益国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。债券类品种的投资，追求在严格控制风险的基础上获取稳健回报的原则。

（1）本基金采用目标久期管理法作为本基金债券类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势，作为组合久期选择的主要依据。

（2）结合收益率曲线变化的预测，采取期限结构配置策略，通过分析和情景测试，确定长、中、短期债券的投资比例。

（3）收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上，进行类属的配置，优化组合收益。

（4）在运用上述策略方法基础上，通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素，选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象，并形成组合。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价错误和回购套利机会等，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。

（5）根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。

### 4、股指期货投资策略

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

在预判市场系统风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。

### 5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债属于高收益债品种之一，其特点是信用风险高、收益率高、债券流动性较低。本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而

引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

本基金在对我国中小企业私募债市场发展动态紧密跟踪基础之上，依据独立的中小企业私募债风险评估体系，配备专业的研究力量，并执行相应的内控制度，更加审慎地分析单只中小企业私募债的信用风险及流动性风险，进行中小企业私募债投资。在中小企业私募债组合的管理上，将使用更加严格的风控标准，严格限制单只债券持有比例的上限，采用更分散化的投资组合，更短的组合到期期限来控制组合的信用风险和流动性风险。

#### 6. 其他投资品种投资策略

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

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

#### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%

本基金为混合型证券投资基金，股票投资比例为 0-95%，因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为 65%，其余为债券投资部分。

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：

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

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称，或法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或市场中出现更适用于本基金的比较基准指数，本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后

变更业绩比较基准，并及时公告。

#### 十、基金的风险收益特征

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

#### 十一、基金的投资组合报告

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

##### 1. 报告期末基金资产组合情况

截至 2016 年 9 月 30 日，华商新常态灵活配置混合型证券投资基金资产净值为 1,362,855,630.92 元，份额净值为 0.981 元，累计份额净值为 1.231 元。

其投资组合情况如下：

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

|   |      |                  |       |
|---|------|------------------|-------|
| 1 | 权益投资 | 1,217,227,703.44 | 88.96 |
|---|------|------------------|-------|

|       |                  |       |
|-------|------------------|-------|
| 其中：股票 | 1,217,227,703.44 | 88.96 |
|-------|------------------|-------|

|   |      |   |   |
|---|------|---|---|
| 2 | 基金投资 | - | - |
|---|------|---|---|

|   |        |   |   |
|---|--------|---|---|
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|---|--------|---|---|

|       |   |   |
|-------|---|---|
| 其中：债券 | - | - |
|-------|---|---|

|        |   |   |
|--------|---|---|
| 资产支持证券 | - | - |
|--------|---|---|

|   |       |   |   |
|---|-------|---|---|
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
|---|-------|---|---|

|   |         |   |   |
|---|---------|---|---|
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
|---|---------|---|---|

|   |          |   |   |
|---|----------|---|---|
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
|---|----------|---|---|

|                   |   |   |
|-------------------|---|---|
| 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
|-------------------|---|---|

|   |              |                |      |
|---|--------------|----------------|------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 125,370,502.94 | 9.16 |
|---|--------------|----------------|------|

|   |      |               |      |
|---|------|---------------|------|
| 8 | 其他资产 | 25,678,842.79 | 1.88 |
|---|------|---------------|------|

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 1,368,277,049.17 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

##### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

###### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

2016 年 9 月 30 日

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

A 农、林、牧、渔业 --  
 B 采矿业 --  
 C 制造业 971,288,730.73 71.27  
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --  
 E 建筑业 45,750.11 0.00  
 F 批发和零售业 75,760,666.23 5.56  
 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 98,349,891.08 7.22  
 J 金融业 177,223.18 0.01  
 K 房地产业 --  
 L 租赁和商务服务业 --  
 M 科学研究和技术服务业 --  
 N 水利、环境和公共设施管理业 --  
 O 居民服务、修理和其他服务业 --  
 P 教育 25,298,921.59 1.86  
 Q 卫生和社会工作 --  
 R 文化、体育和娱乐业 46,306,520.52 3.40  
 S 综合 --  
 合计 1,217,227,703.44 89.31

## 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。

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

2016年9月30日

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |        |      |           |                |      |
|---|--------|------|-----------|----------------|------|
| 1 | 002301 | 齐心集团 | 5,165,430 | 112,606,374.00 | 8.26 |
| 2 | 300056 | 三维丝  | 5,946,051 | 110,299,246.05 | 8.09 |
| 3 | 002414 | 高德红外 | 3,281,907 | 85,821,868.05  | 6.30 |
| 4 | 000404 | 华意压缩 | 5,499,913 | 65,448,964.70  | 4.80 |
| 5 | 000952 | 广济药业 | 2,842,279 | 60,568,965.49  | 4.44 |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 6  | 000034 | 神州数码 | 1,970,964 | 56,468,118.60 | 4.14 |
| 7  | 000662 | 天夏智慧 | 2,075,074 | 55,611,983.20 | 4.08 |
| 8  | 002370 | 亚太药业 | 1,729,816 | 55,025,446.96 | 4.04 |
| 9  | 300072 | 三聚环保 | 981,814   | 42,807,090.40 | 3.14 |
| 10 | 300025 | 华星创业 | 3,099,849 | 42,529,928.28 | 3.12 |

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

##### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 10.3 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。

#### 11. 投资组合报告附注

##### 11.1

天夏智慧于 2016 年 8 月 23 号收到深圳证券交易所《关于对天夏智慧城市科技股

份有限公司及相关当事人给予通报批评纪律处分的决定》，指出公司主要存在：公司 2016 年 6 月 17 号披露的更正公告中指出公司于 2016 年 5 月 31 日披露的《天夏智慧城市科技股份有限公司关于出售部分子公司股权的公告》由于财务测算时没有编制合并报表而造成了较大误差，违反了交易所相关规定，交易所决定对天夏智慧城市科技有限公司、公司时任董事长梁国坚、副总经理高友志以及时任总会计师杨振美予以通报批评，并记入上市公司诚信档案。

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

## 11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 11.3 其他资产构成

2016 年 9 月 30 日

序号 名称 金额（元）

- |   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金   | 787,437.98    |
| 2 | 应收证券清算款 | 24,371,040.53 |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 30,859.01     |
| 5 | 应收申购款   | 489,505.27    |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 25,678,842.79 |

## 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## （九）基金净值表现

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（截止至 2016 年 9 月 30 日）

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准  
收益率标准差④ ①—③ ②—④

2015/06/29 至 2015/12/31 25.10% 2.45% -7.26% 1.78% 32.36% 0.67%

2016/01/01 至 2016/06/30 20.57% 1.98% -17.61% 1.50% 38.18% 0.48%

2016/07/01 至 2016/09/30 2.94% 0.73% 2.55% 0.52% 0.39% 0.21%

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

注：①本基金合同生效日为 2015 年 6 月 29 日。

②根据《华商新常态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

## 十二、基金的费用与税收

### （一）基金运作费用

#### 1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- (1) 基金管理人的管理费。
- (2) 基金托管人的托管费。
- (3) 基金份额持有人大会费用。
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费。
- (6) 基金的证券、期货交易费用。
- (7) 基金的银行汇划费用。
- (8) 基金的开户费用、账户维护费用。
- (9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

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

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### (2) 基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- （1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。
- （2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。
- （3）《基金合同》生效前的相关费用。
- （4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （二）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### （三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十三、对招募说明书更新部分的说明

- （1）更新了“重要提示”部分的相关内容。
- （2）更新了“三、基金管理人”的相关信息。
- （3）更新了“四、基金托管人”的相关信息。
- （4）更新了“五、相关服务机构”中代销机构信息。
- （5）在“九、基金的投资”中根据本基金的实际运作情况，更新了最近一期投资组合报告的内容，及最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。
- （6）在“二十一、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

华商基金管理有限公司

2017 年 2 月 11 日