

# 华商改革创新股票型证券投资基金招募说明书（更新）

## 摘要

（2019年第1号）

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

华商改革创新股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2017年7月5日证监许可[2017]1131号文注册。本基金基金合同于2018年3月2日生效。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为股票型基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或基金管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。本基金偏好于“改革创新”的上市公司，这种评估具有一定的主观性，将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性的风险。该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。因此，本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金无法完全规避股

票市场和债券市场的下跌风险。同时，本基金可能因持续规模较小而被合并导致基金终止的风险。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年3月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31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%
深圳市五洲协和投资有限公司	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、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商稳固添利债券型证券投资基金、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、华商回报 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、华商润丰灵活配置混合型证券投资基金、华商元亨灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞丰混合型证券投资基金、华商民营活力灵活配置混合型证券投资基金、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金、华商可转债债券型证券投资基金、华商上游产业股票型证券投资基金、华商改革创新股票型证券投资基金。

## （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。现任中国证券业协会副监事长；历任甘肃金融控股集团有限公司董事长，华龙证券股份有限公司党委书记、董事长，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。

金树成：董事。男，会计专业硕士。现任中国华电集团资本控股有限公司总经理，党委副书记；曾就职于华鑫国际信托有限公司，任党组书记、副总经理；中国华电集团公司，历任资产部风险管理处处长、审计部主任师、财务与风险管理部副主任；中央企业工委国有重点大型企业监事会，副处级专职监事；武警水电指挥部后勤部企业管理局，会计师。

徐亮天：董事。男，硕士研究生学历、高级会计师。现任济钢集团有限公司副总经理兼财务总监，历任济钢集团有限公司财务处处长、副处长，济南钢铁股份有限公司财务处处长、科员等职务。

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。

王小刚：董事。男，理学硕士。2018年6月加入华商基金管理有限公司，曾任职天水市信托投资公司；华龙证券有限责任公司兰州东岗西路营业部部门经理、副总经理、总经理、公司经纪业务管理总部总经理、公司总经理助理；华龙证券股份有限公司副总经理、党委委员、深圳分公司总经理、公司固定收益总部总经理。

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。

陈星辉：独立董事。男，北京大学 EMBA。现任立信会计师事务所管理合伙人；曾就职于大信会计师事务所，任副主任会计师；湖北省体改委上市中心，任副主任；三峡建行房地产公司，任财务经理。

## 2、监事会成员

苏金奎：监事。男，本科学历。现任华龙证券股份有限公司副总经理兼总会计师；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；历任华龙证券股份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战略研究部部门经理；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。

张新福：监事。男，法律硕士、高级经济师。现任济钢集团有限公司资产管理部部长，历任济钢集团有限公司财务部副部长、法律事务部副部长、处长助理、科长。曾任山东钢铁股份有限公司济南分公司销售管理部副部长。

## 3、总经理及其他高级管理人员

王小刚：董事、总经理。男，理学硕士。2018年6月加入华商基金管理有限公司，曾任职天水市信托投资公司；华龙证券有限责任公司兰州东岗西路营业部部门经理、副总经理、总经理、公司经纪业务管理总部总经理、公司总经理助理；华龙证券股份有限公司副总经理、党委委员、深圳分公司总经理、公司固定收益总部总经理。

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。

高敏：副总经理、深圳分公司总经理。女，会计专业硕士。2007年5月加入华商基金管理有限公司，2007年7月至2017年7月担任综合管理部总经理。曾任兰州百货大楼股份有限公司计划财务总部主管会计，甘肃金信会计师事务所审计主管，兰州金瑞税务师事务所业务部副主任，华龙证券股份有限公司计划财务总部副总经理。

王华：副总经理。男，工商管理硕士。2007年4月加入华商基金管理有限公司，历任证券交易部主管、总经理，机构投资一部总经理、投资经理，公司总经理助理；曾任中国物资再生利用总公司上海期货交易所投资分析员、部门副经理、部门经理，上海宏达期货有限公司投资结算部总监，中国经济开发信托投资公司北京证券营业部总经理助理、研究发展部经理，中海基金筹备组成员，北京华商投资有限公司副总经理。

吴林谦：副总经理。男，大学本科。2019年1月加入华商基金管理有限公司。曾就职于国家地震局兰州地震研究所，任助理研究员；上海新兰德证券投资咨询公司，任总经理助理；金新信托股份有限公司，从事投资管理工作；新疆新界集团公司，从事房地产开发项目投资工作；金元证券股份有限公司乌鲁木齐黄河路营业部，从事投行及机构客户服务工作；华龙证券有限责任公司乌鲁木齐扬子江路证券营业部，任副总经理；华龙证券股份有限公司乌鲁木齐扬子江路证券营业部，任总经理；华龙证券股份有限公司新疆分公司，任总经理。

#### 4、基金经理

李双全，男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。2007年8月至2010年4月，就职于SK能源公司从事财务工作；2010年4月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2014年8月1日至2015年4月7日担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理助理；2015年4月8日起至今担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理；2015年7月8日起至今担任华商双驱

优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年3月2日起至今担任华商改革创新股票型证券投资基金基金经理；现任投资管理部副总经理、公司公募业务权益投资决策委员会委员。

#### 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：

##### （1）权益投资决策委员会

王小刚：华商基金管理有限公司董事、总经理。

周海栋：华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商优势行业灵活配置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、华商主题精选混合型证券投资基金基金经理、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李双全：华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、华商领先企业混合型证券投资基金基金经理、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商改革创新股票型证券投资基金基金经理。

邓默：华商基金管理有限公司量化投资部总经理、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

童立：华商基金管理有限公司研究发展部总经理助理、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商上游产业股票型证券投资基金基金经理。

翟金林：华商基金管理有限公司上海分公司总经理、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商鑫安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。

张杨：华商基金管理有限公司证券交易部副总经理。

##### （2）固收投资决策委员会

王小刚：华商基金管理有限公司董事、总经理。

陈杰：华商基金管理有限公司固定收益部总经理。

张永志：华商基金管理有限公司固定收益部总经理助理、华商稳健双利债

券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、华商稳固添利债券型证券投资基金基金经理、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金基金经理、华商瑞丰混合型证券投资基金基金经理、华商可转债债券型证券投资基金基金经理、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、华商回报1号混合型证券投资基金基金经理。

李海宝：华商信用增强债券型证券投资基金基金经理。

张杨：华商基金管理有限公司证券交易部副总经理。

上述人员之间无近亲属关系。

### （三）基金管理人职责

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

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制季度、半年度和年度基金报告；



13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

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

17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称

“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

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

（8）除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；

（9）协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

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

- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、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、法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### （五）基金经理承诺

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

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

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （六）基金管理人的内部风险控制制度

##### 1、内部控制制度

##### （1）内部控制的原则

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

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

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

4)相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

##### （2）内部控制的主要内容

##### 1)控制环境

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

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

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

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

反馈系统。

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

## 2)风险评估

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

## 3)组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

### ①第一层次风险控制

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

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

### ②第二层次风险控制

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

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

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

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

### ③第三层次风险控制

第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作

流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

#### 4)制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

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

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

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

#### 5)信息与沟通

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

### 2、基金管理人关于内部控制的声明

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

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

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

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》

“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审

批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末，中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度



### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，

与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构：

名称：华商基金管理有限公司

住所：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

法定代表人：李晓安

直销中心：华商基金管理有限公司

电话：010-58573768

传真：010-58573737

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

##### 2、代销机构：

###### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

联系人：田青

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### （2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：王菁

联系电话：021—58781234

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://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](http://www.cmbchina.com)

(5) 乌鲁木齐银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市长风西街 1 号丽华大厦

办公地址：山西省太原市长风西街 1 号丽华大厦

法定代表人：阎俊生

联系人：杨瑞

客服电话：9510-5588

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

(6) 晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市长风西街 1 号丽华大厦

办公地址：山西省太原市长风西街 1 号丽华大厦

法定代表人：阎俊生

联系人：杨瑞

客服电话：9510-5588

公司网址：www.jshbank.com

（7） 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22866282

客服电话：0769-961122

公司网址：www.drcbank.com

（8） 浙商银行股份有限公司

客服电话：95527

公司网址：www.czbank.com

（9） 浙江泰隆商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省台州市路桥区南官大道 188 号

法定代表人：王钧

联系人：陈妍宇

电话：0571-87219677

客服电话：400-88-96575

公司网址：www.zjtlcb.com

（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

公司网址：[www.hlzqgs.com](http://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

公司网址：[www.gtja.com](http://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

公司网址：[www.csc108.com](http://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](http://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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：郑慧

客服电话：95558

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://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：010-83574507

传真：010-83574087

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888、95551

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://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](http://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 45 层

法定代表人：李梅

传真：021-33388224

联系人：王叔胤

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：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：尤习贵

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

公司网址：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：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑红

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

（18）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2201

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：姜晓林

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

联系人：刘晓明

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（19）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：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

（20）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：何耀

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（21）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：祁昊

联系电话：0510-82831662

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn



（22）浙商证券股份有限公司

注册地址：杭州市江干区五星路 201 号

办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

电话：021-80108643

传真：021-80106010

联系人：陈姗姗

客服热线：95345

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

（23）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：刘世安

电话：021-38631117

联系人：石静武

客服电话：95511-8

公司网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

（24）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：95318

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

（25）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

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客户服务电话:400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（26）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

公司网址：www.longone.com.cn

（27）申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人：韩志谦

联系人：王叔胤

联系电话：010-88085858

客服电话：4008-000-562

公司网址：www.hysec.com

（28）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李 玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：021-20315125

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（29）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

公司网址：www.gjq.com.cn

（30）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔

19、20层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔

19、20层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：梁微

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

（31）华鑫证券有限责任公司

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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

联系人：王道

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

公司网址：www.cfsc.com.cn

（32）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：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（33）华宝证券股份有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

联系电话：021-20657517

公司网址：www.cnhbstock.com

客服热线：400-820-9898

（34）长城国瑞证券有限公司

注册地址：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层

办公地址：福建省厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20F

法定代表人：王勇

客服电话：400-0099-886

公司网址：www.gwgsc.com

（35）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：陈灿辉

电话：021-63898427

联系人：徐璐

客户服务电话：400-820-5999

公司网址：www.shhxzq.com

（36）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法人代表:吴坚

联系人：张煜

电话：023-63786633

传真：023-63786212

客服电话：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

（37）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 特区报业大厦 16-17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法人代表:丁益

联系人：金夏

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客服电话：400-666-6888

公司网址：www.cgws.com

（38）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)

（39）深圳众禄基金销售股份有限公司

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 8 号 HALO 广场 4 楼

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

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（40）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 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

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

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

（41）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市高翔路 526 弄 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：周雨平

传真：021—20691861

联系人：黄辉

客服电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

（42）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

公司网址：www.ehowbuy.com

（43）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号（杨树浦路340号）C栋 2楼

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38509639

传真：021-38509777

联系人：徐诚

客户服务电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（44）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

联系人：马林

客服电话：400-818-8000

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

（45）众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、  
1103 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、  
1103 单元

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：400-876-9988

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

（46）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

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

（47）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

联系人：魏晨

电话：010-52413385

传真：010-85894285

客服电话：400-6099-200



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

（48）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

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

（49）北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社综合楼A座712室

法人代表：梁蓉

联系人：魏素清

电话：010-66154828

传真：010-63583991

客服电话：400-6262-818

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

（41）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（42）深圳新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：张彦

联系人：张燕

电话：010-83363099

传真：010-83363072

客服电话：400-166-1188

公司网址：[www.new-rand.cn](http://www.new-rand.cn)

（43）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：胡伟

联系人：陈铭洲

电话：18513699505

客服电话：400-618-0707

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

（44）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：黄祎

电话：021-63333389

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

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

（45）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：王骅

电话：021-20324174

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

（46）北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

传真：010-57569671

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

（47）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（48）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

（49）和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北互联网金融大厦6号楼6楼

办公地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北互联网金融大厦6号楼6楼

法定代表人：李淑慧

联系人：郭兆英

电话：0371-55213196

传真：0371-85518397

客服电话：4000-555-671

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

（50）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外甲6号SK大厦

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166

客服电话：400-910-1166

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

（51）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：李晓涵

电话：0411-88891212-119

传真：0411-84396536

客户服务电话：4000411001

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

（52）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：陈广浩

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客户服务电话：400-684-6500、400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（53）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

公司网站：www.jnlc.com

（54）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18F

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

电话：021-60195121

传真：021-50583633

客服电话：400—921—7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

（55）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：胡学勤

联系人： 宁博宇

电话： 021-20665952

传真： 021-22066653

客服电话： 4008219031

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

（56）北京广源达信基金销售有限公司

注册地址： 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址： 北京市朝阳区望京东园四区浦项中心 B 座 19 层

法定代表人： 齐剑辉

联系人： 王英俊

电话： 4006236060

传真： 010-82055860

客服电话： 4006236060

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

（57）深圳金斧子基金销售有限公司

注册地址： 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园  
B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址： 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园  
B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人： 赖任军

联系人： 刘昕霞

电话： 0755-29330513

传真： 0755-26920530

客服电话： 400-930-0660

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

（58）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址： 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人： 李悦章

联系人：张林

联系电话：010-85594745

客服电话：400-066-8586

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

（59）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-50712782

传真：021-50710161

客服电话：400-821-0203

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（60）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

联系人：吴翠

电话：010-62675657

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com>

（61）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

联系人：范泽杰

电话：021-20530186、13917243813

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

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

（62）浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）13楼

法人：蒋雪琦

联系人：来舒岚

电话：0571-88337888

传真：0571-88337666

客服电话：400-068-0058

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

（63）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A

法定代表人：高锋

联系人：廖苑兰

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

客服电话：400-804-8688

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

（64）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰



电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网址：<http://www.citicsf.com>

（65）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层  
3001室

法定代表人：李悦

联系人：张晔

电话：010-56642600

传真：010-56642623

客服电话：4007868868

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

（66）武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）  
第七幢23层1层4号

办公地址：武汉市泛海国际SOHO城7栋2301、2304

法人代表：陶捷

客服电话：400-027-9899

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

（67）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：4006199059

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

（68）大连网金基金销售有限公司

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：卜勇

联系人：于舒

联系电话：（0411）3902 7828

传真：（0411）3902 7835

客服电话：4000-899-100

公司网址：<http://www.yibaijin.com/>

（69）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287061

传真：010-59287825

客户服务电话：400-111-0889

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

（70）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海  
泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-35385521

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

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

（71）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

电话：010-85650628

传真：010-65884788

客服电话：400-920-0022

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

（72）济安财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516-814

传真：010-65330699

客服电话：400-673-7010

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

（73）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-88066552

客服电话：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.co](http://www.amcfortune.co)

（74）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

客服电话：400-061-8518

公司网址：<https://danjuanapp.com>

（75）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部

法定代表人：江卉

联系人：江卉

电话：13141319110

传真：010-89189566

客服电话：95118 、400-888-8816

网址：<http://fund.jd.com/>

（75）上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：021-50810673

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

（76）天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

电话：010-59013825

传真：010-59013707

客户服务电话:010-59013825

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

(77) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、  
1103 单元

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、  
1103 单元

法定代表人: 申健

联系人: 印强明

客服电话: 021-20292031

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

(78) 北京电盈基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人:程刚

联系人:张旭

客服电话: 400-100-3391

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

(79) 嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312  
-15 单元

法定代表人: 赵学军

客服电话: 400-021-8850

网站: [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(80) 洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司

客服电话: 400-8189-598

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

(81) 深圳信诚基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前港一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市福田区时代财富大厦第 49A 单元

法定代表人：周文

联系人：张敏

联系电话：0755-23946579

传真：0755-82786863

客服电话：0755-23946579

公司网址：www.ecpefund.com

（82）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

传真：025-66996699

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

（83）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：0755—23838750

客服电话：95358

公司网址：ww.firstcapital.com.cn

（84）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

电话：010-85556048

传真：010-85556088

客服电话：95390

公司网址：www.hrsec.com.cn

（85）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋

11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋

11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

联系电话：021-38784580-8918

客服电话：95351

网址：www.xcsc.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：010-58573571

传真：010-58573580

联系人：董士伟

网址：www.hsfund.com

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈熹、周祎

联系人：周祎

#### 四、基金的名称

本基金名称：华商改革创新股票型证券投资基金

#### 五、基金的类型

基金类型：契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金重点关注我国经济转型中涌现出各类改革创新机遇，精选受益于国企改革、户籍和土地制度改革、资源要素价格改革等以及创新动力强的上市公司，在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产持续稳健增长。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括依法发行上市的股票（包括创业板、中小板和其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。



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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于改革创新方向的证券资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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

在中国经济转型发展过程中，各种改革创新机会将层出不穷。本基金将重点关注各种改革创新对我们的经济和社会产生的影响，精选受益于国企改革、户籍和土地制度改革、资源要素价格改革等以及创新动力强的上市公司。同时，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，通过不断优化资产配置、控制仓位和采用股指期货做套期保值等策略，实现基金资产长期稳定增值。

### 1、大类资产配置

本基金综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。

### 2、股票投资策略

本基金分析受益于改革创新的企业的综合性比较优势，以挖掘出符合中国经济转型、具有爆发式增长机会、有利于改善人类生活质量、持续成长能力的优质企业。

#### （1）改革

本基金所指改革主要包括以下几类：

A) 受益于国企改革行业的股票，包括以上市公司作为平台，通过产权制度改革（如兼并重组、整合上市、引入多元股权结构等）或管理制度改革（如国有资产管理体制改革、国企管理层股权激励制度等）等多种方式，提高运营效率和竞争力的行业；受益于国防和军队改革的军工行业（包括非汽车交通运输设备行业、通信行业、信息安全设备行业、安防设备行业等）；

B) 受益于户籍和土地制度改革的行业（包括大众消费、医疗保健、婴儿食品和儿童用品行业、农林牧渔行业等）；

C) 受益于资源要素价格改革的环保行业（包括清洁能源、节能减排、环保技术和设备、环保服务和资源利用等相关行业等）。

## （2）创新动力强

本基金所指的创新，包括新产品开发、重大技术变革、产业边界突破、商业模式变化。其中，新产品开发是指生产新产品、提供新服务等；重大技术变革是指应用新知识、新技术、新工艺实现产品质量的提高、产品成本的降低；产业边界突破是指在技术边界、业务边界、运作边界、市场边界的突破；商业模式变化是指企业在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等方面的变化和创新，以实现企业盈利增加和竞争实力的增强。

本基金对创新企业挖掘的核心在于“创新”动力的评定。本基金将通过主动对行业产品创新、技术能力、产业壁垒、商业格局等进行分析，深入挖掘在商业模式、营销模式、生产流程、管理结构等商业行为中具有创新能力和创新意愿的企业。同时，本基金通过对创新的可持续性、创新的可复制性、创新导致的企业盈利和竞争实力变化等因素进行分析，以得到“创新”动力评价。精选“创新”动力较强并具有爆发式增长潜力、受益于中国经济转型、具有持续成长性的企业。具体来说，本基金将重点筛选如下具有“创新”动力特征的企业，即有创新能力和创新意愿：

a) 提供全新的产品或服务、开创新的产业领域，或以以前所未有的方式提供已有的产品或服务，并且产品或服务具有核心竞争优势（包括电子、休闲服务等）；

b) 应用新知识、新技术、新工艺、新思维，大幅降低生产成本、提高产品质量和产量（包括纺织服装、家用电器等）；

c) 在技术边界上提高生产技术手段、强化工艺流程，在业务边界上改进产品和服务体验，在运作边界上扩大产业活动基础平台，在市场边界上增强产品和服务的竞争力（包括计算机、轻工制造等）；

d) 在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等诸多方面的变化和创新，通过这些创新实现了企业成本的降低、盈利的增加和竞争实力的提高（包括传媒、商业贸易等）；

e) 改善人类生活质量、推动经济的发展和社会的进步（包括食品饮料、公用事业、建筑建材等）。

“改革创新”是一个动态变化的定义，在不同的经济发展阶段，由于特定的时代背景，会出现动态的变化，本基金将根据时代特征变化密切关注“改革创新”变化，对其构成进行动态的调整。

### （3）股票组合构建策略

本基金主要精选受益于改革和创新的上市公司，构建股票组合。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。定量筛选指标主要包括盈利能力、成长性、现金流状况、偿债能力、营运能力、估值等。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、品牌方面的核心竞争力；公司企业文化、治理结构等因素。最后由基金经理结合定量和定性研究以及实地调研，筛选出行业增长空间广阔、发展布局合理、基本面健康、最具比较优势的个股作为本基金的核心投资标的，进行重点投资。

### 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、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。

#### 5、股指期货投资策略

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

在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸的同时，

在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。

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

#### 6、其他投资品种投资策略

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

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

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：

中证 800 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

本基金为股票型证券投资基金，股票投资比例为 80%-95%，因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为 80%，其余为债券投资部分。

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：

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

2、上证国债指数以国债为样本,按照发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性。

3、作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

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

## 十、基金的风险收益特征

本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金和混合型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益产品。

## 十一、基金投资组合报告

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

### 1. 报告期末基金资产组合情况

截至 2018 年 12 月 31 日，华商改革创新股票型证券投资基金资产净值为 438,965,244.71 元，份额净值为 0.8476 元，累计份额净值为 0.8476 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	368,688,726.73	83.68
	其中：股票	368,688,726.73	83.68
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	59,328,716.94	13.47
8	其他资产	12,567,982.88	2.85
9	合计	440,585,426.55	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

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	148,479,202.04	33.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,280,000.00	3.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,076,000.00	10.50
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	117,193,378.89	26.70
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	41,610,000.00	9.48
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	368,688,726.73	83.99

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	603377	东方时尚	2,850,000	41,610,000.00	9.48
2	300596	利安隆	1,000,090	31,002,790.00	7.06
3	000631	顺发恒业	8,783,212	26,086,139.64	5.94
4	002777	久远银海	1,000,000	23,580,000.00	5.37
5	600048	保利地产	1,874,575	22,101,239.25	5.03
6	002146	荣盛发展	2,500,000	19,875,000.00	4.53
7	000063	中兴通讯	1,000,000	19,590,000.00	4.46
8	000002	万科A	800,000	19,056,000.00	4.34
9	001979	招商蛇口	1,000,000	17,350,000.00	3.95
10	002475	立讯精密	1,200,000	16,872,000.00	3.84

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



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

在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸的同时，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。

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

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

### 11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	403,941.91
2	应收证券清算款	12,130,218.02
3	应收股利	-
4	应收利息	17,035.43
5	应收申购款	16,787.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,567,982.88

### 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。

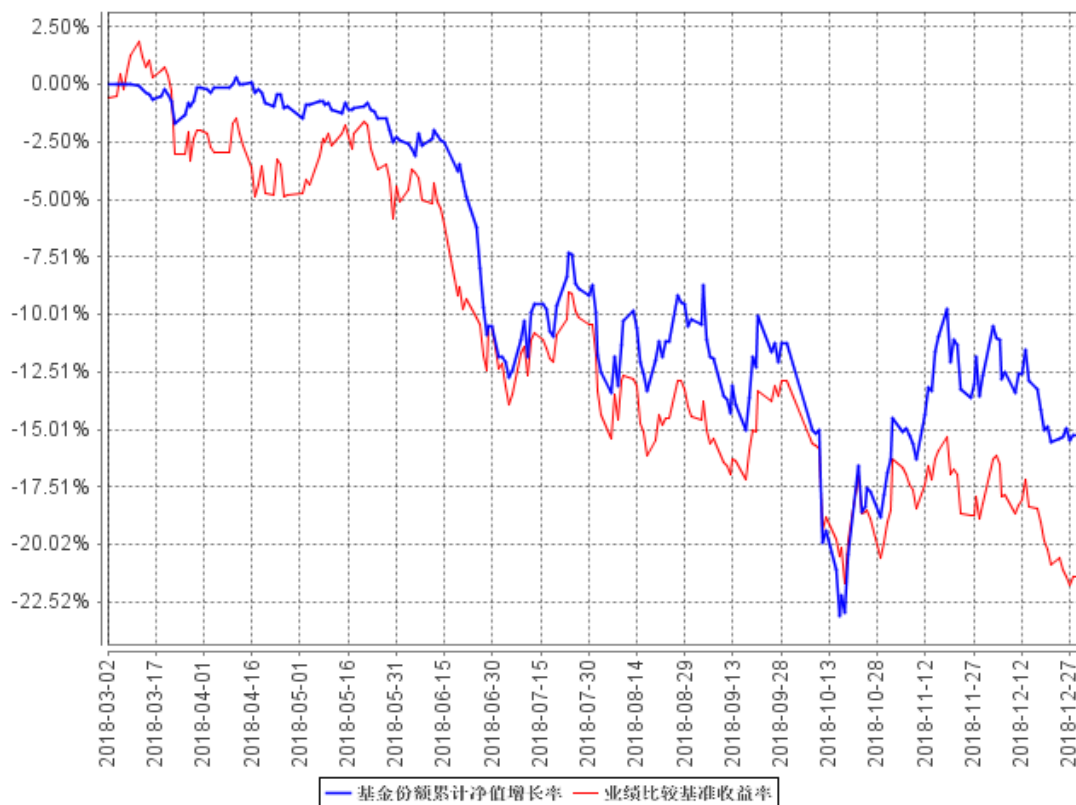
## 十二、基金的业绩

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
基金成立日至 2018/12/31	-15.24%	1.17%	-21.39%	1.09%	6.15%	0.08%

### 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2018年3月2日，至本报告期末，本基金合同生效未满一

年。

②根据《华商改革创新股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围主要为依法发行上市的股票（包括创业板、中小板和其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、权证、股指期货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：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于改革创新方向的证券资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）基金运作费用

##### 1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （1）基金管理人的管理费。
- （2）基金托管人的托管费。
- （3）基金份额持有人大会费用。
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费。
- （6）基金的证券、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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### （2）基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

（3）《基金合同》生效前的相关费用。

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （二）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人在履行适当程序后，可协商酌情调整基金管理费和基金托管费。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。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，本公司结合本基金的运行情况，对其原招募说明书进行了更新，主要更新的内容说明如下：

（一）更新了“重要提示”部分的相关内容。

（二）更新了“三、基金管理人”的相关信息。

（三）更新了“四、基金托管人”的相关信息。

（四）更新了“五、相关服务机构”的相关信息。

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

表现。

（六）在“二十一、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

华商基金管理有限公司

2019年4月15日