

信息披露 disclosure

华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金

2013 年度 报告 摘要

1.基金运营部基金仓位实时监控股票停牌情况,对于连续5个交易日不存在活跃市场的股票及时提示研究及风控并开发出现货;

2.由风控及合规部小组确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值,若确定用估值方法,则采用估值方法,并在估值方法确定后,由风控及合规部小组确认基金持有的投资品种的公允价值,并确定估值所用的方法;

3.由估值委员会计算该投资品种的公允价值,并将计算结果提交风控小组;

4.风控小组对估值结果进行审核,并出具审核意见并提交公司管理层;

5.公司管理层审核后,该估值方法方可实施。

为了确定旗下基金持有的投资品种进行估值时估值政策的一致性,风控小组定期定期对估值政策、程序及估值方法进行评价,在发生了影响估值政策和程序的情况下,公司旗下所有基金持有的投资品种的估值政策、程序及估值方法保持一致,除非非需要更新估值政策或程序的情形。

已确定的估值政策和方法应当持续适用。

风控小组和估值委员会应当互相协助定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的情况下,公司旗下所有基金持有的投资品种的估值政策、程序及估值方法保持一致,除非非需要更新估值政策或程序的情形。

在采用估值政策和方法时,风控小组应当适当参考与估值政策相关的法律法规、会计准则、专业胜任能力和独立性、通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等多种方法和方式的有效性,减少或避免估值偏差的发生。

7.管理人对于报告期内基金估值程序变动的说明

本基金报告期内未发生估值程序变动。

5 持有人报告

报告期内,本基金管理人在对华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 报告期内,本基金管理人基金估值程序变动说明

报告期内,华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金管理人——华商基金管理有限公司在华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金净值信息披露、净值表现、利润分配等事宜,均严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告年度报告中期财务数据及净值表现、净值表现和投资组合报告等内容进行了复核,并对本报告年度中期财务数据、净值表现、利润分配等事宜,均严格按照基金合同的规定进行。

6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)认为本基金出具了无保留意见的审计报告。

7 年度财务报表

会计主体:华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产 期末 2013年12月31日

银行存款 703,075.82

结算备付金 26,996,319.97

存出保证金 134,181.79

交易性金融资产 372,544,338.64

其中:股票投资 372,544,338.64

基金投资 -

债券投资 -

资产支持证券投资 -

衍生金融资产 60,000,000.00

买入返售金融资产 -

应收利息 15,741,590.17

应收股利 20,254.61

应收申购款 -

递延所得税资产 19,523.06

其他资产 -

资产总计 476,279,444.06

负债和所有者权益 期末 2013年12月31日

负债: -

短期借款 -

交易性金融负债 -

应付短期融资款 -

应付赎回款 4,140,557.69

应付管理人报酬 2,244,570.22

应付托管费 595,472.46

应付销售服务费 99,245.42

应付交易费 -

应付利息 -

应付股利 -

递延所得税负债 -

其他负债 62,437.88

负债合计 7,658,263.13

所有者权益: -

实收基金 477,027,540.39

未分配利润 -8,406,159.46

所有者权益合计 468,621,380.93

负债和所有者权益总计 476,279,444.06

注:1.本基金合同于2013年9月17日生效,截至2013年12月31日,本基金运作未满一年。

2.本报告期,本基金管理人基金估值程序变动说明

报告期内,华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金管理人——华商基金管理有限公司在华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金净值信息披露、净值表现、利润分配等事宜,均严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告年度报告中期财务数据及净值表现、净值表现和投资组合报告等内容进行了复核,并对本报告年度中期财务数据、净值表现、利润分配等事宜,均严格按照基金合同的规定进行。

5.4 基金管理人及基金托管人报告

4.1 基金管理人及基金托管人报告

4.1.1 基金管理人及基金托管人报告

4.1.2 基金管理人及基金托管人报告

4.1.3 基金管理人及基金托管人报告

4.1.4 基金管理人及基金托管人报告

4.1.5 基金管理人及基金托管人报告

4.1.6 基金管理人及基金托管人报告

4.1.7 基金管理人及基金托管人报告

4.1.8 基金管理人及基金托管人报告

4.1.9 基金管理人及基金托管人报告

4.1.10 基金管理人及基金托管人报告

4.1.11 基金管理人及基金托管人报告

4.1.12 基金管理人及基金托管人报告

4.1.13 基金管理人及基金托管人报告

4.1.14 基金管理人及基金托管人报告

4.1.15 基金管理人及基金托管人报告

4.1.16 基金管理人及基金托管人报告

4.1.17 基金管理人及基金托管人报告

4.1.18 基金管理人及基金托管人报告

4.1.19 基金管理人及基金托管人报告

4.1.20 基金管理人及基金托管人报告

4.1.21 基金管理人及基金托管人报告

4.1.22 基金管理人及基金托管人报告

4.1.23 基金管理人及基金托管人报告

4.1.24 基金管理人及基金托管人报告

4.1.25 基金管理人及基金托管人报告

4.1.26 基金管理人及基金托管人报告

4.1.27 基金管理人及基金托管人报告

4.1.28 基金管理人及基金托管人报告

4.1.29 基金管理人及基金托管人报告

4.1.30 基金管理人及基金托管人报告

4.1.31 基金管理人及基金托管人报告

4.1.32 基金管理人及基金托管人报告

4.1.33 基金管理人及基金托管人报告

4.1.34 基金管理人及基金托管人报告

4.1.35 基金管理人及基金托管人报告

4.1.36 基金管理人及基金托管人报告

4.1.37 基金管理人及基金托管人报告

4.1.38 基金管理人及基金托管人报告

4.1.39 基金管理人及基金托管人报告

4.1.40 基金管理人及基金托管人报告

4.1.41 基金管理人及基金托管人报告

4.1.42 基金管理人及基金托管人报告

4.1.43 基金管理人及基金托管人报告

4.1.44 基金管理人及基金托管人报告

4.1.45 基金管理人及基金托管人报告

4.1.46 基金管理人及基金托管人报告

4.1.47 基金管理人及基金托管人报告

4.1.48 基金管理人及基金托管人报告

4.1.49 基金管理人及基金托管人报告

4.1.50 基金管理人及基金托管人报告

4.1.51 基金管理人及基金托管人报告

4.1.52 基金管理人及基金托管人报告

4.1.53 基金管理人及基金托管人报告

4.1.54 基金管理人及基金托管人报告

4.1.55 基金管理人及基金托管人报告

4.1.56 基金管理人及基金托管人报告

4.1.57 基金管理人及基金托管人报告

4.1.58 基金管理人及基金托管人报告

4.1.59 基金管理人及基金托管人报告

4.1.60 基金管理人及基金托管人报告

4.1.61 基金管理人及基金托管人报告

4.1.62 基金管理人及基金托管人报告

4.1.63 基金管理人及基金托管人报告

4.1.64 基金管理人及基金托管人报告

4.1.65 基金管理人及基金托管人报告

4.1.66 基金管理人及基金托管人报告

4.1.67 基金管理人及基金托管人报告

4.1.68 基金管理人及基金托管人报告

4.1.69 基金管理人及基金托管人报告

4.1.70 基金管理人及基金托管人报告

4.1.71 基金管理人及基金托管人报告

4.1.72 基金管理人及基金托管人报告

4.1.73 基金管理人及基金托管人报告

4.1.74 基金管理人及基金托管人报告

4.1.75 基金管理人及基金托管人报告

4.1.76 基金管理人及基金托管人报告

4.1.77 基金管理人及基金托管人报告

4.1.78 基金管理人及基金托管人报告

4.1.79 基金管理人及基金托管人报告

4.1.80 基金管理人及基金托管人报告

4.1.81 基金管理人及基金托管人报告

4.1.82 基金管理人及基金托管人报告

4.1.83 基金管理人及基金托管人报告

4.1.84 基金管理人及基金托管人报告

4.1.85 基金管理人及基金托管人报告

4.1.86 基金管理人及基金托管人报告

4.1.87 基金管理人及基金托管人报告

4.1.88 基金管理人及基金托管人报告

4.1.89 基金管理人及基金托管人报告

4.1.90 基金管理人及基金托管人报告

4.1.91 基金管理人及基金托管人报告

4.1.92 基金管理人及基金托管人报告

4.1.93 基金管理人及基金托管人报告

4.1.94 基金管理人及基金托管人报告

4.1.95 基金管理人及基金托管人报告

4.1.96 基金管理人及基金托管人报告

4.1.97 基金管理人及基金托管人报告

4.1.98 基金管理人及基金托管人报告

4.1.99 基金管理人及基金托管人报告

4.1.100 基金管理人及基金托管人报告

4.1.101 基金管理人及基金托管人报告

4.1.102 基金管理人及基金托管人报告

4.1.103 基金管理人及基金托管人报告

4.1.104 基金管理人及基金托管人报告

4.1.105 基金管理人及基金托管人报告

4.1.106 基金管理人及基金托管人报告

4.1.107 基金管理人及基金托管人报告

4.1.108 基金管理人及基金托管人报告

4.1.109 基金管理人及基金托管人报告

4.1.110 基金管理人及基金托管人报告

4.1.111 基金管理人及基金托管人报告

4.1.112 基金管理人及基金托管人报告

4.1.113 基金管理人及基金托管人报告

4.1.114 基金管理人及基金托管人报告

4.1.115 基金管理人及基金托管人报告

4.1.116 基金管理人及基金托管人报告

4.1.117 基金管理人及基金托管人报告

4.1.118 基金管理人及基金托管人报告

4.1.119 基金管理人及基金托管人报告

4.1.120 基金管理人及基金托管人报告

4.1.121 基金管理人及基金托管人报告

4.1.122 基金管理人及基金托管人报告

4.1.123 基金管理人及基金托管人报告

4.1.124 基金管理人及基金托管人报告

4.1.125 基金管理人及基金托管人报告

4.1.126 基金管理人及基金托管人报告

4.1.127 基金管理人及基金托管人报告

4.1.128 基金管理人及基金托管人报告

4.1.129 基金管理人及基金托管人报告

4.1.130 基金管理人及基金托管人报告

4.1.131 基金管理人及基金托管人报告

4.1.132 基金管理人及基金托管人报告

4.1.133 基金管理人及基金托管人报告

4.1.134 基金管理人及基金托管人报告

4.1.135 基金管理人及基金托管人报告

4.1.136 基金管理人及基金托管人报告

4.1.137 基金管理人及基金托管人报告

4.1.138 基金管理人及基金托管人报告

4.1.139 基金管理人及基金托管人报告

4.1.140 基金管理人及基金托管人报告

4.1.141 基金管理人及基金托管人报告

4.1.142 基金管理人及基金托管人报告

4.1.143 基金管理人及基金托管人报告

4.1.144 基金管理人及基金托管人报告

4.1.145 基金管理人及基金托管人报告

4.1.146 基金管理人及基金托管人报告

4.1.147 基金管理人及基金托管人报告

4.1.148 基金管理人及基金托管人报告

4.1.149 基金管理人及基金托管人报告

4.1.150 基金管理人及基金托管人报告

4.1.151 基金管理人及基金托管人报告

4.1.152 基金管理人及基金托管人报告

4.1.153 基金管理人及基金托管人报告

4.1.154 基金管理人及基金托管人报告

4.1.155 基金管理人及基金托管人报告

4.1.156 基金管理人及基金托管人报告

4.1.157 基金管理人及基金托管人报告

4.1.158 基金管理人及基金托管人报告

4.1.159 基金管理人及基金托管人报告

4.1.160 基金管理人及基金托管人报告

4.1.161 基金管理人及基金托管人报告

4.1.162 基金管理人及基金托管人报告

4.1.163 基金管理人及基金托管人报告

4.1.164 基金管理人及基金托管人报告

</