

(上接B012版)

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:闫晓东
联系电话:010-62020088
传真:010-62020355
联系人:霍飞
客服电话: 4008886661
公司网址: www.myfund.com
(58)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:上海市徐汇区龙田路195号3楼902室
法定代表人:其实
联系电话:021-54509988
传真:021-64385308
联系人:潘世华
客服电话: 400-1818-188
公司网址: www.1234567.com.cn
(59)万联财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京路27号院5号楼3201内
办公地址:北京市朝阳区望京路27号院5号楼3201内
法定代表人:王珊
联系电话:010-59393923
传真:010-59390374
联系人:毛怀蓉
客服电话: 400-091-6655
公司网址: www.wlfn.com.cn
(60)浙江天顺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:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-88910240
联系人:杨鹏
客户服务电话: 4008-773-772
公司网址: www.5ifund.com
(61)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B座1809
法定代表人:沈伟彬
电话:010-52856713
传真:010-59594285
联系人:王浩
客服电话: 400 6099 200
网址: www.yixinfund.com
(62)一路财富(北京)信息技术有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街5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:吴雪涛
电话:010-83312277
传真:010-83312885
联系人:段晓璐
客服电话: 400-0011-566
网址: www.yilucaifu.com
(63)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法人代表:王浩
联系人:胡明会
电话:010-59200855
传真:010-59200800
网址: www.tdyhfund.com
客服电话: 400-819-9868
(64)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:梁睿
联系人:张晶磊
电话:010-86164828
传真:010-86067526
客服电话:010-88067525
网址: www.5ifund.com
(三)律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51190388
经办律师:刘佳 张琳
(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)22328888
传真:(021)22328880
经办注册会计师:单峰、周伟
联系人:周伟

四、基金的名称
本基金名称:华商新量化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
本基金充分利用量化投资策略和量化工具,严格控制下行风险,实现基金资产的持续稳健增长。

七、基金的投资方向
本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货及其他经中国证监会核准上市交易的金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、中小企业私募债、地方政府债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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)。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或监管机构的规定。

本基金的投资组合比例为:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的90%-95%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-100%,其中权证占基金资产净值90%-3%,中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于10%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资合计不低于基金资产净值的5%,股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略
本基金所指“新量化”是指本基金所采用的量化投资策略不仅限于传统的多因子量化策略。具体来说,本基金管理人采用自主研发的量化系统风险判定模型对中长期市场的系统性风险进行判断,从而决定本基金在股票、债券和现金等金融工具上的投资比例,并充分利用股指期货作为对冲工具;在配置选择方面,本基金采用量化选股系统和基本面研究相结合的方式进行股票选择和配置,多维度地分散股票的投资成本,精选具有较高投资价值上市公司构建本基金的多头组合。

九、基金的风险控制
本基金通过量化策略和系统,对宏观政策、微观行业、市场情绪等方面进行全面扫描,并输入量化系统风险判定模型来确定中长期市场系统风险。通过识别市场系统风险,合理配置股票、债券、现金、货币市场工具和资产支持证券,并随着各类金融工具的风险收益特征的变化,动态地调整各类金融工具的投资比例,适时地采取股指期货对冲策略做套期保值,以达到控制下行风险的目的。

十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十六、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十七、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十八、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十六、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十七、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十八、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

理论定价的基础上,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
(2)衍生品投资策略:本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理运用股指期货、权证等衍生工具,利用股指期货、权证等衍生工具,进行套期保值或套利操作,以期在承担可控风险的前提下,实现保值和锁定收益。

九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十六、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十七、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十八、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

十九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十六、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十七、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十八、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

二十九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十一、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十二、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十三、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十四、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十五、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十六、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十七、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十八、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

三十九、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

四十、基金的投资风险控制
本基金的投资风险控制主要依靠风险判定模型的结果,综合考虑研究机构的判断和与本公司研究团队的研究结果,同时对量化指标进行不断更新,并对世界前沿的量化技术进行分析和使用,以辅助基金管理人对于市场的判断。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

10.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

12.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。

13.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

14.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

15.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

16.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。

17.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

18.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

19.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

20.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。

21.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

22.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

23.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

24.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。

25.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

26.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

27.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

28.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。

29.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

30.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

31.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

32.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。

33.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

34.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

35.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

36.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。

37.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

38.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

39.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

40.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。

41.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

42.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

43.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

44.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。

45.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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

46.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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

47.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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

注:①本基金合同生效日为2014年6月5日,至本报告期末,本基金合同生效满一年。

②根据《华商新量化灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定,本基金的资产组合比例为:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的0—95%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5—100%,其中权证占基金资产净值的0%—3%,中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于10%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的约定,自基金合同生效之日起6个月内本基金资产配置比例需符合基金合同约定。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》生效与基金相关的信息披露费用;