

华商双翼平衡混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人：华商基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2016年01月21日

§ 1 重要提示
基金管理人的声明及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人对本基金年度报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

代号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,703,624.66	1.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,934,238.11	12.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,261,277.70	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	7,911,579.24	3.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,209,819.40	1.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		52,010,526.11	20.00

本基金是混合型债券型基金，根据风险控制优先于收益性的原则，在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争在保持资产流动性与稳定性的同时，使基金在保持较低风险和中等风险资产的基础上获得超越业绩基准的收益。

本基金自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015 年 10 月 1 日 - 2015 年 12 月 31 日)

1. 本期已实现收益 26,118,218.76

2. 本期利润 39,291,713.73

3. 加权平均基金份额本期利润 0.1342

4. 期末基金资产净值 252,722,104.22

5. 期末基金份额净值 1.0262

注：本基金在实现收益时将首先扣除应收股息、利息收入、其他收入（不含公允价值变动收益）、扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

2. 所述基金业绩不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.1 主要财务指标

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中银绒业 910,000 4,999,500.00 1.93

2 600692 美锦能源 269,900 4,461,575.24 1.77

3 000617 云南锗业 279,945 4,362,144.75 1.72

4 002026 山推股份 240,000 4,229,800.00 1.69

5 600272 丹东港 212,596 4,027,306.30 1.59

6 600364 恒邦股份 310,699 3,954,689.07 1.56

7 002670 福能鼎盛 132,794 3,703,624.66 1.47

8 603126 华阳物流 300,000 3,460,000.00 1.37

9 000882 大股东 662,140 3,209,819.40 1.27

10 000695 大庆华科 101,211 3,103,126.00 1.23

4.4 报告期末按品种分类的证券投资组合

序号 证券代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行业股票 - -

3 金融债券 20,266,000.00 8.02

4 企业债券 152,652,359.86 60.42

5 企业短期融资券 - -

6 企业中期票据 10,361,000.00 4.10

7 可转债(可交换) 143,676,000.00 5.06

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 183,443,033.96 72.59

6.6 报告期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

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 112337 12国债 200,000 20,628,000.00 8.16

2 110314 11进14 200,000 20,256,000.00 8.02

3 120607 11国债 170,000 17,010,200.00 6.73

4 112048 11国债 130,000 13,140,000.00 5.20

5 112146 13国债 128,310 12,814,310.70 5.07

6.7 报告期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

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000052 华商绒纺 910,000 4,999,500.00 1.93

2 600692 美锦能源 269,900 4,461,575.24 1.77

3 000617 云南锗业 279,945 4,362,144.75 1.72

4 002026 山推股份 240,000 4,229,800.00 1.69

5 600272 丹东港 212,596 4,027,306.30 1.59

6 600364 恒邦股份 310,699 3,954,689.07 1.56

7 002670 福能鼎盛 132,794 3,703,624.66 1.47

8 603126 华阳物流 300,000 3,460,000.00 1.37

9 000882 大股东 662,140 3,209,819.40 1.27

10 000695 大庆华科 101,211 3,103,126.00 1.23

4.5 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 离任日期

刘晓鹏 基金经理, 基金投资委员会委员 2015年6月16日 -

说明：刘晓鹏先生拥有丰富的证券从业经验，具有深厚的行业研究功底，能够把握宏观经济运行趋势，具备良好的市场敏感度，能够独立完成投资决策。其在证券行业工作多年，对宏观经济、行业政策、公司基本面研究有深入理解，具备较强的分析判断能力，能够独立完成投资决策。

王伟先生拥有丰富的证券从业经验，具有深厚的行业研究功底，能够把握宏观经济运行趋势，具备良好的市场敏感度，能够独立完成投资决策。其在证券行业工作多年，对宏观经济、行业政策、公司基本面研究有深入理解，具备较强的分析判断能力，能够独立完成投资决策。

4.6 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的前十名债券的投资主体本期未被监管部门立案调查，且在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

4.7 报告期内基金的利润分配情况

本基金在报告期没有进行利润分配。

4.8 报告期末基金资产净值

本基金在报告期末的资产净值为1.0262元，本季度基金净值增长率为13.48%。同时基金净值在报告期末的资产净值为1.0262元，本季度基金净值增长率为13.48%。

4.9 投资组合报告

4.9.1 投资组合报告的编制依据

本基金的编制依据是《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金评价办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第1号——基金宣传推介材料》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第2号——定期报告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第3号——临时报告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第4号——基金上市交易》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第5号——澄清公告》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第6号——基金份额净值计价错误的更正》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第7号——估值方法》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第8号——基金资产估值》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第9号——基金转换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第10号——基金费用计提、支付和分摊》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第11号——基金收益分配》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第12号——基金信息披露义务人公平对待原则和禁止性行为》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第13号——基金客户服务和投诉处理》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第14号——基金投资禁止行为》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第15号——基金交易行为》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第16号——基金服务机构》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第17号——基金投资资产支持证券》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第18号——基金投资股指期货》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第19号——基金投资国债期货》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第20号——基金投资商品期货》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第21号——基金投资权证》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第22号——基金投资黄金、白银等贵金属》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第23号——基金投资期权》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第24号——基金投资商品衍生工具》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第25号——基金投资远期、互换》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第26号——基金投资境外证券》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第27号——基金投资基础设施证券》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第28号——基金投资商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第29号——基金投资商品基金中的基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第30号——基金投资商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第31号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第32号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第33号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第34号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第35号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第36号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第37号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第38号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第39号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第40号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第41号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第42号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第43号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第44号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第45号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第46号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第47号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第48号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第49号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第50号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第51号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第52号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第53号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第54号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第55号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第56号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第57号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第58号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第59号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第60号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第61号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第62号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第63号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第64号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第65号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第66号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第67号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第68号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第69号——基金投资商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金中的商品基金》、《公开募集证券投资基金信息披露规范第7