

华商稳固添利债券型证券投资基金

2016年度报告摘要

2016年12月31日
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
送出日期：2017年3月29日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。
本年度报告经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理人和基金托管人对报告期内基金运作指标的合理性、投资风险、投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务数据经普华永道中天会计师事务所有限公司审计。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------|
| 基金简称 | 华商稳固添利债券 |
| 基金代码 | 000937 |
| 交易代码 | 000937 |
| 基金合同期限 | 定期开放式 |
| 2015年2月17日 | |

| | |
|-------|-----------------|
| 基金总资产 | 126,004,668.02份 |
|-------|-----------------|

| | |
|-----------------|----------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 99,549,368.31份 |
| 26,455,267.91份 | |

| | |
|------------|--|
| 2.2 基金产品说明 | |
|------------|--|

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在合理控制风险的基础上，通过对债券积极主动地投资管理，追求超越业绩基准的绝对收益为目标。 |
|------|--|

| | |
|------|--|
| 投资策略 | 本基金管理人严格执行《证券投资基金投资管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。 |
|------|--|

| | |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金、短期纯债型基金和债券型基金。 |
|--------|--|

| | |
|-----------------|--|
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | |
|-----------------|--|

| | | |
|----|------------|--------------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
| 名称 | 华商基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |

| | |
|-------|-----|
| 联系人姓名 | 周亚平 |
|-------|-----|

| | |
|------|--------------|
| 联系电话 | 010-85573600 |
|------|--------------|

| | |
|------|-------------------|
| 电子邮箱 | zhourh@hsfund.com |
|------|-------------------|

| | |
|--------|-------------|
| 客户服务电话 | 40007008880 |
|--------|-------------|

| | |
|----|--------------|
| 传真 | 010-85573520 |
|----|--------------|

| | |
|------------|--|
| 2.4 信息披露方式 | |
|------------|--|

| | |
|--------------------|--|
| 登载基金半年度报告的管理人互联网网址 | 基金管理人网址： http://www.hsfund.com |
|--------------------|--|

| | |
|-----------|-----------------|
| 基金份额持有人名册 | 基金管理人及基金托管人办公场所 |
|-----------|-----------------|

| | |
|--------------------------|--|
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | |
|--------------------------|--|

| | |
|-----------------|--|
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | |
|-----------------|--|

| | |
|-----------|--|
| 金额单位：人民币元 | |
|-----------|--|

| | | |
|---------------|-------|------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年2月17日至2016年12月31日 |
|---------------|-------|------------------------|

| | |
|-----------|-----------|
| 华商稳固添利债券A | 华商稳固添利债券C |
|-----------|-----------|

| | | |
|---------|---------------|----------------------|
| 本期已实现收益 | 12,779,170.94 | 10,099,14,172,732.58 |
|---------|---------------|----------------------|

| | | |
|------|--------------|--------------|
| 本期利润 | 2,897,892.80 | 4,856,668.29 |
|------|--------------|--------------|

| | | |
|--------------|--------|--------|
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0098 | 0.0095 |
|--------------|--------|--------|

| | | |
|------------|-------|-------|
| 本期基金份额期末余额 | 0.75% | 0.28% |
|------------|-------|-------|

| | | |
|--------------|--------|--------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0705 | 0.0599 |
|--------------|--------|--------|

| | |
|-----------------|--|
| 2.4.2 报告期内基金业表现 | |
|-----------------|--|

| | | |
|---------------|-------|------------------------|
| 3.1.2 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年2月17日至2016年12月31日 |
|---------------|-------|------------------------|

| | |
|-----------|--|
| 华商稳固添利债券A | |
|-----------|--|

| | | | | |
|----|--|------------------------|--|---|
| 阶段 | 份额净增长 长和短 期 益 率 差 率 ① | 份额 增 长 率 ② | 业绩比较基 准 收 益 率 差 率 ③ | 业绩比较基 准 收 益 率 差 率 基 准 收 益 率 差 率 ④ |
|----|--|------------------------|--|---|

| | | | | |
|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去三个月 | -0.03% | 0.08% | 0.65% | 0.01% |
|-------|--------|-------|-------|-------|

| | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去六个月 | 0.28% | 0.06% | 1.30% | 0.01% |
|-------|-------|-------|-------|-------|

| | | | | |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 过去一年 | 0.75% | 0.07% | 2.83% | 0.01% |
|------|-------|-------|-------|-------|

| | | | | |
|-------------|-------|-------|-------|-------|
| 成立以来至同 期 | 7.40% | 0.09% | 5.51% | 0.01% |
|-------------|-------|-------|-------|-------|

| | |
|-----------|--|
| 华商稳固添利债券C | |
|-----------|--|

| | | | | |
|----|--|------------------------|--|---|
| 阶段 | 份额净增长 长和短 期 益 率 差 率 ① | 份额 增 长 率 ② | 业绩比较基 准 收 益 率 差 率 ③ | 业绩比较基 准 收 益 率 差 率 基 准 收 益 率 差 率 ④ |
|----|--|------------------------|--|---|

| | | | | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 过去三个月 | -0.56% | 0.08% | 0.65% | 0.01% |

<tbl_r cells="5" ix="1" maxcspan="1" maxr