

# 华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(摘要)

(2017年第1号)

基金管理人：华商基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示：华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2015年12月16日证监注册[2015]278号核准募集。本基金基金合同于2015年4月9日生效。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行义务，为基金份额持有人谋求利益。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行义务，为基金份额持有人谋求利益。

基金的投资业绩并不预示其未来业绩表现。

本招募说明书所载数据截至2017年4月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日。有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日。

（一）基金管理人概况

1. 名称：华商基金管理有限公司  
2. 住所：陕西省西安市高新区唐延路10号华商国际商务中心19层  
3. 办公地址：北京市西城区平安里西大街28号华商国际商务中心19层  
4. 法定代表人：李耀庭  
5. 成立时间：2015年12月20日  
6. 注册资本：壹亿元  
7. 电话：010-58873900 传真：010-58873520

（二）基金托管人概况

1. 名称：中国工商银行股份有限公司  
2. 住所：北京市西城区复兴门内大街26号  
3. 办公地址：北京市西城区平安里西大街28号华商国际商务中心19层  
4. 法定代表人：李耀庭  
5. 成立时间：1985年10月1日  
6. 注册资本：肆仟肆佰玖拾玖亿玖仟玖佰玖拾玖元玖角玖分  
7. 电话：010-68873900 传真：010-68873520

（三）基金募集概况

1. 募集期间：2015年4月9日至2015年4月15日  
2. 募集规模：1,001,693,640.00元  
3. 募集费用：1,001,693,640.00元  
4. 募集结果：本基金募集规模为1,001,693,640.00元，募集费用为1,001,693,640.00元，募集总额为2,003,387,280.00元。

（四）基金投资目标

本基金为混合型证券投资基金，股票投资比例为50%-95%，因此在业绩比较基准中股票资产权重为50%。其业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证500指数收益率×50%。

（五）基金投资策略

1. 资产配置策略：本基金采用自上而下的资产配置策略，根据宏观经济、政策、市场等因素，动态调整股票、债券、现金等资产的比例。

2. 股票投资策略：本基金采用自下而上的股票投资策略，精选具有良好成长性的个股进行投资。

3. 债券投资策略：本基金采用自上而下的债券投资策略，精选具有良好信用评级的债券进行投资。

4. 现金管理策略：本基金采用自上而下的现金管理策略，根据市场流动性，动态调整现金比例。

（六）基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证500指数收益率×50%。

（七）基金风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种和较高预期收益品种。

（八）基金投资组合报告

截至2016年12月31日，华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金资产净值为2,682,033,412.29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	1,901,693,640.00	70.29
2	固定收益	1,901,693,640.00	70.29
3	现金	1,901,693,640.00	70.29
4	其他资产	1,901,693,640.00	70.29
5	其他负债	1,901,693,640.00	70.29
6	买入返售金融资产	1,901,693,640.00	70.29
7	银行存款和结算备付金合计	801,779,697.11	29.62
8	其他资产	3,304,742,320.00	0.12
9	合计	2,700,754,000.00	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F	批发和零售业	31,017,851.88	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	101,610,612.96	3.79
H	住宿和餐饮业	1,017,612.96	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,362,687.34	1.73
J	金融业	146,967,088.00	5.43
K	房地产业	124,309,767.64	4.63
L	租赁和商务服务业	54,401,253.20	2.03
M	科学研究和技术服务业	1,017,612.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	17,462,635.00	0.65
O	卫生和社会工作	1,017,612.96	0.04
P	教育	76,754,361.18	2.87
Q	艺术、体育和娱乐业	16,479,000.00	0.61
S	合计	1,901,693,640.00	70.29

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	55,359,878.00	2.06
B	采矿业	60,329,528.00	2.25
C	制造业	993,072,168.00	37.03
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	34,475,032.14	1.29
E	建筑业	110,924,924.44	4.14
F			