

2017年9月30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

报告送出日期：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现，投资人投资于风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书及其更新。

本报平安中财资料未经审计。

本基金报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华商红利优选

基金代码 000279

基金的管理人名称 中国工商银行股份有限公司

基金的托管人名称 中国工商银行股份有限公司

基金合同生效日 2013年9月17日

报告期末基金份额总额 366,474,238.00份

投资目标 自上而下为主，自下而上为辅的投资策略，通过精选行业，精选个股，分散配置，从而实现稳定的收益。

投资策略 本基金将坚持“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，通过精选行业，精选个股，分散配置，从而实现稳定的收益。

业绩比较基准 中证红利指数*45%+上证国债指数*45%

风险收益特征 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于证券投资基金中较高风险收益的产品。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 6,380,382.18

2.本期利润 27,116,832.62

3.期末基金总份额本期利润 0.0661

4.期末基金净值 382,549,559.69

5.期末基金净值收益率 1.044

注：①本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、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公允价值变动收益。

②本基金业绩比较指标不包括持有认沽或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所有者权益。

3.2 基金的估值方法

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④ ③-④

过去三个季度 6.75% 0.79% 1.86% 0.29% 4.90% 0.50%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本基金合同生效日为2013年9月17日。

②本基金报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华商红利增强定期开放债券

基金代码 000392

基金的管理人名称 中国工商银行股份有限公司

基金的托管人名称 中国工商银行股份有限公司

基金合同生效日 2016年9月20日

报告期末基金份额总额 110,214,105.07份

投资目标 本基金侧重投资于债券市场，选择具有较好流动性的金融工具，包括但不限于股票（含创业板）、债券、货币市场工具、权证、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，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的30%-80%，现金或类现金资产的净值比例为5%-30%，债券、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的20%-70%，并保持现金或现金等价物的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于基本健康的股票，盈利能力较高，分红稳定或分红潜力较大的大公司股票；同时本基金配置比例不低于权益资产的80%，根据基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求，本基金在建仓期结束后，各项配置比例均符合基金合同约定。

投资策略 本基金在报告期的资产配置比例根据本基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求。

业绩比较基准 中证红利指数*55%+上证国债指数*45%

风险收益特征 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于证券投资基金中较高风险收益的产品。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 157,134.62

2.本期利润 1,968,695.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0128

4.期末基金净值 58,336,466.15

5.期末基金净值收益率 1.003

注：①本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、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公允价值变动收益。

②本基金业绩比较指标不包括持有认沽或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所有者权益。

3.2 基金的估值方法

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④ ③-④

过去三个季度 1.11% 0.15% 0.56% 0.04% 0.55% 0.11%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本基金合同生效日为2013年9月17日。

②本基金报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华商丰利增强定期开放债券

基金代码 000393

基金的管理人名称 中国工商银行股份有限公司

基金的托管人名称 中国工商银行股份有限公司

基金合同生效日 2016年9月20日

报告期末基金份额总额 58,149,440.46份

58,054,664.51份

投资目标 本基金侧重投资于债券市场，选择具有较好流动性的金融工具，包括但不限于股票（含创业板）、债券、货币市场工具、权证、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，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的20%-80%，现金或类现金资产的净值比例为5%-30%，债券、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的20%-70%，并保持现金或现金等价物的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于基本健康的股票，盈利能力较高，分红稳定或分红潜力较大的大公司股票；同时本基金配置比例不低于权益资产的80%，根据基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求，本基金在建仓期结束后，各项配置比例均符合基金合同约定。

投资策略 本基金在报告期的资产配置比例根据本基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求。

业绩比较基准 中证红利指数*55%+上证国债指数*45%

风险收益特征 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于证券投资基金中较高风险收益的产品。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 157,134.62

2.本期利润 1,968,695.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0128

4.期末基金净值 58,054,659.51

5.期末基金净值收益率 1.003

注：①本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、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公允价值变动收益。

②本基金业绩比较指标不包括持有认沽或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所有者权益。

3.2 基金的估值方法

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④ ③-④

过去三个季度 1.11% 0.15% 0.56% 0.04% 0.55% 0.11%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本基金合同生效日为2013年9月17日。

②本基金报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 630005

基金的管理人名称 中国工商银行股份有限公司

基金的托管人名称 中国工商银行股份有限公司

基金合同生效日 2009年11月24日

报告期末基金份额总额 727,706,399.72份

投资目标 本基金侧重投资于具有Alpha特性的股票，即相对大盘指数有超额收益的股票，选择具有较好流动性的金融工具，包括但不限于股票（含创业板）、债券、货币市场工具、权证、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，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-90%，现金或类现金资产的净值比例为10%-40%，债券、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的10%-30%，并保持现金或现金等价物的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于阿尔法系数较高的股票，盈利能力较强，分红稳定或分红潜力较大的大公司股票；同时本基金配置比例不低于权益资产的80%，根据基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求，本基金在建仓期结束后，各项配置比例均符合基金合同约定。

投资策略 本基金在报告期的资产配置比例根据本基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求。

业绩比较基准 上证综指*55%+上证中小板指数*45%

风险收益特征 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于证券投资基金中较高风险收益的产品。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 -10,936,654.99

2.本期利润 52,552,737.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0679

4.期末基金净值 1,466,564,819.00

5.期末基金净值收益率 0.54%

注：①本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、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公允价值变动收益。

②本基金业绩比较指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所有者权益。

3.2 基金的估值方法

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④ ③-④

过去三个季度 3.17% 1.51% 2.63% 0.39% 0.82%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本基金合同生效日为2009年11月24日。

②根据《华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括但不限于股票（含创业板）、债券、货币市场工具、权证、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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-90%，现金或类现金资产的净值比例为10%-40%，债券、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的10%-30%，并保持现金或现金等价物的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于阿尔法系数较高的股票，盈利能力较强，分红稳定或分红潜力较大的大公司股票；同时本基金配置比例不低于权益资产的80%，根据基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例不低于基金合同要求，本基金在建仓期结束后，各项配置比例均符合基金合同约定。

投资策略 本基金在报告期的资产配置比例根据本基金的固定回报，自基金合同生效之日起6个月内本基金配置比例