

华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金

2017年度报告摘要

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
报告截止日：2018年3月26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的法律责任。本年度报告经三分之二以上独立董事签字并书面确认，开会时间在基金合同规定的时间内，根据基金合同的规定，基金管理人应当在每年3月27日前披露了本报告公告的财务状况、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，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及最新的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月21日止。

本年度报告摘要由基金管理人自行决定后于2018年3月27日公告。

本年度报告摘要由基金管理人自行决定后于2018年3月27日公告。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华商量化进取混合

基金简称 华商量化进取

基金代码 001143

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2015年4月9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

报告期末基金份额总额 3,194,487,130,329

基金合同存续期间 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金主要投资于量化技术为基础，并通过基本面研究，严格控制下行风险，实现资产的长期增值。

投资策略 本基金将采用主动开放的量化系统驱动型中短期量化投资策略，通过和不断优化的量化模型，结合量化投资的最新进展，在量化投资方面，本基金将采取量化技术研究和量化投资相结合的方式进行股票投资操作，从而达到本基金的投资目标。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*60%+上证国债收益率*40%

本基金选择的业绩基准，期间届满或因基金管理人原因导致无法继续使用时，基金管理人可重新确定并公告新的业绩基准。

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

信息披露负责人 姓名 闻世锐

联系电话 010-66573600 010-66106790

电子邮箱 zhanyi@hxfund.com.cn custody@icbc.com.cn

客户服务电话 4000700899 010-66106790

传真 010-66573620 010-66106790

2.4 基金销售机构

本基金选择的销售机构包括本公司及与本基金合作的代销机构。

2.5 主要财务指标及财务数据

金额单位：人民币元

3.1 期间数据和指标 2017年 2016年 2015年4月9日至2015年12月31日

本期已实现收益 146,146,841.48 -140,191,538.49 6,569,733.40

本期利润 327,817,472.64 -342,163,724.37 -1,100,881,793.02

加权平均基金份额本期利润 0.0506 -0.0526 -0.0511

本期基金份额净值 13.37% -10.26% -23.00%

3.1.2 期末数据和指标 2017年末 2016年末

本期可供分配利润 -0.2658 -0.3148 -0.2827

期末可供分配基金份额净值 2,474,676,722.14 2,682,033,413.29 3,366,167,697.31

期末可供分配利润 0.076 -0.0911 0.0720

注：1. 上述基金的财务指标不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

2. 本基金选择的业绩基准，期间届满或因基金管理人原因导致无法继续使用时，基金管理人可重新确定并公告新的业绩基准。

3. 3.1.3 期末可供分配利润，采用期末可供分配利润与期末未分配利润的孰低数。

3. 3.1.4 期末可供分配利润，采用期末可供分配利润与未分配利润的孰低数。

3. 3.1.5 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.6 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.7 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.8 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.9 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.10 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.11 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.12 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.13 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.14 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.15 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.16 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.17 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.18 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.19 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.20 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.21 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.22 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.23 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.24 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.25 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.26 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.27 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.28 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.29 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.30 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.31 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.32 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.33 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.34 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.35 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.36 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.37 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.38 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.39 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.40 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.41 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.42 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.43 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.44 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.45 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.46 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.47 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.48 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.49 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.50 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.51 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.52 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.53 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.54 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.55 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.56 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.57 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.58 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.59 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.60 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.61 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.62 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.63 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.64 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.65 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.66 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.67 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.68 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.69 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.70 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.71 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.72 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.73 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.74 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.75 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。

3. 3.1.76 期末可供分配利润，不包括持有人认购、申购基金时产生的费用，计算份额时已扣除该笔费用。