华商盛世成长股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:华商基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月21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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商盛世成长股票
基金主代码	630002
交易代码	630002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月23日
报告期末基金份额总额	2,719,582,181.37份
投资目标	把握中国经济增长的主线,寻找具有持续成长潜质的、估值合理的企业;在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续稳健增长。
投资策略	本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理方法,通过定性和定量研究,对股票、债券及现金进行灵活配置(详见本基金的基金合同和招募说明书)。
业绩比较基准	中信标普300成长指数×75%+中信国债指数×25% 本基金为股票型证券投资基金,股票投资比例为60-95%,因此在业绩比较基准中股票投资部分为75%,其余为债券投资部分。本基金主要投资于成长型企业的股票,因此中信标普300成长指数作为股票投资部分的业绩比较基准更具有代表性,同时,选取中信国债指数作为债券投资部分的比较基准。如果今后市场出现更适用于本基金的指数,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准,并及时公告。
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益和风险水平较混合型基金和债券型基金高,属于高风险、高收益的基金产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	239,681,040.69
2.本期利润	-280,888,084.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0984
4.期末基金资产净值	5,327,555,615.28
5.期末基金份额净值	1.9590

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

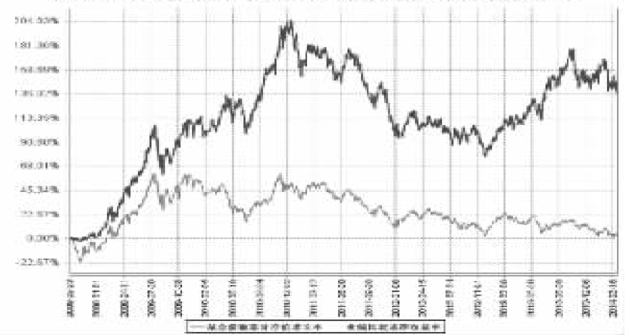
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.25%	1.52%	-5.94%	1.00%	0.69%	0.52%

3.2.2 自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2008年9月23日。

②根据《华商盛世成长股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%,权证资产占基金资产的0%-3%,债券资产占基金资产的0%-35%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宏	基金经理,公司投资管理部副总经理,投资决策委员会委员	2013年2月1日	-	7	男,管理学硕士,特许金融分析师(CFA),中国籍,具有基金从业资格;2002年7月至2007年2月就职于中国移动通信集团公司,任项目经理;2007年2月至2008年3月就职于云南国际信托有限公司,任高级分析师。2008年4月加入华商基金管理有限公司,2009年11月24日至2011年5月31日担任华商动态阿尔法灵活配置混合型基金基金经理助理,2011年5月31日起至今担任华商价值精选股票型证券投资基金基金经理。2012年4月24日至2013年12月10日担任华商产业升级股票型证券投资基金基金经理。2014年3月18日起至今担任华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来,对于A股市场影响最大的事件是IPO正式再度开闸。从元旦之后,大规模的资金都蜂拥而至,希望能够分享制度变化带来的套利机会。由于新股对于投资者的眼球吸引非常多,相应的报告期内,尤其是1月份,A股市场的流动性和投资者心理受到一定程度的影响,从而出现了显著的大盘指数下跌。报告期内,A股市场的分化进一步演绎的淋漓尽致。场内本来不很充裕的资金集中抛售大盘股,尤其是银行、地产和消费类白马股,转而纷纷追逐主题概念股(而非成长股)。到1月份下旬,炒作主题开始扩散,呈现出比较散乱和主题快速切换的局面。这样的市场格局一直持续到2月底,达到了阶段性的高潮。进入3月后,国内外宏观因素共振,导致市场出现显著回调,无论是冷门的大盘蓝筹股还是前期热门的板块。

报告期内,华商盛世成长基金前期持有较多的消费类白马股出现较大跌幅。我们认为,消费在中长期中国宏观经济和国民生活中的核心地位没有变化,对于消费类白马股的中长期巨大投资价值充满信心。因此,在报告期内,华商盛世成长基金在股票仓位上采取偏积极的仓位水平,并没有跟随市场波动减少上述板块在组合中的配置权重。报告期内,华商盛世成长基金投资组合的行业配置,从结果上看仍然在大消费行业配置较多,主要包括食品等大众消费、文化传媒、移动互联网、旅游等领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为1.9590元,份额累计净值为2.2240元。本季度基金份额净值增长率为-5.25%。同期基金业绩比较基准的收益率为-5.94%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率0.69个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年,是改革措施开始逐步落实的第一年。一方面,我们对于我国经济转型以及社会发展的中长期前景保持乐观和信心。因此我们认为,符合转型方向的行业仍然是中长期值得投资的领域。另一方面,我们认识到,改革落实过程,必然是有起伏的过程,也必然会出现阶段性的超市场预期和不达市场预期的情况,因而市场情绪相应会受到影响。如果完全紧密按照改革的逻辑布置全部仓位,应该要有思想准备承受这样的市场波动。同时,我们还积极寻找和改革措施落实进度没有直接联系的领域和板块。目前来看,我认为文化、旅游、健康、移动互联网、新能源(LED、风电、光伏、特高压)等板块就是这样的领域,值得今年重点挖掘的。

基于上述判断,华商盛世成长基金将把股票仓位控制在适度的水平,并结合风险控制目标,保持基金仓位的灵活性。同时,我们仍然积极坚持选股的策略,仍然将以转型为主要方向,结合逐渐落地的改革措施,进一步精挑细选符合转型方向的个股(包括新股),尤其是重点关注包括信息消费、旅游文化、健康等在内的大消费领域,并在市场出现调整之后加强配置。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,912,906,153.74	90.72
	其中:股票	4,912,906,153.74	90.72
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	497,199,153.10	9.18
7	其他资产	5,286,011.43	0.10
8	合计	5,415,391,318.27	100.00

5.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,018,100,531.40	56.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,589,586.46	0.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,879,234.94	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	42,501,915.28	0.80
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,068,085,506.64	20.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	111,360,000.00	2.09
L	租赁和商务服务业	607,402,601.92	11.40
M	科学研究和技术服务业	6,986,777.10	0.13
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	4,912,906,153.74	92.22

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	28,000,000	492,240,000.00	9.24
2	600315	上海家化	14,000,000	471,940,000.00	8.86
3	002230	科大讯飞	9,036,930	406,661,850.00	7.63
4	002292	奥飞动漫	10,235,743	310,654,800.05	5.83
5	600138	中青旅	13,476,269	249,041,451.12	4.67
6	000538	云南白药	2,679,910	225,112,440.00	4.23
7	300058	蓝色光标	4,299,269	200,229,167.56	3.76
8	300178	腾邦国际	5,008,932	158,131,983.24	2.97
9	600597	光明乳业	9,000,000	150,840,000.00	2.83
10	300202	聚龙股份	3,599,005	144,680,001.00	2.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

上海家化于2013年11月20日收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《关于对上海家化联合股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决[2013]49号),指出公司与吴江市黎里沪江日用化学品厂发生采购销售、资金拆借等关联交易中存在未及时披露等问题,对公司提出相应的整改要求。东方财富2014年1月9日公告称,日前全资子公司上海天天基金销售有限公司,收到上海证监局沪证监决[2014]1号行政监管措施决定书。根据《证券投资基金销售管理办法》的规定,责令天天基金限期整改。本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,151,474.48
2	应收证券清算款	1,048,746.79
3	应收股利	-
4	应收利息	100,065.59
5	应收申购款	2,985,724.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,286,011.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300058	蓝色光标	178,122,817.56	3.34	非公开发行

注:本基金本报告期末同时持有蓝色光标(300058)流通股和非公开发行股票,该股票的公允价值合计占期末资产净值的比例为3.76%,其中非公开发行部分占期末基金资产净值的比例为3.34%。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,012,387,286.82
报告期期间基金总申购份额	116,957,776.75
减:报告期期间基金总赎回份额	409,762,882.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,719,582,181.37

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,201,132.82
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,201,132.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.19

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准华商盛世成长股票型证券投资基金设立的文件;

2、《华商盛世成长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《华商盛世成长股票型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内华商盛世成长股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
基金托管人地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。
客户服务中心电话:4007008880(免长途费),010-58573300
基金管理人网址:http://www.hsfund.com

华商基金管理有限公司
2014年4月22日

华商中证500指数分级证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3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
报告送出日期:2014年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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2014年4月21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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商中证500指数分级(场内简称:华商500)		
基金主代码	166301		
交易代码	166301		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年9月6日		
报告期末基金份额总额	14,020,573.89份		
投资目标	本基金运用完全复制的被动型指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险手段,力争将本基金的净值增长率与标的指数之间的日均跟踪误差偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制4%以内,获得与标的指数收益相类似的回报。		
投资策略	本基金采用完全复制法,以中证500指数作为标的指数,按照成份股在指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,严格控制与目标指数的偏离风险,以拟合、跟踪标的指数的收益表现,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整,获得与标的指数收益相似的回报。		
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品;同时本基金为指数型基金,紧密跟踪中证500指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特定,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。		
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		
下属三级基金简称	华商中证500指数分级	华商500A	华商500B
下属三级基金交易代码	166301	150110	150111
下属三级基金报告期末基金份额总额	12,709,627.89份	524,378.00份	786,568.00份
下属三级基金的风险收益特征	华商中证500指数分级份额具有风险较高、收益较高的特征。	华商中证500A类份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	华商中证500B类份额具有高风险、高预期收益的特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	4,031,914.86
2.本期利润	1,109,990.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0407
4.期末基金资产净值	15,486,345.28
5.期末基金份额净值	1.105

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

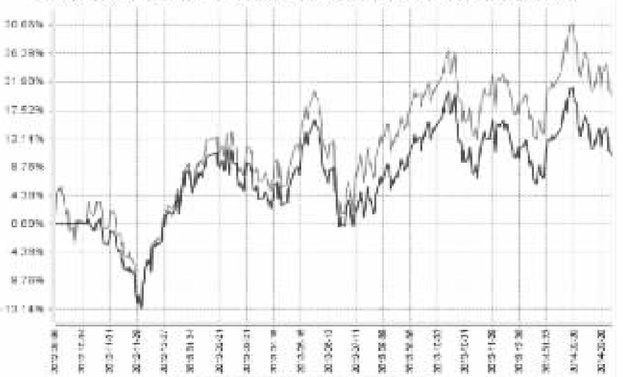
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.52%	1.24%	0.32%	1.36%	-1.84%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2012年9月6日。

②根据《华商中证500指数分级股票型基金基金合同》的规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证500指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以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:投资股票组合的比例占基金资产的85%-95%,其中投资于中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其他金融工具的投资比例符合法律规则和监管机构的规定。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
路阳	基金经理	2013年12月30日	-	7	男,金融学硕士,中国籍,具有基金从业资格。2006年12月至2007年7月,就职于中软融鑫计算机系统工程公司,任模型研发工程师;2007年7月至2007年10月,就职于大众国际资信评估公司,任分析师;2007年10月至2009年9月,就职于民生证券有限公司,任合规监测及金融工程师;2009年9月加入华商基金管理有限公司,从事量化研究及产品设计工作;2013年2月28日至2013年12月30日,担任华商中证500指数分级证券投资基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度本基金发生大比例赎回,对跟踪误差造成一定影响。本基金的操作严格按照指数基金的管理流程及方法,力争将跟踪误差控制在合同约定范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为1.105元,份额累计净值为1.105元。本季度基金份额净值增长率为-1.52%。同期基金业绩比较基准的收益率为0.32%,本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率1.84个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在当前的经济形势下,预计2014年2季度市场仍将维持震荡格局,中证500指数成分大多都是具有良好的成长性的中小盘股票,仍将获益于结构性行情的发展,并相对于创业板等成长性指数具有明显的估值优势。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	13,349,423.70	84.93
	其中:股票	13,349,423.70	84.93
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,325,157.62	14.79
7	其他资产	42,794.35	0.27
8	合计	15,717,375.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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、渔业	171,983.76	1.11
B	采矿业	338,323.67	2.18
C	制造业	8,310,716.92	53.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	354,800.04	2.29
E	建筑业	268,835.87	1.74
F	批发和零售业	751,906.14	4.86
G	交通运输、仓储和邮政业	474,790.82	3.07
H	住宿和餐饮业	41,871.87	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	699,484.71	4.52
J	金融业	107,673.46	0.70
K	房地产业	1,085,707.10	7.01
L	租赁和商务服务业	246,984.40	1.59
M	科学研究和技术服务业	46,430.66	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	153,201.60	0.99
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	203,401.30	1.31
S	综合	93,311.38	0.60
	合计	13,349,423.70	86.20

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600587	新华医疗	2,500	232,975.00	1.50
2	600572	康恩贝	8,871	119,847.21	0.77
3	002223	鱼跃医疗	3,789	116,132.85	0.75
4	002573	国电清新	5,584	99,841.92	0.64
5	002167	东方锆业	8,732	99,457.48	0.64
6	600139	西部资源	9,795	79,829.25	0.52
7	600594	益佰制药	1,917	78,501.15	0.51
8	601929	吉视传媒	6,081	74,127.39	0.48
9	600499	科达机电	3,680	73,526.40	0.47
10	600570	恒生电子	3,412	73,255.64	0.47

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

恒生电子2014年1月2日公告称,日前董事会办公室收到本公司控股子公司杭州数米基金销售有限公司的报告,称其收到浙江证监局[2013]13号行政监管措施决定书。因违反《证券投资基金销售管理办法》相关规定,数米公司被责令限期改正。本公司对上述证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,818.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	537.70
4	应收利息	546.76
5	应收申购款	891.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,794.35

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600587	新华医疗	232,975.00	1.50	重大事项停牌
2	600572	康恩贝	119,847.21	0.77	重大事项停牌
3	002223	鱼跃医疗	116,132.85	0.75	重大事项停牌
4	002167	东方锆业	99,457.48	0.64	重大事项停牌
5	600139	西部资源	79,829.25	0.52	重大事项停牌
6	600570	恒生电子	73,255.64	0.47	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华商中证500指数分级	华商500A	华商500B
报告期期初基金份额总额	44,254,220.83	661,394.00	992,092.00
报告期期间基金总申购份额	558,025.76	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	32,445,158.70	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	342,540.00	-137,016.00	-205,524.00
报告期期末基金份额总额	12,709,627.89	524,378.00	786,568.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,770,038.17
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,770,038.17
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	34.02

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准华商中证500指数分级证券投资基金设立的文件;

2、《华商中证500指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《华商中证500指数分级证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内华商中证500指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
基金托管人地址:北京市西城区复兴门内大街55号
投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。
客户服务中心电话:4007008880(免长途费),010-58573300
基金管理人网址:http://www.hsfund.com

华商基金管理有限公司
2014年4月22日

华商主题精选股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:华商基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月21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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商主题精选股票
基金主代码	630011
交易代码	630011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月31日
报告期末基金份额总额	919,292,767.92份
投资目标	在有效管理投资风险的前提下,追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"为主、"自下为上"为辅的投资视角,在实际投资过程中充分体现"主题投资"这个核心理念。深入分析挖掘社会经济发展进程中各类投资主题得以产生和持续的内在驱动因素,重点投资于具有可持续发展前景的投资主题中的优质上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品,属于较高风险、较高收益的基金产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	27,004,597.84
2.本期利润	11,659,435.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0152
4.期末基金资产净值	1,435,677,643.61
5.期末基金份额净值	1.562

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

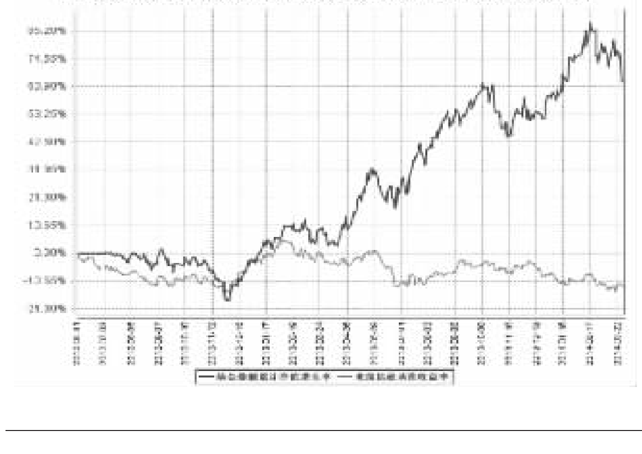
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.43%	1.66%	-5.73%	0.89%	9.16%	0.77%

3.2.2 自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2012年5月31日。

②根据《华商主题精选股票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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的60%-95%;债券投资比例为基金资产的0%-35%;权证投资比例为基金资产净值的0%-3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁永强	基金经理,公司副总经理,量化投资部总经理,投资决策委员会委员	2012年5月31日	-	12	男,经济学博士,中国籍,具有基金从业资格。2002年7月至2004年7月就职于华龙证券有限公司投资银行部,历任研究员、高级研究员;2004年7月至2005年12月担任华商基金管理有限公司筹备组成员;2007年5月15日至2008年9月23日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金基金经理助理,2008年9月23日至2012年4月24日担任华商盛世成长股票型证券投资基金基金经理,2009年11月24日至今担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金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。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度资本市场表现如过山车,前两个月新兴方向延续去年表现优异而传统板块持续受压,而三月份这种风格基本逆转。由于本基金的主要配置集中在反映转型的新兴产业和文化传媒行业,因此在本季度表现正常,优于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为1.562元,份额累计净值为1.662元。本季度基金份额净值增长率为3.43%。同期基金业绩比较基准的收益率为-5.73%,本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率9.16个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前,国内经济的转型与国际产业结构的调整交织在一起,诸多行业的发展略滞后甚至同步于国际发展的步伐。就全球来讲,新的工业革命本质上是构建起了以低碳为主要特征的能源网和以大数据化为主要特征的信息网,基于能源利用模式和信息沟通方式的大变革刚刚开始,各个行业所基于的外部环境在快速发生变化,利用这两大新网改造甚至改变人类的生活方式和企业的盈利模式,未来资本市场的发展基本上会顺应这个趋势。

另外,中国改革进入实质阶段,国企改革可能带来社会存量资产的效率改善,这也将是未来一段时间资本市场追捧的热点所在。

但这两类机会在今年的表现形式基本上都是点的机会,因此如何去寻找这些点需要更加深入细致的调研和分析。

针对这些新的产业方向和市场特征,后续本基金配置的重点主要包括以下方面:基于转型的产业方向比如新能源、生物技术、新材料、人工智能、互联网新模式等,长期投资价值逐步体现的军工行业,符合这些方向的国企将是重点。

围绕这些方向,本基金将精选优质个股进行基本配置。在基本配置完成的基础上,本基金将寻求主题轮动的机会,对一些大的主题进行阶段性的重点配置,以期能为投资者获取较好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,311,402,802.01	89.72
	其中:股票	1,311,402,802.01	89.72
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	138,777,975.74	9.49
7	其他资产	11,490,570.89	0.79
8	合计	1,461,671,348.64	100.00

5.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	16,631,168.40	1.16
C	制造业	1,158,534,652.66	80.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,137,500.00	0.57
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,245,238.64	6.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,376,495.79	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,477,746.52	1.43
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	1,311,402,802.01	91.34

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002249	大洋电机	8,674,128	115,799,608.80	8.07
2	000536	华映科技	4,262,298	94,196,785.80	6.56
3	000547	闽福发A	15,662,767	87,711,495.20	6.11
4	002371	七星电子	4,594,236	82,834,075.08	5.77
5	002010	传化股份	7,385,685	72,379,713.00	5.04
6	601012	隆基股份	5,105,441	67,136,549.15	4.68
7	002292	奥飞动漫	2,155,744	65,426,830.40	4.56
8	000661	长春高新	668,531	64,379,535.30	4.48
9	300272	开能环保	4,512,655	60,334,197.35	4.20
10	002577	雷柏科技	2,184,910	54,884,939.20	3.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

长春高新于2013年5月2日公告称,对吉林证监局下发的吉证监决[2013]4号《关于对长春高新技术产业(集团)股份有限公司采取责令改正措施的决定》要求改正事项的整改结果进行公告,公司已经将该《责令改正决定书》中要求清收的占用资金全部收回,在规定的期限完成了责令改正的事项。本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	282,231.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,938.86
5	应收申购款	11,180,400.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,490,570.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000661	长春高新	64,379,535.30	4.48	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	690,604,790.73
报告期期间基金总申购份额	736,948,751.68
减:报告期期间基金总赎回份额	508,260,774.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	919,292,767.92

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准华商主题精选股票型证券投资基金设立的文件;

2、《华商主题精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《华商主题精选股票型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内华商主题精选股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
基金托管人地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。
客户服务中心电话:4007008880(免长途费),010-58573300
基金管理人网址:http://www.hsfund.com

华商基金管理有限公司
2014年4月22日