

华商新趋势优选灵活配置混合型  
证券投资基金  
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 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：2023 年 7 月 21 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 2023 年 7 月 20 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华商新趋势优选混合  |
| 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    | 2015 年 5 月 14 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,456,978,462.92 份   |
| 投资目标       | 本基金将重点投资于社会及国家发展出现的具有重大变化且符合产业自身发展新趋势以及国家“十二五”战略规划中的新兴产业和行业方向，精选质地优秀、发展趋势良好，且具备估值优势的上市公司，追求超过业绩比较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”、“自下而上”相结合的投资视角。在实际投资过程中，一方面根据宏观经济数据，积极主动调整大类资产配置比例；另一方面，秉承优选“新趋势”核心理念，“自下而上”精选优质成长上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。具体投资策略详见基金合同。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率   |

|        |   |
|--------|---|
|        | ×35%  |
| 风险收益特征 | 本基金是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预期风险和中高预期收益产品。 |
| 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  |

注：华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金由华商中证 500 指数分级证券投资基金通过基金转型而来。

### § 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（2023 年 4 月 1 日 — 2023 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 477,513,295.12                        |
| 2. 本期利润         | -559,521,349.31                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.3743                               |
| 4. 期末基金资产净值     | 14,048,292,331.06                     |
| 5. 期末基金份额净值     | 9.642                                 |

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。

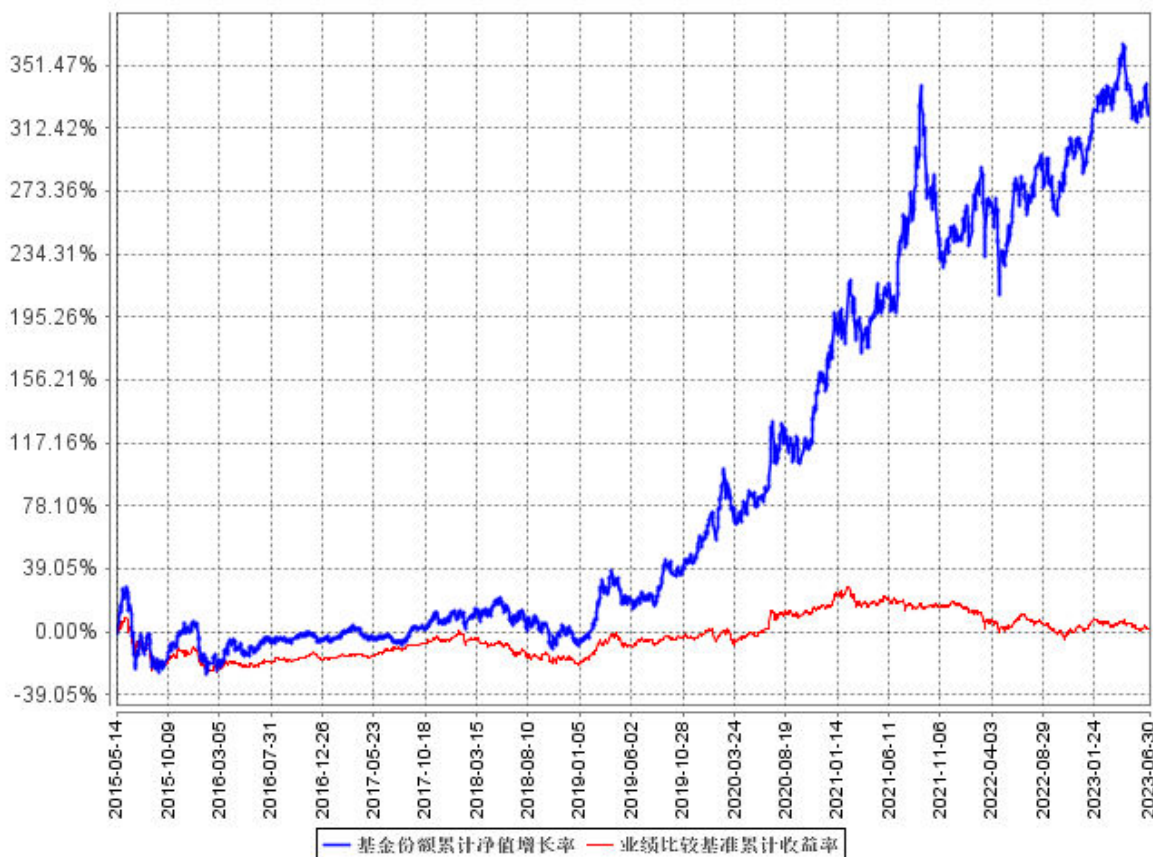
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -3.32%     | 0.94%         | -2.85%         | 0.54%                 | -0.47%  | 0.40% |
| 过去六个月          | 9.23%      | 0.94%         | 0.35%          | 0.55%                 | 8.88%   | 0.39% |
| 过去一年           | 13.58%     | 0.99%         | -8.14%         | 0.64%                 | 21.72%  | 0.35% |
| 过去三年           | 124.70%    | 1.57%         | -0.32%         | 0.78%                 | 125.02% | 0.79% |
| 过去五年           | 289.58%    | 1.62%         | 16.49%         | 0.83%                 | 273.09% | 0.79% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 327.20%    | 1.66%         | 2.00%          | 0.91%                 | 325.20% | 0.75% |

### 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率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①根据基金管理人于 2014 年 12 月 18 日收到的中国证监会《关于准予华商中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可 [2014] 1378 号）及基金管理人于 2015 年 4 月 30 日发布的《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、2015 年 5 月 14 日发布的《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金份额折算结果暨转型后华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件生效的公告》，自 2015 年 5 月 14 日起《华商中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效且《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。华商中证 500 指数分级证券投资基金的基金类别变更为混合型，其投资目标、理念、范围和策略调整，同时更名为“华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金”。修订后的《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2015 年 5 月 14 日生效。

②根据《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货及法律

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。本基金股票资产的投资比例为 0-95%，其中投资于新趋势方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，债券、权证、银行存款、货币市场工具和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占基金资产的 5%—100%，其中权证占基金资产净值的 0—3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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 |        |   |
| 周海栋 | 基金经理，公司权益投资总监，权益投资部总经理，公司投资决策委员会委员，公司公募业务权益投资决策委员会委员 | 2015 年 5 月 14 日 | -    | 15.0   | 男，中国籍，管理学硕士，具有基金从业资格。2003 年 7 月至 2004 年 10 月，就职于上海慧旭药物研究所，任研究员；2004 年 10 月至 2005 年 8 月，就职于上海拓引数码技术有限公司，任项目经理；2008 年 6 月至 2010 年 5 月，就职于中国国际金融有限公司，任研究员；2010 年 5 月加入华商基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、机构投资部投资经理；2012 年 3 月至 2014 年 5 月担任华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；2014 年 5 月 5 日至 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>2021 年 12 月 21 日担任华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 14 日起至今担任华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 9 月 17 日至 2017 年 4 月 21 日担任华商新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 5 日起至今担任华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 21 日起至今担任华商盛世成长混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 11 日至 2019 年 8 月 23 日担任华商主题精选混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 26 日至 2022 年 9 月 21 日担任华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日至 2020 年 4 月 14 日担任华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 2 月 20 日起至今担任华商恒益稳健混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 19 日起至今担任华商甄选回报混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 31 日起至今担任华商鑫选回报一年持有期混</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |                |
|--|--|--|--|--|----------------|
|  |  |  |  |  | 合型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合规守信情况的说明

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《证券投资基金法》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 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年二季度，由于经济复苏节奏略低于市场预期，市场总体在一季度较为强势的表现之后呈现震荡走势。在整体经济、政策不明朗的背景下，市场没有很明确的主线，偏主题方向受到市场的偏好，包括传媒、人工智能、数字经济、光通讯、机器人等。而经济相关性较强的板块，在二季度承受较大的压力，包括消费、化工、建材、有色、地产等。本基金依旧保持了较为均衡的配置，主要持有行业包括有色、计算机、医药、化工、电子、交运、机械、电力设备、军工等。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 9.642 元，份额累计净值为 9.642 元。本季度基金份额净值增长率为-3.32%，同期基金业绩比较基准的收益率为-2.85%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 0.47 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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              | 12,429,580,597.83 | 87.59        |
|    | 其中：股票             | 12,429,580,597.83 | 87.59        |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,342.73          | 0.00         |
|    | 其中：债券             | 1,342.73          | 0.00         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                 | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                 | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                 | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,734,285,789.10  | 12.22        |
| 8  | 其他资产              | 26,212,278.80     | 0.18         |
| 9  | 合计                | 14,190,080,008.46 | 100.00       |



## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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         | 13,340.00         | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 2,285,526,734.14  | 16.27        |
| C  | 制造业              | 6,487,728,212.07  | 46.18        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 108,289,559.25    | 0.77         |
| E  | 建筑业              | 30,847,990.66     | 0.22         |
| F  | 批发和零售业           | 141,828,760.07    | 1.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 942,171,939.31    | 6.71         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 45,031,748.56     | 0.32         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,853,357,086.81  | 13.19        |
| J  | 金融业              | 58,793,554.45     | 0.42         |
| K  | 房地产业             | 58,438,914.29     | 0.42         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 52,462,272.25     | 0.37         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 304,544,252.92    | 2.17         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 60,519,561.49     | 0.43         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                 | -            |
| P  | 教育               | -                 | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 24,148.56         | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,523.00          | 0.00         |
| S  | 综合               | -                 | -            |
|    | 合计               | 12,429,580,597.83 | 88.48        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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  | 601899 | 紫金矿业 | 64,542,545 | 733,848,736.65 | 5.22         |
| 2  | 603728 | 鸣志电器 | 3,886,402  | 312,078,080.60 | 2.22         |
| 3  | 000938 | 紫光股份 | 7,979,800  | 254,156,630.00 | 1.81         |
| 4  | 000630 | 铜陵有色 | 84,814,287 | 245,113,289.43 | 1.74         |
| 5  | 603885 | 吉祥航空 | 15,843,540 | 244,465,822.20 | 1.74         |
| 6  | 603979 | 金诚信  | 7,765,810  | 241,516,691.00 | 1.72         |
| 7  | 000807 | 云铝股份 | 18,745,863 | 238,634,835.99 | 1.70         |
| 8  | 601111 | 中国国航 | 28,585,275 | 233,895,079.41 | 1.66         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 9  | 000426 | 兴业银锡 | 25,106,600 | 222,946,608.00 | 1.59 |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业 | 39,840,000 | 212,347,200.00 | 1.51 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -        | -            |
| 2  | 央行票据      | -        | -            |
| 3  | 金融债券      | -        | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -        | -            |
| 4  | 企业债券      | -        | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -        | -            |
| 6  | 中期票据      | -        | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,342.73 | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | -        | -            |
| 9  | 其他        | -        | -            |
| 10 | 合计        | 1,342.73 | 0.00         |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|----------|--------------|
| 1  | 111007 | 永和转债 | 10    | 1,342.73 | 0.00         |

注：本基金本报告期末持有 1 只债券。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸的同时，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。

此外，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金资产组合将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略，稳定收益。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

兴业银锡

于 2022 年 10 月 10 日公告收到深交所《关于对内蒙古兴业集团股份有限公司给予公开谴责处分的决定》（深证上（2022）988 号），兴业集团存在以下违规行为：一、超期未履行业绩承诺现金补偿义务。2014 年，兴业银锡以 1.2 亿元收购兴业集团持有的唐河时代 100%股权。2015 年，兴业银锡以 3,665.43 万元收购兴业集团持有的荣邦矿业 100%股权。根据兴业银锡与兴业集团签署的相关业绩补偿协议及相关公告，荣邦矿业 2017 年度、2018 年度未完成承诺业绩，唐河时代 2017 年度、2019 至 2021 年度未完成承诺业绩，兴业集团合计应向兴业银锡补偿现金 55,386.39 万元，未补偿金额为 53,561.28 万元。二、超期未履行业绩承诺股份补偿义务。2016 年，兴业银锡以发行股份及支付现金的方式购买兴业集团、吉伟、吉祥、吉喆以及 8 家合伙企业持有的银漫矿业 100%股权。根据兴业银锡与兴业集团、吉伟、吉祥、吉喆签署的相关业绩补偿协议及相关公告，银漫矿业 2019 至 2021 年累计未完成承诺业绩，兴业集团应向兴业银锡补偿股份 65,600,060 股，并返还现金分红款 261.76 万元。兴业集团的上述行为违反了本所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 11.11.1 条和《股票上市规则（2022 年修订）》第 1.4 条、第 7.7.5 条的规定。对内蒙古兴业集团股份有限公司给予公开谴责的处分。

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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   | 1,560,158.26  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 24,652,120.54 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 26,212,278.80 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------|--------------|
| 1  | 111007 | 永和转债 | 1,342.73 | 0.00         |

### 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  | 601111 | 中国国航 | 102,784,055.73 | 0.73         | 非公开发行股票流通受限 |

注：本基金本报告期末同时持有中国国航(601111)流通股票和限售股票，该股票的公允价值合计占期末资产净值的比例为 1.66%，其中限售股票部分占期末基金资产净值的比例为 0.73%。

### 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               | 1,421,445,718.48 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 338,328,117.78   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 302,795,373.34   |
| 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               | 1,456,978,462.92 |

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

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 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未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金设立的文件；
- 2、中国证监会《关于准予华商中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复》；
- 3、《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介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：中国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：4007008880，010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2023 年 7 月 21 日