

华商恒益稳健混合型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华商恒益稳健混合 |
| 基金主代码 | 008488 |
| 交易代码 | 008488 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 2 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,253,744,482.48 份 |
| 投资目标 | 采用多元资产配置方案，确定各类别资产长期配置比例中枢，并结合动态优化调整策略，在严格控制投资组合风险特征的前提下，力争获取长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | （一）战略资产配置策略 本基金采用恒定比例资产配置策略，以保障投资组合具有明确的风险收益特征。长期而言，本基金的股票配置比例中枢为 40%，固定收益类资产的配置比例中枢为 60%。固定收益类资产包括：债券、银行存款、同业存单、债券回购、资产支持证券。 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×35%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债总全价指数收益率×60% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |

| | |
|-------|----------------------------------|
| | 本基金若投资港股通标的股票，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |
| 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

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 7 月 1 日 — 2023 年 9 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -2,236,465.87 |
| 2. 本期利润 | -35,466,867.62 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0277 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,282,770,115.85 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0232 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

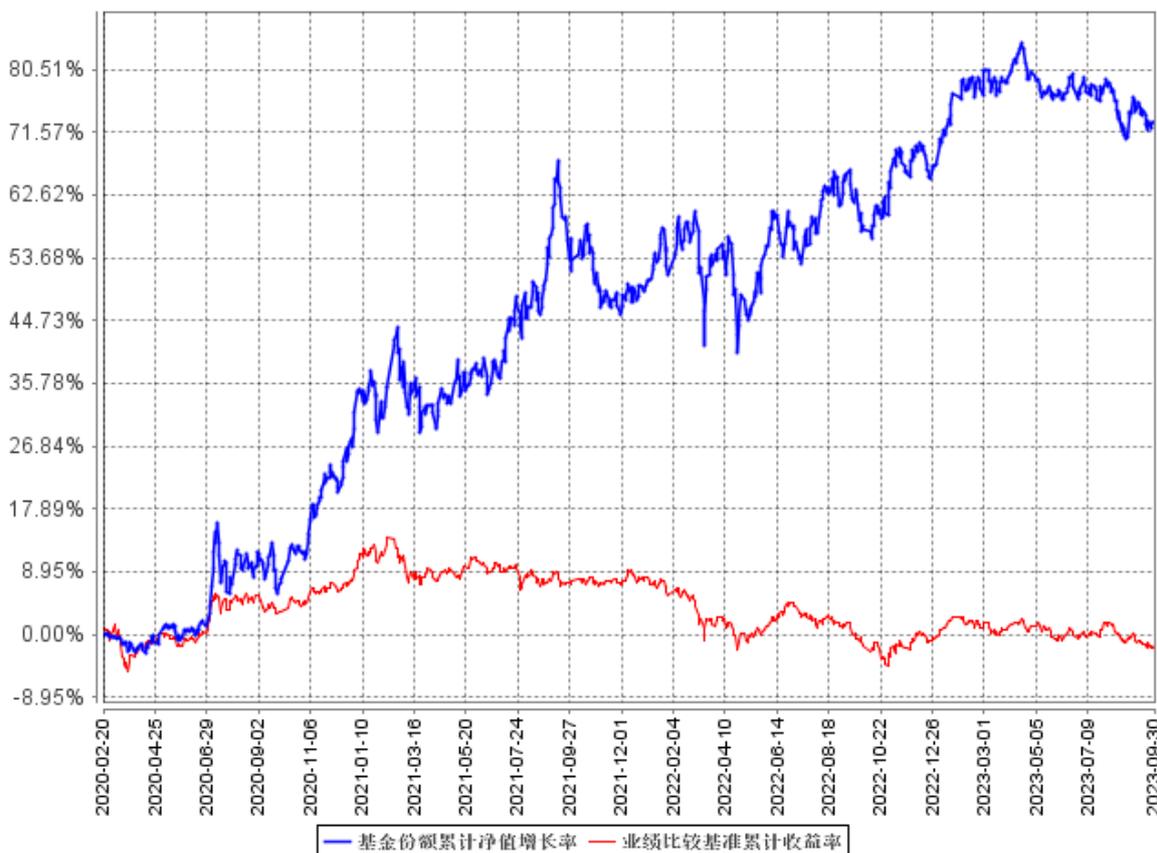
3.2 基金净值表现

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 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 | -2.61% | 0.56% | -1.63% | 0.35% | -0.98% | 0.21% |
| 过去六个月 | -3.54% | 0.49% | -2.84% | 0.33% | -0.70% | 0.16% |
| 过去一年 | 9.86% | 0.58% | -0.08% | 0.39% | 9.94% | 0.19% |
| 过去三年 | 60.67% | 0.97% | -4.74% | 0.45% | 65.41% | 0.52% |
| 自基金合同 生效起至今 | 73.19% | 0.97% | -1.77% | 0.47% | 74.96% | 0.50% |

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

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本基金合同生效日为 2020 年 2 月 20 日。

②根据《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为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（含中小板，创业板，存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、资产支持证券等，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（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：股票投资比例为基金资产的 20%-60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%，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，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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 | | |
| 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 | 2020年2月20日 | - | 15.2 | 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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>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合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

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 年三季度，经济复苏节奏继续低于市场预期，部分地产企业的尾部风险继续发酵，美债利率超预期上行。在这样的背景下，虽然市场整体位置已经处于较低的位置，但仍缺乏上升的动力。同时，市场依然没有明确的主线，偏红利方向受到市场的偏好，包括石油、煤炭、非银、银行等。而上半年表现较好的板块，在三季度承受较大的压力，包括 TMT、电新、军工、机械等。

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、电子、交运、机械、军工等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.0232 元，份额累计净值为 1.6512 元。本季度基金份额净值增长率为-2.61%，同期基金业绩比较基准的收益率为-1.63%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 0.98 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 | 683,351,227.36 | 52.96 |
| | 其中：股票 | 683,351,227.36 | 52.96 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 222,680,359.84 | 17.26 |
| | 其中：债券 | 222,680,359.84 | 17.26 |
| | 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 | 381,861,570.43 | 29.60 |
| 8 | 其他资产 | 2,351,755.65 | 0.18 |
| 9 | 合计 | 1,290,244,913.28 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 227,548,884.26 元，占净值比例 17.74%。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 41,968,330.20 | 3.27 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 310,330,872.04 | 24.19 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,287,794.73 | 0.33 |
| E | 建筑业 | 2,681,812.38 | 0.21 |
| F | 批发和零售业 | 5,353,001.38 | 0.42 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,515,662.60 | 0.90 |
| H | 住宿和餐饮业 | 740,205.00 | 0.06 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 49,284,017.68 | 3.84 |
| J | 金融业 | 1,374,312.00 | 0.11 |
| K | 房地产业 | 1,118,567.00 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,015,135.00 | 0.55 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,536,722.88 | 1.45 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,574,724.75 | 0.12 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 21,185.46 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 455,802,343.10 | 35.53 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| A 基础材料 | 39,915,171.80 | 3.11 |
| B 消费者非必需品 | 78,617,447.79 | 6.13 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | 34,572,627.31 | 2.70 |
| E 金融 | 4,211,591.35 | 0.33 |
| F 医疗保健 | 51,097,416.02 | 3.98 |
| G 工业 | 10,935,451.77 | 0.85 |
| H 信息技术 | 6,041,600.68 | 0.47 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | 2,157,577.54 | 0.17 |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 227,548,884.26 | 17.74 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 00883 | 中国海洋石油 | 2,639,521 | 33,376,588.37 | 2.60 |

| | | | | | |
|----|--------|----------|-----------|---------------|------|
| 2 | 02899 | 紫金矿业 | 1,203,291 | 13,228,027.53 | 1.03 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 591,500 | 7,174,895.00 | 0.56 |
| 3 | 01055 | 中国南方航空股份 | 5,332,000 | 18,641,580.04 | 1.45 |
| 3 | 600029 | 南方航空 | 157,900 | 966,348.00 | 0.08 |
| 4 | 00753 | 中国国航 | 2,864,000 | 13,902,608.37 | 1.08 |
| 4 | 601111 | 中国国航 | 35,100 | 283,608.00 | 0.02 |
| 5 | 300759 | 康龙化成 | 201,525 | 6,267,427.50 | 0.49 |
| 5 | 03759 | 康龙化成 | 328,200 | 5,613,737.33 | 0.44 |
| 6 | 00293 | 国泰航空 | 1,584,000 | 11,686,348.40 | 0.91 |
| 7 | 000807 | 云铝股份 | 760,600 | 11,485,060.00 | 0.90 |
| 8 | 603979 | 金诚信 | 258,700 | 9,590,009.00 | 0.75 |
| 9 | 000630 | 铜陵有色 | 2,917,000 | 9,305,230.00 | 0.73 |
| 10 | 01208 | 五矿资源 | 4,052,000 | 8,923,768.22 | 0.70 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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 | 107,004,260.38 | 8.34 |
| 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） | 115,676,099.46 | 9.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 222,680,359.84 | 17.36 |

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 | 019694 | 23 国债 01 | 456,000 | 46,227,580.93 | 3.60 |
| 2 | 019688 | 22 国债 23 | 400,000 | 40,616,076.71 | 3.17 |
| 3 | 019703 | 23 国债 10 | 200,000 | 20,160,602.74 | 1.57 |
| 4 | 127063 | 贵轮转债 | 62,380 | 9,986,884.19 | 0.78 |
| 5 | 128048 | 张行转债 | 77,240 | 9,037,412.24 | 0.70 |

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。

本基金的股指期货投资基于市场系统风险模型的中短期风险判断，在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低仓位后，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。当市场向好时，管理人可择机在股指期货市场建立能够使得组合 β 值稳定的头寸从而避免现货快速建仓带来的流动性冲击，然后在保持组合风险敞口不变的前提下，在缓慢的现货市场建仓过程中有节奏地将期货头寸逐步平仓，充分利用股指期货提高资金使用效率。

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，且没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 | 82,172.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 1,312,856.71 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 956,726.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,351,755.65 |

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 | 127063 | 贵轮转债 | 9,986,884.19 | 0.78 |
| 2 | 128048 | 张行转债 | 9,037,412.24 | 0.70 |
| 3 | 113044 | 大秦转债 | 5,021,517.52 | 0.39 |
| 4 | 127012 | 招路转债 | 4,988,842.51 | 0.39 |
| 5 | 118028 | 会通转债 | 4,979,039.13 | 0.39 |
| 6 | 113615 | 金诚转债 | 4,538,608.97 | 0.35 |
| 7 | 127039 | 北港转债 | 4,524,006.99 | 0.35 |
| 8 | 113519 | 长久转债 | 4,467,359.25 | 0.35 |
| 9 | 110091 | 合力转债 | 4,270,880.82 | 0.33 |
| 10 | 123048 | 应急转债 | 4,240,357.66 | 0.33 |
| 11 | 128132 | 交建转债 | 4,111,666.02 | 0.32 |
| 12 | 127078 | 优彩转债 | 4,074,117.58 | 0.32 |
| 13 | 128121 | 宏川转债 | 3,840,577.58 | 0.30 |
| 14 | 111011 | 冠盛转债 | 3,746,968.93 | 0.29 |
| 15 | 123142 | 申昊转债 | 3,616,477.88 | 0.28 |
| 16 | 113049 | 长汽转债 | 3,603,670.66 | 0.28 |
| 17 | 110075 | 南航转债 | 3,448,033.38 | 0.27 |
| 18 | 111000 | 起帆转债 | 3,194,343.61 | 0.25 |
| 19 | 127074 | 麦米转 2 | 2,934,581.78 | 0.23 |
| 20 | 127050 | 麒麟转债 | 2,893,995.46 | 0.23 |
| 21 | 128081 | 海亮转债 | 2,782,801.39 | 0.22 |
| 22 | 113634 | 珀莱转债 | 2,704,720.95 | 0.21 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 23 | 127069 | 小熊转债 | 2,515,413.34 | 0.20 |
| 24 | 118014 | 高测转债 | 2,437,725.01 | 0.19 |
| 25 | 113641 | 华友转债 | 2,362,952.60 | 0.18 |
| 26 | 110088 | 淮 22 转债 | 2,079,938.16 | 0.16 |
| 27 | 127027 | 能化转债 | 2,073,738.33 | 0.16 |
| 28 | 113053 | 隆 22 转债 | 1,428,572.11 | 0.11 |
| 29 | 118031 | 天 23 转债 | 1,375,495.30 | 0.11 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,287,324,731.02 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 68,140,441.72 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 101,720,690.26 |
| 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 | 1,253,744,482.48 |

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. 中国证监会批准华商恒益稳健混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商恒益稳健混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商恒益稳健混合型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商恒益稳健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 10 月 25 日