

# 华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华商瑞鑫定期开放债券
基金主代码	002924
交易代码	002924
基金运作方式	<p>契约型、定期开放式</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即以封闭期和开放期相结合的方式运作。</p> <p>本基金以一年为一个封闭运作周期，每个封闭期为自基金合同生效日（包括基金合同生效日）或每个到期开放期结束之日次日起（包括该日）至一年后的对日的前一日止，如无该对日的，则顺延至下一工作日的上一日。</p> <p>在每个封闭期结束后第一个工作日起进入到期开放期。本基金的每个开放期为 10 至 20 个工作日。</p>
基金合同生效日	2016 年 8 月 24 日
报告期末基金份额总额	101,700,229.93 份
投资目标	本基金重点进行债券投资，并通过积极的资产配置，以及主动的个券选择，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，对

	不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。在投资策略选择上，本基金重点关注期限策略及利差策略。同时本基金在债券投资的基础上将适度参与股票投资，把握较确定性的投资机会，在得到稳定收益的同时，以期获得超过业绩比较基准的收益。 具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于较低风险收益水平的投资品种。
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（2023年7月1日—2023年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,582,737.23
2. 本期利润	375,004.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037
4. 期末基金资产净值	165,378,942.59
5. 期末基金份额净值	1.626

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

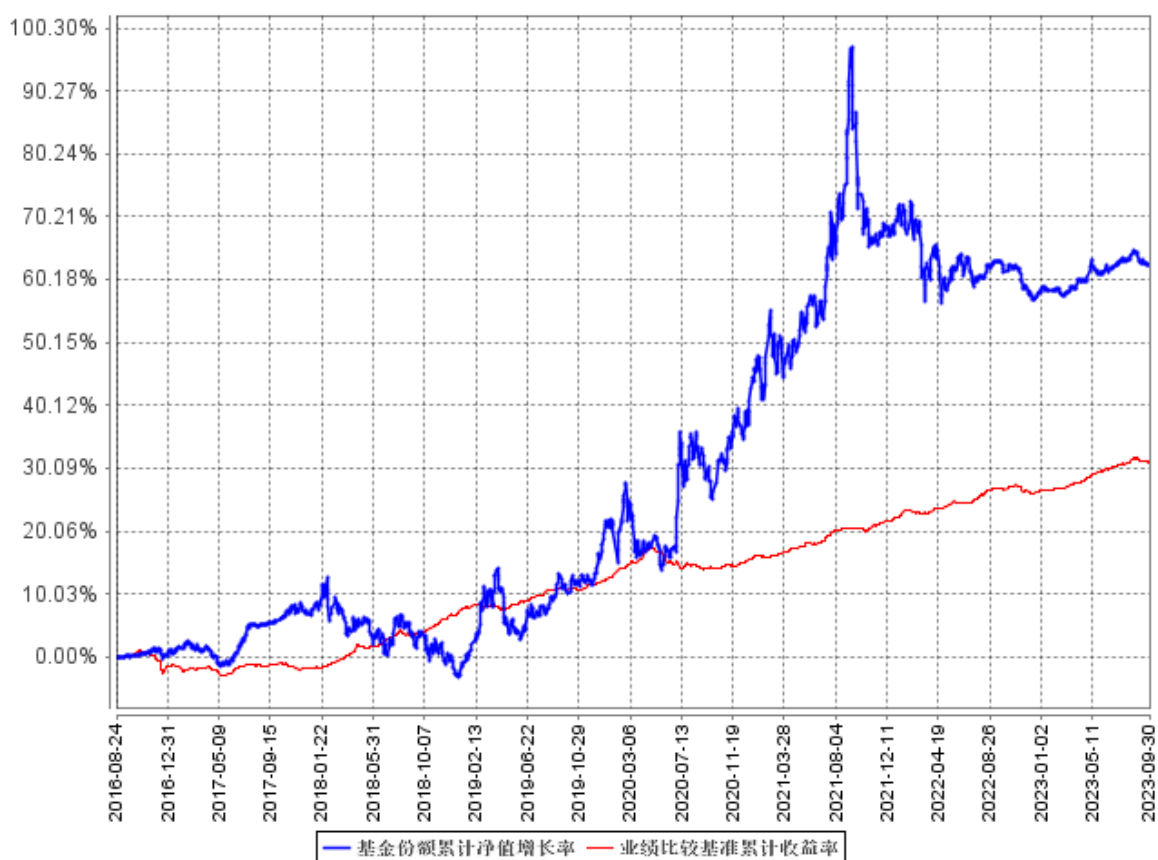
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.25%	0.12%	0.73%	0.06%	-0.48%	0.06%
过去六个月	2.20%	0.17%	2.73%	0.06%	-0.53%	0.11%

过去一年	0.74%	0.16%	3.59%	0.06%	-2.85%	0.10%
过去三年	28.64%	0.72%	14.89%	0.06%	13.75%	0.66%
过去五年	56.20%	0.76%	26.23%	0.07%	29.97%	0.69%
自基金合同生效起至今	62.60%	0.68%	31.26%	0.07%	31.34%	0.61%

### 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 2016 年 8 月 24 日。

②根据《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围主要为国内依法发行固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转债、中期票据、中小企业私募债、回购和银行存款等金融工具。本基金同时投资于依法上市发行的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种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：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制），投资于股票资产的比例不高于基金资产的 20%。其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。持有

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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，本基金在封闭期内不受以上 5%限制。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		
张永志	基金经理，固定收益部副总经理，公司公募业务固收投资决策委员会委员	2016 年 8 月 24 日	-	17.7	男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。1999 年 9 月至 2003 年 7 月，就职于工商银行青岛市市北一支行，任科员、科长等职务；2006 年 1 月至 2007 年 5 月，就职于海通证券，任债券部交易员；2007 年 5 月加入华商基金管理有限公司；2007 年 5 月至 2009 年 1 月担任交易员；2009 年 1 月至 2010 年 8 月担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理助理；2010 年 8 月 9 日起至今担任华商稳健双利债券型证券投资基金的基金经理；2011 年 3 月 15 日起至今担任华商稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 2 月 17 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商稳固添利债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 24

				<p>日起至今担任华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日至 2019 年 5 月 23 日担任华商瑞丰混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起至今担任华商可转债债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日起至今担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商双债丰利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2021 年 4 月 26 日担任华商双翼平衡混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 12 月 15 日担任华商回报 1 号混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 5 月 24 日至 2019 年 8 月 23 日担任华商瑞丰短债债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 9 月 29 日起至今担任华商转债精选债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 11 日起至今担任华商稳健添利一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 4 月 19 日起至今担任华商稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2023 年 5 月 16 日</p>
--	--	--	--	---

					起至今担任华商稳健泓利一年持有期混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

债券市场方面，三季度债市收益率先下后上，整体呈现出平坦化上行的态势，短端上行幅度大于长端。具体来看，7 月资金利率较为宽松，国内宏观经济数据边际下滑，驱动债市收益率下行，7 月底政治局会议释放逆周期政策信号，债市阶段性调整后回归下行趋势。8 月中旬央行非对称降息，引发市场对信贷扩张和防止资金空转的预期，叠加后续多部门密集推出政策组合拳，包括“认房不认贷”、下调存量首套房贷利率、推进特殊再融资债发行等，共同压制债市做多情绪。9 月份以来经济数据边际好转，资金利率维持偏紧，债市持续上行，其中短端上行幅度更为明显。

权益市场方面，三季度以来主要权益指数震荡下行，仅在 7 月末和 8 月末因政策利好出现两轮反弹。具体来看，7 月经济金融数据偏弱，权益市场整体情绪一般，整体呈现震荡态势，成交量小幅收缩。7 月 24 日政治局会议释放利好的政策信号，市场情绪明显提振，权益指数出现大幅反弹，非银板块领涨，周期、消费均有不错的表现。8 月政策兑现后止盈情绪较浓，权益市场出现较大调整，随后 8 月底调降印花税、暂缓发行等政策组合拳落地，权益市场短期反弹，但持续时间不长，9 月整体仍震荡下行。

转债市场方面，三季度转债市场同样呈现出震荡下行的走势，但跌幅和回撤程度较权益指数仍有优势，三季度中证转债下跌 0.52%，呈现明显抗跌性。分阶段来看，7 月和 8 月转债市场窄幅震荡并录得弱收益，9 月以后在宽地产政策落地、资金利率预期偏紧之下，机构止盈情绪浓厚，叠加利率债调整，转债整体下跌，成交量收缩，此后处于反复震荡筑底阶段。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金份额净值为 1.626 元，份额累计净值为 1.626 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.25%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.73%，基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 0.48 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	2,661,945.92	1.32
	其中：股票	2,661,945.92	1.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,185,781.49	95.90
	其中：债券	193,185,781.49	95.90
	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	5,521,554.98	2.74
8	其他资产	85,786.82	0.04
9	合计	201,455,069.21	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	537,544.92	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	432,113.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,665,144.00	1.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,144.00	0.02
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	2,661,945.92	1.61

### 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	601398	工商银行	355,800	1,665,144.00	1.01
2	603871	嘉友国际	24,100	432,113.00	0.26
3	600737	中粮糖业	51,100	421,575.00	0.25
4	688185	康希诺	1,496	115,969.92	0.07
5	000888	峨眉山 A	2,600	27,144.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有上述 5 只股票。

### 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	75,865,620.97	45.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,749,798.36	27.66
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	71,569,392.34	43.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	969.82	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,185,781.49	116.81

### 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	220008	22 付息国债 08	400,000	42,721,202.19	25.83
2	230009	23 付息国债 09	300,000	31,584,893.44	19.10
3	163558	20 华泰 G4	150,000	15,259,923.29	9.23

4	124817	14 北国资	100,000	10,361,728.77	6.27
5	152384	G20 广铁 1	100,000	10,343,250.41	6.25

## 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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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

20 中证 G2

2023 年 2 月中信证券因未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告被中国人民银行罚款 1376 万。2023 年 4 月中信证券股份有限公司因作为西藏华钰矿业股份有限公司首次公开发行并上市项目保荐机构持续督导不力，被证监会出具警示函。

22 招证 G1

2023 年 6 月招商证券股份有限公司因市场影响评估机制不完善，对个别研究报告的市场影响力评估不充分，提级审核管理不到位；分析师调研活动管理、服务客户、公开发表言论等方面的内控管理有效性不足；个别研报制作不审慎，存在内容表述不严谨、未注明引用信息、数据来源披露不当、研报署名不规范等情形被深圳证监局予以警示。

20 华泰 G4

2023 年 8 月，华泰证券股份有限公司因违反《境内外汇账户管理规定》（银发〔1997〕416

号)第四十二条、《关于证券经营机构从事 B 股业务若干问题的补充通知》(证监发(2001)26 号)第四条、《国家外汇管理局关于贯彻实施〈关于境内居民个人投资境内上市外资股若干问题的通知〉中有关问题的通知》(汇发(2001)26 号)第十三条、《中国证券监督管理委员会 国家外汇管理局关于境内居民个人投资境内上市外资股若干问题的通知》(证监发(2001)22 号)第六条被国家外汇管理局江苏省分局罚款 5 万元。

#### 21 深铁 04

2022 年 12 月 14 号,深圳市交通运输局以深圳市地铁集团有限公司在 2022 年 10 月 18 日 10 时 00 分在(违法地点)盐坝高速 K76-K77 路段实施了未经同意穿越公路修建地铁隧道设施的违法行为为由,对深圳市地铁集团有限公司处以 2 万元罚款。

#### G20 广铁 1

(1) 2023 年 2 月 10 号,广州市规划和自然资源局以广州地铁集团有限公司广州地铁集团有限公司未经批准,于 2019 年 4 月开始在白云区石门街鹤岗村“门口田”(土名)地块动工进行建设广州市轨道交通十三号线二期工程朝阳站,用地面积 7406.9 平方米;于 2020 年 7 月在石门街朝阳村“沙墩”(土名)动工进行建设广州市轨道交通十三号线二期工程朝庆区间风井口,用地面积 111.77 平方米。两地块用地面积共 7518.67 平方米为由,对广州地铁集团作出如下处罚:1、没收广州地铁集团有限公司在广州市白云区石门街鹤岗村“门口田”(土名)、朝阳村“沙墩”(土名)地块非法占用的 7518.67 平方米符合土地利用总体规划的土地上新建的建筑物及其他设施;2、对广州地铁集团有限公司非法占用的 6432.44 平方米现状为耕地的土地处以每平方米 21 元罚款,罚款金额为人民币 135081.24 元;对非法占用的 865.7 平方米现状为其它农用地的土地处以每平方米 11 元罚款,罚款金额为人民币 9522.7 元;对非法占用的 220.53 平方米现状为建设用地的土地处以每平方米 3 元罚款,罚款金额为人民币 661.59 元;总罚款金额为人民币壹拾肆万伍仟贰佰陆拾伍元伍角叁分(¥145265.53)。

(2) 2023 年 2 月 2 号,广东省水利厅以广州地铁集团有限公司于 2021 年 5 月 25 日至 2022 年 3 月 26 日期间,广州地铁集团有限公司未经本机关审查同意其工程建设方案,就擅自动工建设广州市轨道交通二十二号线下穿陈村水道隧道工程为由,对广州地铁集团有限公司处以十万元的罚款。

(3) 2023 年 1 月 18 号,广州市规划和自然资源局以广州地铁集团有限公司广州地铁集团有限公司擅自在官洲北苑科韵路东侧地块(轨道交通十二号线仑头站)围蔽、硬化地面、搭建板房,面积 8462.67 平方米为由,对广州地铁集团作出如下处罚:1. 责令退还临时用地批准范围外非法占用的 3684.32 平方米土地;2. 没收在临时用地批准范围外非法占用的 3684.32 平方米土地上的

建筑物和其他设施。自收到本行政处罚决定书之日起 30 个自然日内，清空财物，移交至我局；3. 对非法占用耕地的 2136.2 平方米处以每平方米 21 元的罚款，对非法占用一般农用地的 3480.18 平方米处以每平方米 11 元的罚款，对非法占用建设用地的 1573.52 平方米处以每平方米 5 元的罚款，对非法占用未利用地的 1272.77 平方米处以每平方米 5 元的罚款，处罚面积共计 8462.67 平方米，处罚金额共计人民币玖万柒仟叁佰柒拾叁圆陆角叁分（¥97373.63）。

（4）2023 年 1 月 12 号，广州市规划和自然资源局以广州地铁集团有限公司广州地铁集团有限公司违反了《中华人民共和国土地管理法》（2004 年修正版）第四十四条第一款的规定，未经批准或者采取欺骗手段骗取批准，违法占用土地为由，对广州地铁集团作出如下处罚：1、对广州地铁集团有限公司非法占用土地 3547.81 平方米建设轨道交通十四号线车站的行为，其中土地利用现状为村庄 1557.95 平方米处以每平方米 10 元的罚款，罚款金额为人民币 15579.5 元；土地利用现状为果园（可调整地类）1989.86 平方米处以每平方米 19 元罚款，罚款金额为人民币 37807.34 元；合计罚款金额合计人民币 53386.84 元。2、没收广州地广州地铁集团有限公司非法占用的 3547.81 平方米土地上新建的建构筑物。

（5）2022 年 12 月 28 号，广州市白云区人民政府石井街道办事处以广州地铁集团有限公司广州地铁集团有限公司未经批准非法占用土地行为行政处罚案为由，对广州地铁集团作出如下处罚：1. 没收广州地铁集团有限公司在广州市白云区石井街广海路地铁十二号线槎头车辆段地块处非法占用 39936.89 平方米土地上新建的建筑物及其他设施，2. 对广州地铁集团有限公司破坏 31755.65 平方米现状为耕地的土地处以每平方米 21 元罚款，罚款金额为人民币 666868.65 元，对非法占用 196.41 平方米现状为园地、林地、其它农用地的土地处以每平方米 11 元罚款，罚款金额为人民币 2160.51 元，对非法占用 7984.83 平方米现状为建设用地、未利用地的土地处以每平方米 3 元罚款，罚款金额为人民币 23954.49 元。罚款总金额为人民币陆拾玖万贰仟玖佰捌拾叁圆陆角伍分（¥692983.65）。

（6）2022 年 12 月 19 号，广州市海珠区人民政府华洲街道办事处以广州地铁集团有限公司违反《中华人民共和国土地管理法》（2019 年修正）第四十四条第一款“建设占用土地，涉及农用地转为建设用地的，应当办理农用地转用审批手续”的规定为由，对广州地铁集团作出如下处罚：1、退还非法占用的土地，2、没收非法占用土地上建筑物和其他设施，3、非法占用建设用地的 158.40 平方米处以每平方米 10 元的罚款，处罚金额共计人民币壹仟伍佰捌拾肆元。

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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	44,153.81
2	应收证券清算款	41,633.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	85,786.82

### 5.10.4 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	127032	苏行转债	969.82	0.00

### 5.10.5 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。

### 5.10.6 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	101,700,229.93
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	101,700,229.93

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瑞鑫定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商瑞鑫定期开放债券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. 报告期内华商瑞鑫定期开放债券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：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：4007008880，010-58573300

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