

华商恒益稳健混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 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贵金属投资明细	47
7.9 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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商恒益稳健混合型证券投资基金
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
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	750,278,452.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	高敏	郭明
	联系电话	010-58573600	010-66105799
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007008880	95588
传真		010-58573520	010-66105798

注册地址	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100035	100140
法定代表人	苏金奎	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-14,193,066.89
本期利润	-22,774,519.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0261
本期加权平均净值利润率	-2.64%
本期基金份额净值增长率	-0.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,206,856.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0043
期末基金资产净值	747,071,596.16
期末基金份额净值	0.9957
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	68.54%

注：1. 上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。

2. 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。

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

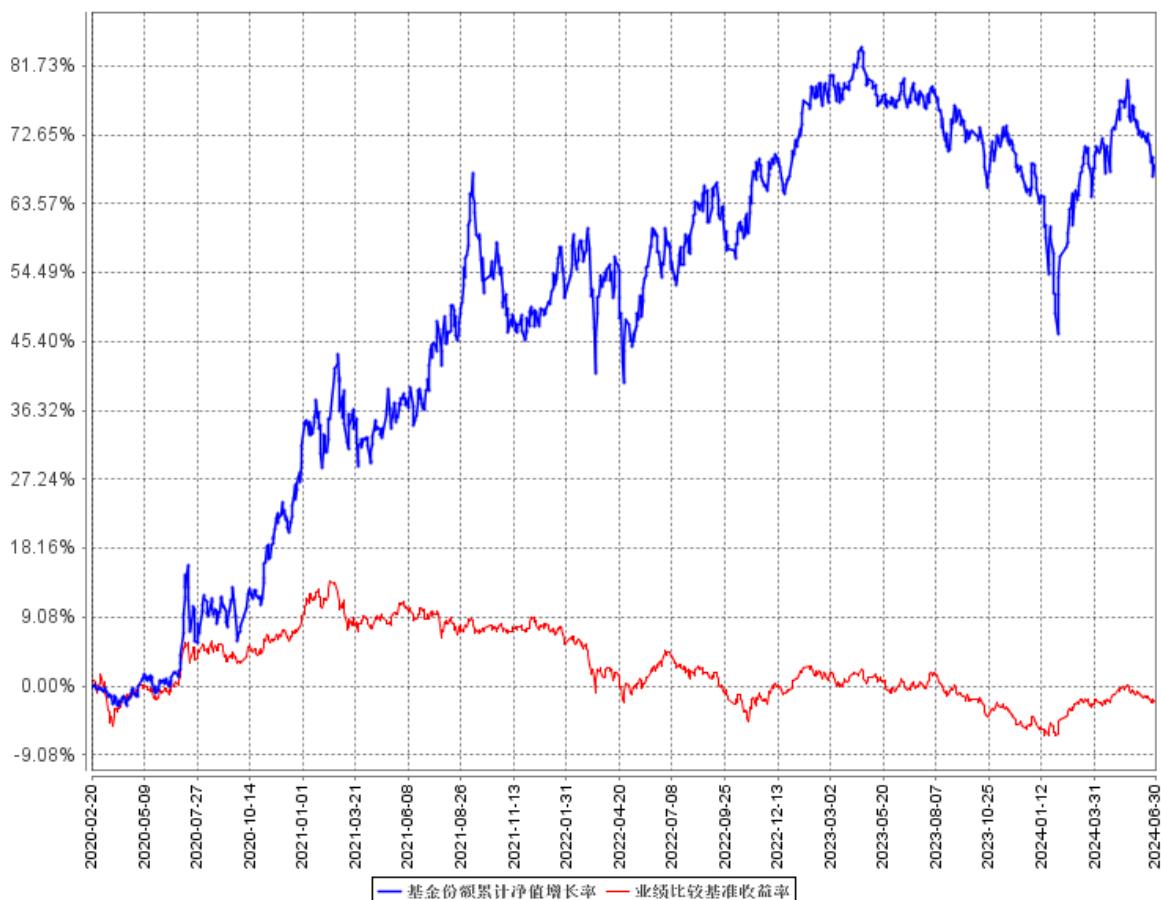
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-3.46%	0.57%	-0.82%	0.19%	-2.64%	0.38%
过去三个月	0.15%	0.78%	0.27%	0.28%	-0.12%	0.50%
过去六个月	-0.17%	0.99%	2.12%	0.34%	-2.29%	0.65%
过去一年	-5.23%	0.80%	-1.86%	0.34%	-3.37%	0.46%
过去三年	23.02%	0.90%	-10.95%	0.41%	33.97%	0.49%
自基金合同生效起至今	68.54%	0.95%	-2.01%	0.45%	70.55%	0.50%

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

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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，成立于 2005 年 12 月 20 日，注册资本为 10000 万元人民币，注册地为北京市，经营范围为基金募集，基金销售，资产管理和中国证监会许可的其他业务。

华商基金管理有限公司在主动权益、固定收益、量化投资、FOF 投资等领域全面布局，为投资者提供专业的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	16.0	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

					<p>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>
--	--	--	--	--	--

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对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

2024 年上半年，中国经济整体呈现复苏态势，修复节奏前快后慢，主要受制于房地产板块缓慢修复，消费边际动能有所弱化。海外来看，在持续限制性利率的影响下，美国经济在消费、房地产、政府支出等需求领域尽管有所降温但保持韧性。结构上，A 股市场风险偏好较低，防御性的类债券红利资产上半年表现较好，H 股能源业和原材料业领涨，资讯科技业、电讯业和公用事业涨势相对较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9957 元，份额累计净值为 1.6237 元。本报告期内本基金份额净值增长率为-0.17%，同期基金业绩比较基准的收益率为 2.12%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准的收益率 2.29 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

展望下半年，风险与机遇并存，其一，地方支出或将加速，关注实物工作量的提振，以及地方财政紧平衡下的投资情况，其二，稳地产政策持续发力，关注房地产市场是否将逐步企稳，其三，全球经济仍将处于温和复苏进程中，关注美联储降息时点、地缘政治冲突。

由于结构上并没有显著优势的方向，本基金仍将保持较为均衡的配置，主要权益持仓行业包括有色、交运、互联网、机械、电子、军工、电力设备、计算机等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期不满足分红条件，不进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——华商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商恒益稳健混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	191,385,570.25	462,069,671.86
结算备付金		10,691,549.99	10,420,612.75
存出保证金		54,715.34	53,784.41
交易性金融资产	6.4.7.2	545,449,814.82	834,317,260.53
其中：股票投资		421,061,244.20	653,108,162.06
基金投资		-	-
债券投资		124,388,570.62	181,209,098.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,223,376.27	320,898.14
应收股利		1,142,941.16	48,131.64
应收申购款		304,592.44	362,481.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		750,252,560.27	1,307,592,840.83
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		34.15	44.34
应付赎回款		2,064,792.84	13,809,991.06
应付管理人报酬		762,246.30	1,350,849.81
应付托管费		127,041.06	225,141.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,328.30	2,322.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	204,521.46	474,180.89
负债合计		3,180,964.11	15,862,529.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	750,278,452.65	1,295,091,692.92
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-3,206,856.49	-3,361,381.90
净资产合计		747,071,596.16	1,291,730,311.02
负债和净资产总计		750,252,560.27	1,307,592,840.83

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9957 元，基金份额总额 750,278,452.65 份。

6.2 利润表

会计主体：华商恒益稳健混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
一、营业总收入		-16,660,596.20	21,905,325.54
1.利息收入		381,802.45	798,603.04
其中：存款利息收入	6.4.7.10	381,802.45	672,625.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	125,977.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,459,291.44	25,945,640.32
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-18,689,008.44	21,436,471.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	4,053,008.91	-1,613.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	616,830.39	-
股利收益	6.4.7.16	4,559,877.70	4,510,782.82
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,581,452.83	-5,697,090.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	998,345.62	858,172.61
减：二、营业总支出		6,113,923.52	6,325,748.45
1. 管理人报酬		5,126,056.95	5,335,378.83
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		854,342.80	889,229.82
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		3,300.32	178.39
8. 其他费用	6.4.7.20	130,223.45	100,961.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,774,519.72	15,579,577.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,774,519.72	15,579,577.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-22,774,519.72	15,579,577.09

6.3 净资产变动表

会计主体：华商恒益稳健混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,295,091,692.92	-	-3,361,381.90	1,291,730,311.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,295,091,692.92	-	-3,361,381.90	1,291,730,311.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-544,813,240.27	-	154,525.41	-544,658,714.86
（一）、综合收益总额	-	-	-22,774,519.72	-22,774,519.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-544,813,240.27	-	22,929,045.13	-521,884,195.14
其中：1.基金申购款	200,341,572.71	-	2,812,920.12	203,154,492.83
2.基金赎回款	-745,154,812.98	-	20,116,125.01	-725,038,687.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	750,278,452.65	-	-3,206,856.49	747,071,596.16
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	359,050,749.68	-	62,884,973.99	421,935,723.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	359,050,749.68	-	62,884,973.99	421,935,723.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	928,273,981.34	-	2,193,739.54	930,467,720.88
（一）、综合收益总额	-	-	15,579,577.09	15,579,577.09
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资	928,273,981.34	-	66,289,553.08	994,563,534.42

产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,154,115,772.11	-	89,691,448.19	1,243,807,220.30
2.基金赎回款	-225,841,790.77	-	-23,401,895.11	-249,243,685.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列)	-	-	-79,675,390.63	-79,675,390.63
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,287,324,731.02	-	65,078,713.53	1,352,403,444.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 王小刚 程蕾 程蕾
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华商恒益稳健混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2382 号《关于准予华商恒益稳健混合型证券投资基金注册的批复》注册，由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字[2020]第 0105 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,308,364,693.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 705,037.95 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	191,385,570.25
等于：本金	191,366,754.24
加：应计利息	18,816.01
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	191,385,570.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	474,031,509.55	-	421,061,244.20	-52,970,265.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	131,398,886.57	993,087.82	124,388,570.62	-8,003,403.77
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	131,398,886.57	993,087.82	124,388,570.62	-8,003,403.77
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	605,430,396.12	993,087.82	545,449,814.82	-60,973,669.12	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,871.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	90,237.40
其中：交易所市场	90,237.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	111,412.26
合计	204,521.46

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	1,295,091,692.92	1,295,091,692.92
本期申购	200,341,572.71	200,341,572.71
本期赎回(以“-”号填列)	-745,154,812.98	-745,154,812.98
本期末	750,278,452.65	750,278,452.65

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期内未发生其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	134,698,960.77	-138,060,342.67	-3,361,381.90
加：会计政策变更（若有）	-	-	-

前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	134,698,960.77	-138,060,342.67	-3,361,381.90
本期利润	-14,193,066.89	-8,581,452.83	-22,774,519.72
本期基金份额交易产生的变动数	-53,959,268.80	76,888,313.93	22,929,045.13
其中：基金申购款	18,424,386.55	-15,611,466.43	2,812,920.12
基金赎回款	-72,383,655.35	92,499,780.36	20,116,125.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,546,625.08	-69,753,481.57	-3,206,856.49

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	374,225.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,160.24
其他	417.01
合计	381,802.45

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	251,613,562.75
减：卖出股票成本总额	269,866,613.57
减：交易费用	435,957.62
买卖股票差价收入	-18,689,008.44

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	933,883.12

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,119,125.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,053,008.91

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	106,904,226.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	102,233,248.05
减：应计利息总额	1,550,667.55
减：交易费用	1,185.02
买卖债券差价收入	3,119,125.79

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	636,630.16
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	1,257.14
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	18,542.63
买卖权证差价收入	616,830.39

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未发生衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,559,877.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,559,877.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,581,452.83
——股票投资	-4,771,690.98
——债券投资	-3,809,761.85
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-8,581,452.83

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	998,345.62
合计	998,345.62

注：基金赎回费收入含转换费收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	47,239.92
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	236.68
账户维护费	9,000.00
港股通证券组合费	6,675.25
银行费用	7,399.26
其他	-
合计	130,223.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,126,056.95	5,335,378.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,514,703.25	1,442,158.22
应支付基金管理人的净管理费	3,611,353.70	3,893,220.61

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	854,342.80	889,229.82

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	191,385,570.25	374,225.20	424,431,362.28	656,697.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	664	4,782.36	4,491.96	-	
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	1303	3,772.60	3,296.80	-	
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	1732	2,045.54	2,638.25	-	

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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风险和中高预期收益产品。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括四个层次：(1) 公司一级风险防范由董事会构成。董事会根据公司章程和《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定履行风险管理职责。董事会下设专业委员会，各专业委员会根据董事会授权和相关议事规则履行相应风险管理和监督职责。(2) 公司二级风险防范由公司管理层构成。公司管理层负责在决策和执行过程中全面把控各类风险，并根据董事会的决议和《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定履行风险管理职责。各高级管理人员负责监督分管业务条线的员工的风险控制质量和执行情况，评价分管业务条线的风险管理水平和效果。(3) 公司的三级风险防范由风险管理小组等职能机构构成。风险管理小组对公司经营过程和基金运作过程中的重大风险进行分析、评估，全面、及时防范公司在经营过程和基金运作过程中面临的各种风险；其他职能机构(如各级投资决策委员会等)在职能范围内依据各职能机构的议事规则对相关业务进行集体决策和风险控制。(4) 公司四级风险防范由公司各部门及公司员工构成。公司各部门及公司员工对自身业务工作中的风险进行自我检查和控制，并根据公司经营计划、部门或岗位职责以及《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定承担相应风险管理责任。各部门、岗位之间相互监督、制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产

净值的比例为 10.69%(2023 年 12 月 31 日: 8.51%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日, 本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.002%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	191,385,570.25	-	-	-	191,385,570.25
结算备付金	10,691,549.99	-	-	-	10,691,549.99
存出保证金	54,715.34	-	-	-	54,715.34
交易性金融资产	60,877,828.60	63,510,742.02	-	421,061,244.20	545,449,814.82

应收清算款	-	-	-	1,223,376.27	1,223,376.27
应收股利	-	-	-	1,142,941.16	1,142,941.16
应收申购款	-	-	-	304,592.44	304,592.44
资产总计	263,009,664.18	63,510,742.02	-	423,732,154.07	750,252,560.27
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	34.15	34.15
应付赎回款	-	-	-	2,064,792.84	2,064,792.84
应付管理人报酬	-	-	-	762,246.30	762,246.30
应付托管费	-	-	-	127,041.06	127,041.06
应交税费	-	-	-	22,328.30	22,328.30
其他负债	-	-	-	204,521.46	204,521.46
负债总计	-	-	-	3,180,964.11	3,180,964.11
利率敏感度缺口	263,009,664.18	63,510,742.02	-	420,551,189.96	747,071,596.16
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	462,069,671.86	-	-	-	462,069,671.86
结算备付金	10,420,612.75	-	-	-	10,420,612.75
存出保证金	53,784.41	-	-	-	53,784.41
交易性金融资产	83,907,651.28	88,351,724.28	8,949,722.91	653,108,162.06	834,317,260.53
应收清算款	-	-	-	320,898.14	320,898.14
应收股利	-	-	-	48,131.64	48,131.64
应收申购款	-	-	-	362,481.50	362,481.50
资产总计	556,451,720.30	88,351,724.28	8,949,722.91	653,839,673.34	1,307,592,840.83
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	44.34	44.34
应付赎回款	-	-	-	13,809,991.06	13,809,991.06
应付管理人报酬	-	-	-	1,350,849.81	1,350,849.81
应付托管费	-	-	-	225,141.60	225,141.60
应交税费	-	-	-	2,322.11	2,322.11
其他负债	-	-	-	474,180.89	474,180.89
负债总计	-	-	-	15,862,529.81	15,862,529.81
利率敏感度缺口	556,451,720.30	88,351,724.28	8,949,722.91	637,977,143.53	1,291,730,311.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 16.65%(2023 年 12 月 31 日：14.03%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	150,007,395.02	-	150,007,395.02
应收股利	-	1,142,941.16	-	1,142,941.16
资产合计	-	151,150,336.18	-	151,150,336.18
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	151,150,336.18	-	151,150,336.18
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	202,278,551.98	-	202,278,551.98
应收股利	-	48,131.64	-	48,131.64
资产合计	-	202,326,683.62	-	202,326,683.62
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	202,326,683.62	-	202,326,683.62

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变
----	------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	7,557,516.81	10,116,334.18
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-7,557,516.81	-10,116,334.18	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 20%-60%，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	421,061,244.20	56.36	653,108,162.06	50.56
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	421,061,244.20	56.36	653,108,162.06	50.56
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	31,948,563.15	33,234,691.92
2. 沪深 300 指数下降 5%	-31,948,563.15	-33,234,691.92	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	500,874,647.55	758,388,611.99
第二层次	44,554,965.54	75,091,214.59
第三层次	20,201.73	837,433.95
合计	545,449,814.82	834,317,260.53

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公

允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	421,061,244.20	56.12
	其中：股票	421,061,244.20	56.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	124,388,570.62	16.58
	其中：债券	124,388,570.62	16.58
	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	202,077,120.24	26.93
8	其他各项资产	2,725,625.21	0.36
9	合计	750,252,560.27	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 150,007,395.02 元，占净值比例 20.08%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	46,885,596.30	6.28
C	制造业	166,403,164.89	22.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供	5,265,066.00	0.70

	应业		
E	建筑业	2,385,351.00	0.32
F	批发和零售业	3,714,916.70	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	10,083,645.20	1.35
H	住宿和餐饮业	476,955.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,102,271.58	2.56
J	金融业	387,438.00	0.05
K	房地产业	121,275.00	0.02
L	租赁和商务服务业	7,155,164.12	0.96
M	科学研究和技术服务业	8,521,588.99	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	551,416.40	0.07
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	271,053,849.18	36.28

7.2.2 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	58,600,204.00	7.84
B 消费者非必需品	41,784,613.21	5.59
C 消费者常用品	-	-
D 能源	16,920,911.97	2.26
E 金融	-	-
F 医疗保健	12,625,056.23	1.69
G 工业	10,186,787.23	1.36
H 信息技术	6,840,330.33	0.92
I 电信服务	-	-
J 公用事业	3,049,492.05	0.41
K 房地产	-	-
合计	150,007,395.02	20.08

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	02899	紫金矿业	1,203,291	18,098,659.50	2.42

1	601899	紫金矿业	528,600	9,287,502.00	1.24
2	00883	中国海洋石油	757,670	15,489,829.73	2.07
3	01055	中国南方航空股份	5,332,000	14,209,916.50	1.90
3	600029	南方航空	142,200	837,558.00	0.11
4	03993	洛阳钼业	1,719,000	11,201,924.01	1.50
4	603993	洛阳钼业	53,400	453,900.00	0.06
5	01208	五矿资源	4,052,000	11,020,574.49	1.48
6	603979	金诚信	198,200	10,015,046.00	1.34
7	00753	中国国航	2,864,000	9,488,513.34	1.27
7	601111	中国国航	33,000	243,540.00	0.03
8	000528	柳工	818,900	9,163,491.00	1.23
9	000807	云铝股份	645,400	8,719,354.00	1.17
10	03690	美团-W	84,100	8,527,634.71	1.14
11	01258	中国有色矿业	1,296,000	8,055,094.64	1.08
12	01818	招金矿业	520,500	6,223,154.21	0.83
13	000960	锡业股份	398,200	6,168,118.00	0.83
14	600415	小商品城	790,600	5,866,252.00	0.79
15	02273	固生堂	169,400	5,797,799.70	0.78
16	000426	兴业银锡	393,300	5,341,014.00	0.71
17	603871	嘉友国际	296,688	5,248,410.72	0.70
18	09992	泡泡玛特	139,600	4,873,437.40	0.65
19	000425	徐工机械	679,200	4,856,280.00	0.65
20	000625	长安汽车	357,600	4,802,568.00	0.64
21	688100	威胜信息	124,900	4,764,935.00	0.64
22	002155	湖南黄金	255,400	4,622,740.00	0.62
23	601100	恒立液压	87,300	4,066,434.00	0.54
24	600985	淮北矿业	241,300	4,039,362.00	0.54
25	600399	抚顺特钢	710,600	4,000,678.00	0.54
26	000933	神火股份	187,400	3,791,102.00	0.51
27	600710	苏美达	455,818	3,714,916.70	0.50
28	09626	哔哩哔哩-W	31,660	3,666,832.45	0.49
29	603393	新天然气	103,300	3,588,642.00	0.48
30	300036	超图软件	246,800	3,445,328.00	0.46
31	000983	山西焦煤	332,230	3,425,291.30	0.46
32	09669	北森控股	890,800	3,308,972.45	0.44
33	600862	中航高科	170,400	3,200,112.00	0.43
34	01548	金斯瑞生物科技	414,298	3,145,970.87	0.42
35	002706	良信股份	446,000	3,059,560.00	0.41
36	02380	中国电力	825,000	3,049,492.05	0.41

37	02382	舜宇光学科技	69,163	3,045,717.89	0.41
38	002138	顺络电子	109,200	2,998,632.00	0.40
39	688486	龙迅股份	51,220	2,934,906.00	0.39
40	603885	吉祥航空	264,900	2,911,251.00	0.39
41	02600	中国铝业	376,000	1,829,083.73	0.24
41	601600	中国铝业	121,800	929,334.00	0.12
42	002149	西部材料	191,900	2,678,924.00	0.36
43	300203	聚光科技	264,200	2,665,778.00	0.36
44	603225	新凤鸣	168,800	2,631,592.00	0.35
45	600765	中航重机	120,800	2,464,320.00	0.33
46	600031	三一重工	147,600	2,435,400.00	0.33
47	002859	洁美科技	117,400	2,357,392.00	0.32
48	600879	航天电子	291,100	2,261,847.00	0.30
49	300496	中科创达	49,030	2,235,277.70	0.30
50	688776	国光电气	38,573	2,136,944.20	0.29
51	02367	巨子生物	50,000	2,092,318.90	0.28
52	300017	网宿科技	264,100	2,086,390.00	0.28
53	00390	中国中铁	525,000	2,065,166.67	0.28
54	600988	赤峰黄金	125,900	2,057,206.00	0.28
55	300161	华中数控	91,400	2,055,586.00	0.28
56	688337	普源精电	79,416	2,002,871.52	0.27
57	688116	天奈科技	85,651	1,976,825.08	0.26
58	601179	中国西电	242,600	1,950,504.00	0.26
59	600497	驰宏锌锗	364,300	1,945,362.00	0.26
60	688131	皓元医药	96,975	1,855,131.75	0.25
61	301319	唯特偶	61,625	1,850,598.75	0.25
62	688507	索辰科技	37,334	1,814,432.40	0.24
63	300818	耐普矿机	69,370	1,768,935.00	0.24
64	688300	联瑞新材	36,556	1,758,343.60	0.24
65	601689	拓普集团	32,500	1,742,325.00	0.23
66	601611	中国核建	215,100	1,740,159.00	0.23
67	301220	亚香股份	66,900	1,707,288.00	0.23
68	300260	新莱应材	80,700	1,689,858.00	0.23
69	002444	巨星科技	67,600	1,669,720.00	0.22
70	688372	伟测科技	41,927	1,648,988.91	0.22
71	00189	东岳集团	212,000	1,642,714.48	0.22
72	00751	创维集团	576,000	1,619,167.33	0.22
73	000923	河钢资源	93,400	1,608,348.00	0.22
74	00667	中国东方教育	766,500	1,581,026.44	0.21

75	600885	宏发股份	54,200	1,500,256.00	0.20
76	00670	中国东方航空股份	830,000	1,484,747.82	0.20
77	603583	捷昌驱动	71,500	1,457,170.00	0.20
78	688385	复旦微电	46,285	1,452,423.30	0.19
79	00639	首钢资源	490,000	1,431,082.24	0.19
80	301095	广立微	34,100	1,402,192.00	0.19
81	000975	银泰黄金	84,800	1,381,392.00	0.18
82	601020	华钰矿业	107,900	1,381,120.00	0.18
83	002791	坚朗五金	52,900	1,368,523.00	0.18
84	603055	台华新材	127,700	1,293,601.00	0.17
85	688083	中望软件	17,700	1,285,374.00	0.17
86	600989	宝丰能源	73,300	1,270,289.00	0.17
87	688332	中科蓝讯	21,115	1,245,573.85	0.17
88	300938	信测标准	62,640	1,245,283.20	0.17
89	688179	阿拉丁	128,545	1,243,030.15	0.17
90	300001	特锐德	59,900	1,205,188.00	0.16
91	603896	寿仙谷	51,200	1,201,664.00	0.16
92	301029	怡合达	58,800	1,156,008.00	0.15
93	688037	芯源微	12,818	1,140,802.00	0.15
94	300395	菲利华	36,100	1,110,075.00	0.15
95	300593	新雷能	111,300	1,106,322.00	0.15
96	688012	中微公司	7,794	1,100,980.44	0.15
97	002372	伟星新材	71,000	1,094,820.00	0.15
98	02285	泉峰控股	64,900	1,078,039.36	0.14
99	002422	科伦药业	35,500	1,076,715.00	0.14
100	688548	广钢气体	117,830	1,075,787.90	0.14
101	688033	天宜上佳	178,726	1,072,356.00	0.14
102	688239	航宇科技	29,834	1,038,223.20	0.14
103	688103	国力股份	29,774	1,034,944.24	0.14
104	301031	中熔电气	12,500	1,027,500.00	0.14
105	002025	航天电器	22,000	1,020,360.00	0.14
106	01357	美图公司	422,000	1,016,798.53	0.14
107	688311	盟升电子	48,796	999,830.04	0.13
108	688133	泰坦科技	63,041	994,786.98	0.13
109	605123	派克新材	17,000	955,060.00	0.13
110	688200	华峰测控	10,348	949,429.00	0.13
111	600301	华锡有色	46,600	942,252.00	0.13
112	603489	八方股份	34,760	937,824.80	0.13
113	689009	九号公司	25,178	926,802.18	0.12

114	600584	长电科技	29,000	919,590.00	0.12
115	300491	通合科技	62,700	900,372.00	0.12
116	301162	国能日新	20,660	899,949.60	0.12
117	301080	百普赛斯	25,350	887,250.00	0.12
118	688719	爱科赛博	33,979	885,832.53	0.12
119	603915	国茂股份	86,000	884,940.00	0.12
120	688777	中控技术	23,343	880,031.10	0.12
121	603105	芯能科技	99,700	877,360.00	0.12
122	300866	安克创新	12,220	870,186.20	0.12
123	01888	建滔积层板	112,500	862,482.60	0.12
124	300286	安科瑞	39,200	848,288.00	0.11
125	601888	中国中免	13,500	843,615.00	0.11
126	603638	艾迪精密	59,600	836,188.00	0.11
127	688019	安集科技	6,639	835,186.20	0.11
128	002430	杭氧股份	37,400	832,150.00	0.11
129	01951	锦欣生殖	317,000	804,308.38	0.11
130	02269	药明生物	74,500	784,658.38	0.11
131	00020	商汤-W	614,000	739,708.89	0.10
132	600388	龙净环保	62,100	720,981.00	0.10
133	002850	科达利	9,300	710,334.00	0.10
134	688333	铂力特	14,394	697,389.30	0.09
135	688192	迪哲医药	18,904	696,423.36	0.09
136	01882	海天国际	34,000	688,890.86	0.09
137	688232	新点软件	34,864	687,518.08	0.09
138	300308	中际旭创	4,900	675,612.00	0.09
139	002273	水晶光电	39,300	667,314.00	0.09
140	300604	长川科技	24,300	660,231.00	0.09
141	002452	长高电新	78,100	646,668.00	0.09
142	601117	中国化学	78,300	645,192.00	0.09
143	688290	景业智能	19,558	627,811.80	0.08
144	605128	上海沿浦	22,200	619,158.00	0.08
145	002484	江海股份	46,100	610,825.00	0.08
146	603209	兴通股份	43,580	603,147.20	0.08
147	688322	奥比中光	22,451	599,666.21	0.08
148	300633	开立医疗	14,900	589,742.00	0.08
149	600114	东睦股份	40,900	588,551.00	0.08
150	603169	兰石重装	130,300	586,350.00	0.08
151	300257	开山股份	57,700	582,770.00	0.08
152	301050	雷电微力	12,000	577,920.00	0.08

153	603186	华正新材	24,000	570,720.00	0.08
154	688376	美埃科技	18,122	568,305.92	0.08
155	002609	捷顺科技	73,600	557,888.00	0.07
156	000792	盐湖股份	31,900	556,655.00	0.07
157	00268	金蝶国际	83,000	554,507.86	0.07
158	603997	继峰股份	53,200	544,236.00	0.07
159	001218	丽臣实业	35,500	531,435.00	0.07
160	688326	经纬恒润	9,245	530,015.85	0.07
161	603556	海兴电力	11,300	529,179.00	0.07
162	00358	江西铜业股份	37,000	526,123.51	0.07
163	600206	有研新材	59,000	525,100.00	0.07
164	002415	海康威视	16,300	503,833.00	0.07
165	000408	藏格矿业	20,800	500,656.00	0.07
166	000060	中金岭南	115,600	490,144.00	0.07
167	688262	国芯科技	25,992	473,314.32	0.06
168	688089	嘉必优	35,101	464,737.24	0.06
169	002384	东山精密	21,800	451,260.00	0.06
170	603977	国泰集团	43,800	445,446.00	0.06
171	688293	奥浦迈	14,088	440,531.76	0.06
172	688981	中芯国际	9,423	434,400.30	0.06
173	000803	山高环能	122,560	427,734.40	0.06
174	688768	容知日新	18,187	425,757.67	0.06
175	688007	光峰科技	26,167	421,288.70	0.06
176	688270	臻镭科技	15,893	414,807.30	0.06
177	300767	震安科技	48,700	412,976.00	0.06
178	601985	中国核电	38,000	405,080.00	0.05
179	600150	中国船舶	9,900	403,029.00	0.05
180	688308	欧科亿	20,708	402,149.36	0.05
181	002028	思源电气	6,000	401,400.00	0.05
182	600886	国投电力	21,600	393,984.00	0.05
183	601101	昊华能源	41,900	385,061.00	0.05
184	603986	兆易创新	4,000	382,480.00	0.05
185	688639	华恒生物	4,330	330,768.70	0.04
186	688439	振华风光	4,924	327,199.80	0.04
187	600754	锦江酒店	13,500	310,230.00	0.04
188	688072	拓荆科技	2,529	303,758.19	0.04
189	688661	和林微纳	9,775	299,603.75	0.04
190	002292	奥飞娱乐	49,200	294,216.00	0.04
191	300280	紫天科技	19,000	289,560.00	0.04

192	603486	科沃斯	5,800	273,644.00	0.04
193	300360	炬华科技	14,100	239,700.00	0.03
194	603712	七一二	13,100	238,289.00	0.03
195	300842	帝科股份	6,020	233,576.00	0.03
196	600893	航发动力	6,300	230,265.00	0.03
197	000582	北部湾港	30,600	227,664.00	0.03
198	300700	岱勒新材	29,260	227,642.80	0.03
199	600118	中国卫星	9,900	220,077.00	0.03
200	688618	三旺通信	8,575	214,632.25	0.03
201	688281	华秦科技	2,537	211,382.84	0.03
202	000519	中兵红箭	13,900	203,913.00	0.03
203	688052	纳芯微	1,966	202,065.48	0.03
204	601336	新华保险	6,600	198,198.00	0.03
205	688682	霍莱沃	6,735	197,604.90	0.03
206	601226	华电重工	39,000	191,100.00	0.03
207	600958	东方证券	24,900	189,240.00	0.03
208	301266	宇邦新材	5,600	171,584.00	0.02
209	600809	山西汾酒	800	168,704.00	0.02
210	600258	首旅酒店	13,500	166,725.00	0.02
211	603369	今世缘	3,400	157,080.00	0.02
212	002027	分众传媒	25,300	153,318.00	0.02
213	603659	璞泰来	10,500	148,365.00	0.02
214	300896	爱美客	840	144,564.00	0.02
215	002335	科华数据	6,600	139,458.00	0.02
216	002738	中矿资源	4,900	131,320.00	0.02
217	600600	青岛啤酒	1,700	123,709.00	0.02
218	600475	华光环能	14,200	123,682.00	0.02
219	000002	万科 A	17,500	121,275.00	0.02
220	000568	泸州老窖	800	114,792.00	0.02
221	002756	永兴材料	3,100	110,918.00	0.01
222	002865	钧达股份	2,600	99,788.00	0.01
223	600702	舍得酒业	1,400	79,338.00	0.01
224	300129	泰胜风能	6,500	44,330.00	0.01
225	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
226	301559	中集环科	1,315	19,159.55	0.00
227	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
228	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
229	601083	锦江航运	1,263	12,074.28	0.00
230	301517	陕西华达	185	9,990.00	0.00

231	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
232	301489	思泉新材	128	9,034.24	0.00
233	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
234	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
235	301500	飞南资源	455	7,939.75	0.00
236	301568	思泰克	246	7,827.72	0.00
237	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
238	301555	惠柏新材	224	6,345.92	0.00
239	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
240	603193	润本股份	303	5,572.17	0.00
241	001378	德冠新材	205	4,891.30	0.00
242	603107	上海汽配	292	4,639.88	0.00
243	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
244	603062	麦加芯彩	126	4,184.46	0.00
245	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
246	001306	夏厦精密	64	3,455.36	0.00
247	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
248	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
249	01772	赣锋锂业	207	2,875.43	0.00
250	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
251	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
252	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
253	603276	恒兴新材	174	2,425.56	0.00
254	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
255	02331	李宁	11	169.67	0.00

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300017	网宿科技	2,527,892.00	0.20
2	301095	广立微	2,442,389.00	0.19
3	600765	中航重机	2,334,753.00	0.18
4	00390	中国中铁	2,028,947.65	0.16
5	688300	联瑞新材	1,789,832.99	0.14
6	601611	中国核建	1,772,700.00	0.14

7	601179	中国西电	1,761,934.00	0.14
8	00189	东岳集团	1,638,519.15	0.13
9	000792	盐湖股份	1,306,979.00	0.10
10	601888	中国中免	1,305,784.00	0.10
11	300496	中科创达	1,217,406.00	0.09
12	688239	航宇科技	1,163,829.32	0.09
13	688548	广钢气体	1,155,963.90	0.09
14	688037	芯源微	1,122,362.99	0.09
15	688012	中微公司	1,115,434.22	0.09
16	688200	华峰测控	879,532.34	0.07
17	688019	安集科技	870,333.14	0.07
18	688259	创耀科技	868,214.88	0.07
19	688192	迪哲医药	837,232.77	0.06
20	01888	建滔积层板	775,400.30	0.06

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00883	中国海洋石油	30,111,791.83	2.33
2	00293	国泰航空	11,743,388.88	0.91
3	300750	宁德时代	9,835,911.00	0.76
4	000630	铜陵有色	9,470,740.00	0.73
5	01801	信达生物	5,417,803.70	0.42
6	09926	康方生物	5,130,570.84	0.40
7	01658	邮储银行	4,454,600.10	0.34
8	600584	长电科技	4,317,237.00	0.33
9	300257	开山股份	4,131,311.00	0.32
10	601666	平煤股份	3,419,829.00	0.26
11	06160	百济神州	3,281,666.47	0.25
12	603979	金诚信	3,137,621.00	0.24
13	000680	山推股份	3,019,216.00	0.23
14	600989	宝丰能源	3,003,865.00	0.23
15	603688	石英股份	2,876,277.00	0.22
16	02096	先声药业	2,823,155.94	0.22
17	600985	淮北矿业	2,761,763.00	0.21

18	01766	中国中车	2,709,440.60	0.21
19	300454	深信服	2,706,021.00	0.21
20	09992	泡泡玛特	2,555,260.51	0.20

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,591,386.69
卖出股票收入（成交）总额	251,613,562.75

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	44,554,965.54	5.96
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）	79,833,605.08	10.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,388,570.62	16.65

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019727	23 国债 24	382,000	38,894,873.70	5.21
2	128048	张行转债	77,240	8,458,753.44	1.13
3	019733	24 国债 02	56,000	5,660,091.84	0.76
4	113044	大秦转债	42,650	5,129,306.34	0.69
5	118028	会通转债	39,700	4,576,490.92	0.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金投资的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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,715.34
2	应收清算款	1,223,376.27
3	应收股利	1,142,941.16
4	应收利息	-

5	应收申购款	304,592.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,725,625.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128048	张行转债	8,458,753.44	1.13
2	113044	大秦转债	5,129,306.34	0.69
3	118028	会通转债	4,576,490.92	0.61
4	127039	北港转债	4,301,358.28	0.58
5	123048	应急转债	4,147,210.70	0.56
6	111011	冠盛转债	3,764,309.57	0.50
7	113519	长久转债	3,716,898.92	0.50
8	127078	优彩转债	3,694,347.22	0.49
9	128132	交建转债	3,683,001.53	0.49
10	113049	长汽转债	3,564,401.48	0.48
11	110075	南航转债	3,384,766.94	0.45
12	128121	宏川转债	3,166,105.98	0.42
13	111000	起帆转债	3,000,794.41	0.40
14	127050	麒麟转债	2,953,663.66	0.40
15	123142	申昊转债	2,808,960.84	0.38
16	127074	麦米转 2	2,715,871.52	0.36
17	113634	珀莱转债	2,664,608.51	0.36
18	128081	海亮转债	2,301,408.77	0.31
19	113641	华友转债	2,262,714.41	0.30
20	127069	小熊转债	2,248,544.13	0.30
21	127027	能化转债	2,111,376.54	0.28
22	118014	高测转债	1,997,479.91	0.27
23	113053	隆 22 转债	1,370,577.30	0.18
24	118031	天 23 转债	1,212,637.10	0.16
25	127084	柳工转 2	598,016.66	0.08

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
25,203	29,769.41	364,466,028.24	48.58%	385,812,424.41	51.42%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	462,615.86	0.0617%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年2月20日）基金份额总额	2,308,364,693.03
本报告期期初基金份额总额	1,295,091,692.92
本报告期基金总申购份额	200,341,572.71
减：本报告期基金总赎回份额	745,154,812.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	750,278,452.65

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2024 年 6 月 22 日，本基金管理人发布公告，苏金奎先生自 2024 年 6 月 21 日起担任公司董事长，陈牧原先生自 2024 年 6 月 21 日起不再担任公司董事长。

2024 年 6 月 22 日，本基金管理人发布公告，因董事会换届，董事会成员调整变动，本基金管理人的董事在该公告日的最近 12 个月变更超过百分之五十。

本基金本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	142,449,066.42	48.44%	99,402.25	40.93%	-
第一创业证券	1	38,829,488.08	13.20%	36,728.68	15.12%	-
中信建投证券	1	34,878,285.04	11.86%	32,991.44	13.58%	-
广发证券	2	31,667,983.01	10.77%	29,973.51	12.34%	-

首创证券	1	24,303,504.28	8.26%	22,988.95	9.47%	-
华泰证券	1	21,970,733.69	7.47%	20,782.16	8.56%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序：

1) 在资质上，要求证券公司财务状况良好，经营行为规范，具备较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；

2) 证券公司从基本情况、研究服务能力、综合服务能力等维度接受本基金管理人进行的服务评价；

3) 对于按照前述标准进行评价后达到本基金管理人要求的证券公司，本基金管理人可向其租用交易单元；

4) 租用交易单元前，本基金管理人将与证券公司签订交易单元租用协议，协议内容包括但不限于双方的权利义务、服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

2. 本报告期内本基金无新增交易单元, 无减少交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	10,626,139.77	12.48%	-	-	636,630.16	100.00%
第一创业证券	17,535,618.25	20.59%	-	-	-	-
中信建投证券	796,530.21	0.94%	-	-	-	-
广发证券	15,407,693.37	18.10%	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	40,781,745.00	47.90%	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 22 日
2	华商基金管理有限公司旗下基金	公司网站、上海证券报、	2024 年 1 月 22 日

	2023 年第四季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、 证券日报	
3	华商基金管理有限公司关于华商恒益稳健混合型证券投资基金暂停机构客户大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 中国证券报	2024 年 1 月 26 日
4	华商基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 2 月 2 日
5	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海大智慧基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 3 月 7 日
6	华商基金管理有限公司关于华商恒益稳健混合型证券投资基金恢复机构客户大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 中国证券报	2024 年 3 月 18 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华福证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 3 月 20 日
8	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司申购费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 3 月 28 日
9	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2023 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
10	华商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 3 月 29 日
11	华商基金管理有限公司关于调整旗下基金定期定额投资起点金额的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 4 月 2 日
12	华商基金管理有限公司关于调整旗下基金最低转换份额限制的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2024 年 4 月 2 日
13	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
14	华商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	公司网站、上海证券报、 中国证券报、证券时报、	2024 年 4 月 22 日

		证券日报	
15	华商基金管理有限公司关于暂停浙江稠州商业银行股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024 年 6 月 20 日
16	华商恒益稳健混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 20 日
17	华商基金管理有限公司关于董事变更的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024 年 6 月 22 日
18	华商基金管理有限公司关于董事长变更的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024 年 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

基金管理人地址：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

2024 年 8 月 30 日