

华商甄选回报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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息	58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§ 9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商甄选回报混合型证券投资基金	
基金简称	华商甄选回报混合	
基金主代码	010761	
交易代码	010761	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 19 日	
基金管理人	华商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,298,804,840.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C
下属分级基金的交易代码:	010761	016049
报告期末下属分级基金的份额总额	5,090,894,803.18 份	2,207,910,037.70 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力求为基金份额持有人获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 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×70%+中证全债指数收益率×20%+ 中证港股通综合指数收益率×10%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏
	联系电话	010-58573600
	电子邮箱	gaom@hsfund.com
客户服务电话	4007008880	95566
传真	010-58573520	010-66594942
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 1 号
办公地址	北京市西城区平安里西大	北京市西城区复兴门内大街 1

	街 28 号楼 19 层	号
邮政编码	100035	100818
法定代表人	苏金奎	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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住所

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

基金级别	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C
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)	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-34,464,061.88	-18,830,064.25
本期利润	377,048,402.01	37,893,916.62
加权平均基金份额本期利润	0.0723	0.0218
本期加权平均净值利润率	5.57%	1.69%
本期基金份额净值增长率	5.82%	5.45%
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	1,644,578,752.69	679,783,475.36
期末可供分配基金份额利润	0.3230	0.3079
期末基金资产净值	6,791,524,731.01	2,910,332,192.56
期末基金份额净值	1.3341	1.3181
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	33.41%	13.02%

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

华商甄选回报混合 A

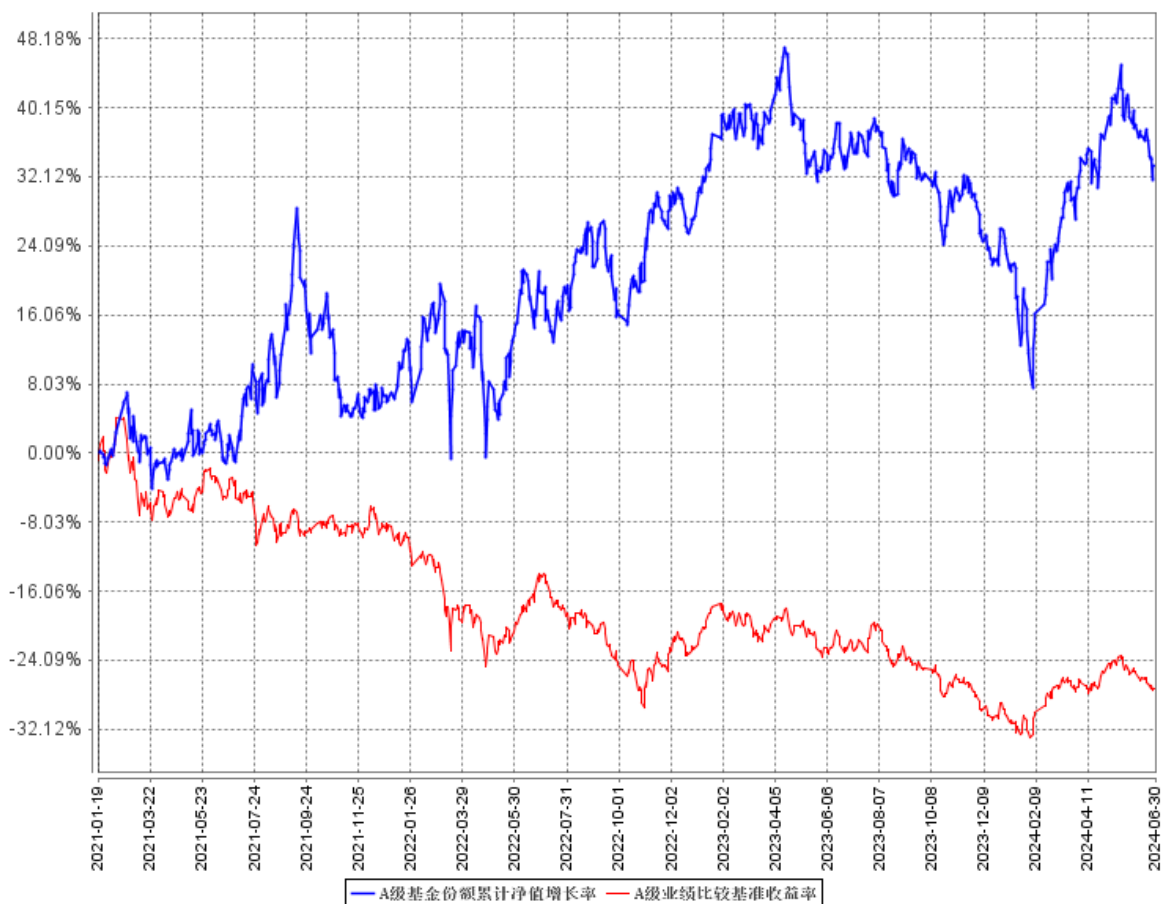
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.09%	0.83%	-2.30%	0.37%	-1.79%	0.46%
过去三个月	1.89%	1.06%	-0.31%	0.59%	2.20%	0.47%
过去六个月	5.82%	1.25%	2.24%	0.71%	3.58%	0.54%
过去一年	-0.85%	1.05%	-6.21%	0.69%	5.36%	0.36%
过去三年	33.87%	1.29%	-24.90%	0.84%	58.77%	0.45%
自基金合同生效起至今	33.41%	1.28%	-27.39%	0.86%	60.80%	0.42%

华商甄选回报混合 C

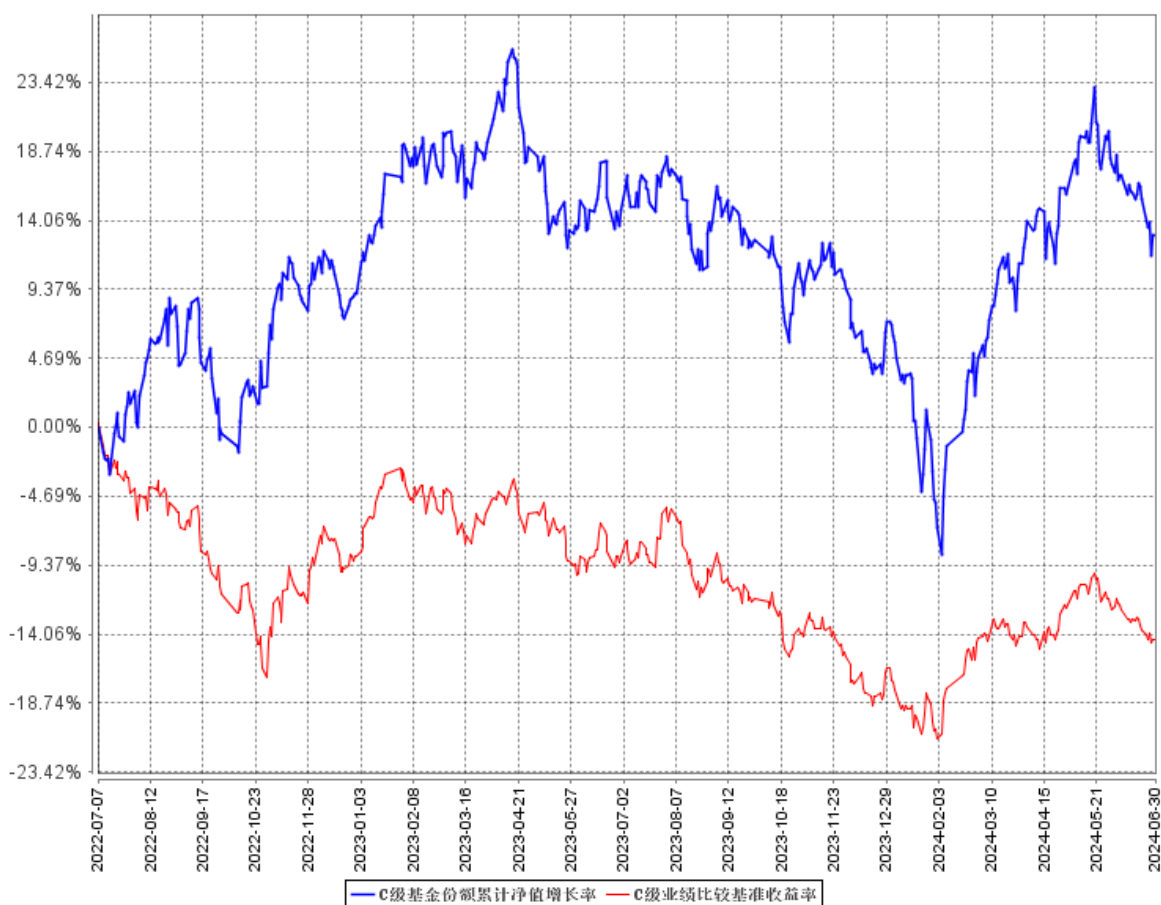
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.14%	0.82%	-2.30%	0.37%	-1.84%	0.45%
过去三个月	1.68%	1.06%	-0.31%	0.59%	1.99%	0.47%
过去六个月	5.45%	1.25%	2.24%	0.71%	3.21%	0.54%
过去一年	-1.50%	1.05%	-6.21%	0.69%	4.71%	0.36%
自基金合同生效起至今	13.02%	1.03%	-14.45%	0.75%	27.47%	0.28%

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

A级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



C级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 2021 年 1 月 19 日。本基金从 2022 年 7 月 7 日起新增 C 类份额。

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		

<p>周海栋</p>	<p>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</p>	<p>2021 年 1 月 19 日</p>	<p>-</p>	<p>16.0</p>	<p>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 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</p>
------------	---	------------------------	----------	-------------	---

					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。
孙蔚	基金经理	2023 年 12 月 29 日	-	8.2	女，中国籍，理学硕士，具有基金从业资格。2013 年 3 月至 2013 年 6 月，就职于阿克苏诺贝尔公司（Akzo Nobel N.V），任财务分析；2013 年 6 月至 2015 年 12 月，就职于普华永道咨询（深圳）有限公司，任高级顾问；2016 年 1 月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2021 年 12 月 2 日至 2023 年 1 月 3 日担任基金经理助理；2023 年 1 月 4 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；2023 年 1 月 10 日起至今担任华商医药消费精选混合型证券投资基金的基金经理；2023 年 12 月 29 日起至今担任华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2023 年 12 月 29 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。
崔志鹏	基金经理	2024 年 1 月 3 日	-	6.9	男，中国籍，金融硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入华商基金管理

					有限公司，曾任行业研究员；2021 年 12 月 2 日至 2024 年 1 月 2 日任基金经理助理；2024 年 1 月 3 日起至今担任华商消费行业股票型证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月 3 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。
--	--	--	--	--	--

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，通过交易系统内的公平交易程序，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，上半年全球制造业 PMI 持续处于扩张区间，美欧开启补库周期，推升全球制造业回暖预期。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，华商甄选回报混合型证券投资基金 A 类份额净值为 1.3341 元，份额累计净值为 1.3341 元。本报告期内本基金份额净值增长率为 5.82%，同期基金业绩比较基准的收益率为 2.24%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 3.58 个百分点。

截至 2024 年 6 月 30 日，华商甄选回报混合型证券投资基金 C 类份额净值为 1.3181 元，份额累计净值为 1.3181 元。本报告期内本基金份额净值增长率为 5.45%，同期基金业绩比较基准的收益率为 2.24%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 3.21 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，主要持仓行业包括有色、交运、互联网、电子、机械、电力设备、军工、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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华商甄选回报混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：华商甄选回报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	644,662,341.22	805,215,708.28
结算备付金		12,967,289.35	13,850,133.71
存出保证金		345,186.27	482,768.72
交易性金融资产	6.4.7.2	8,654,455,466.94	8,088,588,373.46
其中：股票投资		8,114,010,628.42	7,559,405,937.63
基金投资		-	-
债券投资		540,444,838.52	529,182,435.83
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	400,098,630.14	-
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		2,521,354.45	13,249,924.03
应收股利		21,499,045.65	494,847.11
应收申购款		10,755,752.30	45,455,357.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		9,747,305,066.32	8,967,337,112.95
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		9,287,611.43	553.87
应付赎回款		20,863,026.28	152,669,752.77
应付管理人报酬		9,785,008.02	9,063,166.39
应付托管费		1,630,834.67	1,510,527.75
应付销售服务费		1,454,349.89	1,117,768.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		135,925.53	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,291,386.93	2,629,200.36
负债合计		45,448,142.75	166,990,969.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,298,804,840.88	6,995,304,073.20
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	2,403,052,082.69	1,805,042,070.60
净资产合计		9,701,856,923.57	8,800,346,143.80
负债和净资产总计		9,747,305,066.32	8,967,337,112.95

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，华商甄选回报混合 A 基金份额净值 1.3341 元，基金份额总额 5,090,894,803.18 份；华商甄选回报混合 C 基金份额净值 1.3181 元，基金份额总额 2,207,910,037.70 份。华商甄选回报混合份额总额合计为 7,298,804,840.88 份。

6.2 利润表

会计主体：华商甄选回报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		484,242,796.30	334,810,199.39
1.利息收入		1,575,712.44	1,516,061.38
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,477,522.30	1,516,061.38
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		98,190.14	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,569,997.09	510,568,760.51
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-86,999,544.98	428,770,935.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,299,568.08	4,492,688.07
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	4,037,114.74	-
股利收益	6.4.7.16	90,232,859.25	77,305,136.89
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	468,236,444.76	-185,786,328.32
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	3,860,642.01	8,511,705.82
减：二、营业总支出		69,300,477.67	79,918,942.13
1. 管理人报酬		53,483,014.84	62,168,552.65
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		8,913,835.79	10,361,425.41
3. 销售服务费		6,617,541.39	7,228,895.11
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		14,563.45	1.52

8. 其他费用	6.4.7.20	271,522.20	160,067.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		414,942,318.63	254,891,257.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		414,942,318.63	254,891,257.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		414,942,318.63	254,891,257.26

6.3 净资产变动表

会计主体：华商甄选回报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	6,995,304,073.20	-	1,805,042,070.60	8,800,346,143.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,995,304,073.20	-	1,805,042,070.60	8,800,346,143.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	303,500,767.68	-	598,010,012.09	901,510,779.77
（一）、综合收益总额	-	-	414,942,318.63	414,942,318.63
（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）	303,500,767.68	-	183,067,693.46	486,568,461.14
其中：1.基金申购款	2,920,282,650.92	-	946,497,514.25	3,866,780,165.17
2.基金赎回款	-2,616,781,883.24	-	-763,429,820.79	-3,380,211,704.03
（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	7,298,804,840.88	-	2,403,052,082.69	9,701,856,923.57
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	4,814,271,486.07	-	1,322,213,619.81	6,136,485,105.88

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,814,271,486.07	-	1,322,213,619.81	6,136,485,105.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,365,164,311.12	-	802,367,450.42	2,167,531,761.54
（一）、综合收益总额	-	-	254,891,257.26	254,891,257.26
（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）	1,365,164,311.12	-	547,476,193.16	1,912,640,504.28
其中：1.基金申购款	4,678,560,491.94	-	1,780,611,140.67	6,459,171,632.61
2.基金赎回款	-3,313,396,180.82	-	-1,233,134,947.51	-4,546,531,128.33
（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	6,179,435,797.19	-	2,124,581,070.23	8,304,016,867.42

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

华商甄选回报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[2020]3009号《关于准予华商甄选回报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《华商甄选回报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。本基金业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(2021)第0090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商甄选回报混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,697,722,493.80份基金份额,其中认购资金利息折合212,272.76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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	644,662,341.22
等于：本金	644,564,521.65
加：应计利息	97,819.57
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	644,662,341.22

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	8,263,477,024.70	-	8,114,010,628.42	-149,466,396.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,708,750.32	540,444,838.52	-523,138.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,708,750.32	540,444,838.52	-523,138.80
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,799,736,251.70	4,708,750.32	8,654,455,466.94	-149,989,535.08

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	400,098,630.14	-
合计	400,098,630.14	-

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	32,848.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,127,407.66
其中：交易所市场	2,126,967.66
银行间市场	440.00
应付利息	-
预提费用	131,130.80
合计	2,291,386.93

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华商甄选回报混合 A	
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
上年度末	5,283,050,116.39	5,283,050,116.39
本期申购	1,416,187,596.22	1,416,187,596.22
本期赎回(以“-”号填列)	-1,608,342,909.43	-1,608,342,909.43
本期末	5,090,894,803.18	5,090,894,803.18

金额单位：人民币元

华商甄选回报混合 C		
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
上年度末	1,712,253,956.81	1,712,253,956.81
本期申购	1,504,095,054.70	1,504,095,054.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,008,438,973.81	-1,008,438,973.81
本期末	2,207,910,037.70	2,207,910,037.70

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

华商甄选回报混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,744,370,214.32	-367,332,987.60	1,377,037,226.72
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	1,744,370,214.32	-367,332,987.60	1,377,037,226.72
本期利润	-34,464,061.88	411,512,463.89	377,048,402.01
本期基金份额交易产生的变动数	-65,327,399.75	11,871,698.85	-53,455,700.90
其中：基金申购款	454,180,607.37	-9,654,073.59	444,526,533.78
基金赎回款	-519,508,007.12	21,525,772.44	-497,982,234.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,644,578,752.69	56,051,175.14	1,700,629,927.83

单位：人民币元

华商甄选回报混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	545,753,274.71	-117,748,430.83	428,004,843.88
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	545,753,274.71	-117,748,430.83	428,004,843.88
本期利润	-18,830,064.25	56,723,980.87	37,893,916.62
本期基金份额交易产生的变动数	152,860,264.90	83,663,129.46	236,523,394.36
其中：基金申购款	465,178,875.33	36,792,105.14	501,970,980.47
基金赎回款	-312,318,610.43	46,871,024.32	-265,447,586.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	679,783,475.36	22,638,679.50	702,422,154.86

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	1,380,497.11
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	93,412.88
其他	3,612.31
合计	1,477,522.30

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	2,027,935,690.74
减：卖出股票成本总额	2,109,018,577.85
减：交易费用	5,916,657.87
买卖股票差价收入	-86,999,544.98

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	4,944,806.08
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,645,238.00
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	3,299,568.08

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	532,169,550.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	523,145,238.00
减：应计利息总额	10,669,550.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,645,238.00

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	4,166,764.81
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	8,287.99
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	121,362.08
买卖权证差价收入	4,037,114.74

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	90,232,859.25
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	90,232,859.25

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	468,236,444.76
——股票投资	467,166,774.86
——债券投资	1,069,669.90
——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	468,236,444.76

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	3,860,642.01
合计	3,860,642.01

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	62,158.46
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	1,106.52
账户维护费	18,600.00
港股通证券组合费	112,715.09
银行费用	17,269.79
其他	-
合计	271,522.20

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	53,483,014.84	62,168,552.65
其中：支付销售机构的客户维护费	13,307,813.70	14,010,618.87
应支付基金管理人的净管理费	40,175,201.14	48,157,933.78

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的管理费率计提，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 × 管理费年费率 / 当年天数。

根据《华商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》，自 2023 年 8 月 7 日起降低本基金的管理费率，管理费年费率由原 1.50% 下调至 1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	8,913,835.79	10,361,425.41

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值的托管费年费率计提，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×托管费年费率/当年天数。

根据《华商基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》，自 2023 年 8 月 7 日起降低本基金的托管费率，托管费年费率由原 0.25% 下调至 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C	合计
华商基金	-	2,684,571.84	2,684,571.84
华龙证券	-	2,980.21	2,980.21
中国银行	-	5,148.55	5,148.55
合计	-	2,692,700.60	2,692,700.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C	合计
华商基金	-	3,331,539.83	3,331,539.83
华龙证券	-	752.06	752.06
中国银行	-	-	-
合计	-	3,332,291.89	3,332,291.89

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 × 0.60% / 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,480,362.09	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,480,362.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1469%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	644,662,341.22	1,380,497.11	476,779,173.13	1,318,603.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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	66	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	130	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	173	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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
06600	赛生药业	2024年6月21日	重大事项停牌	17.09	-	-	52,000	622,588.97	888,439.22	-
06689	洪九果品	2024年3月21日	重大事项停牌	1.59	-	-	38,800	136,676.93	61,616.85	-

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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在严格控制风险的前提下，力求为基金份额持有人获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。

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 0.00001% (2023 年 12 月 31 日：0.00001%)。

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 0.01%。

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	644,662,341.22	-	-	-	644,662,341.22
结算备付金	12,967,289.35	-	-	-	12,967,289.35
存出保证金	345,186.27	-	-	-	345,186.27
交易性金融资产	540,443,677.44	1,161.08	-	-8,114,010,628.42	8,654,455,466.94
买入返售金融资产	400,098,630.14	-	-	-	400,098,630.14
应收清算款	-	-	-	2,521,354.45	2,521,354.45
应收股利	-	-	-	21,499,045.65	21,499,045.65
应收申购款	-	-	-	10,755,752.30	10,755,752.30
资产总计	1,598,517,124.42	1,161.08	-	-8,148,786,780.82	9,747,305,066.32
负债					
应付清算款	-	-	-	9,287,611.43	9,287,611.43
应付赎回款	-	-	-	20,863,026.28	20,863,026.28
应付管理人报酬	-	-	-	9,785,008.02	9,785,008.02
应付托管费	-	-	-	1,630,834.67	1,630,834.67
应付销售服务费	-	-	-	1,454,349.89	1,454,349.89
应交税费	-	-	-	135,925.53	135,925.53
其他负债	-	-	-	2,291,386.93	2,291,386.93
负债总计	-	-	-	45,448,142.75	45,448,142.75
利率敏感度缺口	1,598,517,124.42	1,161.08	-	-8,103,338,638.07	9,701,856,923.57
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	805,215,708.28	-	-	-	805,215,708.28
结算备付金	13,850,133.71	-	-	-	13,850,133.71
存出保证金	482,768.72	-	-	-	482,768.72
交易性金融资产	529,181,155.63	1,280.20	-	-7,559,405,937.63	8,088,588,373.46

应收清算款	-	-	-	13,249,924.03	13,249,924.03
应收股利	-	-	-	494,847.11	494,847.11
应收申购款	-	-	-	45,455,357.64	45,455,357.64
资产总计	1,348,729,766.34	1,280.20	-	7,618,606,066.41	8,967,337,112.95
负债					
应付清算款	-	-	-	553.87	553.87
应付赎回款	-	-	-	152,669,752.77	152,669,752.77
应付管理人报酬	-	-	-	9,063,166.39	9,063,166.39
应付托管费	-	-	-	1,510,527.75	1,510,527.75
应付销售服务费	-	-	-	1,117,768.01	1,117,768.01
其他负债	-	-	-	2,629,200.36	2,629,200.36
负债总计	-	-	-	166,990,969.15	166,990,969.15
利率敏感度缺口	1,348,729,766.34	1,280.20	-	7,451,615,097.26	8,800,346,143.80

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 5.57% (2023 年 12 月 31 日：6.01%)，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	-	3,069,961,571.17	-	3,069,961,571.17
应收股利	-	21,499,045.65	-	21,499,045.65
资产合计	-	3,091,460,616.82	-	3,091,460,616.82
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	-	3,091,460,616.82	-	3,091,460,616.82

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	-	2,527,689,241.25	-	2,527,689,241.25
应收股利	-	494,847.11	-	494,847.11
资产合计	-	2,528,184,088.36	-	2,528,184,088.36
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	-	2,528,184,088.36	-	2,528,184,088.36

6.4.13.4.2 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%	154,573,030.84	126,409,204.42
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-154,573,030.84	-126,409,204.42	

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。

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

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 60%-95%，其中，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%，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。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。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	8,114,010,628.42	83.63	7,559,405,937.63	85.90
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	8,114,010,628.42	83.63	7,559,405,937.63	85.90

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%		502,763,086.83
2. 沪深 300 指数下降 5%		-502,763,086.83	-371,927,833.07

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	8,113,041,531.70	7,522,274,937.80
第二层次	541,393,733.51	565,438,877.10
第三层次	20,201.73	874,558.56
合计	8,654,455,466.94	8,088,588,373.46

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	8,114,010,628.42	83.24
	其中：股票	8,114,010,628.42	83.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	540,444,838.52	5.54
	其中：债券	540,444,838.52	5.54

	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	400,098,630.14	4.10
	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	657,629,630.57	6.75
8	其他各项资产	35,121,338.67	0.36
9	合计	9,747,305,066.32	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 3,069,961,571.17 元，占净值比例 31.64%。

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	2,192,680.00	0.02
B	采矿业	1,361,204,697.80	14.03
C	制造业	2,518,187,548.88	25.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,545,103.95	1.13
E	建筑业	71,301,106.08	0.73
F	批发和零售业	16,290,955.90	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	286,470,849.02	2.95
H	住宿和餐饮业	18,658,759.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	359,768,874.16	3.71
J	金融业	105,648,949.40	1.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	90,716,058.24	0.94
M	科学研究和技术服务业	95,114,859.47	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	8,930,693.10	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,506.25	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,416.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,044,049,057.25	51.99

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	1,268,197,691.56	13.07
B 消费者非必需品	544,229,703.42	5.61
C 消费者常用品	2,284,473.97	0.02
D 能源	303,250,067.91	3.13
E 金融	8,951,419.41	0.09
F 医疗保健	204,721,081.76	2.11
G 工业	88,958,910.47	0.92
H 信息技术	525,810,973.29	5.42
I 电信服务	21,574,842.52	0.22
J 公用事业	101,982,406.86	1.05
K 房地产	-	-
合计	3,069,961,571.17	31.64

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	601899	紫金矿业	23,007,550	404,242,653.50	4.17
1	02899	紫金矿业	8,280,000	124,539,201.79	1.28
2	03993	洛阳钼业	53,739,000	350,192,085.11	3.61
2	603993	洛阳钼业	8,820,600	74,975,100.00	0.77
3	01378	中国宏桥	30,476,000	328,771,357.74	3.39
4	00883	中国海洋石油	14,833,183	303,250,067.91	3.13
5	00700	腾讯控股	715,499	243,185,254.01	2.51
6	00753	中国国航	44,822,000	148,496,558.94	1.53
6	601111	中国国航	4,781,350	35,286,363.00	0.36
7	000426	兴业银锡	13,388,000	181,809,040.00	1.87
8	01055	中国南方航空股份	60,232,018	160,519,869.91	1.65
8	600029	南方航空	1,805,100	10,632,039.00	0.11
9	603979	金诚信	3,209,060	162,153,801.80	1.67
10	03690	美团-W	1,469,634	149,019,047.62	1.54
11	01810	小米集团-W	9,783,400	147,151,790.68	1.52
12	02600	中国铝业	23,770,000	115,631,171.19	1.19
12	601600	中国铝业	2,154,000	16,435,020.00	0.17
13	000933	神火股份	6,377,314	129,013,062.22	1.33
14	01818	招金矿业	9,483,500	113,385,750.22	1.17
15	01258	中国有色矿业	18,121,000	112,628,371.85	1.16
16	603871	嘉友国际	6,240,224	110,389,562.56	1.14
17	002155	湖南黄金	5,902,300	106,831,630.00	1.10

18	02380	中国电力	27,590,000	101,982,406.86	1.05
19	000807	云铝股份	6,816,906	92,096,400.06	0.95
20	603885	吉祥航空	8,053,958	88,512,998.42	0.91
21	00696	中国民航信息网络	9,669,000	80,834,278.75	0.83
22	601658	邮储银行	15,774,600	79,977,222.00	0.82
23	603393	新天然气	2,168,840	75,345,501.60	0.78
24	688100	威胜信息	1,969,903	75,151,799.45	0.77
25	600415	小商品城	10,094,500	74,901,190.00	0.77
26	01208	五矿资源	26,324,000	71,595,657.19	0.74
27	601179	中国西电	7,956,388	63,969,359.52	0.66
28	000960	锡业股份	4,037,100	62,534,679.00	0.64
29	000625	长安汽车	4,621,933	62,072,560.19	0.64
30	600031	三一重工	3,657,762	60,353,073.00	0.62
31	600989	宝丰能源	3,393,048	58,801,521.84	0.61
32	02273	固生堂	1,679,500	57,481,727.25	0.59
33	000983	山西焦煤	5,514,200	56,851,402.00	0.59
34	600497	驰宏锌锗	10,554,400	56,360,496.00	0.58
35	600985	淮北矿业	3,362,600	56,289,924.00	0.58
36	02057	中通快递-W	345,750	51,814,805.86	0.53
37	600988	赤峰黄金	2,875,968	46,993,317.12	0.48
38	600301	华锡有色	2,194,300	44,368,746.00	0.46
39	02099	中国黄金国际	941,500	43,050,339.82	0.44
40	000923	河钢资源	2,465,900	42,462,798.00	0.44
41	600399	抚顺特钢	7,522,020	42,348,972.60	0.44
42	600765	中航重机	2,048,340	41,786,136.00	0.43
43	002706	良信股份	6,038,940	41,427,128.40	0.43
44	300017	网宿科技	4,928,800	38,937,520.00	0.40
45	300203	聚光科技	3,798,100	38,322,829.00	0.40
46	603583	捷昌驱动	1,728,340	35,223,569.20	0.36
47	000975	银泰黄金	2,144,300	34,930,647.00	0.36
48	688789	宏华数科	307,474	33,145,697.20	0.34
49	000630	铜陵有色	9,173,700	33,117,057.00	0.34
50	688200	华峰测控	354,541	32,529,136.75	0.34
51	601117	中国化学	3,827,100	31,535,304.00	0.33
52	09992	泡泡玛特	901,892	31,485,058.74	0.32
53	300818	耐普矿机	1,193,150	30,425,325.00	0.31
54	000792	盐湖股份	1,723,000	30,066,350.00	0.31
55	601666	平煤股份	2,605,600	29,182,720.00	0.30
56	00390	中国中铁	7,364,000	28,967,404.49	0.30

57	601611	中国核建	3,573,400	28,908,806.00	0.30
58	688300	联瑞新材	593,940	28,568,514.00	0.29
59	600114	东睦股份	1,965,400	28,282,106.00	0.29
60	301095	广立微	678,212	27,888,077.44	0.29
61	600879	航天电子	3,582,529	27,836,250.33	0.29
62	300633	开立医疗	699,200	27,674,336.00	0.29
63	002851	麦格米特	1,052,200	27,188,848.00	0.28
64	688548	广钢气体	2,945,859	26,895,692.67	0.28
65	02269	药明生物	2,481,000	26,130,703.78	0.27
66	688256	寒武纪	131,449	26,114,972.83	0.27
67	000738	航发控制	1,294,600	25,982,622.00	0.27
68	002149	西部材料	1,844,800	25,753,408.00	0.27
69	300257	开山股份	2,491,300	25,162,130.00	0.26
70	300496	中科创达	542,300	24,723,457.00	0.25
71	002025	航天电器	524,500	24,326,310.00	0.25
72	09626	哔哩哔哩-W	208,560	24,155,229.83	0.25
73	688385	复旦微电	759,293	23,826,614.34	0.25
74	688019	安集科技	189,108	23,789,786.40	0.25
75	00751	创维集团	8,404,000	23,624,101.18	0.24
76	002273	水晶光电	1,374,000	23,330,520.00	0.24
77	600588	用友网络	2,326,019	23,260,190.00	0.24
78	600388	龙净环保	1,995,400	23,166,594.00	0.24
79	601168	西部矿业	1,281,213	22,997,773.35	0.24
80	600549	厦门钨业	1,332,400	22,983,900.00	0.24
81	002609	捷顺科技	2,923,716	22,161,767.28	0.23
82	301029	怡合达	1,125,613	22,129,551.58	0.23
83	002142	宁波银行	994,790	21,945,067.40	0.23
84	00941	中国移动	307,000	21,574,842.52	0.22
85	03347	泰格医药	853,600	21,502,156.68	0.22
86	601689	拓普集团	390,135	20,915,137.35	0.22
87	688337	普源精电	826,481	20,843,850.82	0.21
88	688037	芯源微	232,674	20,707,986.00	0.21
89	002138	顺络电子	753,000	20,677,380.00	0.21
90	300036	超图软件	1,473,200	20,565,872.00	0.21
91	603225	新凤鸣	1,316,500	20,524,235.00	0.21
92	300604	长川科技	754,400	20,497,048.00	0.21
93	688122	西部超导	530,902	20,344,164.64	0.21
94	002372	伟星新材	1,317,275	20,312,380.50	0.21
95	601816	京沪高铁	3,733,000	20,046,210.00	0.21

96	601100	恒立液压	429,775	20,018,919.50	0.21
97	600584	长电科技	625,400	19,831,434.00	0.20
98	00268	金蝶国际	2,937,000	19,621,561.29	0.20
99	688012	中微公司	138,824	19,610,278.24	0.20
100	688507	索辰科技	391,086	19,006,779.60	0.20
101	002850	科达利	245,902	18,781,994.76	0.19
102	688116	天奈科技	810,108	18,697,292.64	0.19
103	300938	信测标准	921,475	18,318,923.00	0.19
104	601020	华钰矿业	1,429,540	18,298,112.00	0.19
105	688052	纳芯微	177,821	18,276,442.38	0.19
106	300161	华中数控	803,200	18,063,968.00	0.19
107	603712	七一二	986,700	17,948,073.00	0.18
108	688239	航宇科技	515,120	17,926,176.00	0.18
109	01801	信达生物	532,000	17,868,083.97	0.18
110	600885	宏发股份	642,400	17,781,632.00	0.18
111	002422	科伦药业	586,272	17,781,629.76	0.18
112	300395	菲利华	565,800	17,398,350.00	0.18
113	600131	国网信通	1,019,874	17,205,274.38	0.18
114	01548	金斯瑞生物科技	2,229,428	16,929,156.17	0.17
115	603186	华正新材	710,701	16,900,469.78	0.17
116	688372	伟测科技	429,316	16,884,998.28	0.17
117	688270	臻镭科技	645,628	16,850,890.80	0.17
118	688625	呈和科技	456,888	16,612,447.68	0.17
119	300491	通合科技	1,155,600	16,594,416.00	0.17
120	06078	海吉亚医疗	637,000	16,365,767.05	0.17
121	000528	柳工	1,454,200	16,272,498.00	0.17
122	688271	联影医疗	148,014	16,237,135.80	0.17
123	301162	国能日新	369,737	16,105,743.72	0.17
124	603105	芯能科技	1,801,000	15,848,800.00	0.16
125	688083	中望软件	216,678	15,735,156.36	0.16
126	300191	潜能恒信	1,113,200	15,495,744.00	0.16
127	002791	坚朗五金	589,400	15,247,778.00	0.16
128	688179	阿拉丁	1,552,557	15,013,226.19	0.15
129	603977	国泰集团	1,466,640	14,915,728.80	0.15
130	000060	中金岭南	3,508,400	14,875,616.00	0.15
131	02367	巨子生物	349,786	14,637,277.18	0.15
132	600710	苏美达	1,794,000	14,621,100.00	0.15
133	688103	国力股份	418,004	14,529,819.04	0.15
134	688719	爱科赛博	554,387	14,452,869.09	0.15

135	688777	中控技术	379,350	14,301,495.00	0.15
136	600258	首旅酒店	1,146,500	14,159,275.00	0.15
137	300001	特锐德	703,500	14,154,420.00	0.15
138	688332	中科蓝讯	239,909	14,152,231.91	0.15
139	301080	百普赛斯	391,320	13,696,200.00	0.14
140	605123	派克新材	242,398	13,617,919.64	0.14
141	688776	国光电气	243,784	13,505,633.60	0.14
142	688262	国芯科技	735,135	13,386,808.35	0.14
143	603055	台华新材	1,268,500	12,849,905.00	0.13
144	601888	中国中免	198,500	12,404,265.00	0.13
144	01880	中国中免	4,541	198,313.36	0.00
145	000400	许继电气	363,200	12,497,712.00	0.13
146	688131	皓元医药	649,299	12,421,089.87	0.13
147	301319	唯特偶	411,677	12,362,660.31	0.13
148	002859	洁美科技	613,500	12,319,080.00	0.13
149	301031	中熔电气	146,200	12,017,640.00	0.12
150	603896	寿仙谷	507,776	11,917,502.72	0.12
151	603160	汇顶科技	173,100	11,900,625.00	0.12
152	600129	太极集团	405,900	11,738,628.00	0.12
153	603801	志邦家居	889,736	11,637,746.88	0.12
154	688133	泰坦科技	736,539	11,622,585.42	0.12
155	603638	艾迪精密	818,890	11,489,026.70	0.12
156	01951	锦欣生殖	4,441,500	11,269,197.65	0.12
157	688311	盟升电子	534,048	10,942,643.52	0.11
158	688232	新点软件	551,783	10,881,160.76	0.11
159	600733	北汽蓝谷	1,321,500	10,677,720.00	0.11
160	600487	亨通光电	671,100	10,583,247.00	0.11
161	002452	长高电新	1,268,600	10,504,008.00	0.11
162	688682	霍莱沃	355,652	10,434,829.68	0.11
163	01888	建滔积层板	1,352,500	10,368,957.48	0.11
164	002430	杭氧股份	461,000	10,257,250.00	0.11
165	603209	兴通股份	725,186	10,036,574.24	0.10
166	301269	华大九天	130,079	10,022,586.95	0.10
167	688153	唯捷创芯	266,025	9,842,925.00	0.10
168	002353	杰瑞股份	277,900	9,748,732.00	0.10
169	600761	安徽合力	440,700	9,536,748.00	0.10
170	002371	北方华创	29,800	9,532,722.00	0.10
171	002444	巨星科技	384,700	9,502,090.00	0.10
172	002028	思源电气	141,300	9,452,970.00	0.10

173	300298	三诺生物	371,000	9,401,140.00	0.10
174	600206	有研新材	1,049,800	9,343,220.00	0.10
175	000682	东方电子	844,900	9,327,696.00	0.10
176	600970	中材国际	766,400	9,242,784.00	0.10
177	688326	经纬恒润	157,993	9,057,738.69	0.09
178	688768	容知日新	386,242	9,041,925.22	0.09
179	688192	迪哲医药	244,598	9,010,990.32	0.09
180	603296	华勤技术	162,343	8,966,203.89	0.09
181	00388	香港交易所	39,200	8,951,419.41	0.09
182	000803	山高环能	2,514,820	8,776,721.80	0.09
183	000725	京东方 A	2,133,300	8,725,197.00	0.09
184	002465	海格通信	839,500	8,697,220.00	0.09
185	603728	鸣志电器	211,827	8,521,800.21	0.09
186	00670	中国东方航空股份	4,746,000	8,489,895.39	0.09
187	00358	江西铜业股份	591,000	8,403,756.65	0.09
188	300413	芒果超媒	397,700	8,311,930.00	0.09
189	301220	亚香股份	323,351	8,251,917.52	0.09
190	688260	昀冢科技	547,810	8,145,934.70	0.08
191	01882	海天国际	397,000	8,043,813.91	0.08
192	688290	景业智能	246,047	7,898,108.70	0.08
193	600782	新钢股份	2,356,200	7,822,584.00	0.08
194	002315	焦点科技	288,000	7,764,480.00	0.08
195	688033	天宜上佳	1,281,318	7,687,908.00	0.08
196	301291	明阳电气	254,600	7,650,730.00	0.08
197	02331	李宁	491,584	7,582,335.16	0.08
198	02157	乐普生物-B	2,342,000	7,566,737.82	0.08
199	002484	江海股份	551,000	7,300,750.00	0.08
200	01999	敏华控股	1,464,251	7,163,064.35	0.07
201	000862	银星能源	1,480,200	7,060,554.00	0.07
202	000603	盛达资源	588,200	6,958,406.00	0.07
203	688293	奥浦迈	220,553	6,896,692.31	0.07
204	000408	藏格矿业	280,500	6,751,635.00	0.07
205	301050	雷电微力	140,028	6,743,748.48	0.07
206	300709	精研科技	265,500	6,711,840.00	0.07
207	600862	中航高科	340,400	6,392,712.00	0.07
208	603986	兆易创新	66,400	6,349,168.00	0.07
209	300767	震安科技	721,200	6,115,776.00	0.06
210	688089	嘉必优	461,291	6,107,492.84	0.06
211	00853	微创医疗	1,251,006	6,017,118.18	0.06

212	688639	华恒生物	76,304	5,828,862.56	0.06
213	603169	兰石重装	1,260,400	5,671,800.00	0.06
214	001218	丽臣实业	349,640	5,234,110.80	0.05
215	002017	东信和平	624,390	5,201,168.70	0.05
216	688007	光峰科技	314,602	5,065,092.20	0.05
217	688661	和林微纳	163,762	5,019,305.30	0.05
218	300593	新雷能	499,150	4,961,551.00	0.05
219	688376	美埃科技	154,385	4,841,513.60	0.05
220	000786	北新建材	161,100	4,778,226.00	0.05
221	000021	深科技	310,500	4,694,760.00	0.05
222	603915	国茂股份	454,100	4,672,689.00	0.05
223	301205	联特科技	74,000	4,643,500.00	0.05
224	601021	春秋航空	82,000	4,619,060.00	0.05
225	688439	振华风光	68,977	4,583,521.65	0.05
226	000537	中绿电	479,800	4,572,494.00	0.05
227	689009	九号公司	124,161	4,570,366.41	0.05
228	600754	锦江酒店	195,800	4,499,484.00	0.05
229	603489	八方股份	165,100	4,454,398.00	0.05
230	688618	三旺通信	176,588	4,419,997.64	0.05
231	688333	铂力特	91,034	4,410,597.30	0.05
232	600499	科达制造	510,600	4,304,358.00	0.04
233	600821	金开新能	825,000	4,240,500.00	0.04
234	002930	宏川智慧	341,500	4,234,600.00	0.04
235	688157	松井股份	113,036	3,888,438.40	0.04
236	601398	工商银行	653,800	3,726,660.00	0.04
237	688146	中船特气	117,810	3,516,628.50	0.04
238	688173	希荻微	306,017	3,375,367.51	0.03
239	688539	高华科技	116,056	3,123,066.96	0.03
240	002821	凯莱英	44,835	2,950,143.00	0.03
241	688281	华秦科技	33,918	2,826,047.76	0.03
242	601333	广深铁路	799,900	2,591,676.00	0.03
243	601778	晶科科技	1,060,200	2,417,256.00	0.02
244	300662	科锐国际	138,700	2,237,231.00	0.02
245	603477	巨星农牧	76,400	2,192,680.00	0.02
246	300745	欣锐科技	149,800	2,166,108.00	0.02
247	603517	绝味食品	140,400	2,162,160.00	0.02
248	600587	新华医疗	122,330	1,925,474.20	0.02
249	301088	戎美股份	143,584	1,608,140.80	0.02
250	002941	新疆交建	160,700	1,603,786.00	0.02

251	600153	建发股份	128,700	1,149,291.00	0.01
252	300454	深信服	21,500	1,086,395.00	0.01
253	02020	安踏体育	13,961	955,644.41	0.01
254	06990	科伦博泰生物-B	6,200	938,198.53	0.01
255	688580	伟思医疗	34,740	929,642.40	0.01
256	688308	欧科亿	47,503	922,508.26	0.01
257	688268	华特气体	17,344	895,123.84	0.01
258	06600	赛生药业	52,000	888,439.22	0.01
259	301367	怡和嘉业	12,880	801,136.00	0.01
260	688563	航材股份	15,010	793,728.80	0.01
261	603129	春风动力	5,500	782,870.00	0.01
262	09987	百胜中国	3,544	780,817.45	0.01
263	02015	理想汽车-W	11,761	754,602.27	0.01
264	002709	天赐材料	42,500	746,300.00	0.01
265	00168	青岛啤酒股份	15,666	744,928.14	0.01
266	09922	九毛九	198,471	733,619.07	0.01
267	01211	比亚迪股份	3,432	726,697.72	0.01
268	03613	同仁堂国药	87,000	715,422.47	0.01
269	02319	蒙牛乳业	55,738	712,193.41	0.01
270	00669	创科实业	8,500	691,993.98	0.01
271	09995	荣昌生物	28,000	626,098.48	0.01
272	02268	药明合联	39,500	623,679.88	0.01
273	01177	中国生物制药	251,000	611,650.76	0.01
274	688515	裕太微	10,386	602,388.00	0.01
275	06160	百济神州	7,600	597,914.92	0.01
276	00013	和黄医药	23,500	589,819.45	0.01
277	06699	时代天使	10,800	559,381.57	0.01
278	02162	康诺亚-B	16,500	508,248.68	0.01
279	01024	快手-W	11,726	493,901.25	0.01
280	00512	远大医药	113,500	481,689.69	0.00
281	688567	孚能科技	47,552	456,499.20	0.00
282	00291	华润啤酒	19,017	455,606.43	0.00
283	01928	金沙中国有限公司	29,600	439,809.54	0.00
284	02487	科笛-B	67,400	394,308.79	0.00
285	00027	银河娱乐	11,186	371,616.28	0.00
286	002389	航天彩虹	26,300	365,307.00	0.00
287	301526	国际复材	97,225	323,759.25	0.00
288	301498	乖宝宠物	5,531	297,567.80	0.00
289	00667	中国东方教育	144,088	297,204.09	0.00

290	688549	中巨芯	42,933	289,797.75	0.00
291	09969	诺诚健华	63,000	277,144.41	0.00
292	06639	瑞尔集团	58,000	274,205.58	0.00
293	01458	周黑鸭	144,500	228,156.31	0.00
294	301511	德福科技	13,738	202,772.88	0.00
295	06127	昭衍新药	29,300	200,561.43	0.00
296	09896	名创优品	5,712	195,235.39	0.00
297	06862	海底捞	15,217	194,991.05	0.00
298	00839	中教控股	47,361	194,946.72	0.00
299	301559	中集环科	13,144	191,508.08	0.00
300	688578	艾力斯	2,973	189,499.02	0.00
301	01368	特步国际	42,055	184,621.06	0.00
302	688582	芯动联科	6,476	182,364.16	0.00
303	02313	申洲国际	2,529	176,459.42	0.00
304	301371	敷尔佳	5,637	175,085.22	0.00
305	09869	海伦司	78,441	160,365.03	0.00
306	688435	英方软件	6,316	157,647.36	0.00
307	02469	粉笔	41,283	157,117.96	0.00
308	301508	中机认检	4,186	154,714.56	0.00
309	600276	恒瑞医药	4,000	153,840.00	0.00
310	301525	儒竞科技	2,660	149,704.80	0.00
311	06185	康希诺生物	8,000	142,670.14	0.00
312	00867	康哲药业	23,000	138,964.66	0.00
313	01244	3D MEDICINES	28,500	138,640.66	0.00
314	002050	三花智控	7,200	137,376.00	0.00
315	301509	金凯生科	3,720	135,333.60	0.00
316	688591	泰凌微	6,806	133,057.30	0.00
317	02285	泉峰控股	8,000	132,886.21	0.00
318	00880	澳博控股	52,551	127,099.95	0.00
319	601083	锦江航运	12,630	120,742.80	0.00
320	09868	小鹏汽车-W	4,327	116,697.87	0.00
321	02172	微创脑科学	20,000	113,902.46	0.00
322	688612	威迈斯	4,218	112,072.26	0.00
323	00570	中国中药	33,752	111,821.33	0.00
324	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.00
325	688249	晶合集成	7,405	108,631.35	0.00
326	00780	同程旅行	7,502	106,401.22	0.00
327	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.00
328	688627	精智达	2,212	102,681.04	0.00

329	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.00
330	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.00
331	688610	埃科光电	2,747	92,381.61	0.00
332	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.00
333	00175	吉利汽车	11,168	89,594.80	0.00
334	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.00
335	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.00
336	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.00
337	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.00
338	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.00
339	02333	长城汽车	7,400	81,316.14	0.00
340	688351	微电生理	3,687	81,261.48	0.00
341	002432	九安医疗	2,000	81,080.00	0.00
342	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.00
343	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.00
344	688091	上海谊众	3,366	76,037.94	0.00
345	01361	361 度	20,251	74,485.21	0.00
346	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.00
347	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.00
348	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.00
349	688488	艾迪药业	6,837	69,874.14	0.00
350	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.00
351	301358	湖南裕能	2,026	63,737.96	0.00
352	688472	阿特斯	6,261	63,736.98	0.00
353	688693	锆威特	1,773	63,686.16	0.00
354	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.00
355	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.00
356	06689	洪九果品	38,800	61,616.85	0.00
357	301372	科净源	2,306	61,454.90	0.00
358	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.00
359	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.00
360	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00
361	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.00
362	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.00
363	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
364	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.00
365	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.00
366	001378	德冠新材	2,044	48,769.84	0.00
367	01579	颐海国际	4,006	47,896.17	0.00

368	603107	上海汽配	2,920	46,398.80	0.00
369	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.00
370	001286	陕西能源	3,867	44,586.51	0.00
371	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
372	002653	海思科	1,400	42,980.00	0.00
373	603062	麦加芯彩	1,258	41,778.18	0.00
374	688361	中科飞测	834	39,448.20	0.00
375	688484	南芯科技	1,022	37,916.20	0.00
376	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
377	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.00
378	06979	珍酒李渡	4,600	33,922.49	0.00
379	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
380	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
381	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
382	301333	诺思格	900	30,249.00	0.00
383	601061	中信金属	4,154	28,537.98	0.00
384	688352	颀中科技	2,377	27,121.57	0.00
385	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
386	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.00
387	01316	耐世特	8,040	25,829.57	0.00
388	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.00
389	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
390	001287	中电港	1,460	24,133.80	0.00
391	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.00
392	688531	日联科技	502	23,172.32	0.00
393	301487	盟固利	867	22,420.62	0.00
394	688702	盛科通信	549	22,234.50	0.00
395	688629	华丰科技	793	20,903.48	0.00
396	688631	莱斯信息	336	20,838.72	0.00
397	09877	健世科技-B	5,600	20,392.92	0.00
398	301345	涛涛车业	352	19,395.20	0.00
399	301383	天键股份	735	19,198.20	0.00
400	688570	天玛智控	884	18,024.76	0.00
401	301293	三博脑科	433	16,319.77	0.00
402	600420	国药现代	1,500	16,020.00	0.00
403	688552	航天南湖	956	15,487.20	0.00
404	001376	百通能源	804	14,970.48	0.00
405	688334	西高院	897	14,441.70	0.00
406	06690	海尔智家	600	14,292.57	0.00

407	301305	朗坤环境	823	12,517.83	0.00
408	301439	泓淋电力	986	12,492.62	0.00
409	300904	威力传动	304	12,150.88	0.00
410	688478	晶升股份	402	11,706.24	0.00
411	301382	蜂助手	624	11,288.16	0.00
412	688581	安杰思	228	11,156.04	0.00
413	688562	航天软件	726	11,086.02	0.00
414	301332	德尔玛	1,211	10,705.24	0.00
415	301322	绿通科技	567	10,642.59	0.00
416	688623	双元科技	178	10,008.94	0.00
417	301408	华人健康	884	9,043.32	0.00
418	301210	金杨股份	301	9,033.01	0.00
419	601065	江盐集团	1,036	8,982.12	0.00
420	301337	亚华电子	318	8,770.44	0.00
421	301323	新莱福	277	8,747.66	0.00
422	603135	中重科技	673	8,432.69	0.00
423	301373	凌玮科技	364	8,299.20	0.00
424	301428	世纪恒通	289	8,294.30	0.00
425	688458	美芯晟	309	8,281.20	0.00
426	688620	安凯微	1,016	8,270.24	0.00
427	301315	威士顿	253	8,245.27	0.00
428	601133	柏诚股份	732	7,825.08	0.00
429	301170	锡南科技	296	7,710.80	0.00
430	301203	国泰环保	243	6,879.33	0.00
431	301295	美硕科技	344	6,849.04	0.00
432	688429	时创能源	375	6,352.50	0.00
433	301355	南王科技	624	5,984.16	0.00
434	688651	盛邦安全	178	5,206.50	0.00
435	001367	海森药业	221	5,158.14	0.00
436	603125	常青科技	284	4,887.64	0.00
437	301349	信德新材	134	3,703.76	0.00
438	001328	登康口腔	145	3,668.50	0.00
439	603172	万丰股份	220	3,555.20	0.00
440	001360	南矿集团	262	3,219.98	0.00
441	001301	尚太科技	64	2,766.08	0.00
442	603137	恒尚节能	255	2,601.00	0.00
443	301230	泓博医药	99	2,229.48	0.00
444	001337	四川黄金	95	2,204.95	0.00
445	001324	长青科技	131	2,122.20	0.00

446	301338	凯格精机	60	1,927.80	0.00
447	603173	福斯达	88	1,910.48	0.00
448	603190	亚通精工	70	1,607.20	0.00
449	301227	森鹰窗业	84	1,580.04	0.00
450	001311	多利科技	64	1,547.52	0.00
451	301231	荣信文化	75	1,416.00	0.00
452	301363	美好医疗	45	1,305.00	0.00
453	301273	瑞晨环保	77	1,198.89	0.00
454	001260	坤泰股份	84	1,170.12	0.00
455	001278	一彬科技	73	1,154.13	0.00
456	605319	无锡振华	64	1,132.80	0.00
457	301277	新天地	81	1,051.38	0.00
458	603162	海通发展	110	1,023.00	0.00
459	001368	通达创智	51	997.05	0.00
460	603282	亚光股份	57	961.02	0.00
461	301313	凡拓数创	47	956.45	0.00
462	301326	捷邦科技	27	878.58	0.00
463	301327	华宝新能	15	859.50	0.00
464	301365	矩阵股份	74	813.26	0.00
465	301282	金禄电子	34	808.52	0.00
466	301309	万得凯	28	715.68	0.00
467	301359	东南电子	28	683.20	0.00
468	603153	上海建科	40	676.40	0.00
469	001366	播恩集团	45	499.50	0.00
470	603291	联合水务	36	441.36	0.00
471	603073	彩蝶实业	30	433.80	0.00
472	001314	亿道信息	8	307.44	0.00
473	688522	纳睿雷达	6	281.28	0.00
474	688381	帝奥微	12	233.76	0.00
475	301223	中荣股份	15	220.65	0.00
476	688143	长盈通	9	192.78	0.00
477	301267	华夏眼科	9	186.48	0.00
478	601121	宝地矿业	32	182.08	0.00
479	02150	奈雪的茶	82	154.17	0.00
480	688485	九州一轨	3	23.40	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	01810	小米集团-W	150,966,425.58	1.72
2	00700	腾讯控股	141,001,738.12	1.60
3	00753	中国国航	89,774,109.52	1.02
3	601111	中国国航	9,327,887.00	0.11
4	00696	中国民航信息网络	86,997,660.31	0.99
5	03690	美团-W	59,538,626.68	0.68
6	601179	中国西电	58,444,233.48	0.66
7	02057	中通快递-W	54,384,590.76	0.62
8	01818	招金矿业	44,796,263.51	0.51
9	301095	广立微	43,232,021.35	0.49
10	02600	中国铝业	42,706,555.10	0.49
11	300017	网宿科技	41,231,024.06	0.47
12	600765	中航重机	39,839,808.60	0.45
13	600415	小商品城	39,189,794.00	0.45
14	688300	联瑞新材	30,176,825.59	0.34
15	601611	中国核建	29,719,298.00	0.34
16	688548	广钢气体	29,446,944.77	0.33
17	601117	中国化学	29,425,984.00	0.33
18	688200	华峰测控	29,121,455.54	0.33
19	00390	中国中铁	28,885,571.28	0.33
20	300257	开山股份	28,650,053.84	0.33

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	271,091,499.85	3.08
2	00293	国泰航空	151,180,796.73	1.72
3	300750	宁德时代	138,869,794.08	1.58
4	01658	邮储银行	85,223,159.99	0.97
5	000630	铜陵有色	70,777,574.00	0.80
6	600989	宝丰能源	64,217,335.00	0.73

7	601816	京沪高铁	49,367,395.00	0.56
8	601168	西部矿业	42,087,719.87	0.48
9	601166	兴业银行	40,335,376.00	0.46
10	000938	紫光股份	38,147,477.32	0.43
11	688301	奕瑞科技	36,433,385.65	0.41
12	09926	康方生物	35,019,039.54	0.40
13	01766	中国中车	33,681,853.46	0.38
14	002128	电投能源	32,828,419.74	0.37
15	01898	中煤能源	21,716,767.78	0.25
15	601898	中煤能源	10,561,921.00	0.12
16	00700	腾讯控股	31,328,609.82	0.36
17	01801	信达生物	28,969,760.64	0.33
18	02096	先声药业	28,963,897.34	0.33
19	000762	西藏矿业	25,875,183.64	0.29
20	603379	三美股份	25,225,819.00	0.29

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	2,196,456,493.78
卖出股票收入（成交）总额	2,027,935,690.74

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	540,443,677.44	5.57
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）	1,161.08	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	540,444,838.52	5.57

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	019733	24 国债 02	5,066,000	512,036,164.97	5.28
2	019727	23 国债 24	279,000	28,407,512.47	0.29
3	111007	永和转债	10	1,161.08	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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	345,186.27
2	应收清算款	2,521,354.45
3	应收股利	21,499,045.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,755,752.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,121,338.67

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	111007	永和转债	1,161.08	0.00

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

份额级别	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
华商甄选回报混合 A	68,896	73,892.46	3,052,279,021.34	59.96%	2,038,615,781.84	40.04%
华商甄选回报混合 C	19,256	114,660.89	1,838,617,435.04	83.27%	369,292,602.66	16.73%
合计	88,152	82,797.95	4,890,896,456.38	67.01%	2,407,908,384.50	32.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华商甄选回报混合 A	3,919,728.15	0.0770%
	华商甄选回报混合 C	209,021.55	0.0095%
	合计	4,128,749.70	0.0566%

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	份额级别	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	华商甄选回报混合 A	>100
	华商甄选回报混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华商甄选回报混合 A	>100
	华商甄选回报混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华商甄选回报混合 A	华商甄选回报混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）基金份额总额	5,697,722,493.80	-
本报告期期初基金份额总额	5,283,050,116.39	1,712,253,956.81
本报告期基金总申购份额	1,416,187,596.22	1,504,095,054.70
减：本报告期基金总赎回份额	1,608,342,909.43	1,008,438,973.81
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	5,090,894,803.18	2,207,910,037.70

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。

本基金本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 2021 年 1 月 19 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
国金证券	2	2,439,560,021.86	57.75%	1,544,053.95	47.77%	-
江海证券	2	615,217,849.93	14.56%	581,934.20	18.00%	-
华金证券	1	507,277,171.81	12.01%	479,852.89	14.85%	-
山西证券	1	236,465,854.71	5.60%	223,675.27	6.92%	-
中金公司	2	231,764,531.24	5.49%	219,228.61	6.78%	-
中泰证券	2	101,525,488.50	2.40%	96,102.57	2.97%	-
南京证券	1	92,475,377.55	2.19%	87,472.05	2.71%	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	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. 本基金本报告期内新增南京证券 1 个交易单元。

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
国金证券	536,258,227.00	100.00%	-	-	4,166,764.81	100.00%
江海证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-

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	华商甄选回报混合型证券投资基金招募说明书(更新)	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年1月2日
2	华商甄选回报混合型证券投资基金(华商甄选回报混合A份额)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1月2日
3	华商甄选回报混合型证券投资基金(华商甄选回报混合C份额)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1月2日
4	华商基金管理有限公司关于华商甄选回报混合型证券投资基金基金经理变更的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报	2024年1月4日

5	华商甄选回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 5 日
6	华商甄选回报混合型证券投资基金（华商甄选回报混合 A 份额）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 1 月 5 日
7	华商甄选回报混合型证券投资基金（华商甄选回报混合 C 份额）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 1 月 5 日
8	华商甄选回报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
9	华商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第四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、证券日报	2024 年 1 月 22 日
10	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
11	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
12	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
13	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
14	华商甄选回报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
15	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
16	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
17	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
18	华商甄选回报混合型证券投资基金 2024	公司网站、中国证监会基	2024 年 4 月 22 日

	年第 1 季度报告	金电子披露网站	
19	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、证券日报	2024 年 4 月 22 日
20	华商甄选回报混合型证券投资基金（华商甄选回报混合 A 份额）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 7 日
21	华商甄选回报混合型证券投资基金（华商甄选回报混合 C 份额）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 7 日
22	华商基金管理有限公司关于华商甄选回报混合型证券投资基金 A 类基金份额参加国元证券股份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、证券日报	2024 年 6 月 13 日
23	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
24	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
25	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甄选回报混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商甄选回报混合型证券投资基金基金合同》；

3. 《华商甄选回报混合型证券投资基金托管协议》;
4. 《华商甄选回报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. 报告期内华商甄选回报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、基金托管人住所。

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

托管人住所

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