

华商双债丰利债券型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华商双债丰利债券
基金主代码	000463
交易代码	000463
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 28 日
报告期末基金份额总额	330,344,857.80 份
投资目标	本基金管理人通过严格的风险控制和积极主动的投资管理，在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以信用债和可转债为主要投资标的，力争获得高于业绩比较基准的投资业绩，使基金份额持有人获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金债券投资策略主要采用信用策略，同时采用久期策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、可转债策略等积极投资策略，在合理控制风险的前提下，通过严格的信用分析和对信用利差的变动趋势进行判断，力争获取信用溢价。具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特

	征的品种。	
基金管理人	华商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华商双债丰利债券 A	华商双债丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	000463	000481
报告期末下属分级基金的份额总额	274,190,173.49 份	56,154,684.31 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年7月1日—2022年9月30日）	
	华商双债丰利债券 A	华商双债丰利债券 C
1. 本期已实现收益	2,566,912.68	480,581.48
2. 本期利润	-2,652,297.45	-565,049.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.0100
4. 期末基金资产净值	168,167,749.12	33,636,449.12
5. 期末基金份额净值	0.613	0.599

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华商双债丰利债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.61%	0.35%	0.73%	0.05%	-2.34%	0.30%
过去六个月	1.16%	0.35%	1.03%	0.04%	0.13%	0.31%
过去一年	-2.23%	0.32%	1.73%	0.05%	-3.96%	0.27%
过去三年	-28.55%	0.61%	3.81%	0.07%	-32.36%	0.54%
过去五年	-51.96%	0.64%	8.27%	0.06%	-60.23%	0.58%
自基金合同生效起至今	-14.74%	0.63%	14.65%	0.08%	-29.39%	0.55%

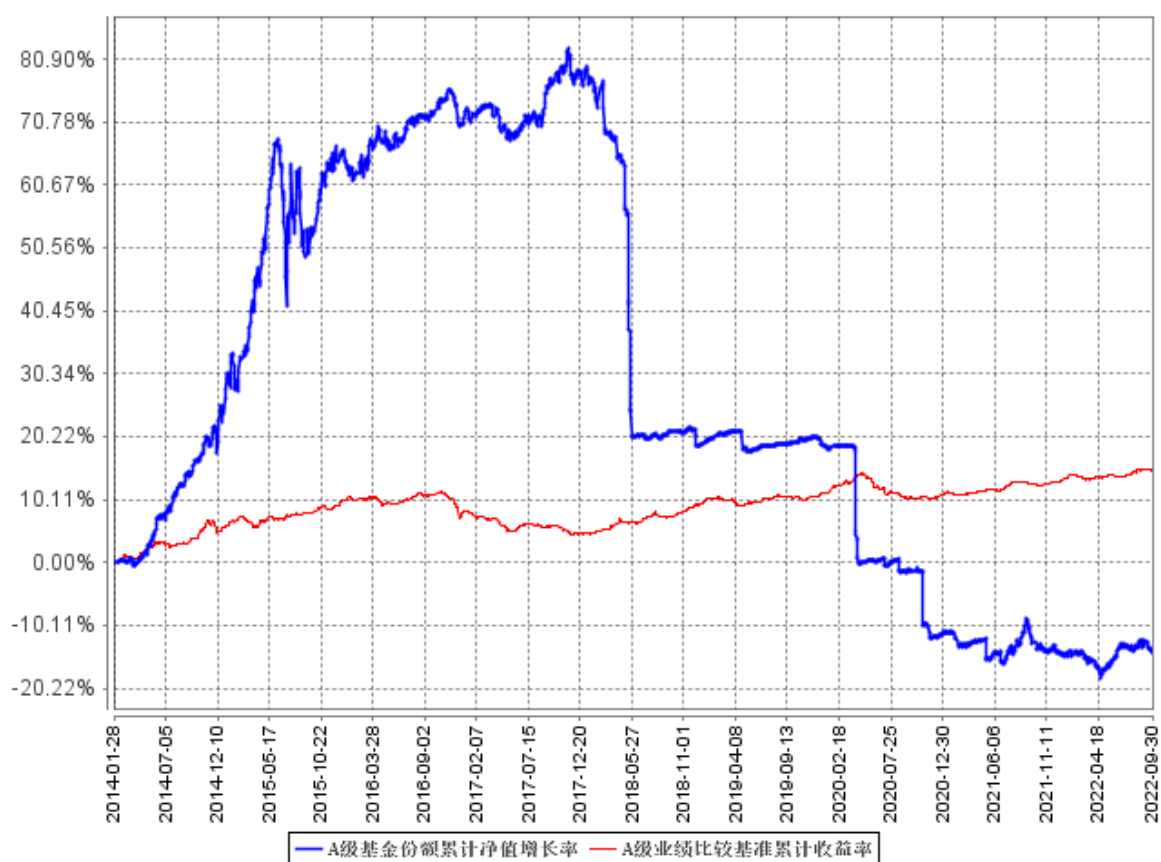
华商双债丰利债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

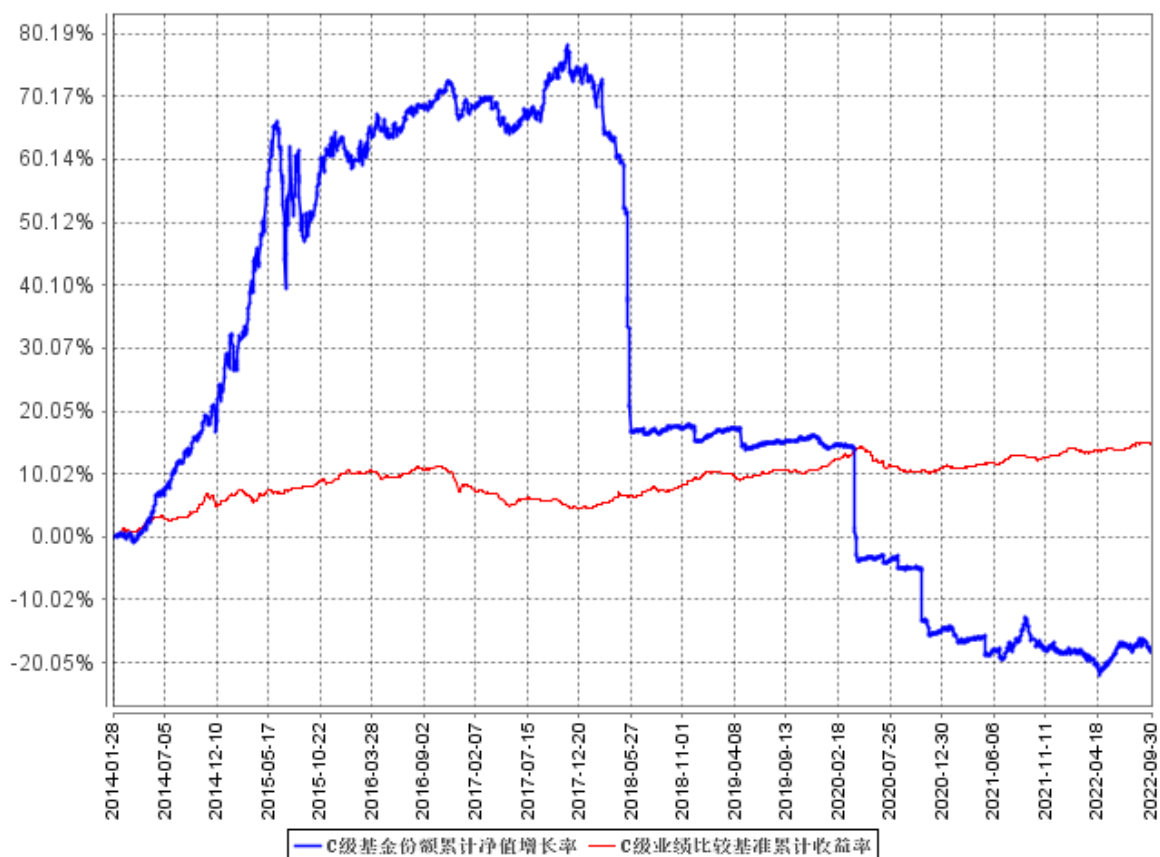
过去三个月	-1.64%	0.34%	0.73%	0.05%	-2.37%	0.29%
过去六个月	1.01%	0.33%	1.03%	0.04%	-0.02%	0.29%
过去一年	-2.60%	0.32%	1.73%	0.05%	-4.33%	0.27%
过去三年	-29.36%	0.61%	3.81%	0.07%	-33.17%	0.54%
过去五年	-52.98%	0.64%	8.27%	0.06%	-61.25%	0.58%
自基金合同生效起至今	-18.57%	0.63%	14.65%	0.08%	-33.22%	0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2014 年 1 月 28 日。

②根据《华商双债丰利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于国内依法发行固定收益类品种，包括信用债、可转换债券（含可分离交易可转债）、国债、政策性金融债、央行票据、债券回购、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于信用债和可转债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%；股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；基金保留的现金或投资于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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
厉骞	基金经 理	2020 年 3 月 10 日	-	6.5	男，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。2016 年 4 月加入华商基金管理有限公司，曾任研究员；2019 年 12 月 25 日起至今担任华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 10 日起至今担任华商双债丰利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 7 月 16 日起至今担任华商信用增强债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年三季度，债券市场先下后上，整体呈现小幅震荡走势。三季度债券关键节点为 8 月中旬。在此关键节点之前，流动性持续宽松，房地产风波叠加疫情对国内经济基本面造成的负面影响，而且 7 月政治局会议对下半年经济增长目标定调相对模糊，稳增长政策也并未超预期，债券市场震荡下行。8 月中旬之后，国内地产政策持续宽松，稳增长政策持续加码，并且美联储鹰派表态导致美元大幅升值，人民币汇率持续承压，受此影响国内利率震荡上行。本基金债券资产配置主要以中短久期的债券为主，投资信用评级以 AAA 为主，严格控制信用风险，并适时参与利率债、可转债及权益资产来增厚基金收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华商双债丰利债券型基金 A 类份额净值为 0.613 元，份额累计净值为 1.028 元，基金份额净值增长率为-1.61%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.73%，本类基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 2.34 个百分点。

截至本报告期末华商双债丰利债券型基金 C 类份额净值为 0.599 元，份额累计净值为 0.984 元，基金份额净值增长率为-1.64%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.73%，本类基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 2.37 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产

净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	35,657,298.65	16.34
	其中：股票	35,657,298.65	16.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	176,950,489.49	81.09
	其中：债券	176,950,489.49	81.09
	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	-1,345.31	-
	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	3,795,894.24	1.74
8	其他资产	1,802,386.62	0.83
9	合计	218,204,723.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,361,204.94	2.16
C	制造业	16,862,929.71	8.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	809,690.00	0.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,242,392.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	2,530,431.00	1.25
H	住宿和餐饮业	5,765.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,431,988.00	3.19
J	金融业	1,716,643.00	0.85
K	房地产业	696,255.00	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	35,657,298.65	17.67

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002025	航天电器	59,900	4,312,800.00	2.14
2	600536	中国软件	87,300	3,759,138.00	1.86
3	600862	中航高科	109,500	2,704,650.00	1.34
4	000034	神州数码	139,800	2,242,392.00	1.11
5	000983	山西焦煤	145,800	2,184,084.00	1.08
6	601111	中国国航	195,700	2,048,979.00	1.02
7	600801	华新水泥	119,800	2,006,650.00	0.99
8	300101	振芯科技	76,300	1,976,170.00	0.98
9	601958	金钼股份	219,618	1,719,608.94	0.85
10	000776	广发证券	120,100	1,713,827.00	0.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,646,825.86	5.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	128,024,322.14	63.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	15,801,863.01	7.83
7	可转债（可交换债）	22,477,478.48	11.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	176,950,489.49	87.68

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127900	18 铁道 17	147,480	15,164,474.63	7.51
2	163551	20 国电 02	132,370	13,373,845.92	6.63
3	132015	18 中油 EB	117,010	12,343,686.24	6.12
4	163335	20 中车 01	120,000	12,194,787.95	6.04
5	019679	22 国债 14	106,000	10,646,825.86	5.28

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

20 中证 13

1、2022 年 6 月 10 日，证监会发现公司存在以下行为：一是 2015 年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报我会批准。二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题。三是存在境外子公司从事房地产基金管理等非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。针对以上问题，证监会对公司采取责令改正的措施。2、2022 年 4 月 21 日，江苏证监局在日常监管过程中发现，中信证券南京洪武

北路营业部和中信证券南京浦口大道营业部(以下分别简称洪武北路营业部和浦口大道营业部)存在以下问题:一是洪武北路营业部未能采取有效措施,防范其从业人员私下接受客户委托,进行股票交易,也未及时向我局报告相关情况,违反了《证券经纪人管理暂行规定》(证监会公告〔2009〕2号)第二十一条的规定。二是浦口大道营业部在向客户销售金融产品过程中,未能勤勉尽责,审慎履职,全面了解投资者情况,也未能了解客户的身份、财产和收入状况、金融知识和投资经验、投资目标、风险偏好等基本情况,评估其购买金融产品的适当性。不符合《证券公司代销金融产品管理规定》(证监会公告〔2020〕20号修订)第十二条,《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令〔2017〕第177号)第三条的规定。江苏证监局对中信证券江苏分公司采取责令改正措施的决定。3、2022年3月2日,江西证监局在检查中发现中信证券江西分公司存在以下问题:一是负责人强制离岗期间审批了OA系统流程,实际代为履职人员与向监管部门报告的情况不一致,违反了《证券公司分支机构监管规定》(证监会公告〔2020〕66号修订)第十四条第一款、第二款的规定。二是部分办公电脑未按要求及时录入CRM员工交易地址监控维护系统,无法提供OA系统代为履职授权记录,违反了《证券公司内部控制指引》(证监机构字〔2003〕260号)第七条第一项的规定。三是增加经营场所未及时向监管部门报告,违反了《证券公司分支机构监管规定》第九条的规定。四是存在向风险等级高于其风险承受能力的投资者发送产品推介短信的情形,违反了《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令〔2020〕177号)第二十二条第(三)项的规定。五是融资融券合同、股票期权经纪合同、投资者开户文本未采取领用、登记控制,未采取连号控制、作废控制,保管人与使用人未分离,违反了《证券公司内部控制指引》第十三条第(一)项、第二十三条的规定。六是部分柜台业务存在客户开户资料重要信息填写缺失、《法定代表人授权委托书》缺少等问题,违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》(证监会公告〔2010〕11号),对中信证券股份有限公司江西分公司采取责令增加内部合规检查。2021年12月31日,黑龙江证监局在检查中发现公司黑龙江分公司存在以下问题:一是对公司总部制度规定落实不到位,未对自行制作的宣传材料提交总部审核;二是分公司自行制作的宣传材料内部审核流于形式,仅采用口头方式进行,无审核留痕;三是分公司个别员工向投资者分发的宣传材料存在不当表述且未提示投资风险,对中信证券股份有限公司黑龙江分公司采取出具警示函措施的决定。

21 招证 G4

1、2022-04-02,深圳证监局关于对招商证券股份有限公司采取责令改正措施的决定招商证券股份有限公司:经查,你公司在2022年3月14日的网络安全事件中,存在变更管理不完善,应急处置不及时、不到位等问题。上述行为违反了《证券期货业信息安全保障管理办法》(证监会令〔2016〕第82号,以下简称《信息安全保障管理办法》)第二十二条、第三十二条第一款以及《证券基金

经营机构信息技术管理办法》（证监会令第 179 号，以下简称《信息技术管理办法》）第二十二条第一款、第三十六条、第四十二条的相关规定。2、2022-06-10，交易所警示函：招商证券股份有限公司：2022 年 3 月 14 日，你公司集中交易系统发生技术故障，导致大量客户成交回报缓慢、部分客户无法登录系统交易，并且导致部分客户报价回购交易申报未成功，引发市场高度关注。经查，故障原因系你公司集中交易系统于 3 月 11 日在上线新功能时，未对程序变更进行充分的回归和性能测试，未发现系统存在严重性能问题导致，反映出你公司存在程序变更管理不完善，应急处置不及时、不到位等问题。上述行为违反了本所《会员管理规则》第 9.6 条、《会员管理业务指引第 1 号——会员交易及相关系统管理》第五条和第三十三条以及《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》第六十五条的相关规定。3、关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：经查，证监会发现你公司在 2022 年 5 月 16 日的网络安全事件中，存在系统设计与升级变更未经充分论证和测试，升级回退方案不完备等问题，反映出公司内部管理存在漏洞、权责分配机制不完善。4、2022-08-09，深圳证监局关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：招商证券股份有限公司：经检查，你公司在从事投资银行类业务过程中，存在以下问题：一是保荐业务中，个别项目对发行人的收入确认、核心技术、研发费用核算尽职调查不充分。二是债券承销业务中，个别项目对发行人的债务情况，对外担保情况，偿债能力，关联交易情况，重大仲裁、诉讼和其他重大事项及或有事项等尽职调查不充分。三是资产证券化业务中，个别项目对原始权益人、托管人的资信水平等尽职调查不充分；尽职调查报告未包含对重要债务人进行尽职调查的情况；存续期管理对基础资产现金流监督检查不到位，未发现涉及基础资产现金流的重大事项并发布临时公告。5、2022-08-13，招商证券：关于收到中国证券监督管理委员会立案告知书：因公司 2014 年在开展上海飞乐股份有限公司（现中安科股份有限公司）独立财务顾问业务工作期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规。2022-08-24，关于对招商证券股份有限公司及相关责任人予以书面警示的决定：2022 年 5 月 14 日，招商证券对恒生柜面管理系统进行升级，但未对系统升级进行全面风险评估，未进行压力测试，未能有效识别软件性能缺陷和变更实际影响范围，最终导致部分客户账户登录认证请求响应延迟。系统异常期间，零售客户登录失败 12.86 万名，机构账户登录失败 78 个，系统服务能力异常比例为 10.78%，上述情况反映出招商证券在交易及相关系统管理方面存在内部管理漏洞、安全运行管理制度执行不到位等问题。2022-09-06，招商证券：收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》。中国证监会认为，招商证券作为中安科重大资产重组的独立财务顾问，履职过程中未勤勉尽责，导致出具的《独立财务顾问报告》存在误导性陈述，且后续在并购重组当事人发生较大变化对本次重组构成较大影响的情况时未能予以高度关注，未按照规定及时向中国证监会报告，涉嫌违反《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监

会令第 54 号) (以下简称《财务顾问管理办法》) 第三条、第十九条第四项、第二十八条第五项之规定和 2005 年修订的《中华人民共和国证券法》(以下简称 2005 年《证券法》) 第二十条第二款和第一百七十三条之规定, 构成《财务顾问管理办法》第四十二条“财务顾问及其财务顾问主办人或者其他责任人员所发表的专业意见存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的, 中国证监会责令改正并依据《证券法》第二百二十三条的规定予以处罚”以及 2005 年《证券法》第二百二十三条“证券服务机构未勤勉尽责, 所制作、出具的文件有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”所述情形。项目签字人陈轩壁、俞新平是直接负责的主管人员。2022-09-08, 收到监管函: 2022 年 5 月 16 日, 你公司集中交易系统发生技术故障, 导致部分客户登录交易 APP 阻塞延迟。经查, 你公司在前述事件中存在交易系统设计与升级变更未经充分论证和测试、升级回退方案不完备等问题, 反映出你公司内部管理存在漏洞。2022-09-20, 招商证券: 收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》。招商证券担任中安科重大资产重组项目独立财务顾问, 项目主办人为陈轩壁和俞新平。经中国证监会另案查明, 中安消技术有限公司(以下简称中安消技术) 未及时提供真实、准确的盈利预测信息和虚增 2013 年营业收入, 导致中安科公开披露的重大资产重组文件存在误导性陈述、虚假记载。中安消技术将“班班通”项目计入 2014 年度《盈利预测报告》, 在该项目难以继续履行的情况下, 未及时提供真实、准确信息, 导致提供给中安科的信息不真实、不准确, 存在误导性陈述, 致使重组置入资产评估值严重虚增, 中安科据此虚增评估值发行股份, 严重损害了上市公司及其股东合法权益。招商证券制作、出具的《独立财务顾问报告》对相关盈利预测、置入资产评估值均有引用, 存在误导性陈述。招商证券未对“班班通”项目予以必要的关注, 未对“班班通”项目中标情况和实际进展情况予以审慎核查, 对制作、出具《独立财务顾问报告》所引用文件内容的真实性、准确性、完整性未进行充分核查和验证。

20 邮政 01

2022 年 3 月, 深圳市邮政管理局就疫情防控约谈中国邮政集团有限公司深圳市南山局, 督促中国邮政集团有限公司深圳市分公司落实企业防疫主体责任, 查漏补缺, 加强对入境信函、印刷品的投递信息和收件人信息的统计, 将入境国际邮件每日投递数据真实、准确、及时推送给邮政管理部门; 落实对从业人员、作业场所、运输车辆管理等防控要求, 进一步延伸风险管控链条, 切实做好国际邮件快件作业场所、人员、环境等重点部位和分拣、运输、投递等环节的疫情防控工作, 严防境外疫情通过寄递渠道扩散。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外, 本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查, 且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	51,314.14
2	应收证券清算款	1,751,072.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,802,386.62

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18 中油 EB	12,343,686.24	6.12
2	110059	浦发转债	6,367,032.99	3.16
3	110053	苏银转债	1,666,522.17	0.83
4	113011	光大转债	1,270,314.12	0.63
5	110045	海澜转债	407,989.87	0.20
6	128105	长集转债	219,130.75	0.11
7	123072	乐歌转债	190,644.19	0.09
8	113545	金能转债	12,158.15	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华商双债丰利债券 A	华商双债丰利债券 C
报告期期初基金份额总额	274,454,173.87	56,370,471.39
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	264,000.38	215,787.08
报告期期间基金拆分变动份额（份额减）	-	-

少以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	274,190,173.49	56,154,684.31

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	250,479,765.53
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	250,479,765.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	75.82

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额； 报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-07-01 至 2022-09-30	250,479,765.53	0.00	0.00	250,479,765.53	75.82%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%及以上的情况，由于持有人相对集中，本基金可能面临基金净值大幅波动的风险、延迟或暂停赎回的风险，且根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定本基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华商双债丰利债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《华商双债丰利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华商双债丰利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华商双债丰利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内华商双债丰利债券型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），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

2022 年 10 月 26 日