

华商恒益稳健混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 31 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 2023 年 8 月 30 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 2023 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
§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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	18
§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.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 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	1,287,324,731.02 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	陈牧原	陈四清

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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	21,276,667.52
本期利润	15,579,577.09
加权平均基金份额本期利润	0.0187
本期加权平均净值利润率	1.73%
本期基金份额净值增长率	6.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	65,078,713.53
期末可供分配基金份额利润	0.0506
期末基金资产净值	1,352,403,444.55
期末基金份额净值	1.0506
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	77.83%

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。

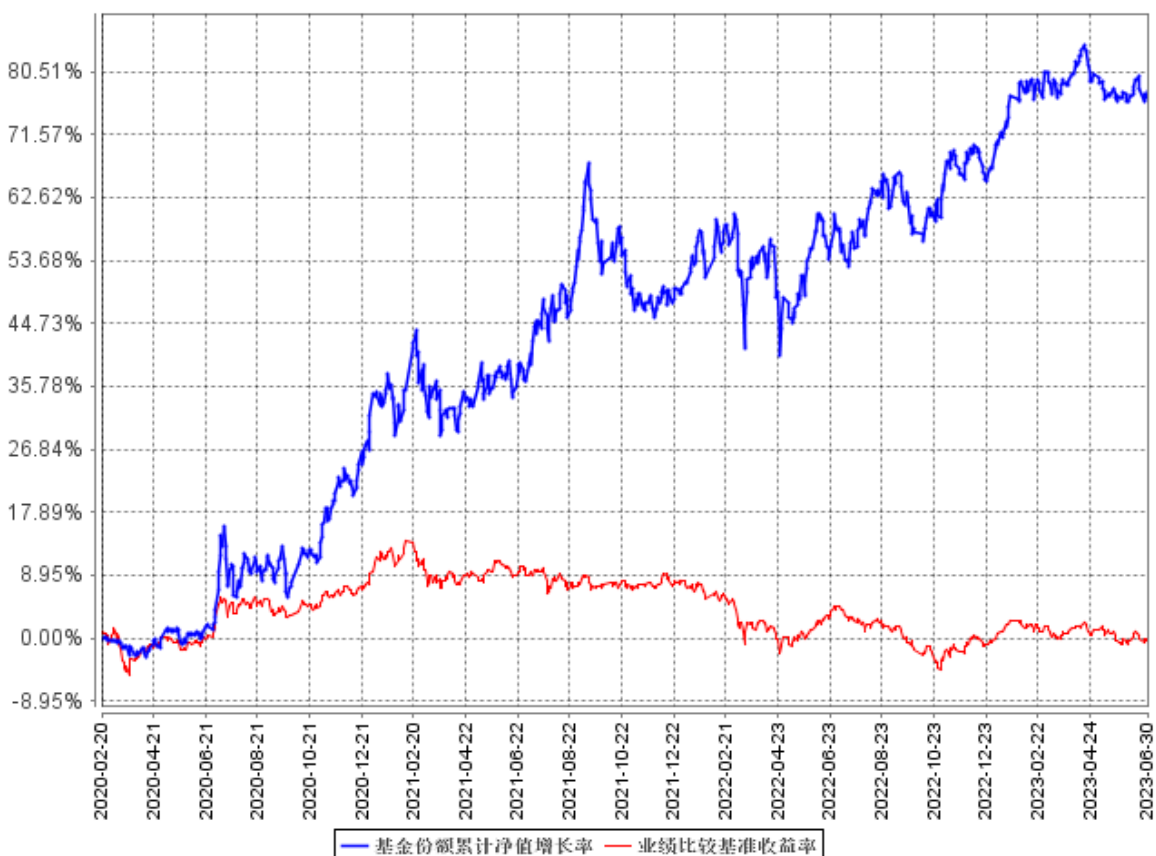
3.2 基金净值表现

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	0.60%	0.48%	0.85%	0.34%	-0.25%	0.14%
过去三个月	-0.95%	0.41%	-1.24%	0.32%	0.29%	0.09%
过去六个月	6.41%	0.54%	0.31%	0.33%	6.10%	0.21%
过去一年	12.09%	0.67%	-4.48%	0.39%	16.57%	0.28%
过去三年	74.41%	1.04%	-0.86%	0.47%	75.27%	0.57%
自基金合同生效起至今	77.83%	0.99%	-0.15%	0.48%	77.98%	0.51%

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《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板，创业板，存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、资产支持证券等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 20%-60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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，是一家为客户提供专业理财服务的资产管理机构。

本基金管理人拥有公募基金管理业务、私募资产管理业务、受托管理保险资金业务等业务资格，在主动权益、固定收益、量化投资、FOF 投资等领域全面布局，为客户提供专业理财服务。

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	2020 年 2 月 20 日	-	15.0	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

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

					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。
--	--	--	--	--	---

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

2023 年上半年，由于经济复苏节奏略低于市场预期，市场总体在一季度较为强势的表现之后呈现震荡走势。在整体经济、政策不明朗的背景下，市场没有很明确的主线，偏主题方向受到市场的偏好，包括传媒、人工智能、数字经济、光通讯、机器人等。而经济相关性较强的板块，在上半年承受较大的压力，包括消费、化工、建材、有色、地产等。本基金依旧保持了较为均衡的配置，主要持有行业包括有色、计算机、医药、化工、电子、交运、机械、电力设备、军工等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0506 元，份额累计净值为 1.6786 元。本报告期内本基金份额净值增长率为 6.41%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.31%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准的收益率 6.10 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

随着经济周期见底回升，稳增长政策效果逐渐显现，下半年市场有希望呈现较好的表现，市场整体机会可能会多于上半年。制造业、资源、科技、消费、金融等领域都会有相应的投资机会出现。

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》，本基金本报告期内应分配利润 59,251,391.92 元，本报告期内已实施的利润分配为 79,675,390.63 元。

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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	424,431,362.28	147,998,841.41
结算备付金		19,448,901.07	14,987,541.59
存出保证金		73,771.32	20,341.77
交易性金融资产	6.4.7.2	834,064,469.76	272,777,290.74
其中：股票投资		611,615,904.66	210,338,566.45
基金投资		-	-
债券投资		222,448,565.10	62,438,724.29
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	80,016,052.64	-
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		-	-
应收股利		1,488,962.92	-
应收申购款		1,976,934.02	2,469,192.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,361,500,454.01	438,253,207.55

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		5,593,912.83	14,756,555.50
应付赎回款		1,423,827.73	784,922.37
应付管理人报酬		1,367,244.84	410,585.18
应付托管费		227,874.15	68,430.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		565.91	361.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	483,584.00	296,628.90
负债合计		9,097,009.46	16,317,483.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,287,324,731.02	359,050,749.68
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	65,078,713.53	62,884,973.99
净资产合计		1,352,403,444.55	421,935,723.67
负债和净资产总计		1,361,500,454.01	438,253,207.55

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0506 元，基金份额总额 1,287,324,731.02 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		21,905,325.54	14,578,573.07
1.利息收入		798,603.04	48,946.78
其中：存款利息收入	6.4.7.10	672,625.82	48,946.78
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	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,945,640.32	2,010,341.16
其中：股票投资收益	6.4.7.11	21,436,471.08	-200,214.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-1,613.58	87,325.55
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,510,782.82	2,123,230.43
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	-5,697,090.43	12,305,892.38
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	858,172.61	213,392.75
减：二、营业总支出		6,325,748.45	1,553,345.16
1. 管理人报酬		5,335,378.83	1,245,582.07
2. 托管费		889,229.82	207,596.97
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		178.39	123.24
8. 其他费用	6.4.7.20	100,961.41	100,042.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,579,577.09	13,025,227.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,579,577.09	13,025,227.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,579,577.09	13,025,227.91

6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	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(基金净值)	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(基金净值)	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基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	928,273,981.34	-	66,289,553.08	994,563,534.42
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基金净值变动(净值减少以“-”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(基金净值)	1,287,324,731.02	-	65,078,713.53	1,352,403,444.55
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	180,540,196.51	-	40,036,214.79	220,576,411.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	180,540,196.51	-	40,036,214.79	220,576,411.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,690,832.65	-	-18,272,636.93	-10,581,804.28
(一)、综合收益总额	-	-	13,025,227.91	13,025,227.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变	7,690,832.65	-	-135,391.69	7,555,440.96

动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	61,320,583.04	-	6,970,515.72	68,291,098.76
2.基金赎回款	-53,629,750.39	-	-7,105,907.41	-60,735,657.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-31,162,473.15	-31,162,473.15
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	188,231,029.16	-	21,763,577.86	209,994,607.02

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》、《华商恒益稳健混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止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

除下文列示的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.2 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，于2023年3月31日前，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》和《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值，自2023年3月31日开始，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》和《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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。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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	424,431,362.28
等于：本金	424,379,524.02
加：应计利息	51,838.26
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：	424,431,362.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	602,846,252.96	-	611,615,904.66	8,769,651.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,270,577.30	222,448,565.10	1,495,493.66
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,270,577.30	222,448,565.10	1,495,493.66
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	821,528,747.10	2,270,577.30	834,064,469.76	10,265,145.36

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 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	80,016,052.64	-
银行间市场	-	-
合计	80,016,052.64	-

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,094.59

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	387,729.26
其中：交易所市场	387,729.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
合计	483,584.00

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	359,050,749.68	359,050,749.68
本期申购	1,154,115,772.11	1,154,115,772.11
本期赎回(以“-”号填列)	-225,841,790.77	-225,841,790.77
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,287,324,731.02	1,287,324,731.02

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
本期期初	101,986,944.08	-39,101,970.09	62,884,973.99
本期利润	21,276,667.52	-5,697,090.43	15,579,577.09
本期基金份额交易产生的变动数	98,291,326.69	-32,001,773.61	66,289,553.08
其中：基金申购款	132,511,542.06	-42,820,093.87	89,691,448.19
基金赎回款	-34,220,215.37	10,818,320.26	-23,401,895.11
本期已分配利润	-79,675,390.63	-	-79,675,390.63
本期末	141,879,547.66	-76,800,834.13	65,078,713.53

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	656,697.58
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	15,529.92
其他	398.32
合计	672,625.82

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	140,107,788.69
减：卖出股票成本总额	117,776,134.50
减：交易费用	895,183.11
买卖股票差价收入	21,436,471.08

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	892,918.78
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-894,532.36
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	-1,613.58

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 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,326,071.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,935,940.26
减：应计利息总额	282,365.55
减：交易费用	2,297.82
买卖债券差价收入	-894,532.36

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

本基金本报告期内未发生权证投资收益。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,510,782.82
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	4,510,782.82

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,697,090.43
——股票投资	-11,264,796.38

——债券投资	5,567,705.95
——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	-5,697,090.43

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	858,172.61
合计	858,172.61

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
帐户维护费	9,000.00
银行费用	2,701.26
其他	-
合计	100,961.41

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,335,378.83	1,245,582.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,442,158.22	419,052.38

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	889,229.82	207,596.97

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自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自有资金投资本基金。

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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 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	424,431,362.28	656,697.58	28,626,446.69	46,708.73

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 2 月 27 日	-	2023 年 2 月 27 日	2.0000	57,280,425.66	22,394,964.97	79,675,390.63	
合计	-	-	-	2.0000	57,280,425.66	22,394,964.97	79,675,390.63	

6.4.12 期末（2023 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
688256	寒武纪	2023 年 4 月 13 日	6 个月	非公开发行流通受限	121.10	164.56	18,600	2,252,460.00	3,060,816.00	-
300379	东方通	2023 年 6 月 8 日	6 个月	非公开发行流通受限	20.75	18.75	163,013	3,382,519.75	3,056,493.75	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	4,278	47,485.80	72,897.12	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,221	63,969.06	58,171.26	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	721	17,015.60	46,627.07	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-

301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	133	20,266.54	18,084.01	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	355	8,438.35	15,225.95	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	871	14,145.04	14,763.45	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,205	14,580.50	14,544.35	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	394	15,756.06	14,463.74	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	570	6,771.60	11,981.40	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	93	15,470.28	11,356.23	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	183	15,995.42	9,742.92	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	535	10,694.65	9,041.50	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,173	7,718.34	8,891.34	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	406	7,226.80	7,263.34	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	146	10,723.70	6,809.44	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	460	4,765.60	5,446.40	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	387	4,512.42	4,744.62	-

001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	133	3,455.34	3,262.49	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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中国工商银行，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，违约风险可能性很小；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 2023 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 5.07%(2022 年 12 月 31 日：8.93%)。

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随时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 2023 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 2023 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 0.52%。

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 2023 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	424,431,362.28	-	-	-	424,431,362.28
结算备付金	19,448,901.07	-	-	-	19,448,901.07
存出保证金	73,771.32	-	-	-	73,771.32
交易性金融资产	222,448,565.10	-	-	611,615,904.66	834,064,469.76
买入返售金融资产	80,016,052.64	-	-	-	80,016,052.64
应收股利	-	-	-	1,488,962.92	1,488,962.92
应收申购款	-	-	-	1,976,934.02	1,976,934.02
资产总计	746,418,652.41	-	-	615,081,801.60	1,361,500,454.01
负债					
应付清算款	-	-	-	5,593,912.83	5,593,912.83

应付赎回款	-	-	-	1,423,827.73	1,423,827.73
应付管理人报酬	-	-	-	1,367,244.84	1,367,244.84
应付托管费	-	-	-	227,874.15	227,874.15
应交税费	-	-	-	565.91	565.91
其他负债	-	-	-	483,584.00	483,584.00
负债总计	-	-	-	9,097,009.46	9,097,009.46
利率敏感度缺口	746,418,652.41	-	-	605,984,792.14	1,352,403,444.55
上年度末 2022 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	147,998,841.41	-	-	-	147,998,841.41
结算备付金	14,987,541.59	-	-	-	14,987,541.59
存出保证金	20,341.77	-	-	-	20,341.77
交易性金融资产	38,235,265.65	24,203,458.64	-	210,338,566.45	272,777,290.74
应收申购款	-	-	-	2,469,192.04	2,469,192.04
资产总计	201,241,990.42	24,203,458.64	-	212,807,758.49	438,253,207.55
负债					
应付清算款	-	-	-	14,756,555.50	14,756,555.50
应付赎回款	-	-	-	784,922.37	784,922.37
应付管理人报酬	-	-	-	410,585.18	410,585.18
应付托管费	-	-	-	68,430.86	68,430.86
应交税费	-	-	-	361.07	361.07
其他负债	-	-	-	296,628.90	296,628.90
负债总计	-	-	-	16,317,483.88	16,317,483.88
利率敏感度缺口	201,241,990.42	24,203,458.64	-	196,490,274.61	421,935,723.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-739,840.22	-212,285.89
	2. 市场利率下降 25 个基点	748,696.97	214,238.82

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 2023 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	-	137,304,730.89	-	137,304,730.89
资产合计	-	137,304,730.89	-	137,304,730.89
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	-	137,304,730.89	-	137,304,730.89
项目	上年度末 2022 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	-	61,004,777.46	-	61,004,777.46
资产合计	-	61,004,777.46	-	61,004,777.46
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	-	61,004,777.46	-	61,004,777.46

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	6,865,236.54	3,050,238.87
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-6,865,236.54	-3,050,238.87

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	611,615,904.66	45.22	210,338,566.45	49.85
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	611,615,904.66	45.22	210,338,566.45	49.85

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		32,617,230.82
2. 沪深 300 指数下降 5%		-32,617,230.82	-13,111,805.06

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	673,055,333.23	248,008,629.10
第二层次	154,110,341.92	24,768,661.64
第三层次	6,898,794.61	-
合计	834,064,469.76	272,777,290.74

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 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应收款项和其他金融负债，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	611,615,904.66	44.92
	其中：股票	611,615,904.66	44.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	222,448,565.10	16.34
	其中：债券	222,448,565.10	16.34
	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	80,016,052.64	5.88
	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	443,880,263.35	32.60
8	其他各项资产	3,539,668.26	0.26
9	合计	1,361,500,454.01	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 137,304,730.89 元，占净值比例 10.15%。

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	31,016,367.03	2.29
C	制造业	300,574,454.75	22.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,499,606.93	0.33
E	建筑业	2,617,126.10	0.19
F	批发和零售业	10,473,190.49	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	11,872,298.06	0.88
H	住宿和餐饮业	827,415.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,860,891.40	6.13
J	金融业	484,212.00	0.04
K	房地产业	2,892,202.00	0.21
L	租赁和商务服务业	3,769,394.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	20,182,255.64	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	2,217,977.51	0.16

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	474,311,173.77	35.07

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	30,559,925.30	2.26
B 消费者非必需品	42,467,453.23	3.14
C 消费者常用品	-	-
D 能源	15,133,227.78	1.12
E 金融	-	-
F 医疗保健	20,244,882.75	1.50
G 工业	3,417,484.83	0.25
H 信息技术	18,747,522.88	1.39
I 电信服务	-	-
J 公用事业	6,057,777.39	0.45
K 房地产	676,456.73	0.05
合计	137,304,730.89	10.15

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	00763	中兴通讯	579,400	16,773,729.66	1.24
1	000063	中兴通讯	75,200	3,424,608.00	0.25
2	02899	紫金矿业	1,203,291	12,758,217.72	0.94
2	601899	紫金矿业	591,500	6,725,355.00	0.50
3	01055	中国南方航空股份	4,436,000	18,077,372.50	1.34
3	600029	南方航空	157,900	952,137.00	0.07
4	00883	中国海洋石油	1,465,521	15,133,227.78	1.12
5	00753	中国国航	1,926,000	9,908,592.82	0.73
5	601111	中国国航	35,100	289,224.00	0.02
6	000807	云铝股份	760,600	9,682,438.00	0.72
7	00293	国泰航空	1,247,000	9,209,169.57	0.68
8	000630	铜陵有色	2,917,000	8,430,130.00	0.62
9	603979	金诚信	258,700	8,045,570.00	0.59

10	603728	鸣志电器	88,600	7,114,580.00	0.53
11	000960	锡业股份	442,400	6,879,320.00	0.51
12	03993	洛阳钼业	1,719,000	6,498,022.84	0.48
12	603993	洛阳钼业	63,000	335,790.00	0.02
13	000066	中国长城	484,800	6,704,784.00	0.50
14	300161	华中数控	119,900	6,417,048.00	0.47
15	300379	东方通	324,893	6,386,365.35	0.47
16	601100	恒立液压	96,900	6,233,577.00	0.46
17	002230	科大讯飞	90,600	6,157,176.00	0.46
18	000528	柳工	758,500	5,992,150.00	0.44
19	002706	良信股份	527,100	5,929,875.00	0.44
20	688776	国光电气	65,135	5,398,388.80	0.40
21	603896	寿仙谷	120,900	5,355,870.00	0.40
22	300759	康龙化成	134,350	5,142,918.00	0.38
23	000425	徐工机械	754,600	5,108,642.00	0.38
24	600862	中航高科	201,300	5,094,903.00	0.38
25	688372	伟测科技	31,311	4,795,279.65	0.35
26	600399	抚顺特钢	466,800	4,761,360.00	0.35
27	600584	长电科技	150,900	4,703,553.00	0.35
28	688256	寒武纪	27,111	4,660,884.00	0.34
29	002153	石基信息	316,550	4,431,700.00	0.33
30	688337	普源精电	73,478	4,427,784.28	0.33
31	688232	新点软件	82,261	4,426,464.41	0.33
32	01258	中国有色矿业	1,296,000	4,421,078.50	0.33
33	300203	聚光科技	210,900	4,274,943.00	0.32
34	002149	西部材料	254,200	4,268,018.00	0.32
35	688131	皓元医药	73,689	4,198,799.22	0.31
36	02096	先声药业	582,000	4,163,956.71	0.31
37	600587	新华医疗	115,600	4,084,148.00	0.30
38	688486	龙迅股份	36,817	4,051,710.85	0.30
39	688033	天宜上佳	211,260	4,039,291.20	0.30
40	603105	芯能科技	235,600	3,979,284.00	0.29
41	002821	凯莱英	24,400	2,875,784.00	0.21
41	06821	凯莱英	13,300	1,077,859.16	0.08
42	600570	恒生电子	88,300	3,910,807.00	0.29
43	002057	中钢天源	369,500	3,879,750.00	0.29
44	603885	吉祥航空	251,200	3,876,016.00	0.29
45	00902	华能国际电力股份	856,000	3,867,152.91	0.29
46	600276	恒瑞医药	79,200	3,793,680.00	0.28

47	02273	固生堂	82,200	3,766,601.77	0.28
48	600710	苏美达	437,800	3,747,568.00	0.28
49	000426	兴业银锡	418,400	3,715,392.00	0.27
50	002155	湖南黄金	301,700	3,680,740.00	0.27
51	300496	中科创达	38,030	3,664,190.50	0.27
52	01208	五矿资源	1,724,000	3,608,150.29	0.27
53	600415	小商品城	421,700	3,597,101.00	0.27
54	600536	中国软件	71,120	3,334,105.60	0.25
55	600031	三一重工	193,800	3,222,894.00	0.24
56	688300	联瑞新材	68,507	3,202,702.25	0.24
57	688133	泰坦科技	37,120	3,162,252.80	0.23
58	300525	博思软件	203,820	3,126,598.80	0.23
59	000933	神火股份	231,300	3,006,900.00	0.22
60	000938	紫光股份	92,500	2,946,125.00	0.22
61	300170	汉得信息	254,200	2,933,468.00	0.22
62	01801	信达生物	107,000	2,920,095.06	0.22
63	688111	金山办公	6,178	2,917,375.16	0.22
64	002138	顺络电子	122,000	2,917,020.00	0.22
65	688311	盟升电子	41,198	2,881,388.12	0.21
66	300723	一品红	97,350	2,852,355.00	0.21
67	01516	融创服务	1,396,000	2,844,455.82	0.21
68	301319	唯特偶	47,200	2,824,920.00	0.21
69	300298	三诺生物	104,300	2,820,272.00	0.21
70	002859	洁美科技	99,100	2,745,070.00	0.20
71	603222	济民医疗	260,800	2,720,144.00	0.20
72	301236	软通动力	99,900	2,718,279.00	0.20
73	300996	普联软件	87,900	2,698,530.00	0.20
74	301220	亚香股份	78,900	2,691,279.00	0.20
75	600129	太极集团	45,100	2,682,999.00	0.20
76	603712	七一二	88,800	2,682,648.00	0.20
77	300257	开山股份	176,500	2,677,505.00	0.20
78	02269	药明生物	74,500	2,579,216.00	0.19
79	01797	东方甄选	109,500	2,574,398.66	0.19
80	603871	嘉友国际	163,100	2,562,301.00	0.19
81	600989	宝丰能源	201,600	2,542,176.00	0.19
82	002653	海思科	107,310	2,532,516.00	0.19
83	300036	超图软件	103,700	2,458,727.00	0.18
84	600521	华海药业	131,000	2,411,710.00	0.18
85	600497	驰宏锌锗	478,300	2,401,066.00	0.18

86	000768	中航西飞	89,700	2,399,475.00	0.18
87	600131	国网信通	118,700	2,396,553.00	0.18
88	600153	建发股份	219,200	2,391,472.00	0.18
89	688179	阿拉丁	77,379	2,310,536.94	0.17
90	603019	中科曙光	44,900	2,285,410.00	0.17
91	688083	中望软件	15,551	2,253,184.39	0.17
92	688586	江航装备	158,707	2,207,614.37	0.16
93	688100	威胜信息	73,998	2,205,880.38	0.16
94	02380	中国电力	825,000	2,190,624.48	0.16
95	300832	新产业	37,000	2,183,000.00	0.16
96	603915	国茂股份	101,500	2,149,770.00	0.16
97	002368	太极股份	51,800	2,132,606.00	0.16
98	688103	国力股份	35,193	2,108,412.63	0.16
99	01818	招金矿业	232,500	2,096,444.22	0.16
100	300395	菲利华	42,600	2,095,920.00	0.15
101	01548	金斯瑞生物科技	128,298	2,081,872.14	0.15
102	689009	九号公司	55,951	2,061,794.35	0.15
103	600489	中金黄金	199,400	2,059,802.00	0.15
104	01099	国药控股	90,800	2,051,036.71	0.15
105	000680	山推股份	360,800	2,031,304.00	0.15
106	301208	中亦科技	36,600	2,025,078.00	0.15
107	688258	卓易信息	29,539	1,971,137.47	0.15
108	688036	传音控股	13,323	1,958,481.00	0.14
109	02600	中国铝业	376,000	1,168,259.30	0.09
109	601600	中国铝业	143,800	789,462.00	0.06
110	002608	江苏国信	258,070	1,953,589.90	0.14
111	301263	泰恩康	92,340	1,928,059.20	0.14
112	301162	国能日新	24,360	1,921,516.80	0.14
113	300593	新雷能	82,900	1,899,239.00	0.14
114	002791	坚朗五金	29,300	1,896,003.00	0.14
115	301080	百普赛斯	29,850	1,875,177.00	0.14
116	00751	创维集团	576,000	1,837,469.26	0.14
117	601816	京沪高铁	347,706	1,828,933.56	0.14
118	300286	安科瑞	46,200	1,749,132.00	0.13
119	688777	中控技术	27,591	1,732,162.98	0.13
120	002372	伟星新材	83,800	1,721,252.00	0.13
121	688768	容知日新	21,496	1,716,885.52	0.13
122	605020	永和股份	66,038	1,704,440.78	0.13
123	600048	保利发展	130,500	1,700,415.00	0.13

124	002025	航天电器	25,500	1,626,900.00	0.12
125	000821	京山轻机	79,000	1,616,340.00	0.12
126	02367	巨子生物	50,000	1,604,245.20	0.12
127	688290	景业智能	23,117	1,542,135.07	0.11
128	603259	药明康德	24,500	1,526,595.00	0.11
129	002430	杭氧股份	44,100	1,515,276.00	0.11
130	688262	国芯科技	37,119	1,510,372.11	0.11
131	688433	华曙高科	44,399	1,509,566.00	0.11
132	603138	海量数据	78,200	1,488,928.00	0.11
133	300767	震安科技	57,500	1,458,200.00	0.11
134	000975	银泰黄金	123,700	1,447,290.00	0.11
135	603638	艾迪精密	70,300	1,442,556.00	0.11
136	300229	拓尔思	55,400	1,438,738.00	0.11
137	002915	中欣氟材	81,700	1,365,207.00	0.10
138	688435	英方软件	17,903	1,361,344.12	0.10
139	603212	赛伍技术	61,400	1,277,734.00	0.09
140	688089	嘉必优	42,337	1,261,642.60	0.09
141	688625	呈和科技	31,523	1,235,386.37	0.09
142	688506	百利天恒	16,919	1,224,258.84	0.09
143	00020	商汤-W	614,000	1,171,818.14	0.09
144	002338	奥普光电	27,600	1,163,340.00	0.09
145	002389	航天彩虹	52,100	1,157,141.00	0.09
146	603169	兰石重装	153,900	1,145,016.00	0.08
147	600562	国睿科技	70,100	1,135,620.00	0.08
148	002422	科伦药业	37,700	1,118,936.00	0.08
149	601020	华钰矿业	127,400	1,094,366.00	0.08
150	603209	兴通股份	51,380	1,089,769.80	0.08
151	301391	卡莱特	9,200	1,077,964.00	0.08
152	688385	复旦微电	21,516	1,077,951.60	0.08
153	000803	山高环能	103,400	1,068,122.00	0.08
154	002436	兴森科技	68,300	1,058,650.00	0.08
155	688153	唯捷创芯	14,438	1,056,284.08	0.08
156	300633	开立医疗	19,300	1,051,850.00	0.08
157	603039	泛微网络	12,800	1,044,864.00	0.08
158	600428	中远海特	163,200	1,028,160.00	0.08
159	600435	北方导航	89,000	1,022,610.00	0.08
160	300366	创意信息	82,300	1,017,228.00	0.08
161	600511	国药股份	25,800	1,002,330.00	0.07
162	002444	巨星科技	45,800	1,002,104.00	0.07

163	300045	华力创通	86,300	1,001,080.00	0.07
164	688369	致远互联	18,097	1,000,764.10	0.07
165	301088	戎美股份	55,800	997,146.00	0.07
166	600301	华锡有色	55,000	987,250.00	0.07
167	688308	欧科亿	24,476	979,040.00	0.07
168	300866	安克创新	11,000	962,500.00	0.07
169	000537	广宇发展	81,100	946,437.00	0.07
170	603583	捷昌驱动	43,900	945,606.00	0.07
171	001218	丽臣实业	41,800	945,098.00	0.07
172	600970	中材国际	73,600	938,400.00	0.07
173	300378	鼎捷软件	27,200	931,600.00	0.07
174	688590	新致软件	40,784	927,020.32	0.07
175	001323	慕思股份	27,100	920,316.00	0.07
176	301367	怡和嘉业	6,200	919,708.00	0.07
177	603489	八方股份	13,100	918,572.00	0.07
178	300474	景嘉微	9,900	890,901.00	0.07
179	688260	昀冢科技	47,033	864,466.54	0.06
180	00670	中国东方航空股份	352,000	860,022.94	0.06
181	600248	陕建股份	179,400	855,738.00	0.06
182	301165	锐捷网络	13,800	851,736.00	0.06
183	600021	上海电力	78,100	841,137.00	0.06
184	600988	赤峰黄金	62,200	837,212.00	0.06
185	300146	汤臣倍健	34,800	834,504.00	0.06
186	300699	光威复材	27,040	834,184.00	0.06
187	00268	金蝶国际	83,000	801,975.08	0.06
188	600085	同仁堂	13,800	794,328.00	0.06
189	688293	奥浦迈	16,652	793,800.84	0.06
190	300682	朗新科技	34,000	791,520.00	0.06
191	688658	悦康药业	37,921	789,136.01	0.06
192	003029	吉大正元	24,300	788,535.00	0.06
193	688472	阿特斯	42,778	779,757.12	0.06
194	603517	绝味食品	20,600	765,290.00	0.06
195	603281	江瀚新材	24,448	754,954.24	0.06
196	002180	纳思达	21,900	750,075.00	0.06
197	688515	裕太微	4,364	749,124.24	0.06
198	002941	新疆交建	47,800	739,944.00	0.05
199	000831	中国稀土	23,500	695,600.00	0.05
200	603859	能科科技	13,600	695,368.00	0.05
201	000035	中国天楹	150,779	690,567.82	0.05

202	00817	中国金茂	638,000	676,456.73	0.05
203	000060	中金岭南	136,500	648,375.00	0.05
204	688661	和林微纳	8,886	624,685.80	0.05
205	688249	晶合集成	32,208	605,155.95	0.04
206	688361	中科飞测	7,207	585,029.93	0.04
207	300910	瑞丰新材	11,590	582,977.00	0.04
208	01882	海天国际	34,000	573,029.01	0.04
209	600754	锦江酒店	13,500	571,590.00	0.04
210	002384	东山精密	21,800	564,620.00	0.04
211	002017	东信和平	42,380	555,601.80	0.04
212	002020	京新药业	43,300	555,106.00	0.04
213	688489	三未信安	8,708	550,781.00	0.04
214	300753	爱朋医疗	29,600	542,568.00	0.04
215	688439	振华风光	4,924	540,753.68	0.04
216	002415	海康威视	16,300	539,693.00	0.04
217	688146	中船特气	11,820	498,804.00	0.04
218	301035	润丰股份	6,300	494,991.00	0.04
219	688072	拓荆科技	1,155	491,995.35	0.04
220	002292	奥飞娱乐	49,200	491,016.00	0.04
221	688682	霍莱沃	5,685	476,061.90	0.04
222	688981	中芯国际	9,423	476,049.96	0.04
223	300627	华测导航	14,100	457,827.00	0.03
224	603486	科沃斯	5,800	451,066.00	0.03
225	688078	龙软科技	8,728	449,928.40	0.03
226	688200	华峰测控	2,735	418,455.00	0.03
227	688618	三旺通信	6,163	417,358.36	0.03
228	603659	璞泰来	10,500	401,310.00	0.03
229	300700	岱勒新材	20,900	398,145.00	0.03
230	002865	钧达股份	2,600	396,578.00	0.03
231	301266	宇邦新材	5,600	393,736.00	0.03
232	300842	帝科股份	4,300	393,192.00	0.03
233	688520	神州细胞	6,923	392,811.02	0.03
234	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.03
235	600821	金开新能	56,700	390,663.00	0.03
236	002128	电投能源	29,200	386,024.00	0.03
237	002463	沪电股份	18,400	385,296.00	0.03
238	688037	芯源微	2,238	382,586.10	0.03
239	000875	吉电股份	69,300	373,527.00	0.03
240	688281	华秦科技	1,812	366,930.00	0.03

241	600079	人福医药	13,600	366,384.00	0.03
242	600316	洪都航空	15,400	361,130.00	0.03
243	600150	中国船舶	9,900	325,809.00	0.02
244	601226	华电重工	39,000	305,760.00	0.02
245	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
246	603556	海兴电力	11,300	285,212.00	0.02
247	002028	思源电气	6,000	280,320.00	0.02
248	600118	中国卫星	9,900	279,279.00	0.02
249	600886	国投电力	21,600	273,240.00	0.02
250	601985	中国核电	38,000	267,900.00	0.02
251	300896	爱美客	600	266,970.00	0.02
252	600588	用友网络	13,000	266,500.00	0.02
253	600893	航发动力	6,300	266,238.00	0.02
254	600258	首旅酒店	13,500	255,825.00	0.02
255	300360	炬华科技	14,100	252,108.00	0.02
256	000519	中兵红箭	13,900	251,451.00	0.02
257	002738	中矿资源	4,900	249,606.00	0.02
258	000002	万科 A	17,500	245,350.00	0.02
259	601101	昊华能源	41,900	243,858.00	0.02
260	601336	新华保险	6,600	242,682.00	0.02
261	600958	东方证券	24,900	241,530.00	0.02
262	688552	航天南湖	9,556	239,960.00	0.02
263	301117	佳缘科技	3,700	239,094.00	0.02
264	002335	科华数据	6,600	237,270.00	0.02
265	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.02
266	000582	北部湾港	30,600	232,560.00	0.02
267	300294	博雅生物	6,300	228,564.00	0.02
268	301349	信德新材	4,500	225,630.00	0.02
269	601388	怡球资源	78,100	224,928.00	0.02
270	300831	派瑞股份	16,900	222,911.00	0.02
271	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.02
272	688326	经纬恒润	1,445	208,643.55	0.02
273	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.01
274	688531	日联科技	1,327	195,404.95	0.01
275	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.01
276	002756	永兴材料	3,100	194,091.00	0.01
277	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.01
278	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.01
279	002027	分众传媒	25,300	172,293.00	0.01

280	600475	华光环能	14,200	168,696.00	0.01
281	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
282	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
283	688484	南芯科技	3,937	160,435.34	0.01
284	688352	颀中科技	12,041	160,180.19	0.01
285	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.01
286	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
287	301358	湖南裕能	3,549	155,793.89	0.01
288	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
289	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
290	001287	中电港	5,693	154,298.34	0.01
291	301408	华人健康	8,706	150,779.05	0.01
292	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
293	688522	纳睿雷达	2,645	141,560.40	0.01
294	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
295	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
296	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
297	688507	索辰科技	928	120,432.28	0.01
298	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
299	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
300	301322	绿通科技	1,818	101,548.17	0.01
301	601061	中信金属	11,725	101,537.90	0.01
302	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.01
303	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
304	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.01
305	301439	泓淋电力	5,343	94,816.22	0.01
306	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
307	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
308	603135	中重科技	4,057	81,743.74	0.01
309	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
310	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.01
311	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
312	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
313	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
314	301345	涛涛车业	1,458	69,404.96	0.01
315	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.00
316	300129	泰胜风能	6,500	62,335.00	0.00
317	601065	江盐集团	4,593	60,952.59	0.00
318	601133	柏诚股份	3,861	56,541.96	0.00

319	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.00
320	688157	松井股份	906	47,655.60	0.00
321	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.00
322	603125	常青科技	1,330	37,317.14	0.00
323	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
324	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
325	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
326	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
327	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
328	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
329	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
330	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
331	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
332	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
333	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
334	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.00
335	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
336	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
337	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
338	605319	无锡振华	764	12,124.68	0.00
339	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
340	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
341	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
342	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
343	01772	赣锋锂业	207	9,752.43	0.00
344	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
345	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
346	02331	李宁	11	427.48	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	01055	中国南方航空股份	14,696,598.63	3.48
2	00763	中兴通讯	13,524,575.05	3.21
3	002230	科大讯飞	10,512,564.00	2.49

4	600276	恒瑞医药	8,358,184.20	1.98
5	00293	国泰航空	8,254,637.69	1.96
6	688131	皓元医药	6,594,134.22	1.56
7	688776	国光电气	6,262,095.90	1.48
8	000066	中国长城	6,224,771.00	1.48
9	000528	柳工	5,763,615.00	1.37
10	601100	恒立液压	5,700,870.00	1.35
11	603896	寿仙谷	5,660,292.70	1.34
12	300759	康龙化成	5,522,550.50	1.31
13	603259	药明康德	5,232,538.90	1.24
14	600399	抚顺特钢	5,201,072.00	1.23
15	300496	中科创达	5,133,180.70	1.22
16	300161	华中数控	5,075,344.00	1.20
17	01258	中国有色矿业	5,031,859.76	1.19
18	000425	徐工机械	4,817,322.00	1.14
19	600584	长电科技	4,792,116.32	1.14
20	600862	中航高科	4,772,873.00	1.13

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	002230	科大讯飞	5,645,722.83	1.34
2	600276	恒瑞医药	5,276,743.80	1.25
3	600011	华能国际	5,238,874.00	1.24
4	603619	中曼石油	4,689,427.00	1.11
5	688256	寒武纪	4,304,851.76	1.02
6	300229	拓尔思	3,984,167.00	0.94
7	603019	中科曙光	3,797,446.00	0.90
8	600021	上海电力	3,658,092.00	0.87
9	002268	电科网安	3,402,192.00	0.81
10	300558	贝达药业	3,258,217.90	0.77
11	603259	药明康德	3,220,281.00	0.76
12	02096	先声药业	3,005,694.14	0.71
13	603728	鸣志电器	2,801,682.24	0.66
14	688036	传音控股	2,616,698.37	0.62

15	600536	中国软件	2,436,054.00	0.58
16	688506	百利天恒	2,432,871.86	0.58
17	600023	浙能电力	2,402,537.00	0.57
18	600031	三一重工	2,397,790.00	0.57
19	000603	盛达资源	2,205,418.00	0.52
20	601225	陕西煤业	2,197,794.00	0.52

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	530,318,269.09
卖出股票收入（成交）总额	140,107,788.69

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	153,842,107.26	11.38
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）	68,606,457.84	5.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	222,448,565.10	16.45

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	019679	22 国债 14	661,000	67,288,405.56	4.98
2	019694	23 国债 01	456,000	46,105,997.59	3.41
3	019688	22 国债 23	400,000	40,447,704.11	2.99
4	128048	张行转债	77,240	8,836,359.69	0.65
5	113615	金诚转债	21,710	6,196,607.98	0.46

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

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	73,771.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,488,962.92
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,976,934.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,539,668.26

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	8,836,359.69	0.65
2	113615	金诚转债	6,196,607.98	0.46
3	110091	合力转债	3,129,513.88	0.23
4	113519	长久转债	3,102,318.02	0.23
5	123048	应急转债	3,085,465.12	0.23
6	128132	交建转债	2,961,760.43	0.22
7	127039	北港转债	2,946,327.45	0.22
8	110075	南航转债	2,936,815.25	0.22
9	111000	起帆转债	2,901,730.71	0.21
10	110053	苏银转债	2,823,585.05	0.21
11	113634	珀莱转债	2,724,928.32	0.20
12	113049	长汽转债	2,631,925.69	0.19
13	123142	申昊转债	2,626,224.74	0.19
14	127069	小熊转债	2,505,209.45	0.19
15	128121	宏川转债	2,371,520.87	0.18
16	127036	三花转债	2,004,792.33	0.15
17	127027	能化转债	1,981,703.32	0.15
18	127078	优彩转债	1,978,552.27	0.15
19	113641	华友转债	1,946,923.46	0.14
20	118014	高测转债	1,501,942.70	0.11
21	113053	隆 22 转债	1,443,380.25	0.11

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
50,508	25,487.54	766,515,193.48	59.54%	520,809,537.54	40.46%

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	387,624.66	0.0301%

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	359,050,749.68
本报告期基金总申购份额	1,154,115,772.11
减：本报告期基金总赎回份额	225,841,790.77
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	1,287,324,731.02

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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
广发证券	2	346,386,713.43	52.72%	322,625.82	56.62%	-
中信建投证券	1	100,060,142.41	15.23%	93,186.58	16.35%	-
海通证券	2	97,565,702.35	14.85%	48,782.70	8.56%	-
国联证券	2	75,641,959.00	11.51%	70,445.80	12.36%	-
首创证券	1	37,373,760.53	5.69%	34,806.11	6.11%	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择专用席位的标准和程序：

1) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- a) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- b) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- c) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2) 基金交易单元的选择程序如下：

- a) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- b) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2. 本基金本报告期内新增中信建投证券 1 个席位。

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
广发证券	55,387,273.51	30.03%	160,000,000.00	8.98%	-	-
中信建投证券	12,113,182.30	6.57%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	109,529,134.06	59.38%	1,621,000,000.00	91.02%	-	-
首创证券	7,426,433.84	4.03%	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
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	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西部证券股份有限公司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、	2023 年 1 月 3 日

		证券时报、证券日报	
2	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司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	2023 年 1 月 4 日
3	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
4	华商基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2023 年 1 月 20 日
5	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	2023 年 2 月 2 日
6	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京坤元基金销售有限公司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	2023 年 2 月 15 日
7	华商恒益稳健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	2023 年 2 月 21 日
8	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	2023 年 2 月 21 日
9	华商基金管理有限公司关于面向养老金客户通过直销柜台认、申购旗下部分基金实施费率优惠的公告	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	2023 年 2 月 21 日
10	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 2023 年度第一次分红公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报	2023 年 2 月 23 日
11	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	2023 年 2 月 28 日
12	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海陆享基金销售有限公司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	2023 年 2 月 28 日
13	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购赎回等交易类业务的公告	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	2023 年 3 月 15 日
14	华商基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	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、	2023 年 3 月 15 日

		证券时报、证券日报	
15	华商基金管理有限公司关于旗下基金可投资北交所股票的公告	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	2023 年 3 月 16 日
16	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海中欧财富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	2023 年 3 月 24 日
17	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海长量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	2023 年 3 月 27 日
18	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
19	华商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023 年 3 月 31 日
20	华商基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	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	2023 年 4 月 1 日
21	华商基金管理有限公司关于旗下基金投资寒武纪（688256）非公开发行股票的公告	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	2023 年 4 月 14 日
22	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业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、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023 年 4 月 18 日
23	华商基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告	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	2023 年 4 月 22 日
24	华商恒益稳健混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 23 日
25	华商基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2023 年 4 月 23 日
26	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	2023 年 4 月 28 日
27	华商基金管理有限公司关于终止	公司网站、中国证监会	2023 年 5 月 5 日

	与江西正融基金销售有限公司销售合作关系的公告	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	
28	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行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、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023 年 5 月 23 日
29	华商基金管理有限公司关于旗下基金投资东方通(300382.SZ)非公开发行股票的公告	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	2023 年 6 月 9 日
30	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参加华泰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、中国证券报	2023 年 6 月 28 日
31	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海中正达广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	2023 年 6 月 30 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

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	2023-01-01 至 2023-02-27	84,946,483.18	27,906,046.51	0.00	112,852,529.69	8.77%
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。

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

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

基金托管人地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880，010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日