

华商稳健泓利一年持有期混合型
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 07 月 01 日至 09 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华商稳健泓利一年持有混合 |
| 基金主代码 | 016641 |
| 交易代码 | 016641 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 5 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 75,888,260.52 份 |
| 投资目标 | 以追求长期稳定收益为目标，在严格控制投资组合风险特征的前提下，力争为实现基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采用战略资产配置和战术资产配置决策来确定基金组合中各类资产的比例。</p> <p>(1) 战略资产配置</p> <p>本基金将遵循绝对收益理念构建战略资产配置模型。在考虑各大类资产配置时，以预期收益、最大回撤作为衡量各资产属性的指标，借鉴马科维茨的均值方差理论，形成各类别资产配置的“预期收益-最大回撤”有效前沿。在此基础上，结合本基金的目标风险收益特征定位，得到中长期战略资产配置比例中枢。</p> <p>(2) 战术资产配置</p> <p>在确定各类资产中长期资产配置比例中枢的基础上，本基金将根据内部大类资产轮动模型，定</p> |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 期对各类资产进行动态优化调整，以提升投资组合的风险调整后收益。 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×15%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债总全价指数收益率×80% | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华商稳健泓利一年持有混合 A | 华商稳健泓利一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016641 | 016642 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 58,393,153.90 份 | 17,495,106.62 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（2024 年 7 月 1 日 — 2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------|
| | 华商稳健泓利一年持有混合 A | 华商稳健泓利一年持有混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -677,036.60 | -240,938.00 |
| 2. 本期利润 | 1,547,340.63 | 401,103.94 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0229 | 0.0191 |
| 4. 期末基金资产净值 | 62,241,383.95 | 18,545,236.96 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0659 | 1.0600 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华商稳健泓利一年持有混合 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 | 3.05% | 0.41% | 3.39% | 0.26% | -0.34% | 0.15% |

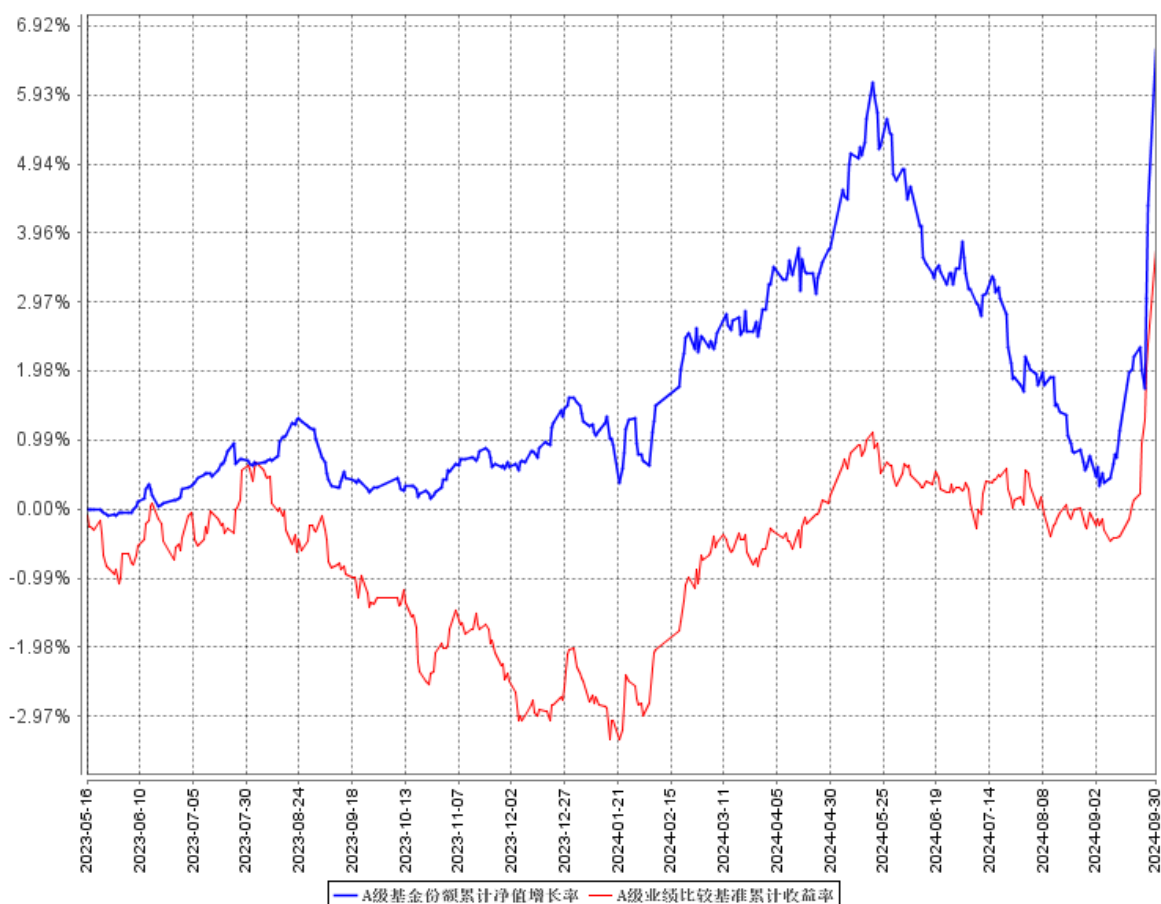
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | 3.64% | 0.35% | 4.31% | 0.21% | -0.67% | 0.14% |
| 过去一年 | 6.25% | 0.27% | 5.04% | 0.20% | 1.21% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.59% | 0.23% | 3.72% | 0.19% | 2.87% | 0.04% |

华商稳健泓利一年持有混合 C

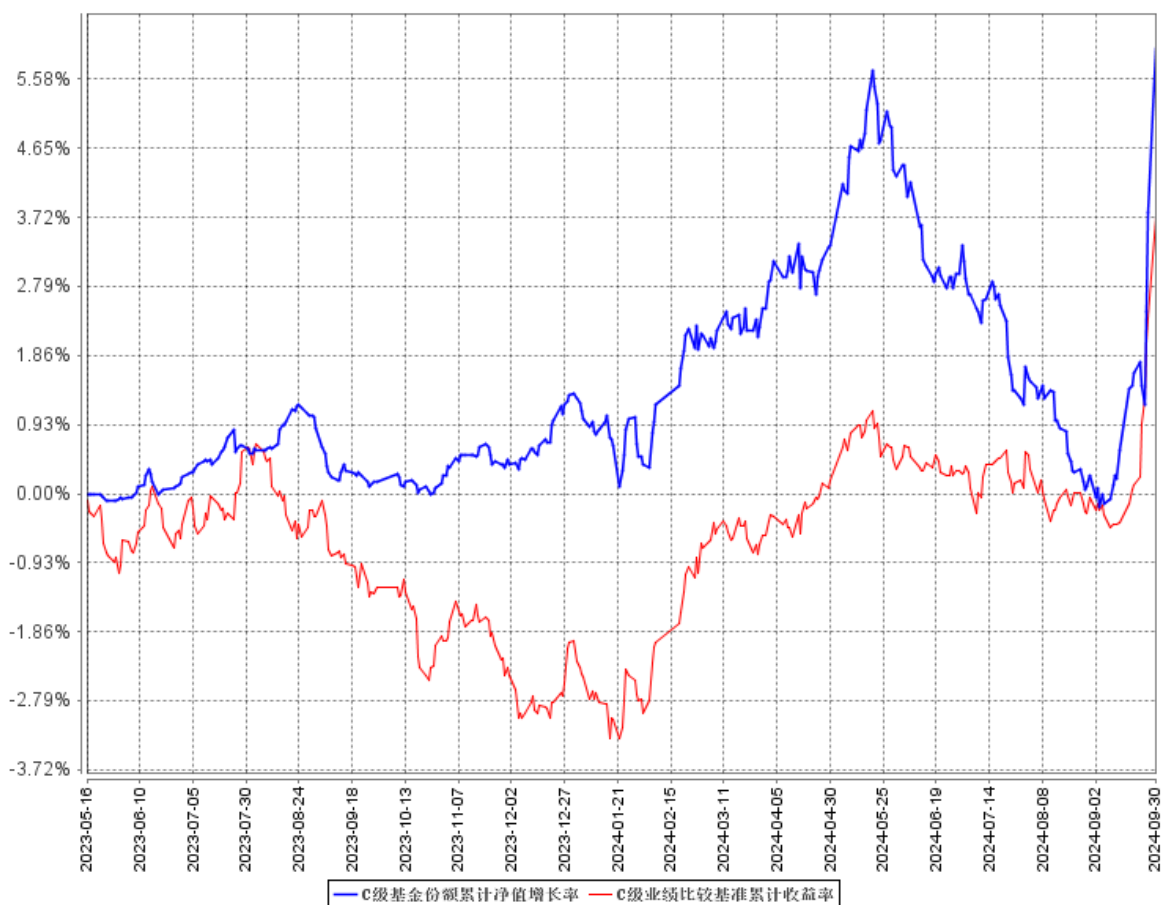
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.94% | 0.41% | 3.39% | 0.26% | -0.45% | 0.15% |
| 过去六个月 | 3.42% | 0.35% | 4.31% | 0.21% | -0.89% | 0.14% |
| 过去一年 | 5.82% | 0.27% | 5.04% | 0.20% | 0.78% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.00% | 0.23% | 3.72% | 0.19% | 2.28% | 0.04% |

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 2023 年 5 月 16 日。

②根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张永志 | 基金经理, 固定收益部副总经理, 公司公募业务固收投资决策委员 | 2023 年 5 月 16 日 | - | 18.7 | 男, 中国籍, 经济学硕士, 具有基金从业资格。1999 年 9 月至 2003 年 7 月, 就职于工商银行青岛市市北一支行, 任科员、科长等职务; 2006 年 1 月至 2007 年 5 月, 就职于海通证券, 任债券部交易员; 2007 年 5 月加入华商基金管理有限公司; 2007 |

| | | | | |
|--|------------|--|--|--|
| | <p>会委员</p> | | | <p>年 5 月至 2009 年 1 月担任交易员；2009 年 1 月至 2010 年 8 月担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理助理；2010 年 8 月 9 日起至今担任华商稳健双利债券型证券投资基金的基金经理；2011 年 3 月 15 日起至今担任华商稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 2 月 17 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商稳固添利债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 24 日起至今担任华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日至 2019 年 5 月 23 日担任华商瑞丰混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起至今担任华商可转债债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日起至今担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商双债丰利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2021 年 4 月 26 日担任华商双翼平衡混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 12 月 15 日担任华商回报 1 号混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 5 月 24 日至 2019 年 8 月 23 日担任华商瑞丰短债债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 9 月 29 日起至今担任华商转债精选债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 11 日起至今担任华商稳健添利一年持有期混合型证券投资</p> |
|--|------------|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 资基金的基金经理；2022 年 4 月 19 日至 2024 年 6 月 19 日担任华商稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2023 年 5 月 16 日起至今担任华商稳健泓利一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

范、控制措施。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场方面，2024 年三季度，债券收益率整体先下后上，波动较大。具体来看，7 月国内经济基本面延续弱复苏，货币政策维持宽松取向，降息操作落地，债市收益率整体下行。8 月政府债券的发行加速，债市供需失衡的格局有所改善，收益率整体震荡。9 月中上旬，债市对货币政策宽松预期较强，债市收益率持续向下突破，9 月末政策层面在支持实体经济、扭转资本市场预期等方面都加大力度，债市收益率转为上行。

权益市场方面，2024 年三季度，A 股市场在一揽子政策利好下走出超跌反弹的行情。7 月、8 月市场避险情绪较强，A 股市场震荡回调，业绩稳定的红利风格表现相对较好。9 月稳增长政策密集出台，首先央行公告降息、降准、降房贷利率三管齐下，紧接着政治局会议超预期召开，传递出明确的稳经济、稳市场、稳预期信号，有效扭转了市场情绪。A 股指数整体收涨，其中上证指数上涨 12.44%，深证成指上涨 19.00%，创业板上涨 29.21%。

转债市场方面，2024 年三季度，可转债市场整体跟随正股走势，先抑后扬。具体来看，7 月和 8 月，权益市场延续回调，转债市场跟随下行，在部分弱资质转债信用风险的扰动下，转债市场担忧情绪加剧，估值亦有压缩。9 月稳增长政策密集出台，带动权益市场大幅反弹，转债市场也随之超跌反弹，三季度中证转债指数小幅收涨 0.58%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华商稳健泓利一年持有混合型证券投资基金 A 类份额净值为 1.0659 元，份额累计净值为 1.0659 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.05%，同期基金业绩比较基准的收益率为 3.39%，基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 0.34 个百分点。

截至报告期末华商稳健泓利一年持有混合型证券投资基金 C 类份额净值为 1.0600 元，份额累计净值为 1.0600 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.94%，同期基金业绩比较基准的收益率为 3.39%，基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率 0.45 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 | 20,351,545.74 | 24.70 |
| | 其中：股票 | 20,351,545.74 | 24.70 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 11,463,239.13 | 13.91 |
| | 其中：债券 | 11,463,239.13 | 13.91 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 49,111,142.10 | 59.59 |
| 8 | 其他资产 | 1,482,684.84 | 1.80 |
| 9 | 合计 | 82,408,611.81 | 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 3,141,737.49 元，占净值比例 3.89%。

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 | 2,723,723.59 | 3.37 |
| B | 采矿业 | 444,415.00 | 0.55 |
| C | 制造业 | 11,072,101.91 | 13.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 347,585.00 | 0.43 |
| E | 建筑业 | 71,688.00 | 0.09 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 67,773.00 | 0.08 |
| J | 金融业 | 1,942,287.00 | 2.40 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 521,852.75 | 0.65 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 18,382.00 | 0.02 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 17,209,808.25 | 21.30 |

5.2.2 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 | 711,068.06 | 0.88 |
| B 消费者非必需品 | 263,611.25 | 0.33 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | 2,167,058.18 | 2.68 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 3,141,737.49 | 3.89 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 00700 | 腾讯控股 | 5,405 | 2,167,058.18 | 2.68 |
| 2 | 002714 | 牧原股份 | 42,289 | 1,958,403.59 | 2.42 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 63,200 | 1,282,960.00 | 1.59 |
| 4 | 688578 | 艾力斯 | 14,572 | 804,082.96 | 1.00 |
| 5 | 300498 | 温氏股份 | 38,000 | 765,320.00 | 0.95 |
| 6 | 00189 | 东岳集团 | 101,481 | 711,068.06 | 0.88 |
| 7 | 601211 | 国泰君安 | 29,700 | 548,856.00 | 0.68 |
| 8 | 600309 | 万华化学 | 5,800 | 529,656.00 | 0.66 |
| 9 | 688372 | 伟测科技 | 9,655 | 521,852.75 | 0.65 |
| 10 | 600600 | 青岛啤酒 | 6,400 | 501,440.00 | 0.62 |

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。

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 | 4,333,653.10 | 5.36 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 7,129,586.03 | 8.83 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 11,463,239.13 | 14.19 |

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 | 185792 | 22 京投 02 | 50,000 | 5,060,127.95 | 6.26 |
| 2 | 019740 | 24 国债 09 | 43,000 | 4,333,653.10 | 5.36 |
| 3 | 149474 | 21 深投 02 | 20,000 | 2,069,458.08 | 2.56 |

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在国债期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交

易活跃的国债期货合约，以对冲投资组合的风险、提高组合收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | -58,123.18 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -125,100.00 |

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金根据风险控制的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货的交易来对冲潜在的利率波动风险。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

国泰君安

1. 2024 年 1 月 8 日，中国证券监督管理委员会行政处罚信息公开表（处罚字[2024]56 号）显示，国泰君安股份有限公司存在以下违法违规行为：一、作为泰禾集团股份有限公司公司债券受托管理人，在受托管理过程中存在履职尽责不到位的情况，未能督导发行人真实、准确、完整、及时披露相关信息，根据《公司债券发行与交易管理办法（2015 年修订）》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法（2015）》）第七条、第四十九条、第五十五条对国泰君安股份有限公司出具警示函，执行日期为 2024 年 1 月 5 日。

2. 2024 年 1 月 24 日，中国证券监督管理委员会安徽监管局出具对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定（〔2023〕46 号）显示，国泰君安证券股份有限公司存在以下违法违规行为：李懿、蔡伟成，在保荐滁州多利汽车科技股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责，导致出现对发行人董监高资金流水的穿透核查程序不充分、资金流水核查结论与实际不符等问题，对国泰君安股份有限公司出具警示函，执行日期为 2023 年 11 月 17 日。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 70,535.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,412,149.58 |
| 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 | 1,482,684.84 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 601211 | 国泰君安 | 548,856.00 | 0.68 | 重大事项停牌 |

5.11.6 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 | 华商稳健泓利一年持有混合 A | 华商稳健泓利一年持有混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 75,590,277.81 | 25,209,000.09 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 256,432.38 | 3,085.02 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 17,453,556.29 | 7,716,978.49 |
| 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 | 58,393,153.90 | 17,495,106.62 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准华商稳健泓利一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商稳健泓利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商稳健泓利一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商稳健泓利一年持有期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. 报告期内华商稳健泓利一年持有期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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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 10 月 25 日