华商未来主题混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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：2018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2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商未来主题混合
基金主代码	000800
交易代码	000800
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月14日
报告期末基金份额总额	1,416,716,436.78份
投资目标	本基金分享居民收入增长和消费升级蕴含的新兴产业投资机会，精选具有核心竞争力的企业，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"、"自下而上"相结合的投资视角，重点关注居民收入增长和消费升级蕴含的新兴产业投资机会，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%＋上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	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预期风险和中高预期收益产品。
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

§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（2018年7月1日 － 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-184,200,325.91
2.本期利润	-59,790,521.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0412
4.期末基金资产净值	915,452,595.53
5.期末基金份额净值	0.646

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。

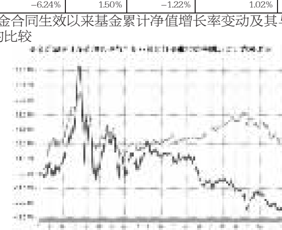
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-6.24%	1.50%	-1.22%	1.02%	-5.02%	0.48%

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



注：①本基金合同生效日为2014年10月14日。

②根据《华商未来主题混合型证券投资基金合同》的规定，本基金股票资产的投资占基金资产的比例为60-95%，其中投资于质地优秀的未来主题方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的5%—40%，其中权证占基金资产净值的0—3%，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。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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		
梁皓	基金经理	2017年7月26日	2018年8月10日	8	男，中国籍，理学博士，具有基金从业资格。2010年12月至2012年4月，就职于中国中投证券有限责任公司，任研究员；2012年5月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2016年10月20日至2017年7月25日担任华商未来主题混合型证券投资基金基金经理助理；2017年10月31日起至今担任华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年7月12日起至今担任华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
翟金林	基金经理，上海分公司总经理	2018年2月23日	–	17	男，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。1985年7月至1990年9月、1992年7月至1994年9月，就职于安徽无为县六洲中学，任教师；1997年8月至1999年2月，就职于天津信托投资有限公司，任研究员；1999年2月至2000年7月，就职于天津国际资产管理公司，任项目经理；2001年7月至2003年7月，就职于申银万国证券研究所，任宏观部研究员；2003年7月至2009年11月，就职于太平洋资产管理公司固定收益部，任资深高级投资经理；2009年12月至2017年5月，就职于中国人保资产管理有限公司权益研究投资部，任助理总经理；2017年5月加入华商基金管理有限公司；2017年7月31日起至今担任华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年9月12日起至今担任华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
梁永强	基金经理，公司总经理	2014年10月14日	2018年7月11日	16	男，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。2002年7月至2004年7月，就职于华龙证券股份有限公司投资银行部，历任研究员、高级研究员；2004年7月至2005年12月担任华商基金管理有限公司筹备组成员；公司成立后历任投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理、总经理；2007年5月15日至2008年9月23日担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理助理；2008年9月23日至2012年4月24日担任华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理；2009年11月24日至2018年7月11日担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2012年5月31日至2018年7月11日担任华商主题精选混合型证券投资基金基金经理；2014年7月24日至2018年7月11日担任华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《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

本账户主要投向那些能够充分反映中国经济在走向兴盛的未来之过程中的一些代表性行业与公司。考虑的投资方向主要是从全球与中国科技进步，从中国经济的可持续发展，从人类健康的发展等多角度，构建未来主题这只基金的投资组合。在三季度中，由于基金军工占比仍然过高，因此减持了部分军工股，一方面降低组合中军工的比重，另一方面使组合中的军工特色集中在优质军工白马股和业绩股上，使得组合的集中度与稳定性相对提高，同时，增加投资了生物制药与新型消费类行业中的优质公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日，本基金份额净值为0.646元，份额累计净值为0.646元。本季度基金份额净值增长率为-6.24%，同期基金业绩比较基准的收益率为-1.22%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率5.02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，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	818,756,591.46	88.06
	其中：股票	818,756,591.46	88.06
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	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	35,000,000.00	3.76
	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	65,003,680.65	6.99
8	其他资产	10,966,083.41	1.18
9	合计	929,726,355.52	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	56,024,477.28	6.12
C	制造业	741,655,933.94	81.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	6,652,845.00	0.73
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	13,463,713.00	1.47
J	金融业	959,622.24	0.10
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	–	–
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	818,756,591.46	89.44

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 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	600038	中直股份	1,300,000	51,818,000.00	5.66
2	600760	中航沈飞	1,325,177	50,489,243.70	5.52
3	600803	新奥股份	2,999,982	45,179,728.92	4.94
4	600893	航发动力	1,798,621	43,274,821.26	4.73
5	600332	白云山	1,040,121	38,068,428.60	4.16
6	002338	奥普光电	2,999,700	37,706,229.00	4.12
7	300003	乐普医疗	1,142,693	34,680,732.55	3.79
8	600028	中国石化	4,866,600	34,650,192.00	3.79
9	600703	三安光电	2,068,700	33,843,932.00	3.70
10	002422	科伦药业	1,244,510	33,191,081.70	3.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

在预判市场系统风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，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。

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

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

奥普光电于2018年1月5号收到深交所中小板公司管理部监管函《关于对长春奥普光电技术股份有限公司及董事会秘书 的监管函》（中小板监管函【2017】第198号）。指出公司主要存在：股东减持信息披露不准确的情况。对公司提出相应的整改要求。

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末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

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	892,979.80
2	应收证券清算款	9,906,703.37
3	应收股利	–
4	应收利息	29,559.86
5	应收申购款	136,840.38
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,966,083.41

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	1,556,059,466.86
报告期期间基金总申购份额	64,376,509.88
减：报告期期间基金总赎回份额	203,719,539.96
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	1,416,716,436.78

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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。

§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未来主题混合型证券投资基金设立的文件；

2.《华商未来主题混合型证券投资基金基金合同》；

3.《华商未来主题混合型证券投资基金托管协议》；

4.《华商未来主题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、营业执照和公司章程；

6.报告期内华商未来主题混合型证券投资基金在指定报刊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

华商基金管理有限公司
2018年10月26日

华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期：2018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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商新锐产业混合
基金主代码	000654
交易代码	000654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月24日
报告期末基金份额总额	2,258,608,558.41份
投资目标	本基金主要投资于新锐产业中的优质上市公司，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"、"自下而上"相结合的投资视角，在实际投资过程中充分体现"新锐产业投资"这个核心理念。深入分析中国经济结构转型背景下社会意识、经济基础、科技进步、消费升级与产业政策等各个方面对新锐产业发展的综合影响，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	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。
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

§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（2018年7月1日 － 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-156,398,283.80
2.本期利润	-82,872,864.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0362
4.期末基金资产净值	2,133,287,525.27
5.期末基金份额净值	0.945

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。

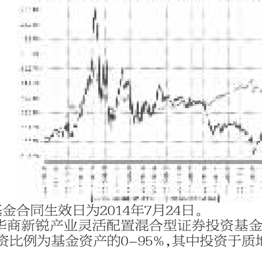
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-3.67%	0.81%	-0.90%	0.88%	-2.77%	-0.07%

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



注：①本基金合同生效日为2014年7月24日。

②根据《华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定，本基金股票资产的投资比例为基金资产的0-95%，其中投资于质地优秀的新锐产业方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%—100%，其中权证占基金资产净值的0—3%，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。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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		
梁永强	基金经理，公司总经理	2014年7月24日	2018年7月11日	16	男，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。2002年7月至2004年7月，就职于华龙证券股份有限公司投资银行部，历任研究员、高级研究员；2004年7月至2005年12月担任华商基金管理有限公司筹备组成员；公司成立后历任投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理、总经理；2007年5月15日至2008年9月23日担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理助理；2008年9月23日至2012年4月24日担任华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理；2009年11月24日至2018年7月11日担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2012年5月31日至2018年7月11日担任华商主题精选混合型证券投资基金基金经理；2014年10月14日至2018年7月11日担任华商未来主题混合型证券投资基金基金经理。
童立	基金经理，研究发展部总经理助理，公司公募业务权益投资决策委员会委员	2016年12月23日	–	7	男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。2011年7月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2015年7月21日至2016年4月11日担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理助理；2016年4月12日至2017年4月21日担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；2017年12月21日起至今担任华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年12月27日起至今担任华商上游产业股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《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

本季度市场仍显疲弱。但得益于季末的反弹，三季度全市场的表现相对好于上季度，且呈现出明显的大小分化（上证50指数本季度涨幅5.1%，创业板指则下跌12.2%）。

在三季度，本基金将仓位控制在不高的水平，并且全季度都没有太多变化。策略方向上，我们大幅减持了上半年配置较多的消费行业，适当加仓了包括军工在内的制造业。最后，大的配置层面，则依然集中在之前所述的"制造业升级+消费升级"范畴内。

回顾三季度，面对复杂的内外局势，政策亦是与时俱进。从"当前经济运行稳中有变"与"积极财政政策要更加积极"等表述中，我们能够看到决策层为稳定经济及相关预期的积极应对。去杠杆有序可控地进行，将带来中国经济中长期更有质量的增长潜力。也因此，展望未来，我们非但没有太多焦虑，反而认为当前悲观的市场情绪所导致的系统性的股价下跌，可能正在酝酿一些新的投资机会。

最后，针对一直未有缓和的中美经贸摩擦，我们想用一句话表达自己的观点：天行健，君子以自强不息。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日，本基金份额净值为0.945元，份额累计净值为0.965元。本季度基金份额净值增长率为-3.67%，同期基金业绩比较基准的收益率-0.90%，本基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率2.77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，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	952,069,234.01	42.83
	其中：股票	952,069,234.01	42.83
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	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	1,218,619,093.12	54.82
8	其他资产	52,373,063.89	2.36
9	合计	2,223,061,391.02	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	17,784,000.00	0.83
C	制造业	559,784,596.74	26.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	20,559,568.65	0.96
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	46,850,114.10	2.20
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,420,095.40	1.99
J	金融业	84,730,000.00	3.97
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	124,087,520.64	5.82
N	水利、环境和公共设施管理业	18,944,307.84	0.89
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	36,909,030.64	1.73
S	综合	–	–
	合计	952,069,234.01	44.63

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 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	600760	中航沈飞	2,300,000	87,630,000.00	4.11
2	300012	华测检测	15,000,346	87,602,020.64	4.11
3	300114	中航电测	7,000,008	75,740,086.56	3.55
4	000768	中航飞机	3,600,047	57,168,746.36	2.68
5	601336	新华保险	1,000,000	50,480,000.00	2.37
6	600038	中直股份	1,200,067	47,834,670.62	2.24
7	002025	航天电器	1,399,957	38,330,822.66	1.80
8	603060	国检集团	2,150,000	36,485,500.00	1.71
9	600031	三一重工	4,100,000	36,408,000.00	1.71
10	300226	上海钢联	750,002	35,775,095.40	1.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

在预判市场系统风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，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。

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

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

新华保险于9月29日收到中国保险监督管理委员会政处罚决定书（银保监保罚决字〔2018〕1号），指出公司存在欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或者备案的保险费率的问题，依据规定对公司进行相应处罚。

新华保险于2018年2月11日收到中国保险监督管理委员会监管函（监管函〔2018〕31号），指出公司境外投资业务违反了《保险资金境外投资管理暂行办法实施细则》（保监发〔2012〕93号）关于可投资国家或者地区的相关规定，对公司提出相应的整改要求。

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末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

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	645,023.43
2	应收证券清算款	1,352,831.90
3	应收股利	–
4	应收利息	251,747.09
5	应收申购款	50,123,461.47
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	52,373,063.89

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债券投资。

5.11.5 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。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	2,208,870,262.39
报告期期间基金总申购份额	205,555,726.24
减：报告期期间基金总赎回份额	155,817,430.22
报告期期末基金份额总额	2,258,608,558.41

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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。

§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新锐产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2.《华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3.《华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4.《华商新锐产业灵活配置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、营业执照和公司章程；

6.报告期内华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊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：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（免长途费），010－58573300

基金管理人网址：http://www.hsfund.com

华商基金管理有限公司
2018年10月26日

华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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：2018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2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华商智能生活混合
基金主代码	001822
交易代码	001822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月13日
报告期末基金份额总额	303,645,045.14份
投资目标	本基金将重点关注与百姓生活需求密切相关的企业与行业，通过深入研究并积极投资与智能生活相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，力求获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金密切关注宏观政策，通过对经济增长指标、经济结构、社会需求主体及市场驱动因素的研究，发掘出转型经济下的长期投资机会，并进行重点配置。
业绩比较基准	中证800指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	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。
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

§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（2018年7月1日 － 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	10,139,390.21
2.本期利润	-6,752,653.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0217
4.期末基金资产净值	253,724,108.26
5.期末基金份额净值	0.836

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。

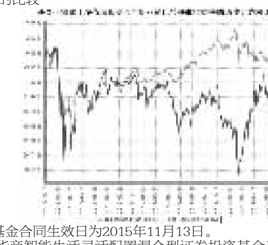
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-2.34%	1.18%	-1.89%	0.86%	-0.45%	0.32%

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



注：①本基金合同生效日为2015年11月13日。

②根据《华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板和其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、债券回购、银行存款、权证、股指期货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：股票资产占基金资产的比例为0-95%，且投资于智能生活方向的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券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，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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		
马国江	基金经理	2015年11月13日	–	9	男，中国籍，工学硕士，具有基金从业资格。2008年7月至2010年6月，就职于天相投资顾问有限公司，任研究员；2010年6月至2011年4月，就职于中再资产管理有限公司，任研究员；2011年4月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2014年8月1日至2015年4月7日担任华商主题精选混合型证券投资基金基金经理助理；2015年4月8日至2016年8月19日担任华商主题精选混合型证券投资基金基金经理；2016年8月5日起至今担任华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月23日起至今担任华商盛世成长混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《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

2018年三季度市场经历较大波动，8月份在贸易战、企业活力下降等多重压力下，市场经历了一波持续下跌。

三季度房地产对经济拉动能力减弱，国内消费增速下降，海外市场是为数不多的亮点。在产业升级的背景下，科技创新重要性凸显，消费行业的稳定性也是市场所追求的。该季度本基金仓位始终保持中性水平，配置方向主要集中在信息技术、新消费、智能制造、医药零售等为代表的转型方向上。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日，本基金份额净值为0.836元，份额累计净值为0.836元。本季度基金份额净值增长率为-2.34%，同期基金业绩比较基准的收益率为-1.89%，本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，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	224,744,029.48	87.73
	其中：股票	224,744,029.48	87.73
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	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	31,097,390.54	12.14
8	其他资产	343,629.82	0.13
9	合计	256,185,049.84	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	7,699,200.00	3.03
B	采矿业	550,000.00	0.22
C	制造业	95,358,685.48	37.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	88,760,624.00	34.98
G	交通运输、仓储和邮政业	10,113,600.00	3.99
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,857,920.00	5.86
J	金融业	–	–
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	7,404,000.00	2.92
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	224,744,029.48	88.58

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 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	603883	老百姓	360,800	22,560,824.00	8.89
2	002727	一心堂	850,000	21,896,000.00	8.63
3	300673	佩蒂股份	399,000	20,620,320.00	8.13
4	603233	大参林	420,000	19,924,800.00	7.85
5	603939	益丰药房	220,000	12,639,000.00	4.98
6	002475	立讯精密	650,000	10,023,000.00	3.95
7	000636	风华高科	660,055	9,927,227.20	3.91
8	002456	欧菲科技	720,000	9,712,800.00	3.83
9	300078	思创医惠	800,000	7,760,000.00	3.06
10	002008	大族激光	180,036	7,628,125.32	3.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸的同时，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。

此外，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金资产组合将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略，稳定收益。

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

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

一心堂于2018年3月30日收到中小板关注函【2018】第87号，要求公司针对媒体报道的有关医保卡刷生活用品事项自查原因，并加强对控股子公司的管理控制。公司已于2018年4月9日、2018年4月12日、2018年5月24日、2018年8月16日公告披露相关的处罚结果和后期的整改进程。

佩蒂股份于2018年1月25日收到深交所创业板公司管理部《关于对佩蒂动物营养科技股份有限公司、董事长兼总经理陈振标、副总经理兼董事会秘书唐照波的监管函》，指出公司实际控制人、董事长兼总经理陈振标与副总经理兼董事会秘书唐照波未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，对公司提出整改要求。

风华高科于2018年8月8日收到中国证券监督管理委员《调查通知书》（粤证调查通字180161号），指出公司主要存在：公司因涉嫌信息披露违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

欧菲科技于2018年6月25日收到深圳证券交易所中小板管理部《关于对欧菲科技股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2018】第 102 号），指出公司主要存在：公司的上述行为违反了本所《股票上市规则（2018年修订）》第1.4条和第2.1条的规定。请你公司董事会充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝上述问题的再次发生。

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末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

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	188,063.74
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	7,040.04
5	应收申购款	148,526.04
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	343,629.82

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	319,112,939.36
报告期期间基金总申购份额	6,219,652.59
减：报告期期间基金总赎回份额	21,687,546.81
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	303,645,045.14

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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。

§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智能生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2.《华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3.《华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4.《华商智能生活灵活配置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、营业执照和公司章程；

6.报告期内华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊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

华商基金管理有限公司
2018年10月26日