

华商民营活力灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

<p>2017年9月30日</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p> <p>报告送出日期:2017年10月26日</p>													
§1 重要提示	<p>基金管理人承诺基金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法律责任。</p> <p>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2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等内容,保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。</p> <p>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。</p> <p>本报告中财务资料未经审计。</p> <p>本报告日期2017年7月1日起至9月30日止。</p>												
§2 基金产品概况	<table> <tr> <td>基金名称</td><td>华商民营活力混合</td></tr> <tr> <td>基金代码</td><td>004189</td></tr> <tr> <td>交易代码</td><td>004189</td></tr> <tr> <td>基金运作方式</td><td>契约型,定期开放式</td></tr> <tr> <td>基金合同生效日</td><td>2016年9月15日</td></tr> <tr> <td>报告期末基金份额总额</td><td>112,354,554.00</td></tr> </table> <p>投资目标:本基金投资于具有良好发展前景的中资民营企业,精选具有良好成长性的个股,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。</p> <p>投资策略:本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,在宏观研究过程中,一方面跟踪宏观经济政策,判断宏观经济走势和资产配置比例,另一方面,秉承“民活”“民营活力”“中股优上”“自下而上”“精选具有成长性的,业绩持续优秀”等投资理念进行选股。</p> <p>资产配置:本基金股票资产投资比例不低于65%,其中投资于中资民营企业方向的投资比例不低于基金资产净值的60%,每个交易日终扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值的5%,股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>业绩比较基准:中证民营活力指数收益率×65%+中证800指数收益率×35%</p> <p>风险收益特征:本基金属于混合型证券投资基金,预期风险和预期收益水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和较高预期收益产品。</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p>	基金名称	华商民营活力混合	基金代码	004189	交易代码	004189	基金运作方式	契约型,定期开放式	基金合同生效日	2016年9月15日	报告期末基金份额总额	112,354,554.00
基金名称	华商民营活力混合												
基金代码	004189												
交易代码	004189												
基金运作方式	契约型,定期开放式												
基金合同生效日	2016年9月15日												
报告期末基金份额总额	112,354,554.00												
§3 主要财务指标和基金净值表现	<p>3.1 主要财务指标</p> <table> <tr> <th>主要财务指标</th><th>报告期 2017年7月1日至2017年9月30日</th></tr> <tr> <td>1.本期已实现收益</td><td>1,003,137.48</td></tr> <tr> <td>2.本期公允价值变动收益</td><td>5,078,410.78</td></tr> <tr> <td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>0.0302</td></tr> <tr> <td>4.期末基金份额净值</td><td>116.98,129.56</td></tr> <tr> <td>5.期末基金份额净值增长率</td><td>10.41</td></tr> </table> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.2 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</p> <p>注:①.本基金合同生效日为2017年3月15日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。</p> <p>②.按照《华商民营活力灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定,本基金的投资范围包括股指期货</p>	主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日	1.本期已实现收益	1,003,137.48	2.本期公允价值变动收益	5,078,410.78	3.加权平均基金份额本期利润	0.0302	4.期末基金份额净值	116.98,129.56	5.期末基金份额净值增长率	10.41
主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日												
1.本期已实现收益	1,003,137.48												
2.本期公允价值变动收益	5,078,410.78												
3.加权平均基金份额本期利润	0.0302												
4.期末基金份额净值	116.98,129.56												
5.期末基金份额净值增长率	10.41												

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600527	江南高科	1,529,188	8,395,132.32	7.18
2	300648	星源股份	95,000	7,153,500.00	6.12
3	600466	金风科技	400,000	6,908,000.00	5.91
4	603182	耀客集团	130,000	6,797,700.00	5.81
5	300342	沃森生物	355,000	5,697,500.00	5.04
6	600198	山东黄金	80,000	4,332,800.00	3.70
7	000333	荣泰股份	80,000	3,536,200.00	3.02
8	600703	三七互娱	100,000	2,314,000.00	1.98
9	603059	华翔科技	80,000	2,158,400.00	1.85
10	000207	新康达	120,000	1,942,800.00	1.66

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 本基金股指期货投资的收益政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

基金管理人于2016年11月21日收到工信部行政处理告知书,金龙汽车子公司苏州金龙公司申报2015年度中央财政补贴资金的新数据中有,1.6833亿元涉嫌骗取财政补贴,工信部根据相关规定,责令停止生产和销售并限期整改,责令苏州金龙公司进行为期6个月整改,整改完成后,工信部将对整改情况进行验收。

2016年11月29日收到财政部行政决定书,根据相关法规规定,财政部对苏州金龙公司2015年的中央财政补贴资金51,921万元,并对苏州金龙公司中央控股关联企业的50%以上(约29,950.5万元)的中央财政补贴,同时从2016年起取消苏州金龙公司中央控股关联企业的中央财政补贴。

中国平安资产管理有限责任公司资产管理人于2017年2月22日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局行政处理决定书(【2017】2),根据2008年4月30日和2011年11月在平安证券有限责任公司投资部门任职期间涉嫌违法从事证券业务,深圳证监局对违法从事证券业务进行了调查,并依法向当事人告知了行政处理的事实、理由、依据和当事人依法享有的权利,当事人依法履行了陈述、申辩程序,并签署了认可书,本案现已结案,审理终结。

本公司以上所述的涉及违法违规行为和违法违规及公司治理的相关事项,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,且在报告

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	沃森生物	54,212,573.32	45.20
2	星源股份	54,212,573.32	45.20
3	耀客集团	-	-
4	金风科技	-	-
5	沃森生物	-	-
6	沃森生物	-	-
7	耀客集团	61,133,071.50	50.96
8	其他资产	4,005,767.50	3.34
9	合计	119,951,410.56	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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	-	-
B	制造业	-	-
C	金融业	46,237,832.32	39.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	137,540.00	0.12
E	信息技术业	1,346,000.00	1.10
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	房地产业	-	-
H	信息传输和金融业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,332,800.00	3.70
K	房地产业	-	-
L	制造业和金融业	-	-
M	科学和技术服务业	2,158,400.00	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	建筑业、建筑业和金融业	-	-
P	信息传输和金融业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	54,212,573.32	45.34

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

5.2.3 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	名称	金额(元)
1	转出资金	36,119.77
2	收回证券本金	4,541,608.63
3	利息收入	-
4	公允价值变动	13,280.04
5	申购赎回费	14,003.30
6	其他应收款	-
7	其他应付款	-
8	其他	-
9	合计	4,605,768.74

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 股指期货持仓损益和其他资产损益部分

由于资产互利的原理,亏损之和与合并项之间可能存在差异。

5.6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	192,314,547.03
报告期基金总申购份额	507,307.41
报告期基金总赎回份额	80,487,699.96
报告期基金总申购份额净增加(减少)	(19,865,744.52)*
报告期基金总申购份额	112,354,554.00

注:①.申购份额含红利再投资、转换入份额;②.赎回份额含转换转出份额。

§7 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没有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没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内一致投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期末未发生一致投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 重大事件目录

9.1 重大事件目录

1.中国证监会核准华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金合同》;

3.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金基金托管协议》;

4.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。

6.报告期内华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的摘要。

9.2 修改议案

基金管理人、基金托管人、

9.3 召开方式

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

基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

投资者对华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金有任何疑问,可向基金管理人华商基金管理有限公司、客户服务电话:4007008880或传真:(010)58573300

基金管理人网址: http://www.hfund.com

华商基金管理有限公司

2017年10月25日

<p>2017年9月30日</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p> <p>报告送出日期:2017年10月26日</p>													
§1 重要提示	<p>基金管理人承诺基金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。</p> <p>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2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等内容,保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。</p> <p>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。</p> <p>本报告中财务资料未经审计。</p> <p>本报告日期2017年7月1日起至9月30日止。</p>												
§2 基金产品概况	<table> <tr> <td>基金名称</td><td>华商瑞鑫定期开放债券</td></tr> <tr> <td>基金代码</td><td>003403</td></tr> <tr> <td>交易代码</td><td>003403</td></tr> <tr> <td>基金运作方式</td><td>契约型,定期开放式</td></tr> <tr> <td>基金合同生效日</td><td>2017年3月1日</td></tr> <tr> <td>报告期末基金份额总额</td><td>178,678,431.99</td></tr> </table> <p>投资目标:本基金投资于具有良好发展前景的中资民营企业,精选具有良好成长性的个股,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。</p> <p>投资策略:本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,在宏观研究过程中,一方面跟踪宏观经济政策,判断宏观经济走势和资产配置比例,另一方面,秉承“民活”“民营活力”“中股优上”“自下而上”“精选具有成长性的,业绩持续优秀”等投资理念进行选股。</p> <p>资产配置:本基金股票资产投资比例不低于65%,其中投资于中资民营企业方向的投资比例不低于基金资产净值的60%,每个交易日终扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值的5%,股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>业绩比较基准:中证民营活力指数收益率×65%+中证800指数收益率×40%</p> <p>风险收益特征:本基金属于混合型证券投资基金,预期风险和预期收益水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和较高预期收益产品。</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p>	基金名称	华商瑞鑫定期开放债券	基金代码	003403	交易代码	003403	基金运作方式	契约型,定期开放式	基金合同生效日	2017年3月1日	报告期末基金份额总额	178,678,431.99
基金名称	华商瑞鑫定期开放债券												
基金代码	003403												
交易代码	003403												
基金运作方式	契约型,定期开放式												
基金合同生效日	2017年3月1日												
报告期末基金份额总额	178,678,431.99												
§3 主要财务指标和基金净值表现	<p>3.1 主要财务指标</p> <table> <tr> <th>主要财务指标</th><th>报告期 2017年7月1日至2017年9月30日</th></tr> <tr> <td>1.本期已实现收益</td><td>16,762,481.71</td></tr> <tr> <td>2.本期公允价值变动收益</td><td>17,150,168.84</td></tr> <tr> <td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>0.0689</td></tr> <tr> <td>4.期末基金份额净值</td><td>125.70,102.86</td></tr> <tr> <td>5.期末基金份额净值增长率</td><td>10.713</td></tr> </table> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.2 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</p> <p>注:①.本基金合同生效日为2017年3月1日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。</p> <p>②.按照《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金合同》的规定,本基金投资于国内依法发行上市的公司股票、债券等金融工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,具体包括:股票(包含中小创、创业板及</p>	主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日	1.本期已实现收益	16,762,481.71	2.本期公允价值变动收益	17,150,168.84	3.加权平均基金份额本期利润	0.0689	4.期末基金份额净值	125.70,102.86	5.期末基金份额净值增长率	10.713
主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日												
1.本期已实现收益	16,762,481.71												
2.本期公允价值变动收益	17,150,168.84												
3.加权平均基金份额本期利润	0.0689												
4.期末基金份额净值	125.70,102.86												
5.期末基金份额净值增长率	10.713												

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	1,896,669	7,614,393.68	6.22
2	601987	中国银行	956,700	7,644,030.00	6.08
3	601288	农业银行	1,939,881	7,563,145.62	6.08
4	601939	建设银行	1,023,938	7,136,847.68	5.62
5	603062	金通证券	2,783	115,299.99	0.09
6	603198	耀客集团	2,786	84,025.98	0.07
7	602355	华翔集团	2,658	62,498.59	0.05
8	603919	中国通海	1,760	39,783.00	0.03
9	603183	耀客集团	741	25,571.91	0.02
10	603333	荣泰科技	1,691	17,468.03	0.01

5.4 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

本基金本报告期末未持有流通股股票。

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十名债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	其他资产	7,008,800.00	5.58

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本基金股指期货投资的收益政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

基金管理人于2016年11月21日收到工信部行政处理告知书,金龙汽车子公司苏州金龙公司申报2015年度中央财政补贴资金的新数据中有,1.6833亿元涉嫌骗取财政补贴,工信部根据相关规定,责令停止生产和销售并限期整改,责令苏州金龙公司进行为期6个月整改,整改完成后,工信部将对整改情况进行验收。

2016年11月29日收到财政部行政决定书,根据相关法规规定,财政部对苏州金龙公司2015年的中央财政补贴资金51,921万元,并对苏州金龙公司中央控股关联企业的50%以上(约29,950.5万元)的中央财政补贴,同时从2016年起取消苏州金龙公司中央控股关联企业的中央财政补贴。

中国平安资产管理有限责任公司资产管理人于2017年2月22日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局行政处理决定书(【2017】2),根据2008年4月30日和2011年11月在平安证券有限责任公司投资部门任职期间涉嫌违法从事证券业务,深圳证监局对违法从事证券业务进行了调查,并依法向当事人告知了行政处理的事实、理由、依据和当事人依法享有的权利,当事人依法履行了陈述、申辩程序,并签署了认可书,本案现已结案,审理终结。

本公司以上所述的涉及违法违规行为和违法违规及公司治理的相关事项,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,且在报告

序号	名称	金额(元)
1	转出资金	76,047.51
2	收回证券本金	217,737.01
3	利息收入	-
4	公允价值变动	728,263.73
5	申购赎回费	21,242.54
6	其他应收款	-
7	其他应付款	-
8	其他	-
9	合计	1,043,200.79

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 股指期货持仓损益和其他资产损益部分

由于资产互利的原理,亏损之和与合并项之间可能存在差异。

5.6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	360,756,531.24
报告期基金总申购份额	3,942,738.88
报告期基金总赎回份额	217,338,641.37
报告期基金总申购份额净增加(减少)	(14,639,371.25)*
报告期基金总申购份额	147,338,423.55

注:①.申购份额含红利再投资、转换入份额;②.赎回份额含转换转出份额。

§7 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没有运用固有资金投资本基金。

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没有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没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内一致投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期末未发生一致投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 重大事件目录

9.1 重大事件目录

1.中国证监会核准华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金合同》;

3.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金基金托管协议》;

4.《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。

6.报告期内华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的摘要。

9.2 修改议案

基金管理人、基金托管人、

9.3 召开方式

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

基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

投资者对华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金有任何疑问,可向基金管理人华商基金管理有限公司、客户服务电话:4007008880或传真:(010)58573300

基金管理人网址: http://www.hfund.com

华商基金管理有限公司

2017年10月25日

<p>2017年9月30日</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p> <p>报告送出日期:2017年10月26日</p>													
§1 重要提示	<p>基金管理人承诺基金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。</p> <p>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2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等内容,保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。</p> <p>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。</p> <p>本报告中财务资料未经审计。</p> <p>本报告日期2017年7月1日起至9月30日止。</p>												
§2 基金产品概况	<table> <tr> <td>基金名称</td><td>华商瑞鑫定期开放债券</td></tr> <tr> <td>基金代码</td><td>002024</td></tr> <tr> <td>交易代码</td><td>002024</td></tr> <tr> <td>基金运作方式</td><td>契约型,定期开放式</td></tr> <tr> <td>基金合同生效日</td><td>2016年9月15日</td></tr> <tr> <td>报告期末基金份额总额</td><td>170,674,711.91</td></tr> </table> <p>投资目标:本基金投资于具有良好发展前景的中资民营企业,精选具有良好成长性的个股,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。</p> <p>投资策略:本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,在宏观研究过程中,一方面跟踪宏观经济政策,判断宏观经济走势和资产配置比例,另一方面,秉承“民活”“民营活力”“中股优上”“自下而上”“精选具有成长性的,业绩持续优秀”等投资理念进行选股。</p> <p>资产配置:本基金股票资产投资比例不低于65%,其中投资于中资民营企业方向的投资比例不低于基金资产净值的60%,每个交易日终扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值的5%,股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>业绩比较基准:中证民营活力指数收益率×65%+中证800指数收益率×40%</p> <p>风险收益特征:本基金属于混合型证券投资基金,预期风险和预期收益水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和较高预期收益产品。</p> <p>基金管理人:华商基金管理有限公司</p> <p>基金托管人:中国银行股份有限公司</p>	基金名称	华商瑞鑫定期开放债券	基金代码	002024	交易代码	002024	基金运作方式	契约型,定期开放式	基金合同生效日	2016年9月15日	报告期末基金份额总额	170,674,711.91
基金名称	华商瑞鑫定期开放债券												
基金代码	002024												
交易代码	002024												
基金运作方式	契约型,定期开放式												
基金合同生效日	2016年9月15日												
报告期末基金份额总额	170,674,711.91												
§3 主要财务指标和基金净值表现	<p>3.1 主要财务指标</p> <table> <tr> <th>主要财务指标</th><th>报告期 2017年7月1日至2017年9月30日</th></tr> <tr> <td>1.本期已实现收益</td><td>31,698,530.36</td></tr> <tr> <td>2.本期公允价值变动收益</td><td>35,158,524.91</td></tr> <tr> <td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>0.0686</td></tr> <tr> <td>4.期末基金份额净值</td><td>180.531,035.49</td></tr> <tr> <td>5.期末基金份额净值增长率</td><td>1.058</td></tr> </table> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.2 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</p> <p>注:①.本基金合同生效日为2016年9月15日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。</p> <p>②.按照《华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金合同》的规定,本基金投资于国内依法发行上市的公司股票、债券等金融工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,具体包括:股票(包含中小创、创业板及</p>	主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日	1.本期已实现收益	31,698,530.36	2.本期公允价值变动收益	35,158,524.91	3.加权平均基金份额本期利润	0.0686	4.期末基金份额净值	180.531,035.49	5.期末基金份额净值增长率	1.058
主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日												
1.本期已实现收益	31,698,530.36												
2.本期公允价值变动收益	35,158,524.91												
3.加权平均基金份额本期利润	0.0686												
4.期末基金份额净值	180.531,035.49												
5.期末基金份额净值增长率	1.058												

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	2,858,300	10,918,706.00	6.05
2	000725	东方金	1,248,300	5,492,520.00	3.04
3	601867	中国通海	668,688	5,328,435.12	2.95
4	000208	华翔集团	901,700	5,320,000.00	2.95
5	002394	耀客集团	102,400	1,627,000.00	0.91
6	601198	山东黄金	102,400	1,707,496.00	0.96
7	000388	耀客集团	80,000	920,800.00	0.51

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

5.2.3 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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	2,039,400.00	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	其他资产	99,734,816.80	55.25
6	企业债券	-	-
7	央行票据	-	-
8	金融债券	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	其他	5,857,000.00	3.30
11	合计	111,341,216.80	61.67

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有流通股股票。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本基金股指期货投资的收益政策

根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括