

合煦智远嘉选混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 月 30 日

基金管理人：合煦智远基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	合煦智远嘉选混合
基金主代码	006323
交易代码	006323
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 18 日
报告期末基金份额总额	76,223,925.74 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础之上，通过优化风险收益配比，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过自上而下和自下而上相结合的研究方式调整基金资产在股票、债券及现金等大类资产之间的配置比例，以实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>本基金通过对上市公司全面深度研究，结合实地调研，精选出具有长期投资价值的优质上市公司股票构建股票投资组合。</p> <p>本基金在保证资产流动性和控制各类风险的基础上，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	<p>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、债券型基金，低于股票型基金，属于中等收益/风险特征的基金。</p> <p>本基金将投资香港联合交易所上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场风险。</p>

基金管理人	合煦智远基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	合煦智远嘉选混合 A	合煦智远嘉选混合 C
下属分级基金的交易代码	006323	006324
报告期末下属分级基金的份 额总额	30,008,967.40 份	46,214,958.34 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（2019 年 7 月 1 日—2019 年 9 月 30 日）	
	合煦智远嘉选混合 A	合煦智远嘉选混合 C
1.本期已实现收益	1,646,315.16	2,617,284.48
2.本期利润	1,391,118.85	2,472,287.60
3.加权平均基金份额本期利 润	0.0452	0.0458
4.期末基金资产净值	31,850,862.50	48,667,224.78
5.期末基金份额净值	1.0614	1.0531

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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

合煦智远嘉选混合 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	4.07%	0.93%	0.64%	0.49%	3.43%	0.44%

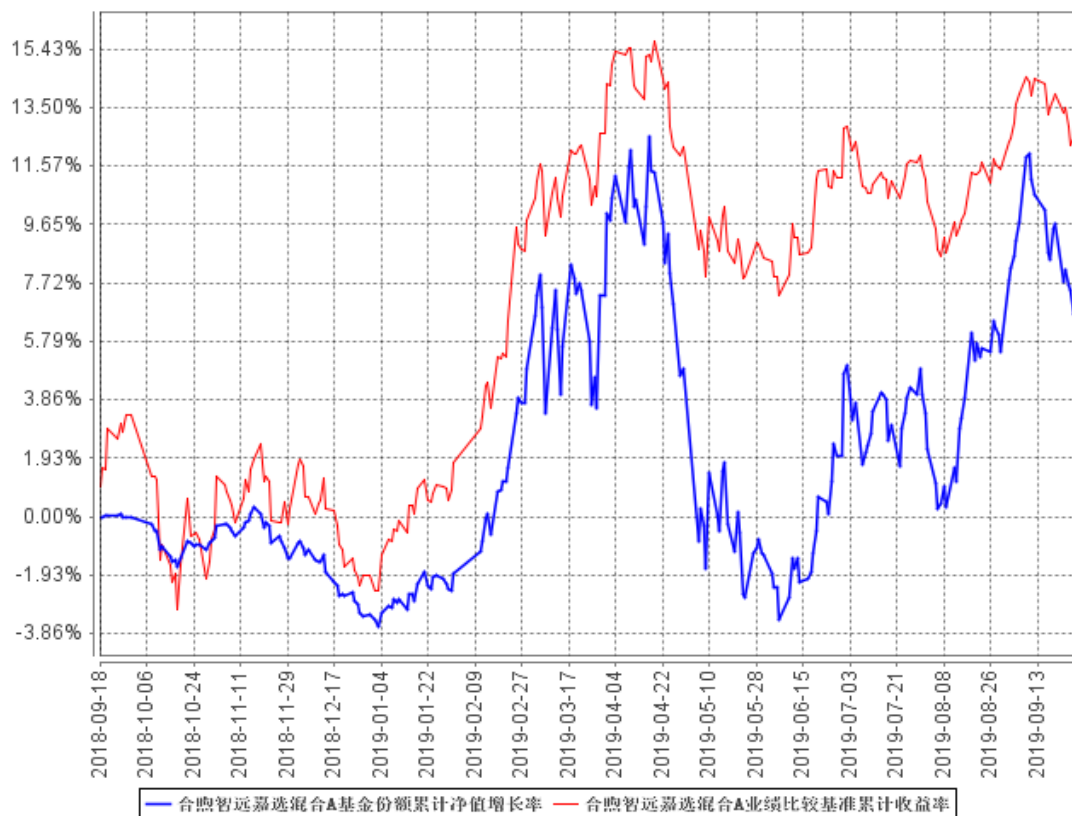
合煦智远嘉选混合 C

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	3.92%	0.93%	0.64%	0.49%	3.28%	0.44%

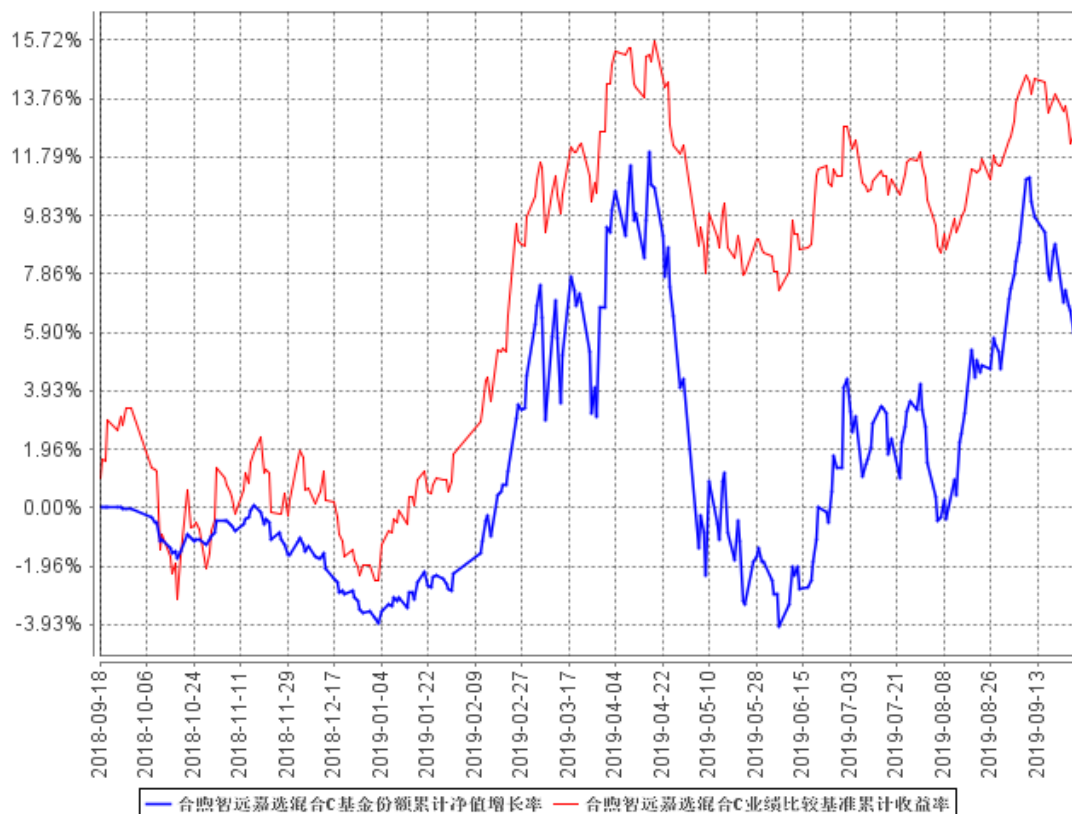
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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

合煦智远嘉选混合A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



合煦智远嘉选混合C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、本基金基金合同于 2018 年 9 月 18 日生效；2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
陈嘉平	本基金基金经理（已离任）	2018 年 9 月 18 日	2019 年 9 月 24 日	18 年	商学硕士，CFA,FRM。曾任台湾兆丰金控兆丰证券经济研究部襄理；德盛安联投信基金经理；景顺长城基金管理有限公司国际投资部高级经理、A 股研究员、资深研究员、基金经理、投资副总监等职务，担任基金经理期间先后管理

					景顺长城优选、核心竞争力、成长之星、资源垄断等 A 股基金；2015 年担任上海擎松投资管理有限公司法定代表人及投资总监；2018 年 4 月加入合煦智远基金管理有限公司，担任股票投资总监。
朱伟东	本基金基金经理	2018 年 9 月 18 日	-	12 年	工商管理硕士。曾任航空信托投资有限公司财务主管、联想集团高级审计主管、北方天鸟智能科技股份有限公司总经理助理、泰康资产管理有限公司研究组长、高瓴资本高级经理、SNOW LAKE CAPITAL 总监。2017 年 12 月加入合煦智远基金管理有限公司，担任研究总监。

注：1、担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格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

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

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》和公司制定的公平交易相关制度，通过系统和人工等多种方式在各业务环节严格落实公平交易的执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一、经济及金融概况

1. 对外部环境的看法：我们的核心假设是“经济外需难振、全球央行被动再宽松、利率震荡下行、国际摩擦不断扩散、金融市场动荡加剧但总体可控”。

1) 在大周期视角下,我们认为全球并未摆脱 2008 年起的后金融危机阶段。一方面是生产力进步放缓、缺乏强有力结构变革,另一方面是反危机的金融扩张短期手段被长期化使用、日益体现负面效应。经济总量增长乏力叠加货币泛滥激发的金融波动,加剧了社会风险和财富分配的矛盾,外化为国内各阶层撕裂、民粹崛起和国际冲突加剧。全球经济金融进入经济下行期和金融后周期的不利组合格局。我们认为世界经济总量复苏还需要较长时间,由于缺乏强有力的提振手段,预计主要国家将继续降息和维系宽松的货币环境,较长时间内均呈现衰退式宽松和过量资金追逐少数有确定性增长资产的格局。

2) 短期来看, 2019 中期以来,全球经济下行态势更加明显,经济增长预测被持续下调,同时世界多国纷纷下调利率来应对经济下行,全球负利率资产创历史新高。美国经济表现和股市依然较好,但中期衰退压力也在加剧,美联储夹在短期较强数据和中期衰退信号之间,也启动了“预防式”的小幅降息。全球降息、美国经济和股市潜在下滑、将推动全球资产再配置,资金将往相对预期报酬高和稳定的地区(例如中国的股债市)方向配置。

2. 关于中美贸易战：我们认为中美贸易战的本质是经济金融大周期下的国际矛盾加剧、叠加中国综合实力逼近美国和大国复兴意图彰显后引发的美国对中国的遏制。我们认为贸易战将是一场比拼不同体制活力的持久战,经历上半年的几次突变后,资本市场对中美冲突的深度和持久性、对中国抗压能力的韧性都有了新的认识,总体反应在钝化,但还要警惕贸易战的背后不仅是全球产业链重组、技术冷战,还会扩散到地缘摩擦和金融热战。

3. 对内部环境的看法：

1) 中期视角下,中国经济纵向处在新旧动能切换的减速提质期,横向看全球比较视角下,中国国力仍处在相对提升期。如果能依托大国优势和稳定的内外环境、以深度改革和科创人才引领,中国经济仍然拥有巨大的发展潜力。国内经济从 2019 年第二季度后持续下行、9 月起局部出现企稳迹象,虽然市场一度乐观预期的反弹落空,但基本呈现区间筑底、结构分化、新经济动能加速的特征。

2) 我们理解国内政策目前的基调是：金融总量克制、结构改革加速、财政托底、确保经济总量在设定区间运行的同时提升经济运行的长期品质。中国政府近期在金融政策方面体现出了超预期的战略定力和以办好自己事为主的结构调整决心,珍惜(但不排除)使用包括降准降息等总量政策资源以应对潜在风险。第三季度央行不但未跟随外围降息,反而继续强调不搞大水漫灌(货币总量与名义 GDP 保持相对稳定关系)加强了资金流向监管,甚至明确提出弃用房地产作为短期刺激手段。我们认为当下政策组合的目标是金融政策在总量上保持克制以抑制系统性金融风险(稳杠杆),同时大力压降实体融资成本(挤出地产资金流入实体、强调金融机构要服务实体)。对外主动开放积极营造环境吸引海外低息资金、对内致力于压降商业银行的资金成本和疏通资产端的利率传导方式。

3) 我们积极看好上述政策组合的设计意图,但也警惕在货币总量刺激边际放缓的背景下,经济下行和转型期可能面临的信用载体总量收缩和民企小微等低信用主体在信用分化背景下的资金困境。随着缺乏竞争力的企业倒闭和次级金融机构的风险加剧、中小金融机构开始面临缩表压力、而地产这一最佳信用载体的集中受控是否会带来全社会信用投放的过快收缩、以及政府是否能及时启动政策性金融工具给与对冲,尤其在年末资金紧张时点的影响需要密切关注。

4. 对国内金融市场的看法:

1) 我们看好中国股市基于资金来源结构改善带来的投资机会。政府积极破刚兑、控地产、控国企信用,将使得全社会过去长期存在的刚兑利率大幅下降,进而压低实际融资成本、提升实体业绩和金融市场整体估值。

2) 在政府坚持可控式出清、逐步增强经济体质后,结合金融开放的步调明显加速,以下 3 点均有利于外围资金持续入市:①政府有能力维持稳定的国内经济金融环境、积极对外开放、中国稳定收益的资产预计能持续吸引海外低息资本流入,这些对未来几年中国经济发展及金融市场有相对正面的影响;②鉴于房产投资的预期变化、以及依托其上的高息信托、非标和理财等刚兑型居民投资品将大幅收敛、随之将引导国内的百万级低风险偏好资金再配置;③与此同时,政府积极规范和壮大专业理财机构,如大幅放开投资机构的准入、设立独立的银行理财子公司,划转国资充实社保、引导长线资金入市等,积极疏通居民储蓄到金融市场的专业渠道。

二、股票市场展望&操作策略想法

1. 操作策略回顾:

1) 股票市场在 5 月受到特朗普在中美贸易谈判中的极限施压影响震荡下跌,后续股票市场吸引力提高,配合预期的海外资金流入,本基金股票仓位维持在可操作区间 35-80%中的高位 70-80%波动;本季度,资金向很多受经济影响相对较低的消费类股票流入,波动性较高的成长相关类股票则因为风险偏好而明显下跌,但下跌后却反而突出了相对的股价吸引力。搭配上市公司半年报的公布,本基金配置的重点放在较为稳定的医药/物业管理及成长类股票中的新能源车/新能源(如风电)及谷底经营回复的企业上。

2) 从 9 月最后一周,基金策略发生明显变化,基于对盈利确定性和估值性价比的评估,大幅买入低估值价值型股票,尤其是银行地产。

2. 未来操作策略:信用下行期我们会选择更高品质、产业地位牢固、长期商业价值确定性更强的核心标的、投资主线可概括为“资产荒受益股+景气行业的龙头股+周期底部掘金”;

1) 基于低风险稳定回报资金入市、衰退式宽松下资产荒的资产再配置逻辑;

A. 大幅增配低估值、高 ROE、高股息率、定位于轻资本消耗和低对公贷款敞口的银行股。

- B. 积极配置实业中具有类债券属性的降息受益股、如电站运营、燃气等公用事业股。
- C. 在实际利率下降、全球冲突加剧避险升温的背景下、我们适度配置合理估值的黄金股。
- 2) 布局技术驱动型的景气行业龙头：
- A. 以合理价格挖掘具有技术、规模、品牌等复合壁垒、在细分产业能创造显著终端用户价值、有全球比较优势或启动进口高端产品替代的企业。如白电、工程机械、先进制造、半导体等。
- B. 基于对中国特色的产业（政策）环境理解、挖掘企业生态结构性变化后带来的产业链投资机会；如医改推动的创新药、供改驱动的疫苗、军改驱动军民融合、新基建和新能源的收益者等。
- C. 适度配置估值合理、基本面好、长期成长空间稳定的医药、消费类股票。
- 3) 挖掘受益于周期下行已进入底部区域、具有系统性成本优势能享受周期启动后集中度提高的受益标的；如海油运输、锂矿铜矿等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 4.07%，同期业绩基准增长率为 0.64%，C 类份额净值增长率为 3.92%，同期业绩基准增长率为 0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	59,954,037.09	70.85
	其中：股票	59,954,037.09	70.85
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	16,000,000.00	18.91
	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	7,962,154.07	9.41
8	其他资产	705,388.25	0.83
9	合计	84,621,579.41	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

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	-	-
C	制造业	22,506,058.20	27.95
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,581,732.00	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	12,273,623.12	15.24
K	房地产业	4,751,493.00	5.90
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	41,112,906.32	51.06

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

单位：人民币元

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	2,879,793.21	3.58
非日常生活消费品	1,531,951.23	1.90
金融	7,805,489.42	9.69
信息技术	712,227.10	0.88
公用事业	5,911,669.81	7.34
合计	18,841,130.77	23.40

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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	600036	招商银行	116,900	4,062,275.00	5.05
2	601318	中国平安	44,000	3,829,760.00	4.76
3	00451	协鑫新能源	14,296,000	3,610,637.79	4.48
4	601818	光大银行	908,748	3,580,467.12	4.45
5	06818	中国光大银行	1,028,000	3,097,069.38	3.85
6	01818	招金矿业	352,000	2,879,793.21	3.58
7	000333	美的集团	53,700	2,744,070.00	3.41
8	002511	中顺洁柔	187,000	2,328,150.00	2.89
9	01600	天伦燃气	341,500	2,301,032.02	2.86
10	300122	智飞生物	41,700	1,978,665.00	2.46

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。

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。

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

本基金本报告期内没有发生股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，采用流动性好、交易活跃的合约品种，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，以达到降低投资组合整体风险的目的。

本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。

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

基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内没有发生国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有发生国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

报告期内基金投资的前十名证券除光大银行（证券代码：601818）、中国光大银行（证券代码：06818）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

基金管理人分析认为，中国光大银行股份有限公司在常规业务过程中被监管机关给与警告、处罚、分行高管市场禁入等行政处罚、其罚款金额和行政监管措施的商业价值影响相比其经营规模和利润而言比例极小。基金管理人经审慎分析，认为受罚情况对公司经营和价值应不会构成重大影响。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	507,240.82
3	应收股利	3,019.10
4	应收利息	-4,672.12
5	应收申购款	199,800.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	705,388.25

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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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，投资组合报告中数字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	合煦智远嘉选混合 A	合煦智远嘉选混合 C
报告期期初基金份额总额	32,910,275.53	62,633,577.11
报告期期间基金总申购份额	2,523,747.90	437,542.88
减：报告期期间基金总赎回份额	5,425,056.03	16,856,161.65
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	30,008,967.40	46,214,958.34

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,004,409.72
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,004,409.72
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.57

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发生运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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

单位：份

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（份）	申购份额（份）	赎回份额（份）	持有份额（份）	份额占比
机构	1	20190923-20190926	15,000,000.00	-	-	15,000,000.00	19.68%

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还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等情形。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

- 1、本报告期内，聘任朱广科为总行资产托管部副总经理（主持工作），免去朱广科的总行资产托管部常务副总经理职务；
- 2、本报告期内，免去陈辰的总行资产托管部总经理职务。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立合煦智远嘉选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《合煦智远嘉选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《合煦智远嘉选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人合煦智远基金管理有限公司，客服热线 400-983-5858。

合煦智远基金管理有限公司

2019 年 10 月 22 日