

合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券 投资基金(LOF) 2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 月 31 日

基金管理人：合煦智远基金管理有限公司

基金托管人：申万宏源证券有限公司

报告送出日期：2021 年 4 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。

基金托管人申万宏源证券有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	合煦智远金融科技指数（LOF）
场内简称	金融科技
基金主代码	168701
交易代码	168701
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2020 年 4 月 3 日
报告期末基金份额总额	93,225,968.99 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要根据标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：国证香蜜湖金融科技指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金主要通过投资于国证香蜜湖金融科技指数的成分股来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与国证香蜜湖金融科技指数的表现密切相关。 本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于 R3 类(中等收益/风险特征)的基金。 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。
基金管理人	合煦智远基金管理有限公司

基金托管人	申万宏源证券有限公司	
下属分级基金的基金简称	合煦智远金融科技指数(LOF) A (金融科技)	合煦智远金融科技指数(LOF) C (金融科 C)
下属分级基金的交易代码	168701	168702
报告期末下属分级基金的份额总额	83,356,167.07 份	9,869,801.92 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（2021年1月1日—2021年3月31日）	
	合煦智远金融科技指数(LOF) A (金融科技)	合煦智远金融科技指数(LOF) C (金融科 C)
1.本期已实现收益	-1,598,003.80	-215,979.19
2.本期利润	-7,909,925.30	-1,004,270.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0886	-0.0875
4.期末基金资产净值	82,364,756.23	9,704,410.33
5.期末基金份额净值	0.9881	0.9832

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

合煦智远金融科技指数(LOF) A (金融科技)

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	-8.73%	1.49%	-8.94%	1.50%	0.21%	-0.01%
过去六个月	-9.51%	1.51%	-11.71%	1.54%	2.20%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-1.19%	1.50%	3.76%	1.70%	-4.95%	-0.20%

合煦智远金融科技指数(LOF) C (金融科 C)

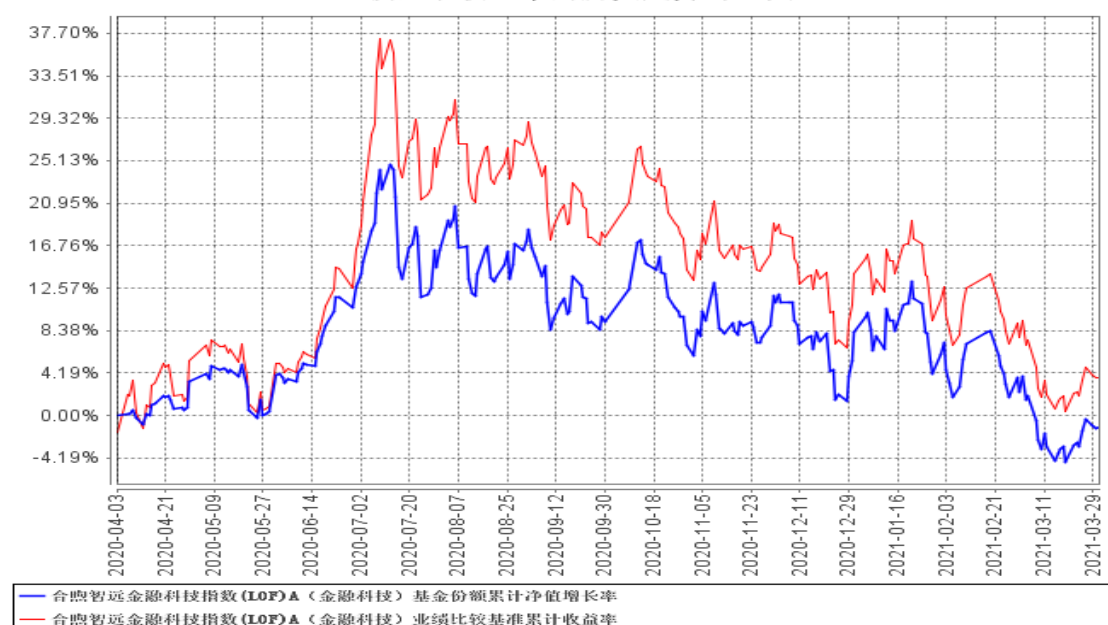
阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-8.84%	1.49%	-8.94%	1.50%	0.10%	-0.01%
过去六个月	-9.74%	1.51%	-11.71%	1.54%	1.97%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.68%	1.50%	3.76%	1.70%	-5.44%	-0.20%

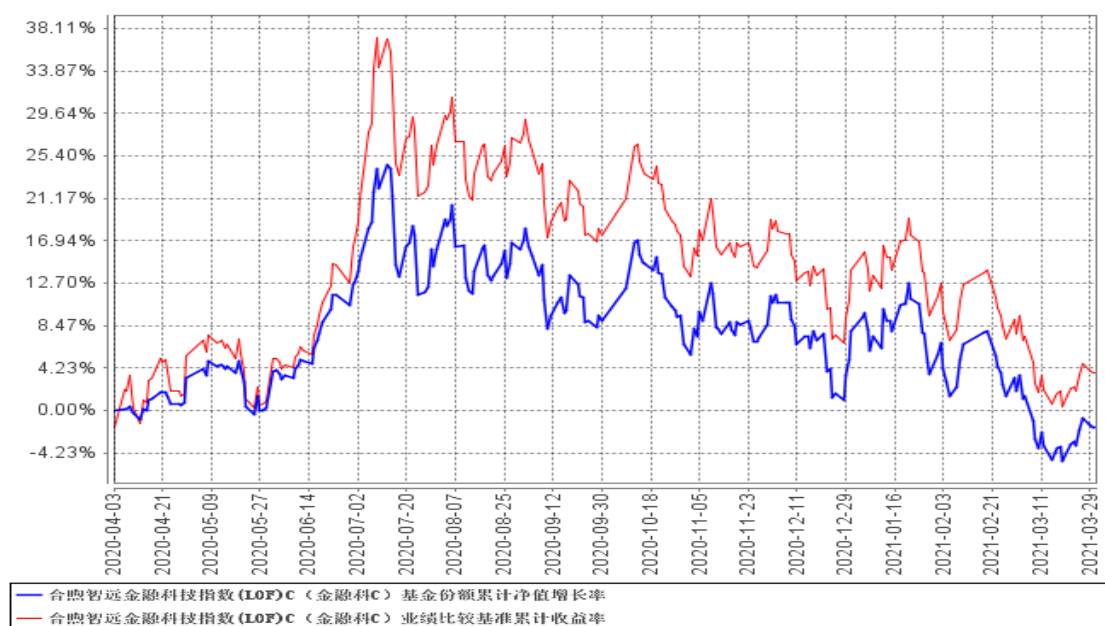
注：本基金的业绩比较基准为：国证香蜜湖金融科技指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

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

合煦智远金融科技指数(LOF)A（金融科技）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



合煦智远金融科技指数(LOF)C(金融科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：本基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；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		
潘天奇	本基金基金经理	2020 年 4 月 3 日	-	9 年	四川大学理学学士,美国匹兹堡大学理学硕士和卡茨商学院金融 MBA。历任恒瑞医药股份有限公司研究员,广州证券股份有限公司研究所(后更名“广证恒生证券研究所”)研究员,国投瑞银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理,2018 年 7 月加入合煦智远基金管理有限公司。

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期，离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期未发生本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1. 宏观经济和市场环境

2021年1季度，国内经济延续复苏态势，海外随着新冠疫苗注射的扩大范围经济活动也逐步地开始复苏，需求端的改善拉动制造业产业链盈利趋势向好，工业增加值将稳步上行。A股今年2-3月的调整体现了对于海外货币宽松引起通胀上行和疫情恢复货币政策转向的部分担心，我们后续仍需观察全球经济活动恢复情况以及市场流动性变化。总体来看，海外市场风险仍然较高，更看好国内经济和市场的韧性。

从政策支持、细分行业发展趋势、财务报表质量、竞争格局等角度，中长期看好医药生物、信息技术类、消费类、新能源车产业链、高端制造等行业。

2. 投资策略及运行

本产品所跟踪的国证香蜜湖金融科技指数(399699)意在表征金融科技行业发展趋势。2021年1季度该产品90%以上仓位配置国证香蜜湖金融科技指数(399699)成份股。后续产品运行也将体现与国证香蜜湖金融科技指数(399699)高度跟踪的走势。除此之外，通过网下申购新股、主动仓位部分的选股，我们也将努力为投资者创造更高的超额收益。

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-8.73%，同期业绩基准增长率为-8.94%，C 类份额净值增长率为-8.84%，同期业绩基准增长率为-8.94%。

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	86,158,399.65	93.18
	其中：股票	86,158,399.65	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,999.60	0.05
	其中：债券	45,999.60	0.05
	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	5,877,972.31	6.36
8	其他资产	386,791.54	0.42
9	合计	92,469,163.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
C	制造业	14,168,174.72	15.39
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,033,522.89	52.17
J	金融业	22,415,661.70	24.35
K	房地产业	517,631.00	0.56
L	租赁和商务服务业	740,104.00	0.80
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	85,875,094.31	93.27

5.2.2 报告期末积极投资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	14,520.00	0.02
C	制造业	182,515.34	0.20
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,910.00	0.04
J	金融业	22,520.00	0.02
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	30,840.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	283,305.34	0.31

5.2.3 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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	300059	东方财富	355,800	9,699,108.00	10.53
2	601318	中国平安	109,351	8,605,923.70	9.35
3	600570	恒生电子	89,319	7,502,796.00	8.15
4	002410	广联达	97,252	6,456,560.28	7.01
5	600588	用友网络	177,800	6,349,238.00	6.90
6	000938	紫光股份	138,600	2,749,824.00	2.99
7	000977	浪潮信息	99,944	2,736,466.72	2.97
8	300033	同花顺	20,900	2,495,460.00	2.71
9	002439	启明星辰	69,921	2,333,263.77	2.53
10	002152	广电运通	123,500	1,407,900.00	1.53

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300451	创业慧康	3,000	32,910.00	0.04
2	002044	美年健康	2,000	30,840.00	0.03
3	601838	成都银行	2,000	22,520.00	0.02
4	002422	科伦药业	1,000	22,090.00	0.02
5	300898	熊猫乳品	496	17,558.40	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

单位：人民币元

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	-	-
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）	45,999.60	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,999.60	0.05

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

单位：人民币元

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	123105	拓尔转债	460	45,999.60	0.05

注：以上为本基金本报告期末持有的所有债券投资明细。

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，采用流动性好、交易活跃的合约品种，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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**

本基金基金合同约定的投资范围未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同约定的投资范围未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同约定的投资范围未包含国债期货投资。

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

基金投资的前十名证券中用友网络（证券代码：600588）在一年内受到罚款处罚，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，上述公司在常规业务过程中被监管机关给予小额罚款等行政处罚、其处罚的商业影响相比起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	343,090.08
3	应收股利	-
4	应收利息	1,825.49
5	应收申购款	41,875.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	386,791.54

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 报告期末股票投资中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	300898	熊猫乳品	17,558.40	0.02	首次公开发行限售

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	合煦智远金融科技指数 (LOF) A (金融科技)	合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科 C)
报告期期初基金份额总额	103,753,648.75	13,778,585.19
报告期期间基金总申购份额	5,879,917.35	5,143,264.95
减：报告期期间基金总赎回份额	26,277,399.03	9,052,048.22
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	83,356,167.07	9,869,801.92

§ 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

本基金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

本基金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

本基金本报告期内没有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

报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)的文件；
- 2、《合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)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及指定网站上披露的各项公告。

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

2021 年 4 月 22 日