

# 合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券 投资基金(LOF) 2021 年中期报告

2021 年 06 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：申万宏源证券有限公司

报告送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	35
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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贵金属投资明细.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
§8 基金份额持有人信息 .....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	44
§9 开放式基金份额变动 .....	45
§10 重大事件揭示 .....	45
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
11.1 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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§12 备查文件目录 .....	48
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)	
基金简称	合煦智远金融科技指数 (LOF)	
场内简称	金融科技 LOF	
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	
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	
报告期末基金份额总额	98,145,750.87 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2020年5月6日	
下属分级基金的基金简称	合煦智远金融科技指数 (LOF) A	合煦智远金融科技指数 (LOF) 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	89,762,049.96 份	8,383,700.91 份

### 2.2 基金产品说明

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	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份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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	合煦智远基金管理有限公司	申万宏源证券有限公司

信息披露负责人	姓名	林琦	刘尚文
	联系电话	4009835858	010-88085720
	电子邮箱	pub_compliance@uvasset.com	liushangwen@swhysc.com
客户服务电话		4009835858	010-88013540
传真		0755-21835680	010-88085221
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中社区福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 5 层 01-06	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中社区福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 5 层 01-06	北京市西城区太平桥大街 19 号恒奥中心 B 座	
邮政编码	518000	100033	
法定代表人	郑旭	杨玉成	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.uvasset.com">https://www.uvasset.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

	合煦智远金融科技指数(LOF)A	合煦智远金融科技指数(LOF)C
3.1.1 期间数据和指标	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日
本期已实现收益	10,096.74	-60,224.25
本期利润	443,636.11	575.15
加权平均基金份额本期利润	0.0050	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.48%	0.01%

本期基金份额净值增长率	0.27%	0.02%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
期末可供分配利润	7,673,076.81	660,457.44
期末可供分配基金份额利润	0.0855	0.0788
期末基金资产净值	97,435,126.77	9,044,158.35
期末基金份额净值	1.0855	1.0788
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
基金份额累计净值增长率	8.55%	7.88%

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，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即2021年6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 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

合煦智远金融科技指数（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.74%	1.20%	0.47%	1.22%	0.27%	-0.02%
过去三个月	9.86%	1.21%	9.14%	1.22%	0.72%	-0.01%
过去六个月	0.27%	1.36%	-0.62%	1.37%	0.89%	-0.01%
过去一年	-3.67%	1.54%	-2.69%	1.63%	-0.98%	-0.09%
自基金合同生效起至今	8.55%	1.45%	13.25%	1.62%	-4.70%	-0.17%

合煦智远金融科技指数（LOF）C

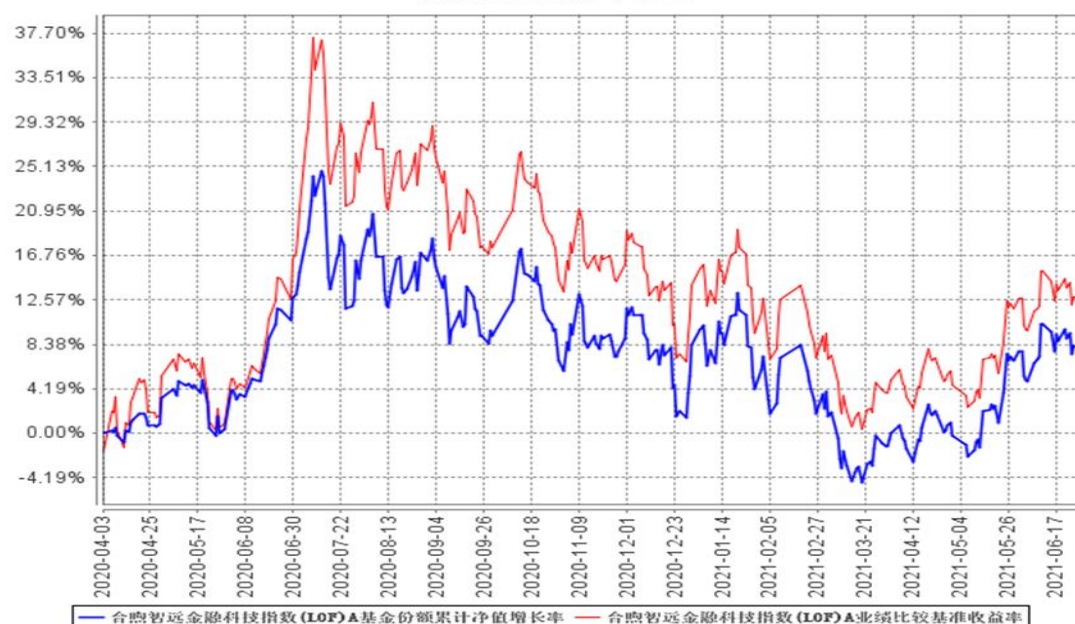
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.70%	1.20%	0.47%	1.22%	0.23%	-0.02%
过去三个月	9.72%	1.21%	9.14%	1.22%	0.58%	-0.01%
过去六个月	0.02%	1.36%	-0.62%	1.37%	0.64%	-0.01%
过去一年	-4.14%	1.54%	-2.69%	1.63%	-1.45%	-0.09%
自基金合同生效起至今	7.88%	1.45%	13.25%	1.62%	-5.37%	-0.17%

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%。

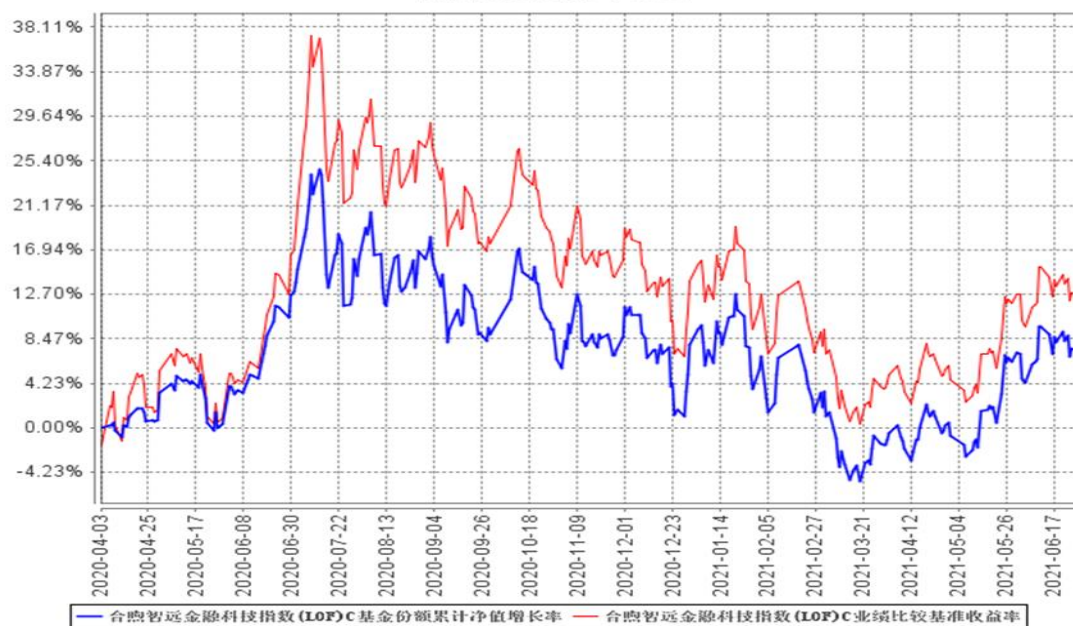
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2020年4月3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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

合煦智远基金管理有限公司（原青松基金管理有限公司）是经中国证监会2017年8月1日证监许可（2017）1419号文批准设立，于2017年8月21日在广东省深圳市注册成立，并于2018年2月8日取得由中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。公司于2018年6月21日完成工商变更登记手续，更名为“合煦智远基金管理有限公司”，并于2018年7月9日取得由中国证监会换发的《经营证券期货业务许可证》。业务范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。

截止报告期末，公司公募基金总规模2.53亿元，管理3只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程卉超	本基金基金经理	2021年4月27日	-	12年	北京大学经济学硕士。2009年至2014年就职于融通基金管理有限公司，担任研究员；2015年至2017年就职于上海高

					毅资产管理合伙企业（有限合伙），担任高级研究员。2017年12月加入合煦智远基金管理有限公司。
潘天奇	本基金基金经理（已离任）	2020年4月3日	2021年4月27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。

#### 4.1.3 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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、本基金基金合同、基金招募说明书等有关法律文件的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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控制公平交易的执行。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，此原则贯彻于基金的运作始终。

本基金运用指数化投资方式，采取量化策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对国证香蜜湖金融科技指数（399699）的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A类基金份额净值增长率为0.27%，C类基金份额净值增长率为0.02%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，行业受益于产业创新周期、资本投入周期和政策周期三个周期的共振，未来十年，该领域景气度较高。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金估值程序严格遵照执行相关法律法规、基金合同、《合煦智远基金管理有限公司估值委员会议事规则》及《合煦智远基金管理有限公司基金资产估值业务管理指引》。

##### 1、估值流程

基金估值程序采用基金管理人与基金托管人同步独立核算、相互核对的方式，基金管理人每日对基金持有的投资品种进行估值，基金托管人根据法律法规要求对基金管理人采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。基金管理人还会将基金在证券经纪商开立的证券资金账户对账单与估值结果进行核对，每日估值结果必须与基金托管人、证券经纪商核对一致后才能对外公告基金净值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立估值委员会，成员由投资部、研究部、监察稽核部、运营部等部门总监或其他指定的相关人员组成。公司估值委员会负责审议估值政策、监督估值结果、跟踪及定期评估估值政策的执行、与基金托管人及相关估值机构沟通协商估值政策、跟踪研究规则变化对估值的影响、修订补充完善估值相关制度和流程。

日常基金资产的估值程序，由公司运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，公司启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，公司运营部具体执行。

2、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，申万宏源证券有限公司（以下称“本托管人”）在对合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督、对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30	上年度末 2020 年 12 月
----	-----	-------------------	------------------

		日	31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	559,307.45	528,022.88
结算备付金		6,934,847.20	8,170,247.89
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	100,052,640.96	119,142,667.35
其中：股票投资		100,052,640.96	119,142,667.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		609,107.03	221,960.88
应收利息	6.4.7.5	1,644.61	2,482.25
应收股利		-	-
应收申购款		601,966.24	102,532.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		108,759,513.49	128,167,914.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,008,704.83	705,529.90
应付管理人报酬		44,984.00	57,235.96
应付托管费		8,996.81	11,447.18
应付销售服务费		4,196.17	6,066.73
应付交易费用	6.4.7.7	437.76	158.84

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	212,908.80	205,629.97
负债合计		2,280,228.37	986,068.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	98,145,750.87	117,532,233.94
未分配利润	6.4.7.10	8,333,534.25	9,649,611.67
所有者权益合计		106,479,285.12	127,181,845.61
负债和所有者权益总计		108,759,513.49	128,167,914.19

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额98,145,750.87份，其中合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)A类基金份额89,762,049.96份，A类基金份额净值1.0855元；合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)C类基金份额8,383,700.91份，C类基金份额净值1.0788元。

## 6.2 利润表

会计主体：合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间2020年 4月3日(基金合同生效 日)至2020年6月30 日
一、收入		1,088,469.57	41,544,200.24
1. 利息收入		69,705.45	916,126.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,229.19	544,706.48
债券利息收入		18.78	0.16
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		457.48	371,419.68
其他利息收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		162,908.96	28,405,570.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-314,573.60	27,537,894.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	979.37	281.14
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	476,503.19	867,394.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	494,338.77	10,023,919.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	361,516.39	2,198,583.88
减：二、费用		644,258.31	2,168,125.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	254,832.50	461,955.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	50,966.53	92,391.12
3. 销售服务费		27,464.09	11,251.92
4. 交易费用	6.4.7.19	95,928.40	1,495,172.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	-
7. 其他费用	6.4.7.20	215,066.74	107,354.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		444,211.26	39,376,074.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		444,211.26	39,376,074.78

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	117,532,233.94	9,649,611.67	127,181,845.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	444,211.26	444,211.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“—”号填列)	-19,386,483.07	-1,760,288.68	-21,146,771.75
其中：1. 基金申购款	55,521,998.98	2,948,828.52	58,470,827.50
2. 基金赎回款	-74,908,482.05	-4,709,117.20	-79,617,599.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“—”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	98,145,750.87	8,333,534.25	106,479,285.12
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	531,837,888.28	-	531,837,888.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	39,376,074.78	39,376,074.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-358,005,314.01	-17,349,199.50	-375,354,513.51



动数（净值减少以“—”号填列）			
其中：1. 基金申购款	11,470,164.31	731,536.09	12,201,700.40
2. 基金赎回款	-369,475,478.32	-18,080,735.59	-387,556,213.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	173,832,574.27	22,026,875.28	195,859,449.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 郑旭 \_\_\_\_\_ 刘慧红 \_\_\_\_\_ 刘慧红 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 2773 号《关于准予合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准，由合煦智远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型、上市开放式(LOF)，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 531,621,595.05 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2020 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 531,837,888.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 216,293.23 份基金份额。本基金的基金管理人为合煦智远基金管理有限公司，基金托管人为申万宏源证券有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]333 号核准，本基金 316,790,447.00 份 A 类基金份额于 2020 年 5 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《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》和《合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用而不计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金还可投资于依法发行上市的其他股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票等)、港股通标的股票、债券(含国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券质押式及买断式回购、现金、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款等)、货币市场工具、股票期权、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；基金投资于港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。本基金的业绩比较基准为：国证香蜜湖金融科技指数收益率 $\times$ 95%+人民币银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 所采用的会计政策会计\_会计估计与上年度相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	427,571.86
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	131,735.59
合计	559,307.45

注：本基金持有的其他存款均为为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	107,616,482.55	100,052,640.96	-7,563,841.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	107,616,482.55	100,052,640.96	-7,563,841.59

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	156.22
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	50.55
应收结算备付金利息	1,437.84
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,644.61

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	437.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	437.76

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,333.16
应付证券出借违约金	-
预提费用	161,575.64
指数使用费	50,000.00
合计	212,908.80

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
上年度末	103,753,648.75	103,753,648.75
本期申购	43,554,411.44	43,554,411.44
本期赎回（以“-”号填列）	-57,546,010.23	-57,546,010.23
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	89,762,049.96	89,762,049.96

金额单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
上年度末	13,778,585.19	13,778,585.19
本期申购	11,967,587.54	11,967,587.54
本期赎回（以“-”号填列）	-17,362,471.82	-17,362,471.82
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	8,383,700.91	8,383,700.91

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	19,983,002.67	-11,416,084.07	8,566,918.60
本期利润	10,096.74	433,539.37	443,636.11
本期基金份额交易产生的变动数	-2,735,875.07	1,398,397.17	-1,337,477.90
其中：基金申购款	7,917,611.08	-5,492,831.53	2,424,779.55
基金赎回款	-10,653,486.15	6,891,228.70	-3,762,257.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,257,224.34	-9,584,147.53	7,673,076.81

单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,594,483.82	-1,511,790.75	1,082,693.07
本期利润	-60,224.25	60,799.40	575.15
本期基金份额交易产生的变动数	-980,377.80	557,567.02	-422,810.78
其中：基金申购款	2,114,584.07	-1,590,535.10	524,048.97
基金赎回款	-3,094,961.87	2,148,102.12	-946,859.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,553,881.77	-893,424.33	660,457.44

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,016.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,399.71
结算备付金利息收入	63,810.45
其他	2.86
合计	69,229.19

注：“其他”为“申购款利息收入”。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	42,814,341.64
减：卖出股票成本总额	43,128,915.24
买卖股票差价收入	-314,573.60

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	46,998.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,999.60
减：应收利息总额	19.60
买卖债券差价收入	979.37

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内没有发生资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内没有发生贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内没有发生衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	476,503.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	476,503.19

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	494,338.77
——股票投资	494,338.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	494,338.77

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元



项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	361,516.39
合计	361,516.39

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	95,928.40
银行间市场交易费用	-
合计	95,928.40

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划费	3,491.10
指数使用费	100,000.00
上市初费及年费	29,752.78
合计	215,066.74

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
合煦智远基金管理有限公司（“合煦智远基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源证券”）	基金托管人、基金证券经纪商、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额 (元)	占当期股票成交总额的比例	成交金额 (元)	占当期股票成交总额的比例
申万宏源证券	50,017,796.55	75.97%	796,566,518.71	68.84%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额 (元)	占当期债券成交总额的比例	成交金额 (元)	占当期债券成交总额的比例
申万宏源证券	36,743.11	78.18%	1,281.30	100.00%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额 (元)	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额 (元)	占当期债券回购成交总额的比例
申万宏源证券	5,700,000.00	90.48%	3,156,700,000.00	60.16%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金 (元)	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额 (元)	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源证券	35,922.03	75.99%	353.14	80.67%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金 (元)	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额 (元)	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源证券	575,174.62	68.96%	16,771.34	68.64%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围包括证券经纪服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	254,832.50	461,955.58
其中：支付销售机构的客户维护费	96,521.99	203,024.86

注：1、支付基金管理人的管理人报酬年费率为 0.50%，逐日计提，按月支付。其计算公式为：日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	50,966.53	92,391.12

注：支付基金托管人的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	合煦智远金融科技指数 (LOF) A	合煦智远金融科技指数 (LOF) C	合计
合煦智远基金公司	-	1,827.58	1,827.58
申万宏源证券	-	742.99	742.99
合计	-	2,570.57	2,570.57
获得销售服务费的	上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30		

各关联方名称	日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	合煦智远金融科技指数 (LOF) A	合煦智远金融科技指数 (LOF) C	合计
合煦智远基金公司	-	829.08	829.08
申万宏源证券	-	1,518.87	1,518.87
合计	-	2,347.95	2,347.95

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，支付基金销售机构的C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%，逐日计提，按月支付给合煦智远基金公司，再由合煦智远基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比较期间内转融通证券出借业务未发生重大关联交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未持有本基金份额。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	合煦智远金融科技指数（LOF）A			
	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额（份）	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额（份）	持有的基金份额占基金总份额的比例
郑旭	288,050.43	0.3209%	228,255.55	0.2200%
林琦	298.58	0.0003%	298.58	0.0003%

份额单位：份

关联方名称	合煦智远金融科技指数（LOF）C			
	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额（份）	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额（份）	持有的基金份额占基金总份额的比例
林琦	100.12	0.0012%	100.12	0.0007%

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
申万宏源证券	42,936.04	1,216.32	73,398.13	21,834.70

注：本基金申万宏源证券户的存款由基金托管人申万宏源证券保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
申万宏源证券	605339	南侨食品	网下申购	863	14,653.74

单位：人民币元

上年度可比期间 2020 年 4 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
申万宏源证券	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 本基金本报告期持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认	可流通	流通受	认购	期末	数量(单	期末成本	期末估值	备注

		购日	日	限类型	价格	估值 单价	位：股)	总额	总额	
300919	中伟股份	2020年 12月15 日	2021年 7月2 日	首次公 开发行 限售	24.60	163.0 0	168	4,132.80	27,384.00	-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	首次公 开发行 限售	12.85	25.80	260	3,341.00	6,708.00	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。基金参与网下或网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让；其中基金参与网下申购作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

#### 6.4.12.1.2 本基金本报告期持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，投资的金融工具主要包括股票、债券等，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，属于中等收益/风险特征的基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核与风险管理工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人申万宏源证券开立于中国建设银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于2021年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

(2020年12月31日：同)

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。



本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	559,307.45	-	-	-	559,307.45
结算备付金	6,934,847.20	-	-	-	6,934,847.20
交易性金融资产	-	-	-	100,052,640.96	100,052,640.96
应收证券清算款	-	-	-	609,107.03	609,107.03
应收利息	-	-	-	1,644.61	1,644.61
应收申购款	-	-	-	601,966.24	601,966.24
资产总计	7,494,154.65	-	-	101,265,358.84	108,759,513.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,008,704.83	2,008,704.83
应付管理人报酬	-	-	-	44,984.00	44,984.00
应付托管费	-	-	-	8,996.81	8,996.81
应付销售服务费	-	-	-	4,196.17	4,196.17
应付交易费用	-	-	-	437.76	437.76
其他负债	-	-	-	212,908.80	212,908.80
负债总计	-	-	-	2,280,228.37	2,280,228.37
利率敏感度缺口	7,494,154.65	-	-	98,985,130.47	106,479,285.12
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	528,022.88	-	-	-	528,022.88
结算备付金	8,170,247.89	-	-	-	8,170,247.89
交易性金融资产	-	-	-	119,142,667.35	119,142,667.35
应收证券清算款	-	-	-	221,960.88	221,960.88
应收利息	-	-	-	2,482.25	2,482.25
应收申购款	-	-	-	102,532.94	102,532.94
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,698,270.77	-	-	119,469,643.42	128,167,914.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	705,529.90	705,529.90
应付管理人报酬	-	-	-	57,235.96	57,235.96
应付托管费	-	-	-	11,447.18	11,447.18
应付销售服务费	-	-	-	6,066.73	6,066.73
应付交易费用	-	-	-	158.84	158.84
其他负债	-	-	-	205,629.97	205,629.97
负债总计	-	-	-	986,068.58	986,068.58
利率敏感度缺口	8,698,270.77	-	-	118,483,574.84	127,181,845.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2020 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金未持有不以记账本位币计价的资产，因此不存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	100,052,640.96	93.96	119,142,667.35	93.68
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,052,640.96	93.96	119,142,667.35	93.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准之外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	5,260,840.67	5,220,530.55
	2.业绩比较基准下降 5%	-5,260,840.67	-5,220,530.55

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：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	100,052,640.96	91.99
	其中：股票	100,052,640.96	91.99
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	7,494,154.65	6.89
8	其他资产	1,212,717.88	1.12
9	合计	108,759,513.49	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	16,197,445.72	15.21
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	57,628,491.18	54.12
J	金融业	24,084,470.08	22.62
K	房地产业	769,928.00	0.72
L	租赁和商务服务业	1,234,161.00	1.16
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	99,914,495.98	93.83

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	75,517.04	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
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	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.03
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	138,144.98	0.13

### 7.2.3 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。

## 7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：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	315,820	10,355,737.80	9.73
2	601318	中国平安	140,751	9,047,474.28	8.50
3	600570	恒生电子	94,719	8,832,546.75	8.30
4	002410	广联达	108,052	7,369,146.40	6.92
5	600588	用友网络	186,700	6,209,642.00	5.83
6	300339	润和软件	76,500	3,317,040.00	3.12
7	000938	紫光股份	150,900	3,301,692.00	3.10
8	000977	浪潮信息	106,044	2,983,017.72	2.80
9	300033	同花顺	22,600	2,548,828.00	2.39
10	002439	启明星辰	74,721	2,167,656.21	2.04
11	002152	广电运通	127,400	1,660,022.00	1.56
12	002065	东华软件	203,223	1,611,558.39	1.51
13	600271	航天信息	113,300	1,476,299.00	1.39
14	000997	新大陆	83,200	1,380,288.00	1.30
15	300773	拉卡拉	44,400	1,253,412.00	1.18

16	002195	二三四五	586,600	1,190,798.00	1.12
17	002268	卫士通	60,500	1,178,540.00	1.11
18	002153	石基信息	48,534	1,141,034.34	1.07
19	300079	数码视讯	140,000	1,078,000.00	1.01
20	300348	长亮科技	58,800	1,076,040.00	1.01
21	300369	绿盟科技	62,800	1,001,660.00	0.94
22	300803	指南针	25,300	976,580.00	0.92
23	600718	东软集团	99,000	968,220.00	0.91
24	600410	华胜天成	118,400	918,784.00	0.86
25	300663	科蓝软件	23,700	910,317.00	0.85
26	002183	怡亚通	155,700	892,161.00	0.84
27	600446	金证股份	61,000	880,840.00	0.83
28	300226	上海钢联	14,620	870,621.00	0.82
29	300352	北信源	124,600	867,216.00	0.81
30	601519	大智慧	96,200	835,978.00	0.79
31	002368	太极股份	40,299	808,397.94	0.76
32	300674	宇信科技	42,740	798,810.60	0.75
33	002285	世联行	125,600	769,928.00	0.72
34	000555	神州信息	53,200	769,804.00	0.72
35	300085	银之杰	38,000	670,700.00	0.63
36	600797	浙大网新	100,300	670,004.00	0.63
37	300377	赢时胜	57,691	642,677.74	0.60
38	600776	东方通信	47,500	589,000.00	0.55
39	002177	御银股份	72,900	553,311.00	0.52
40	300324	旋极信息	120,200	512,052.00	0.48
41	002649	博彦科技	47,400	497,700.00	0.47
42	300368	汇金股份	38,700	472,527.00	0.44
43	002537	海联金汇	80,300	438,438.00	0.41
44	002376	新北洋	47,700	435,978.00	0.41
45	300541	先进数通	27,600	432,768.00	0.41
46	300465	高伟达	35,400	429,756.00	0.40
47	300322	硕贝德	34,000	426,020.00	0.40
48	300468	四方精创	22,208	421,729.92	0.40
49	300579	数字认证	8,800	417,736.00	0.39
50	300248	新开普	40,600	399,504.00	0.38
51	300229	拓尔思	43,200	387,504.00	0.36
52	002104	恒宝股份	63,900	378,288.00	0.36
53	300297	蓝盾股份	87,600	371,424.00	0.35
54	300130	新国都	31,800	363,792.00	0.34
55	300386	飞天诚信	20,500	353,215.00	0.33
56	300349	金卡智能	30,000	351,900.00	0.33
57	002668	奥马电器	63,700	350,987.00	0.33
58	002657	中科金财	30,600	347,616.00	0.33

59	300061	旗天科技	38,000	342,000.00	0.32
60	002987	京北方	10,700	341,865.00	0.32
61	002453	华软科技	49,400	337,896.00	0.32
62	000948	南天信息	25,200	335,160.00	0.31
63	300205	天喻信息	27,200	334,832.00	0.31
64	002017	东信和平	28,600	326,898.00	0.31
65	002530	金财互联	33,700	326,216.00	0.31
66	002777	久远银海	18,140	320,896.60	0.30
67	600318	新力金融	40,800	319,872.00	0.30
68	300096	易联众	32,000	310,720.00	0.29
69	603232	格尔软件	18,549	309,582.81	0.29
70	002197	证通电子	41,100	301,674.00	0.28
71	002315	焦点科技	16,600	300,460.00	0.28
72	300231	银信科技	35,600	283,376.00	0.27
73	600571	信雅达	37,700	276,718.00	0.26
74	300333	兆日科技	31,842	260,785.98	0.24
75	300290	荣科科技	50,600	255,530.00	0.24
76	603383	顶点软件	8,760	249,046.80	0.23
77	002908	德生科技	12,800	233,600.00	0.22
78	300872	天阳科技	6,300	228,690.00	0.21
79	300479	神思电子	11,900	219,198.00	0.21
80	002587	奥拓电子	44,600	218,986.00	0.21
81	300295	三六五网	17,200	200,036.00	0.19
82	002095	生意宝	14,200	196,812.00	0.18
83	300542	新晨科技	12,790	176,885.70	0.17
84	603106	恒银科技	25,250	145,440.00	0.14
85	300546	雄帝科技	8,100	143,046.00	0.13
86	300380	安硕信息	7,500	141,525.00	0.13
87	300399	天利科技	9,000	114,030.00	0.11

### 7.3.2 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所有股票投资明细

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	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
2	300919	中伟股份	168	27,384.00	0.03
3	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
4	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
5	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
6	300918	南山智尚	957	9,962.37	0.01
7	300922	天秦装备	255	8,881.65	0.01



8	300956	英力股份	260	6,708.00	0.01
9	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,715,796.92	2.92
2	300059	东方财富	3,541,297.00	2.78
3	002410	广联达	1,815,627.00	1.43
4	600570	恒生电子	1,575,586.00	1.24
5	600588	用友网络	1,400,707.00	1.10
6	300339	润和软件	559,598.00	0.44
7	000938	紫光股份	555,408.00	0.44
8	000977	浪潮信息	506,339.00	0.40
9	300541	先进数通	483,447.00	0.38
10	300033	同花顺	423,996.00	0.33
11	002439	启明星辰	379,041.00	0.30
12	002657	中科金财	370,565.00	0.29
13	002987	京北方	341,141.00	0.27
14	002065	东华软件	281,851.00	0.22
15	600271	航天信息	259,618.00	0.20
16	002195	二三四五	243,607.00	0.19
17	300803	指南针	234,374.00	0.18
18	002152	广电运通	232,246.00	0.18
19	300872	天阳科技	226,461.00	0.18
20	300369	绿盟科技	217,468.00	0.17

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	10,037,018.30	7.89
2	601318	中国平安	3,752,725.00	2.95
3	600570	恒生电子	3,368,300.75	2.65
4	600588	用友网络	3,007,679.80	2.36
5	002410	广联达	2,882,175.00	2.27
6	000938	紫光股份	1,131,041.00	0.89
7	000977	浪潮信息	1,079,895.08	0.85
8	300033	同花顺	948,128.31	0.75

9	002439	启明星辰	807,287.00	0.63
10	002065	东华软件	614,189.00	0.48
11	600271	航天信息	503,600.00	0.40
12	002152	广电运通	470,194.00	0.37
13	002044	美年健康	464,343.00	0.37
14	300773	拉卡拉	424,112.00	0.33
15	002153	石基信息	384,336.00	0.30
16	000997	新大陆	381,105.00	0.30
17	002195	二三四五	358,527.00	0.28
18	300348	长亮科技	357,671.00	0.28
19	600718	东软集团	346,048.00	0.27
20	002268	卫士通	341,647.00	0.27

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,544,550.08
卖出股票收入（成交）总额	42,814,341.64

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 报告期末其他各项资产构成

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	609,107.03
3	应收股利	-

4	应收利息	1,644.61
5	应收申购款	601,966.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,212,717.88

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 报告期末股票投资中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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。

##### 7.12.5.2 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	300919	中伟股份	27,384.00	0.03	首次公开发行限售
2	605287	德才股份	11,014.44	0.01	新股未上市

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额（份）	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额（份）	占总份额比例	持有份额（份）	占总份额比例
合煦智远金融科技指数(LOF) A	14,490	6,194.76	5,441,917.81	6.06%	84,320,132.15	93.94%
合煦智远金融科技指数(LOF) C	1,297	6,463.92	-	-	8,383,700.91	100.00%
合计	15,787	6,216.87	5,441,917.81	5.54%	92,703,833.06	94.46%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

份额单位：份

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	尹华平	5,001,409.00	14.75%
2	徐爱英	1,455,014.00	4.29%
3	魏萍	1,222,023.00	3.60%
4	蒋约文	960,000.00	2.83%
5	边晓全	949,000.00	2.80%
6	王敬袖	800,046.00	2.36%
7	刘霄	506,108.00	1.49%
8	李威	500,140.00	1.48%
9	楼佩丽	500,029.00	1.47%
10	刘梁	483,431.00	1.43%

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	合煦智远金融科技指数（LOF）A	523,742.33	0.5835%
	合煦智远金融科技指数（LOF）C	9,153.26	0.1092%
	合计	532,895.59	0.5430%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	合煦智远金融科技指数（LOF）A	10~50
	合煦智远金融科技指数（LOF）C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	合煦智远金融科技指数（LOF）A	0
	合煦智远金融科技指数（LOF）C	0
	合计	0

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## § 9 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	合煦智远金融科技指数（LOF）C
基金合同生效日(2020年4月3日)基金份额总额	521,433,389.32	10,404,498.96
本报告期期初基金份额总额	103,753,648.75	13,778,585.19
本报告期基金总申购份额	43,554,411.44	11,967,587.54
减：报告期基金总赎回份额	57,546,010.23	17,362,471.82
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	89,762,049.96	8,383,700.91

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：2021年3月5日，本基金托管人申万宏源证券有限公司聘任王慧晶担任托管中心总经理，刘晔不再担任托管中心总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略没有发生变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未发生受到监管部门稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额（元）	占当期股票成交总额的比例	佣金（元）	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	50,017,796.55	75.97%	35,922.03	75.99%	-
安信证券	2	15,819,958.37	24.03%	11,352.61	24.01%	-

注：1、本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择申万宏源证券有限公司、安信证券股份有限公司作为证券经纪商，证券经纪商申万宏源证券是本基金的基金托管人，本基金与安信证券不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商的选择标准如下：

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

3、证券经纪商的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经纪商。

2) 基金管理人和被选中的证券经纪商签订证券经纪服务协议。

4、佣金支付情况：

1) 股票佣金利率为 0.08%，债券交易佣金为 0.01%，债券回购交易佣金按不同标准及不同天数收取，交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、证管费、风险金），但不包括印花税、上海市场过户费、港股通交易相关费用等税费。

2) 本基金本报告期应支付给申万宏源证券的交易佣金为 35,922.03 元, 应支付给安信证券的交易佣金为 11,352.61 元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额(元)	占当期债券成交总额的比例	成交金额(元)	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额(元)	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	36,743.11	78.18%	5,700,000.00	90.48%	-	-
安信证券	10,255.46	21.82%	600,000.00	9.52%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	合煦智远基金管理有限公司关于旗下合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210511
2	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)(A类份额)基金产品资料概要、合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)(C类份额)基金产品资料概要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210430
3	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(2021年第2号)、合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书及基金产品资料概要提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210430
4	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210429
5	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、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金2021年第1季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210422
6	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)2020年年度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金2020年年度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210331
7	合煦智远基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210325



8	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要、合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210227
9	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(2021 年第 1 号)	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210227
10	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(2021 年 2 月修订)、合煦智远基金管理有限公司关于合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210227
11	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)2020 年第 4 季度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210122

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 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 8 月 31 日