

# 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12 |
| 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.....       | 12 |
| §5 托管人报告.....                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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.....      | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| §7 投资组合报告.....                               | 36 |
| 7.1 报告期末基金资产组合情况.....                        | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37 |
| 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.....                     | 39 |
| 7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 40 |
| 7.6 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.....    | 40 |
| 7.7 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资产支持证券投资明细..... | 40 |
| 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.....   | 40 |
| 7.9 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.....    | 40 |

|  |    |
|--|----|
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                 | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 41 |
| §8 基金份额持有人信息.....                        | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 42 |
| 8.3 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.....    | 43 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                 | 43 |
| §9 开放式基金份额变动.....                        | 43 |
| §10 重大事件揭示.....                          | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 43 |
| 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.....    | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 44 |
| 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.....       | 44 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 44 |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 45 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                  | 46 |
| 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..... | 46 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 47 |
| §12 备查文件目录.....                          | 47 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 47 |
| 12.2 存放地点.....                           | 47 |
| 12.3 查阅方式.....                           | 47 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                 |
|-----------------|----------------------|-----------------|
| 基金名称            | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 合煦智远消费主题股票发起式        |                 |
| 基金主代码           | 007287               |                 |
| 交易代码            | 007287               |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                 |
| 基金合同生效日         | 2019 年 7 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           | 中国工商银行股份有限公司         |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 12,473,776.90 份      |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 合煦智远消费主题股票发起式 A      | 合煦智远消费主题股票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 007287               | 007288          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,870,264.72 份       | 10,603,512.18 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过积极精选个股，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金将充分发挥“自下而上”的主动选股能力，主要在本基金所界定的消费行业内，寻找持续创造社会价值，成长空间大，产业链地位高，盈利模式清晰，拥有核心竞争力的上市公司。通过量化评估安全边际和成长空间，判断风险收益比例，发掘价值被低估或合理的上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 中证内地消费主题指数收益率×75%+中证港股通主要消费综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×15%   |
| 风险收益特征 | 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。<br>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 | 中国工商银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 武宜达                  |
|         | 联系电话         | 4009835858           |
|         | 电子邮箱         | pub_compliance@uvass |
|         |              | 郭明                   |
|         |              | 010-66105799         |
|         |              | custody@icbc.com.cn  |

|        |                                      |               |                 |
|--------|--------------------------------------|---------------|-----------------|
|        |                                      | et.com        |                 |
| 客户服务电话 |                                      | 4009835858    | 95588           |
| 传真     |                                      | 0755-21835680 | 010-66105798    |
| 注册地址   | 深圳市福田区莲花街道福中社区福中一路1001号生命保险大厦十九层1903 |               | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址   | 深圳市福田区莲花街道福中社区福中一路1001号生命保险大厦十九层1903 |               | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 邮政编码   |                                      | 518000        | 100140          |
| 法定代表人  |                                      | 郑旭            | 陈四清             |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 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 | 合煦智远基金管理有限公司 | 深圳市福田区莲花街道福中社区福中一路1001号生命保险大厦十九层1903 |

## § 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

#### 1、合煦智远消费主题股票发起式 A

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 213,763.76                  |
| 本期利润          | 29,577.29                   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0160                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.33%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.32%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 279,676.34                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1495                      |
| 期末基金资产净值      | 2,149,941.06                |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末基金份额净值     | 1.1495                |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率  | 14.95%                |

## 2、合煦智远消费主题股票发起式 C

|               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 1,113,441.99                          |
| 本期利润          | 217,307.90                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0195                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.65%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.57%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | 1,330,828.85                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1255                                |
| 期末基金资产净值      | 11,934,341.03                         |
| 期末基金份额净值      | 1.1255                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 12.55%                                |

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 2023 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

## 合煦智远消费主题股票发起式 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      | -0.35%   | 0.81%       | 3.38%      | 0.99%         | -3.73% | -0.18% |
| 过去三个月      | -5.32%   | 0.68%       | -7.18%     | 0.84%         | 1.86%  | -0.16% |
| 过去六个月      | -0.32%   | 0.76%       | -5.75%     | 0.88%         | 5.43%  | -0.12% |
| 过去一年       | -0.48%   | 0.95%       | -15.91%    | 1.04%         | 15.43% | -0.09% |
| 过去三年       | 4.00%    | 1.26%       | 0.02%      | 1.26%         | 3.98%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 14.95%   | 1.25%       | 14.05%     | 1.23%         | 0.90%  | 0.02%  |

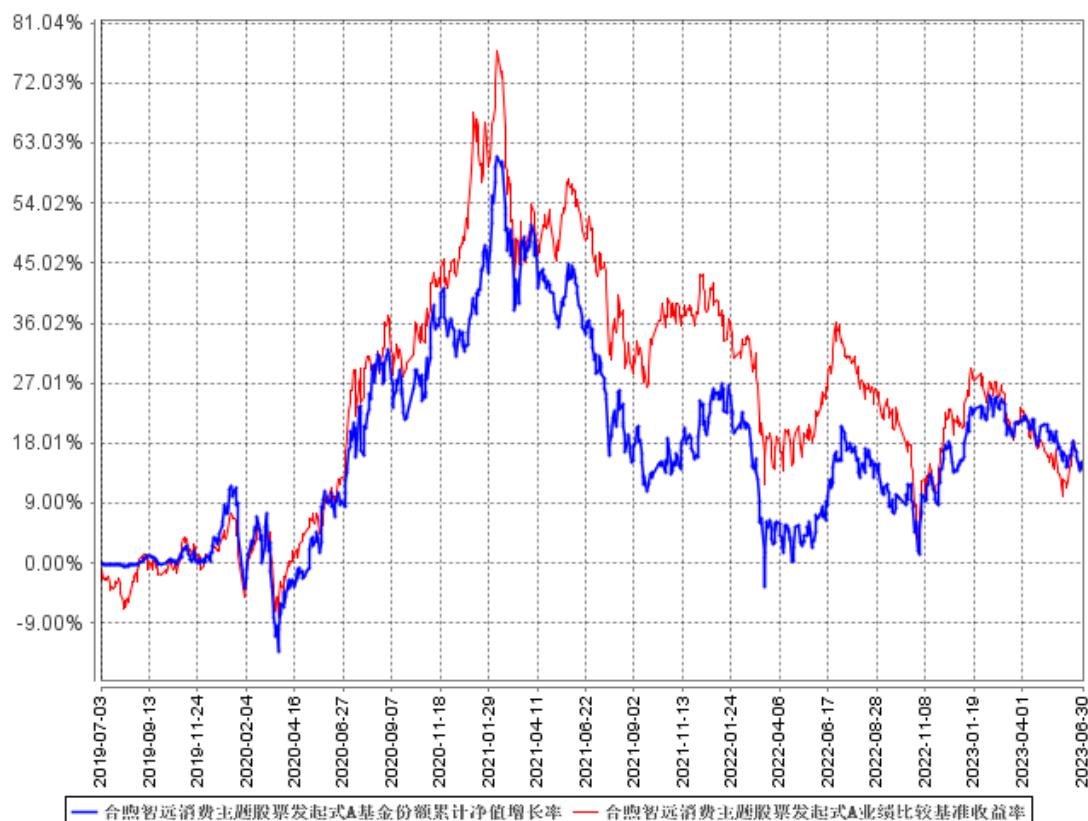
## 合煦智远消费主题股票发起式 C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | -0.38%       | 0.81%               | 3.38%              | 0.99%                     | -3.76% | -0.18% |
| 过去三个月          | -5.44%       | 0.68%               | -7.18%             | 0.84%                     | 1.74%  | -0.16% |
| 过去六个月          | -0.57%       | 0.76%               | -5.75%             | 0.88%                     | 5.18%  | -0.12% |
| 过去一年           | -0.98%       | 0.95%               | -15.91%            | 1.04%                     | 14.93% | -0.09% |
| 过去三年           | 2.47%        | 1.26%               | 0.02%              | 1.26%                     | 2.45%  | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 12.55%       | 1.25%               | 14.05%             | 1.23%                     | -1.50% | 0.02%  |

注：本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×75%+中证港股通主要消费综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×15%。

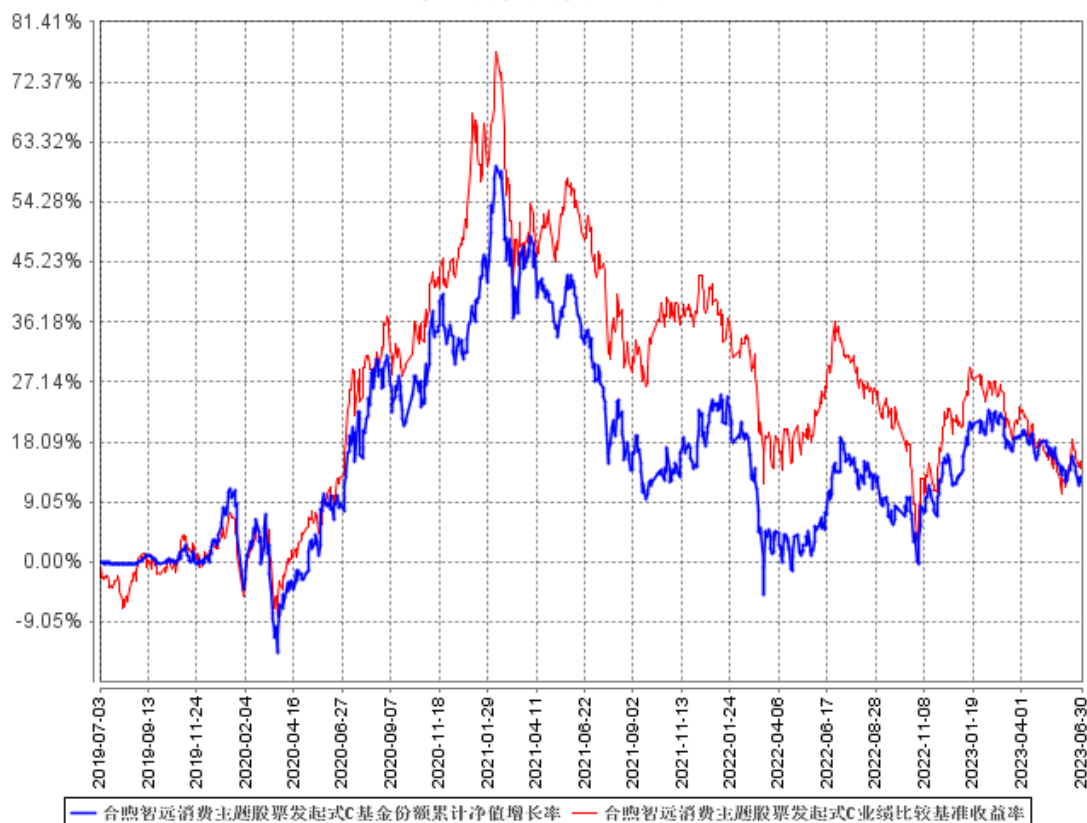
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

合煦智远消费主题股票发起式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





合煦智远消费主题股票发起式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 2019 年 7 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。

截止本报告期末，本基金管理人共管理了 4 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 | 证券 | 说明 |
|----|----|-----------|----|----|
|----|----|-----------|----|----|

|     |                 | (助理) 期限            |      | 从业<br>年限 |  |
|-----|-----------------|--------------------|------|----------|--|
|     |                 | 任职日期               | 离任日期 |          |  |
| 杨志勇 | 本基金<br>基金经<br>理 | 2022 年 6<br>月 30 日 | -    | 27       | 杨志勇先生，同济大学工学学士，27 年证券投资相关经验。1996 年进入中国信达信托投资公司，任证券业务部投资经理；2000 年进入中国银河证券有限责任公司，历任证券投资部投资经理、QFII 业务部高级经理；2005 年进入北京高华证券有限责任公司，历任经纪业务部执行董事、资产管理部执行董事；2018 年进入中国投融资担保股份有限公司，任财富管理中心资本市场部执行总经理，并先后在其旗下全资私募证券投资基金管理人中投保信裕资产管理（北京）有限公司和上海谨睿投资中心（有限合伙）任职；2022 年 5 月加入合煦智远基金管理有限公司。自 2022 年 6 月 30 日起任本基金基金经理。 |

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

本报告期末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》、《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，并本着诚实信用、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，无损害基金份额持有人利益的行为。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 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

2023 年上半年，内地消费指数下跌 6.94%，其中一季度上涨 2.23%，二季度下跌 8.97%。从走势上看，一月份上涨到上半年最高点，之后二月、三月、四月和五月连续四个月震荡下跌，六月创上半年最低点（也是全年最低点的可能性极大）并企稳反弹。上半年消费行业中表现较好的是家用电器（+13.29%）、汽车（+5.89%）和纺织服饰（+3.30%）；表现较差的是商贸零售（-23.44%）、美容护理（-13.61%）和农林牧渔（-9.62%）。消费之外的行业中，涨幅居前的是通信（+50.66%）、传媒（+42.75%）和计算机（+27.57%）；跌幅居前的是房地产（-14.29%）、建筑材料（-10.52%）和综合（-9.62%）。

上半年市场呈现结构性行情，热点主要集中在“中特估”和 TMT 领域，数字经济和人工智能主题实际上都包含在 TMT 行业内。上半年市场情绪波动加大，从年初对经济恢复的强烈预期以及一二月份消费的报复性反弹，市场信心较强，但之后陆续公布的一些经济数据总体偏弱，特别是四月份以来的数据，呈现的是偏弱的经济现实，市场情绪迅速逆转，风险偏好明显下降。“中特估”行情的展开更多源于低估值高分红属性的国企股的防御价值，人工智能主题则是海外映射，激发了对新一代技术革命成为经济增长的新引擎的美好憧憬，理想胜于估值。

消费属于经济后周期，长期看，伴随就业率的提升、居民可支配收入的提高、对未来信心的增强、超额储蓄的降低以及对美好生活的追求，消费有望迎来较佳的投资机会，尽管上半年陆续出台了很多人刺激消费的政策，但囿于缺乏报表层面的数据支撑以及悲观情绪的笼罩，很多消费品类表现艰难。

报告期内，本基金继续坚持均衡配置并持续优化持有结构，同时结合对市场资金流向与量价因子等的密切跟踪与分析，增加了一些战术性投资操作。虽然产品净值表现好于业绩比较基准，回撤控制也比较理想，但是在今年结构化的行情中，特别在人工智能和“中特估”的主题行情中参与的还不够充分，没能进一步增强收益，对此管理人不会以产品为消费主题的约束条件为借口，此外有些消费行业持股没能及时止损操作也是需要深刻反思。未来的操作中，将继续努力把握好持有标的胜率、赔率和效率的“三率”统一，特别是做好移动式止损操作，保持组合一定程度的灵活性，力争做到既能控制好回撤，又能跟得上市场的上行趋势，给投资者以良好的持有体验。

### 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-0.32%，C 类基金份额净值增长率为-0.57%，同期业绩比较基准收益率为-5.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为市场已经比较充分地 Price in 悲观预期，股价的下跌与估值水平的不断下移实际上释放了相当的风险。国内政策层面在不断堆积利好，包括货币的宽松、消费的鼓励、民营经济的扶持以及房地产及地方债等领域风险的化解等，伴随政策的不断推出，必将提升市场对于经济增长的信心。

今年下半年，经济仍将延续缓慢修复过程，修复重在修，修复之后会进入到复苏的趋势中。伴随企业利润和居民的资产负债表的不断修复，需求端将出现较大的释放空间，我国经济的韧性和潜力将不断呈现。

今年是价值风格持续的第三年，上半年价值风格仍然表现较强，根据历史统计，明年出现风格转换的可能性较大，因此下半年要密切观察成长风格的表现并寻找投资机会。在行业配置上，大消费等部分顺周期板块估值已经回落到历史较低水平，叠加政策利好的累积效应，在情绪转好的情况下，即使报表仅有边际的数据改善，也会激发投资热情。从中长期角度看，汽车智能化、人形机器人、人工智能及低估值高股息国企股等相关股票仍然值得重点关注。

#### 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

本基金自 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 3 月 27 日、2023 年 4 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金的管理人——合煦智远基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对合煦智远基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产        | 附注号     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：       |         |                     |                       |
| 银行存款      | 6.4.7.1 | 1,184,161.73        | 2,088,659.50          |
| 结算备付金     |         | 963,651.85          | 1,058,334.47          |
| 存出保证金     |         | -                   | -                     |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 12,013,087.00       | 11,618,898.24         |
| 其中：股票投资   |         | 12,013,087.00       | 11,575,474.00         |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | -                   | 43,424.24             |
| 资产支持证券投资  |         | -                   | -                     |
| 贵金属投资     |         | -                   | -                     |
| 其他投资      |         | -                   | -                     |
| 衍生金融资产    | 6.4.7.3 | -                   | -                     |
| 买入返售金融资产  | 6.4.7.4 | -                   | -                     |
| 债权投资      | 6.4.7.5 | -                   | -                     |
| 其中：债券投资   |         | -                   | -                     |
| 资产支持证券投资  |         | -                   | -                     |
| 其他投资      |         | -                   | -                     |
| 其他债权投资    | 6.4.7.6 | -                   | -                     |
| 其他权益工具投资  | 6.4.7.7 | -                   | -                     |
| 应收清算款     |         | -                   | -                     |
| 应收股利      |         | -                   | -                     |
| 应收申购款     |         | 10,290.00           | 11,318.79             |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.8 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 14,171,190.58       | 14,777,211.00         |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 |         | -                   | -                     |
| 应付清算款     |         | -                   | 852,686.96            |
| 应付赎回款     |         | 5,527.95            | 10,889.75             |
| 应付管理人报酬   |         | 16,954.20           | 24,988.61             |
| 应付托管费     |         | 2,825.70            | 4,164.78              |

|          |          |               |               |
|----------|----------|---------------|---------------|
| 应付销售服务费  |          | 4,826.70      | 7,222.03      |
| 应付投资顾问费  |          | -             | -             |
| 应交税费     |          | -             | 0.35          |
| 应付利润     |          | -             | -             |
| 递延所得税负债  |          | -             | -             |
| 其他负债     | 6.4.7.9  | 56,773.94     | 38,580.15     |
| 负债合计     |          | 86,908.49     | 938,532.63    |
| 净资产：     |          |               |               |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 12,473,776.90 | 12,183,215.54 |
| 其他综合收益   |          | -             | -             |
| 未分配利润    | 6.4.7.11 | 1,610,505.19  | 1,655,462.83  |
| 净资产合计    |          | 14,084,282.09 | 13,838,678.37 |
| 负债和净资产总计 |          | 14,171,190.58 | 14,777,211.00 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 12,473,776.90 份，其中合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 A 类基金份额 1,870,264.72 份，A 类基金份额净值 1.1495 元；合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 C 类基金份额 10,603,512.18 份，C 类基金份额净值 1.1255 元。

## 6.2 利润表

会计主体：合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期 2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年<br>1 月 1 日至 2022 年 6 月<br>30 日 |
|------------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入          |          | 464,764.14                            | -2,263,089.63                                 |
| 1.利息收入           |          | 11,417.27                             | 35,621.03                                     |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.12 | 11,417.27                             | 13,888.67                                     |
| 债券利息收入           |          | -                                     | -   |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                     | -   |
| 买入返售金融资产收入       |          | -                                     | 21,732.36                                     |
| 证券出借利息收入         |          | -                                     | -   |
| 其他利息收入           |          | -                                     | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 1,339,246.15                          | 56,155.22                                     |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.13 | 1,194,260.22                          | -176,195.63                                   |
| 基金投资收益           |          | -                                     | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.14 | 9,253.43                              | -   |
| 资产支持证券投资         | 6.4.7.15 | -                                     | -   |

|                       |            |               |               |
|-----------------------|------------|---------------|---------------|
| 收益                    |            |               |               |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 股利收益                  | 6.4.7.18   | 135,732.50    | 232,350.85    |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |            | -             | -             |
| 其他投资收益                |            | -             | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19   | -1,080,320.56 | -2,381,039.04 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -             | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20   | 194,421.28    | 26,173.16     |
| 减：二、营业总支出             |            | 217,878.95    | 275,393.94    |
| 1.管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 113,846.42    | 182,607.67    |
| 2.托管费                 | 6.4.10.2.2 | 18,974.39     | 30,434.69     |
| 3.销售服务费               |            | 32,427.86     | 14,929.11     |
| 4.投资顾问费               |            | -             | -             |
| 5.利息支出                |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | -             | -             |
| 6.信用减值损失              | 6.4.7.21   | -             | -             |
| 7.税金及附加               |            | 0.01          | -             |
| 8.其他费用                | 6.4.7.22   | 52,630.27     | 47,422.47     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |            | 246,885.19    | -2,538,483.57 |
| 减：所得税费用               |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |            | 246,885.19    | -2,538,483.57 |
| 五、其他综合收益的税后净额         |            | -             | -             |
| 六、综合收益总额              |            | 246,885.19    | -2,538,483.57 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |              |               |
|-----------------|------------------------------------|--------|--------------|---------------|
|                 | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 12,183,215.54                      | -      | 1,655,462.83 | 13,838,678.37 |



|  |   |        |               |                |
|--|---|--------|---------------|----------------|
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                       | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 12,183,215.54                           | -      | 1,655,462.83  | 13,838,678.37  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 290,561.36                              | -      | -44,957.64    | 245,603.72     |
| (一)、综合收益总额                               | -                                       | -      | 246,885.19    | 246,885.19     |
| (二)、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)      | 290,561.36                              | -      | -291,842.83   | -1,281.47      |
| 其中：1.基金申购款                               | 34,392,884.50                           | -      | 6,341,713.64  | 40,734,598.14  |
| 2.基金赎回款                                  | -34,102,323.14                          | -      | -6,633,556.47 | -40,735,879.61 |
| (三)、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) | -                                       | -      | -             | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                       | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 12,473,776.90                           | -      | 1,610,505.19  | 14,084,282.09  |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|  | 实收基金                                    | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 25,402,638.60                           | -      | 6,369,965.32  | 31,772,603.92  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                       | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 25,402,638.60                           | -      | 6,369,965.32  | 31,772,603.92  |
| 三、本期增减变动                                 | 172,573,240.99                          | -      | 20,912,843.54 | 193,486,084.53 |

|  |                |   |               |                |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 动额(减少以“-”号填列)                            |                |   |               |                |
| (一)、综合收益总额                               | -              | - | -2,538,483.57 | -2,538,483.57  |
| (二)、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)      | 172,573,240.99 | - | 23,451,327.11 | 196,024,568.10 |
| 其中: 1.基金申购款                              | 184,609,591.98 | - | 24,930,924.97 | 209,540,516.95 |
| 2.基金赎回款                                  | -12,036,350.99 | - | -1,479,597.86 | -13,515,948.85 |
| (三)、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) | -              | - | -             | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -             | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 197,975,879.59 | - | 27,282,808.86 | 225,258,688.45 |

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:

\_\_\_\_\_ 李骥 \_\_\_\_\_ 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

合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金(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]608号《关于准予合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金注册的批复》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《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 48,538,157.86 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(2019)第 0394 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 3 日正式生效,基金合同生效日的

基金份额总额为 48,547,565.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,407.83 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,003,417.01 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》和《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取的认购/申购费用、销售服务费用等方式的差异，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费用，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，计算公式为计算日各类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、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、可转换债券及分离交易可转债、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、国债期货、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：投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中，投资于港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；本基金非现金资产中不低于 80% 将投资于消费主题相关公司或企业的股票；每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货及国债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。本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×75%+中证港股通主要消费综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×15%。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.4.4 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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------|
| 活期存款   | 222,583.41          |
| 等于：本金  | 222,565.35          |
| 加：应计利息 | 18.06               |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 减：坏账准备         | -            |
| 定期存款           | -            |
| 等于：本金          | -            |
| 加：应计利息         | -            |
| 减：坏账准备         | -            |
| 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           | 961,578.32   |
| 等于：本金          | 961,507.00   |
| 加：应计利息         | 71.32        |
| 减：坏账准备         | -            |
| 合计             | 1,184,161.73 |

注：本基金持有的其他存款均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 2023 年 6 月 30 日 |      |               |               |
|---------------|---------------------|------|---------------|---------------|
|               | 成本                  | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 13,414,340.35       | -    | 12,013,087.00 | -1,401,253.35 |
| 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            | 13,414,340.35       | -    | 12,013,087.00 | -1,401,253.35 |

#### 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。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本基金本报告期末未有需计提减值准备的资产项目。

**6.4.7.5 债权投资**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                   |
| 应付赎回费       | 12.23               |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 应付交易费用      | 4,693.44            |
| 其中：交易所市场    | 4,693.44            |
| 银行间市场       | -                   |
| 应付利息        | -                   |
| 预提费用        | 52,068.27           |
| 合计          | 56,773.94           |

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

| 合煦智远消费主题股票发起式 A |                                    |              |
|-----------------|------------------------------------|--------------|
| 项目              | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |              |
|                 | 基金份额（份）                            | 账面金额         |
| 上年度末            | 2,244,265.81                       | 2,244,265.81 |
| 本期申购            | 499,522.59                         | 499,522.59   |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -873,523.68                        | -873,523.68  |
| 基金份额折算变动份额      | -                                  | -            |
| 本期末             | 1,870,264.72                       | 1,870,264.72 |

| 合煦智远消费主题股票发起式 C |                                    |
|-----------------|------------------------------------|
| 项目              | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |

|               | 基金份额（份）        | 账面金额           |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末          | 9,938,949.73   | 9,938,949.73   |
| 本期申购          | 33,893,361.91  | 33,893,361.91  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -33,228,799.46 | -33,228,799.46 |
| 基金份额折算变动份额    | -              | -              |
| 本期末           | 10,603,512.18  | 10,603,512.18  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

| 合煦智远消费主题股票发起式 A |             |             |             |
|-----------------|-------------|-------------|-------------|
| 项目              | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
| 上年度末            | 187,624.63  | 156,115.96  | 343,740.59  |
| 本期利润            | 213,763.76  | -184,186.47 | 29,577.29   |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -29,084.03  | -64,557.51  | -93,641.54  |
| 其中：基金申购款        | 75,106.35   | 20,539.13   | 95,645.48   |
| 基金赎回款           | -104,190.38 | -85,096.64  | -189,287.02 |
| 本期已分配利润         | -           | -           | -           |
| 本期末             | 372,304.36  | -92,628.02  | 279,676.34  |

| 合煦智远消费主题股票发起式 C |               |               |               |
|-----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目              | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末            | 611,348.78    | 700,373.46    | 1,311,722.24  |
| 本期利润            | 1,113,441.99  | -896,134.09   | 217,307.90    |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | 95,538.75     | -293,740.04   | -198,201.29   |
| 其中：基金申购款        | 3,840,620.15  | 2,405,448.01  | 6,246,068.16  |
| 基金赎回款           | -3,745,081.40 | -2,699,188.05 | -6,444,269.45 |
| 本期已分配利润         | -             | -             | -             |
| 本期末             | 1,820,329.52  | -489,500.67   | 1,330,828.85  |

#### 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 374.26                             |
| 定期存款利息收入  | -                                  |
| 其他存款利息收入  | 4,499.21                           |
| 结算备付金利息收入 | 5,693.80                           |
| 其他        | 850.00                             |
| 合计        | 11,417.27                          |

注：“其他”为“申购款利息收入”。



### 6.4.7.13 股票投资收益

#### 6.4.7.13.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 14,371,283.59                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 13,140,555.69                      |
| 减：交易费用     | 36,467.68                          |
| 买卖股票差价收入   | 1,194,260.22                       |

### 6.4.7.14 债券投资收益

#### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3.12                               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 9,250.31                           |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                                  |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                                  |
| 合计                           | 9,253.43                           |

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 47,272.00                          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 37,999.75                          |
| 减：应计利息总额               | 12.49                              |
| 减：交易费用                 | 9.45                               |
| 买卖债券差价收入               | 9,250.31                           |

### 6.4.7.15 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。

### 6.4.7.16 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。

### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内没有发生衍生工具收益。

### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 135,732.50                         |
| 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            | 135,732.50                         |

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -1,080,320.56                      |
| ——股票投资                 | -1,074,905.31                      |
| ——债券投资                 | -5,415.25                          |
| ——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                     | -1,080,320.56                      |

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 194,421.28                         |
| 合计      | 194,421.28                         |

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内没有发生信用减值损失。

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 12,396.69                          |
| 信息披露费   | 39,671.58                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 开户费     | 400.00                             |

|     |           |
|-----|-----------|
| 汇划费 | 162.00    |
| 合计  | 52,630.27 |

## 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

本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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）   | 基金托管人                 |

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

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股票交易、债券交易、债券回购交易及权证交易，也没有发生应支付关联方的佣金。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 113,846.42                         | 182,607.67                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 30,607.30                          | 31,675.72                               |
| 支付投资顾问的投资顾问费    | -                                  | -                                       |

注：1、支付基金管理人的管理人报酬年费率为 1.50%，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×1.50%÷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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 18,974.39                          | 30,434.69                               |

注：支付基金托管人的托管费年费率为 0.25%，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 × 0.25% ÷ 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日      |                 |          |
|----------------|---|-----------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                        |                 |          |
|                | 合煦智远消费主题股票发起式 A                         | 合煦智远消费主题股票发起式 C | 合计       |
| 合煦智远基金公司       | -                                       | 9,774.16        | 9,774.16 |
| 合计             | -                                       | 9,774.16        | 9,774.16 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                 |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                        |                 |          |
|                | 合煦智远消费主题股票发起式 A                         | 合煦智远消费主题股票发起式 C | 合计       |
| 合煦智远基金公司       | -                                       | 167.74          | 167.74   |
| 合计             | -                                       | 167.74          | 167.74   |

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**

份额单位：份

| 项目                             | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                 |
|--------------------------------|---------------------------------|-----------------|
|                                | 合煦智远消费主题股票发起式 A                 | 合煦智远消费主题股票发起式 C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 3 日）持有的基金份额 | 10,003,417.01                   | -               |
| 报告期初持有的基金份额                    | -                               | -               |
| 报告期间申购/买入总份额                   | -                               | -               |
| 报告期间因拆分变动份额                    | -                               | -               |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                 | -                               | -               |
| 报告期末持有的基金份额                    | -                               | -               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | -                               | -               |

| 项目                             | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                 |
|--------------------------------|---------------------------------|-----------------|
|                                | 合煦智远消费主题股票发起式 A                 | 合煦智远消费主题股票发起式 C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 3 日）持有的基金份额 | 10,003,417.01                   | -               |
| 报告期初持有的基金份额                    | 10,003,417.01                   | -               |
| 报告期间申购/买入总份额                   | -                               | -               |
| 报告期间因拆分变动份额                    | -                               | -               |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                 | -                               | -               |
| 报告期末持有的基金份额                    | 10,003,417.01                   | -               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | 78.81%                          | -               |

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间内除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

**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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
|--------|------------|--------|---------------|--------|
| 中国工商银行 | 222,583.41 | 374.26 | 14,247,148.79 | 455.97 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按约定的利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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

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证券。

##### 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，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。本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。

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中国工商银行，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 2023 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。

##### **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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | -                   | -                     |
| AAA 以下 | -                   | 43,424.24             |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | -                   | 43,424.24             |

#### 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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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时间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 2023 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 2023 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、结算备付金和买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 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                  | 1,184,161.73 | -     | -         | -             | 1,184,161.73  |
| 结算备付金                 | 963,651.85   | -     | -         | -             | 963,651.85    |
| 交易性金融资产               | -            | -     | -         | 12,013,087.00 | 12,013,087.00 |
| 应收申购款                 | -            | -     | -         | 10,290.00     | 10,290.00     |
| 资产总计                  | 2,147,813.58 | -     | -         | 12,023,377.00 | 14,171,190.58 |
| 负债                    |              |       |           |               |               |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -         | 5,527.95      | 5,527.95      |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -         | 16,954.20     | 16,954.20     |
| 应付托管费                 | -            | -     | -         | 2,825.70      | 2,825.70      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -         | 4,826.70      | 4,826.70      |
| 其他负债                  | -            | -     | -         | 56,773.94     | 56,773.94     |
| 负债总计                  | -            | -     | -         | 86,908.49     | 86,908.49     |
| 利率敏感度缺口               | 2,147,813.58 | -     | -         | 11,936,468.51 | 14,084,282.09 |
| 上年度末 2022 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                  | 2,088,659.50 | -     | -         | -             | 2,088,659.50  |
| 结算备付金                 | 1,058,334.47 | -     | -         | -             | 1,058,334.47  |
| 交易性金融资产               | -            | -     | 43,424.24 | 11,575,474.00 | 11,618,898.24 |
| 应收申购款                 | -            | -     | -         | 11,318.79     | 11,318.79     |
| 资产总计                  | 3,146,993.97 | -     | 43,424.24 | 11,586,792.79 | 14,777,211.00 |
| 负债                    |              |       |           |               |               |
| 应付清算款                 | -            | -     | -         | 852,686.96    | 852,686.96    |
| 应付赎回款                 | -            | -     | -         | 10,889.75     | 10,889.75     |
| 应付管理人报酬               | -            | -     | -         | 24,988.61     | 24,988.61     |
| 应付托管费                 | -            | -     | -         | 4,164.78      | 4,164.78      |
| 应付销售服务费               | -            | -     | -         | 7,222.03      | 7,222.03      |
| 应交税费                  | -            | -     | -         | 0.35          | 0.35          |
| 其他负债                  | -            | -     | -         | 38,580.15     | 38,580.15     |
| 负债总计                  | -            | -     | -         | 938,532.63    | 938,532.63    |
| 利率敏感度缺口               | 3,146,993.97 | -     | 43,424.24 | 10,648,260.16 | 13,838,678.37 |

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

|                   |                    |                             |                        |
|-------------------|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设                | 除市场利率以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（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|                   | 1.市场利率平行上升 25 个基点  | -                           | -622.76                |
| 2.市场利率平行下降 25 个基点 | -                  | 633.47                      |                        |

#### 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 2023 年 6 月 30 日 |               | 上年度末 2022 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 | 12,013,087.00       | 85.29         | 11,575,474.00         | 83.65         |
| 交易性金融资产-基金投资 | -                   | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产-债券投资 | -                   | -             | 43,424.24             | 0.31          |
| 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          | 12,013,087.00 | 85.29 | 11,618,898.24 | 83.96 |

#### 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（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 520,331.27                  | 631,953.60        |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -520,331.27                 | -631,953.60       |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 12,013,087.00       | 11,618,898.24         |
| 第二层次          | -                   | -                     |
| 第三层次          | -                   | -                     |
| 合计            | 12,013,087.00       | 11,618,898.24         |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况****6.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

无

**6.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况**

无

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 6 月 30 日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 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              | 12,013,087.00 | 84.77        |
|    | 其中：股票             | 12,013,087.00 | 84.77        |
| 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      | 2,147,813.58  | 15.16        |
| 8  | 其他资产              | 10,290.00     | 0.07         |
| 9  | 合计                | 14,171,190.58 | 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              | 9,112,154.00  | 64.70        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 203,400.00    | 1.44         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 373,350.00    | 2.65         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 86,205.00     | 0.61         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 127,020.00    | 0.90         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 77,120.00     | 0.55         |
| J  | 金融业              | 1,109,722.00  | 7.88         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 585,558.00    | 4.16         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 119,658.00    | 0.85         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 94,900.00     | 0.67         |
| 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        | 124,000.00    | 0.88         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 12,013,087.00 | 85.29        |

### 7.2.2 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。

## 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

| 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  | 600519 | 贵州茅台 | 400    | 676,400.00 | 4.80         |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 43,400 | 616,280.00 | 4.38         |
| 3  | 002557 | 洽洽食品 | 14,000 | 581,700.00 | 4.13         |
| 4  | 000568 | 泸州老窖 | 2,500  | 523,925.00 | 3.72         |
| 5  | 000338 | 潍柴动力 | 40,000 | 498,400.00 | 3.54         |
| 6  | 603809 | 豪能股份 | 39,000 | 437,970.00 | 3.11         |
| 7  | 002078 | 太阳纸业 | 40,000 | 427,600.00 | 3.04         |
| 8  | 600809 | 山西汾酒 | 2,200  | 407,154.00 | 2.89         |
| 9  | 301207 | 华兰疫苗 | 12,000 | 399,120.00 | 2.83         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 10 | 601888 | 中国中免 | 3,600   | 397,908.00 | 2.83 |
| 11 | 002228 | 合兴包装 | 120,000 | 387,600.00 | 2.75 |
| 12 | 600597 | 光明乳业 | 35,000  | 364,000.00 | 2.58 |
| 13 | 603886 | 元祖股份 | 18,000  | 330,120.00 | 2.34 |
| 14 | 600993 | 马应龙  | 11,000  | 305,910.00 | 2.17 |
| 15 | 603517 | 绝味食品 | 8,000   | 297,200.00 | 2.11 |
| 16 | 002304 | 洋河股份 | 2,100   | 275,835.00 | 1.96 |
| 17 | 600694 | 大商股份 | 15,000  | 265,950.00 | 1.89 |
| 18 | 600600 | 青岛啤酒 | 2,200   | 227,986.00 | 1.62 |
| 19 | 688489 | 三未信安 | 3,460   | 218,845.00 | 1.55 |
| 20 | 600298 | 安琪酵母 | 6,000   | 217,260.00 | 1.54 |
| 21 | 600919 | 江苏银行 | 29,000  | 213,150.00 | 1.51 |
| 22 | 000591 | 太阳能  | 30,000  | 203,400.00 | 1.44 |
| 23 | 600132 | 重庆啤酒 | 2,100   | 193,536.00 | 1.37 |
| 24 | 600429 | 三元股份 | 40,000  | 190,800.00 | 1.35 |
| 25 | 600138 | 中青旅  | 15,000  | 187,650.00 | 1.33 |
| 26 | 600887 | 伊利股份 | 6,500   | 184,080.00 | 1.31 |
| 27 | 601222 | 林洋能源 | 20,000  | 163,800.00 | 1.16 |
| 28 | 601901 | 方正证券 | 25,000  | 163,500.00 | 1.16 |
| 29 | 601952 | 苏垦农发 | 13,000  | 151,320.00 | 1.07 |
| 30 | 300957 | 贝泰妮  | 1,700   | 151,096.00 | 1.07 |
| 31 | 600268 | 国电南自 | 20,000  | 149,800.00 | 1.06 |
| 32 | 000333 | 美的集团 | 2,500   | 147,300.00 | 1.05 |
| 33 | 002507 | 涪陵榨菜 | 7,800   | 142,818.00 | 1.01 |
| 34 | 000063 | 中兴通讯 | 3,000   | 136,620.00 | 0.97 |
| 35 | 605567 | 春雪食品 | 10,000  | 128,300.00 | 0.91 |
| 36 | 600754 | 锦江酒店 | 3,000   | 127,020.00 | 0.90 |
| 37 | 000960 | 锡业股份 | 8,000   | 124,400.00 | 0.88 |
| 38 | 300144 | 宋城演艺 | 10,000  | 124,000.00 | 0.88 |
| 39 | 688131 | 皓元医药 | 2,100   | 119,658.00 | 0.85 |
| 40 | 600690 | 海尔智家 | 5,000   | 117,400.00 | 0.83 |
| 41 | 000001 | 平安银行 | 10,400  | 116,792.00 | 0.83 |
| 42 | 000858 | 五粮液  | 700     | 114,499.00 | 0.81 |
| 43 | 600713 | 南京医药 | 20,000  | 107,400.00 | 0.76 |
| 44 | 601200 | 上海环境 | 10,000  | 94,900.00  | 0.67 |
| 45 | 002824 | 和胜股份 | 3,000   | 88,590.00  | 0.63 |
| 46 | 601021 | 春秋航空 | 1,500   | 86,205.00  | 0.61 |
| 47 | 688308 | 欧科亿  | 2,100   | 84,000.00  | 0.60 |
| 48 | 603927 | 中科软  | 2,000   | 77,120.00  | 0.55 |
| 49 | 002568 | 百润股份 | 2,000   | 72,700.00  | 0.52 |
| 50 | 600456 | 宝钛股份 | 2,000   | 67,680.00  | 0.48 |
| 51 | 000951 | 中国重汽 | 4,000   | 67,400.00  | 0.48 |
| 52 | 600779 | 水井坊  | 1,000   | 58,990.00  | 0.42 |

## 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  | 000568 | 泸州老窖 | 769,875.00 | 5.56            |
| 2  | 600054 | 黄山旅游 | 551,975.00 | 3.99            |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 509,472.00 | 3.68            |
| 4  | 002557 | 洽洽食品 | 472,494.00 | 3.41            |
| 5  | 002078 | 太阳纸业 | 460,060.00 | 3.32            |
| 6  | 603517 | 绝味食品 | 452,439.00 | 3.27            |
| 7  | 601901 | 方正证券 | 447,000.00 | 3.23            |
| 8  | 600529 | 山东药玻 | 416,500.00 | 3.01            |
| 9  | 600993 | 马应龙  | 406,081.00 | 2.93            |
| 10 | 002228 | 合兴包装 | 389,000.00 | 2.81            |
| 11 | 600809 | 山西汾酒 | 387,075.00 | 2.80            |
| 12 | 000581 | 威孚高科 | 376,090.00 | 2.72            |
| 13 | 603886 | 元祖股份 | 340,092.00 | 2.46            |
| 14 | 002142 | 宁波银行 | 302,860.00 | 2.19            |
| 15 | 300718 | 长盛轴承 | 299,731.00 | 2.17            |
| 16 | 688489 | 三未信安 | 288,330.52 | 2.08            |
| 17 | 600456 | 宝钛股份 | 284,129.00 | 2.05            |
| 18 | 600415 | 小商品城 | 270,300.00 | 1.95            |
| 19 | 603809 | 豪能股份 | 247,744.00 | 1.79            |
| 20 | 600298 | 安琪酵母 | 243,626.00 | 1.76            |

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  | 002345 | 潮宏基  | 807,160.00 | 5.83            |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 724,139.00 | 5.23            |
| 3  | 688041 | 海光信息 | 665,113.75 | 4.81            |
| 4  | 300979 | 华利集团 | 645,062.00 | 4.66            |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 587,174.00 | 4.24            |
| 6  | 600054 | 黄山旅游 | 573,150.00 | 4.14            |
| 7  | 600415 | 小商品城 | 510,100.00 | 3.69            |
| 8  | 688169 | 石头科技 | 490,665.20 | 3.55            |
| 9  | 000581 | 威孚高科 | 476,714.00 | 3.44            |
| 10 | 001213 | 中铁特货 | 455,200.00 | 3.29            |
| 11 | 600529 | 山东药玻 | 420,499.00 | 3.04            |



|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 300580 | 贝斯特  | 382,774.00 | 2.77 |
| 13 | 002683 | 广东宏大 | 372,162.00 | 2.69 |
| 14 | 301207 | 华兰疫苗 | 359,686.00 | 2.60 |
| 15 | 300021 | 大禹节水 | 354,300.00 | 2.56 |
| 16 | 688106 | 金宏气体 | 335,317.64 | 2.42 |
| 17 | 300718 | 长盛轴承 | 329,388.00 | 2.38 |
| 18 | 301102 | 兆讯传媒 | 307,243.00 | 2.22 |
| 19 | 002142 | 宁波银行 | 286,754.00 | 2.07 |
| 20 | 601901 | 方正证券 | 277,100.00 | 2.00 |

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 | 14,653,074.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,371,283.59 |

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 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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 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。

### 7.10 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。

## 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

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。

### 7.11.2 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。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、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  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 10,290.00 |
| 6  | 其他应收款 | -         |

|   |      |           |
|---|------|-----------|
| 7 | 待摊费用 | -         |
| 8 | 其他   | -         |
| 9 | 合计   | 10,290.00 |

#### 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。

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |        |              |        |
|-----------------|--------------|---------------|--------------|--------|--------------|--------|
|                 |              |               | 机构投资者        |        | 个人投资者        |        |
|                 |              |               | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额         | 占总份额比例 |
| 合煦智远消费主题股票发起式 A | 763          | 2,451.20      | 5,196.77     | 0.28%  | 1,865,067.95 | 99.72% |
| 合煦智远消费主题股票发起式 C | 933          | 11,364.96     | 4,486,835.03 | 42.31% | 6,116,677.15 | 57.69% |
| 合计              | 1,696        | 7,354.82      | 4,492,031.80 | 36.01% | 7,981,745.10 | 63.99% |

### 8.2 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 | 合煦智远消费主题股票发起式 A | 1,208.37  | 0.0646%  |
|                  | 合煦智远消费主题股票发起式 C | 18,046.04 | 0.1702%  |
|                  | 合计              | 19,254.41 | 0.1544%  |

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。

### 8.3 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 合煦智远消费主题股票发起式 A | 合煦智远消费主题股票发起式 C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日(2019 年 7 月 3 日)基金份额总额 | 25,403,198.42   | 23,144,367.27   |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 2,244,265.81    | 9,938,949.73    |
| 本报告期基金总申购份额                   | 499,522.59      | 33,893,361.91   |
| 减：报告期基金总赎回份额                  | 873,523.68      | 33,228,799.46   |
| 本报告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                  | 1,870,264.72    | 10,603,512.18   |

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本基金本报告期未改聘会计师事务所。

## 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

### 10.6.1 管理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。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券 | 2      | 24,885,795.59 | 85.74%       | 18,076.06 | 91.20%     | -  |
| 东莞证券 | 2      | 4,138,562.00  | 14.26%       | 1,743.51  | 8.80%      | -  |

注：1、 本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择中信证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司作为证券经纪商，其中东莞证券为本报告期新增证券经纪商；本基金与证券经纪商中信证券、东莞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、中信证券佣金支付情况:

1) 股票佣金利率为 0.08%, 债券交易佣金为 0.01%, 债券回购交易佣金不同天数按不同标准收取, 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) 每季度佣金经基金托管人、证券经纪商核对无误后于季度结束后第 10 个交易日在本基金的证券资金账户中扣收, 本基金本报告期合计应支付中信证券佣金为 18,076.06 元。

5、东莞证券佣金支付情况

1) 股票佣金利率为 0.05%, 债券交易佣金为 0.001%, 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) 本基金本报告期合计应支付东莞证券佣金为 1,743.51 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      | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | 47,272.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 东莞证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |

### 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基金增加麦高证券有限责任公司为基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告                    | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-05-31 |
| 2  | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要、合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要 | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-04-28 |
| 3  | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金  | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-04-28 |

|   |  |                          |            |
|---|--|--------------------------|------------|
|   | 招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）、合煦智远基金管理有限公司旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要提示性公告               | 人网站、证监会基金电子披露网站          |            |
| 4 | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2023 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 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-04-21 |
| 5 | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2022 年年度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告           | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-03-31 |
| 6 | 合煦智远基金管理有限公司关于旗下基金增加上海长量基金销售有限公司为基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告                       | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-03-28 |
| 7 | 合煦智远基金管理有限公司关于旗下基金直销调整费率优惠活动的公告  | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-02-01 |
| 8 | 合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2022 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 2022 年第 4 季度报告提示性公告 | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2023-01-20 |

## § 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

| 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         | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额         | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20230328-20230403                      | 0.00         | 21,065,048.87 | 21,065,048.87 | 0.00         | 0.00%  |
| 机构    | 2              | 20230101-20230327<br>20230404-20230630 | 4,492,031.80 | 0.00          | 0.00          | 4,492,031.80 | 36.01% |
| 个人    | 1              | 20230328-20230405                      | 0.00         | 10,953,825.41 | 10,953,825.41 | 0.00         | 0.00%  |

#### 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。

## 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消费主题股票型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《合煦智远消费主题股票型发起式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。

### 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

2023 年 8 月 31 日