

# 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

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：合煦智远基金管理有限公司

基金托管人：申万宏源证券有限公司

报告送出日期：2021 年 3 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。本年度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 3 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。

本报告中财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	13
4.10 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	45
8.1 报告期末基金资产组合情况.....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	47

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53
8.8 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.....	53
8.9 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.....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
8.12 投资组合报告附注.....	54
§9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
9.4 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.....	56
§10 开放式基金份额变动.....	57
§11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
11.2 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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8 其他重大事件.....	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
12.1 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.....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	61
13.3 查阅方式.....	61

## § 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	
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	117,532,233.94 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 (金融科技)	合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科 C)
下属分级基金的交易代码	168701	168702
报告期末下属分级基金的份 额总额	103,753,648.75 份	13,778,585.19 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	本基金的业绩比较基准为：国证香蜜湖金融科技指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金主要通过投资于国证香蜜湖金融科技指数的成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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.uvasset.com">https://www.uvasset.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

	合煦智远金融科技指数 (LOF)A (金融科技)	合煦智远金融科技指数 (LOF)C (金融科 C)
3.1.1 期间数据和指标	2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	40,510,931.61	1,950,690.80
本期利润	34,195,865.75	207,576.30
加权平均基金份额本期利润	0.1698	0.0177
本期加权平均净值利润率	15.86%	1.61%
本期基金份额净值增长率	8.26%	7.86%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	
期末可供分配利润	8,566,918.60	1,082,693.07
期末可供分配基金份额利润	0.0826	0.0786
期末基金资产净值	112,320,567.35	14,861,278.26
期末基金份额净值	1.0826	1.0786
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	
基金份额累计净值增长率	8.26%	7.86%

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 3 日，至 2020 年 12 月 31 日未满 1 年，故 2020 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

### 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 (金融科技)

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
过去三个月	-0.86%	1.54%	-3.04%	1.58%	2.18%	-0.04%
过去六个月	-3.92%	1.69%	-2.09%	1.85%	-1.83%	-0.16%
自基金合同 生效起至今	8.26%	1.51%	13.95%	1.76%	-5.69%	-0.25%

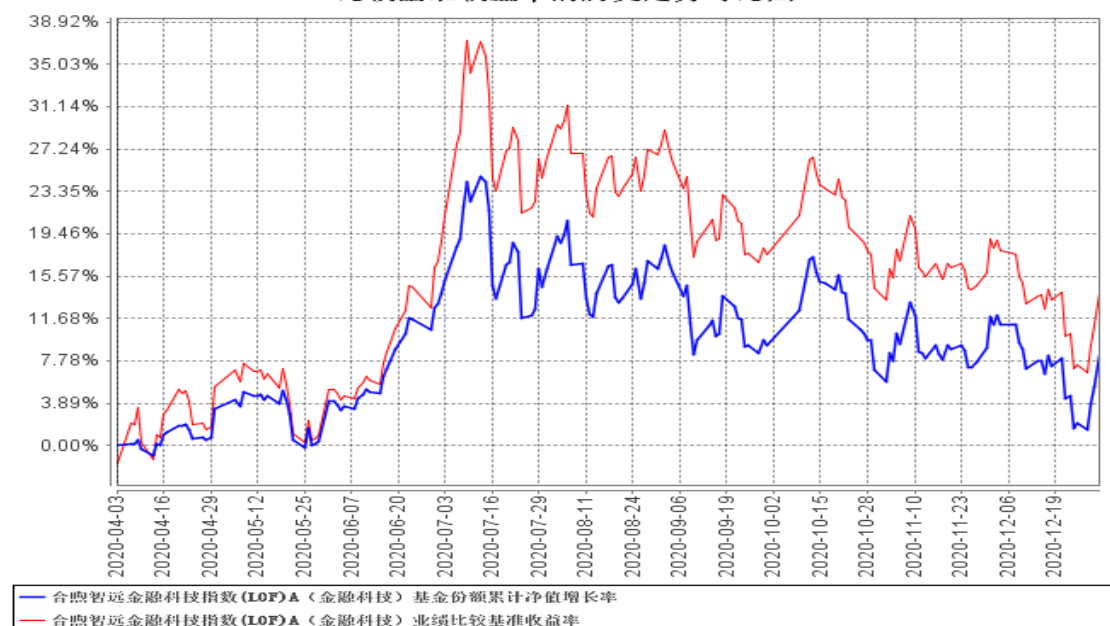
合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科 C)

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
过去三个月	-0.98%	1.54%	-3.04%	1.58%	2.06%	-0.04%
过去六个月	-4.16%	1.69%	-2.09%	1.85%	-2.07%	-0.16%
自基金合同 生效起至今	7.86%	1.51%	13.95%	1.76%	-6.09%	-0.25%

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%。

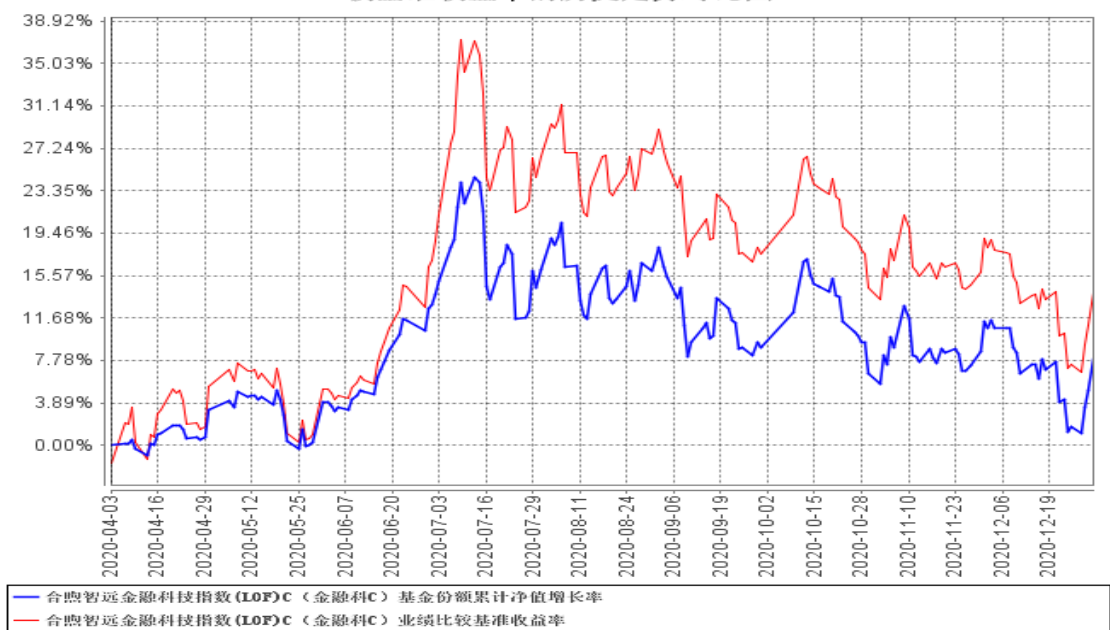
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

合煦智远金融科技指数 (LOF) A (金融科技) 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





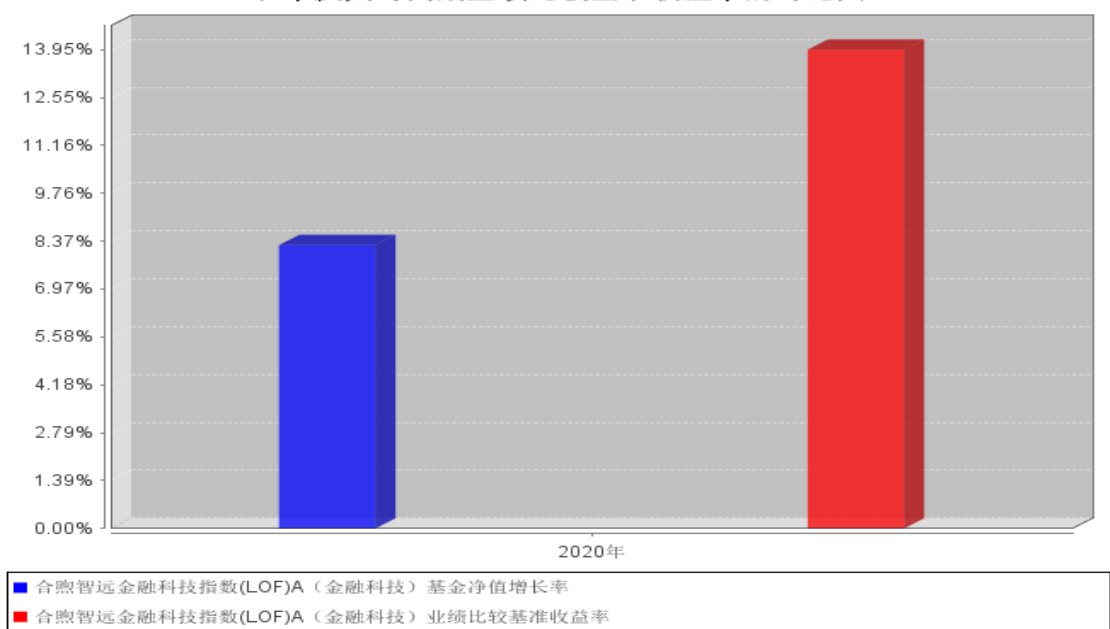
合煦智远金融科技指数(LOF)C(金融科C)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



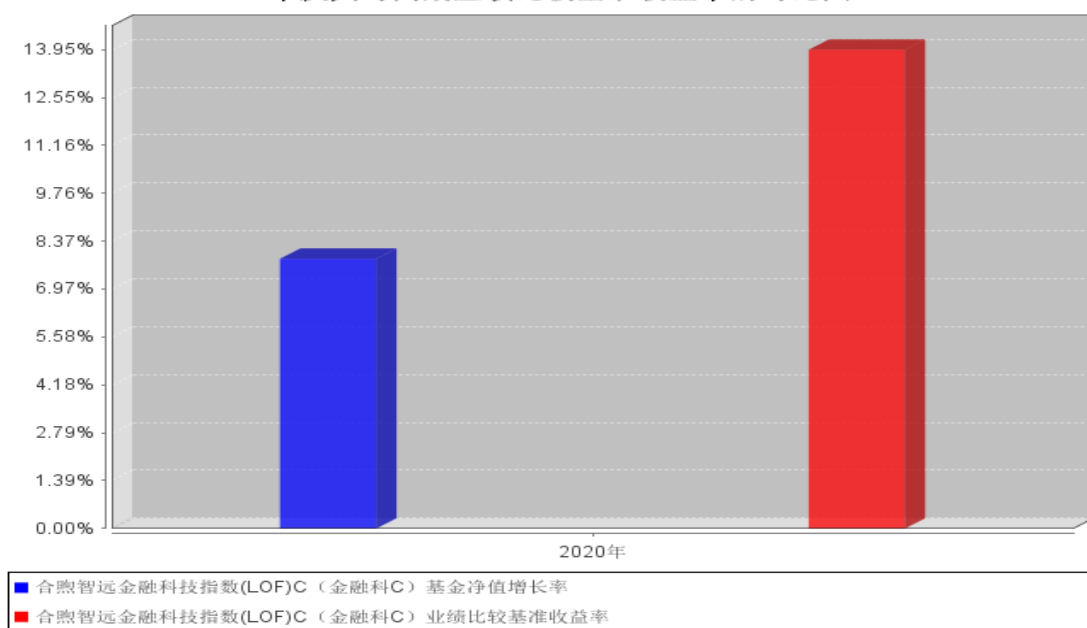
注：本基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

合煦智远金融科技指数(LOF)A(金融科技)自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



合煦智远金融科技指数(LOF)C(金融科C)自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2020年4月3日成立，截至本报告期末成立未满1年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2020年4月3日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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，公司管理资产总规模2.67亿元，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		
潘天奇	本基金基金经理	2020 年 4 月 3 日	-	9 年	四川大学理学学士,美国匹兹堡大学理学硕士和卡茨商学院金融 MBA。历任恒瑞医药股份有限公司研究员,广州证券股份有限公司研究所(后更名“广证恒生证券研究所”)研究员,国投瑞银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理,2018 年 7 月加入合煦智远基金管理有限公司。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.3 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遵规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，进一步完善了《公平交易管理制度》，对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理各个相关环节，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

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。自 2020 年 4 月 3 日成立以来，第一个月封闭期采取低仓位运行，重点是低波动基础上获得收益，首月以低仓位配置指数成份为主的操作较好地控制了回撤。在产品的建仓期 6 月内，稳步提升了仓位，以指数成份股为基础进行组合配置并附加主动择时和产品说明允许比例下的主动选股，兼顾产品的收益和净值的回撤。建仓期过后，产品 90%以上仓位配置复制国证香蜜湖金融科技指数（399699）成份股，体现了与国证香蜜湖金融科技指数（399699）高度跟踪的走势。除此之外，产品通过网下新股申购获得部分额外收益。

后续产品仍将保持 90%以上仓位配置国证香蜜湖金融科技指数（399699）成份股从而有效体现指数走势及产品的配置属性。另外，通过网下申购新股、主动仓位部分的选股，我们也将努力为投资者创造更高的超额收益。

#### 4.4.2 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8.26%，C类基金份额净值增长率为7.86%，同期业绩比较基准收益率为13.95%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2020 年市场情况，上半年应对疫情冲击，央行降准、降息，货币政策较为宽松，下半年国内经济活动逐渐恢复，稳货币的基调下，货币政策回归正常化。结构性宽松和收紧并存，防止超额资金流入房地产行业，继续支持制造业、中小微企业融资。证券市场从 3 月下旬到 7 月中旬表现较好呈上行走势和 7 月下旬到年底的震荡走势也较为符合流动性全年的放松和把控的节奏

展望 2021 年，国内经济将延续 2020 年下半年的复苏趋势；国际方面，随着新冠疫苗接种的不断推进，全球的经济活动也将逐步复苏。需求端的改善拉动制造业产业链盈利趋势向好，工业增加值将稳步上行。另一方面，我们需要时刻保持清醒，海外国家在本轮由疫情引发的货币宽松可能引起通胀上行，以美国为例，2020 年以来推出超大力度的货币宽

松政策随着疫情好转和通胀的压力可能出现转向，证券市场会因此出现波动。相对来说，更看好国内的市场的韧性，因为国内经济先于全球复苏，同时货币政策非常稳健。

行业层面呈现结构分化。从政策支持、细分行业发展趋势、财务报表质量、竞争格局等角度，中长期看好科技类、消费类、新能源车产业链、高端制造等行业。

央行提出长时间实施正常货币政策，流动性仍将维持合理充裕，实际贷款利率也有望进一步降低，预计2021年货币政策将继续保持稳健。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人依据最新的法律法规、监管政策，并结合公司业务发展情况，遵照公司内部控制的整体要求，搭建公司内控体系，积极践行合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规政策和公司管理制度的落实，确保基金合同得到严格履行。

报告期内，本基金管理人积极贯彻落实法律法规和监管要求，进行各项公司制度、流程的制定，建立了较为完善的公司内控体系；开展对基金投资运作和公司经营管理的合规性稽核，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，对公司投研交易、市场销售、人员管理等方面开展稽核审计，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况；多次组织针对法律法规、职业道德方面的培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德，营造合规经营的公司氛围；严格规范基金销售业务，审慎审查宣传推介材料，督促落实销售适当性管理制度及投资者教育工作；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金管理人承诺将继续坚持审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全及基金份额持有人的权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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，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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 20762 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了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“合煦智远金融科技指数基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了合煦智远金融科技指数基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>

	<p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于合煦智远金融科技指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>合煦智远金融科技指数基金的基金管理人合煦智远基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估合煦智远金融科技指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算合煦智远金融科技指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督合煦智远金融科技指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对合煦智远金融科技指数基金持续经营能力产生重大疑</p>



	<p>虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致合煦智远金融科技指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 吴琳杰
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	528,022.88
结算备付金		8,170,247.89
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	119,142,667.35
其中：股票投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-

应收证券清算款		221,960.88
应收利息	7.4.7.5	2,482.25
应收股利		-
应收申购款		102,532.94
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		128,167,914.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		705,529.90
应付管理人报酬		57,235.96
应付托管费		11,447.18
应付销售服务费		6,066.73
应付交易费用	7.4.7.7	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	7.4.7.8	205,629.97
负债合计		986,068.58
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	117,532,233.94
未分配利润	7.4.7.10	9,649,611.67
所有者权益合计		127,181,845.61
负债和所有者权益总计		128,167,914.19

注: 1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日, 基金份额总额 117,532,233.94 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 103,753,648.75 份, A 类基金份

额净值 1.0826 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 13,778,585.19 份，C 类基金份额净值 1.0786 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

3、本基金基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，无上年度可比期间及可比较数据。

## 7.2 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：2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		37,662,397.18
1. 利息收入		1,093,845.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	661,363.93
债券利息收入		14.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		432,466.96
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		41,909,767.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	40,813,219.23
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	12,083.03
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,084,465.48
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-8,058,180.36
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	2,716,964.30
减：二、费用		3,258,955.13

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	860,146.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	172,029.43
3. 销售服务费		47,502.03
4. 交易费用	7.4.7.19	1,847,985.76
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.02
7. 其他费用	7.4.7.20	331,290.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,403,442.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,403,442.05

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

2、本基金基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，无上年度可比期间及可比较数据。

### 7.3 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：2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	-	34,403,442.05	34,403,442.05
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）	-414,305,654.34	-24,753,830.38	-439,059,484.72
其中：1. 基金申购款	65,473,554.90	8,647,264.49	74,120,819.39
2. 基金赎回款	-479,779,209.24	-33,401,094.87	-513,180,304.11

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）	117,532,233.94	9,649,611.67	127,181,845.61

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

2、本基金基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，无上年度可比期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_赵新宇\_\_\_\_                      \_\_\_\_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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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分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\*95%+人民币银行活期存款利率(税后)\*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人合煦智远基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及

2020年4月3日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2020年4月3日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金



实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定以及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金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》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	453,823.77
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	74,199.11
合计	528,022.88

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	127,200,847.71	119,142,667.35	-8,058,180.36
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	127,200,847.71	119,142,667.35	-8,058,180.36

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	160.20

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	95.35
应收结算备付金利息	2,226.70
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	2,482.25

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	158.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	158.84

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,629.97
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	205,629.97

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）A（金融科技）		
项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
基金合同生效日	521,433,389.32	521,433,389.32
本期申购	42,319,252.28	42,319,252.28
本期赎回（以“-”号填列）	-459,998,992.85	-459,998,992.85
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	103,753,648.75	103,753,648.75

金额单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）C（金融科 C）		
项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
基金合同生效日	10,404,498.96	10,404,498.96
本期申购	23,154,302.62	23,154,302.62
本期赎回（以“-”号填列）	-19,780,216.39	-19,780,216.39
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	13,778,585.19	13,778,585.19

注：1、本基金自 2020 年 3 月 2 日起至 2020 年 3 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 531,621,595.05 元，折合为 531,621,595.05 份基金份额（其中 A 类基金份额 521,226,034.81 份，C 类基金份额 10,395,560.24 份）。根据《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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 216,293.23 元在本基金成立后，折合为 216,293.23 份基金份额（其中 A 类基金份额 207,354.51 份，C 类基金份额 8,938.72 份），划入基金份额持有人账户。

2、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》、《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》及《合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金（LOF）开放申购、赎回、定期定额投资业务及开通跨系统转托管业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 5 月 5 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购、赎回、定期定额投资业务及开通跨系统转托管业务自 2020 年 5 月 6 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）A（金融科技）			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	40,510,931.61	-6,315,065.86	34,195,865.75
本期基金份额交易产生的变动数	-20,527,928.94	-5,101,018.21	-25,628,947.15
其中：基金申购款	5,363,574.53	105,708.69	5,469,283.22
基金赎回款	-25,891,503.47	-5,206,726.90	-31,098,230.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,983,002.67	-11,416,084.07	8,566,918.60

单位：人民币元

合煦智远金融科技指数（LOF）C（金融科 C）			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,950,690.80	-1,743,114.50	207,576.30

本期基金份额交易产生的变动数	643,793.02	231,323.75	875,116.77
其中：基金申购款	2,988,384.35	189,596.92	3,177,981.27
基金赎回款	-2,344,591.33	41,726.83	-2,302,864.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,594,483.82	-1,511,790.75	1,082,693.07

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	91,124.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	29,122.69
结算备付金利息收入	540,693.77
其他	423.27
合计	661,363.93

注：“其他”为“申购款利息收入”。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	678,603,782.22
减：卖出股票成本总额	637,790,562.99
买卖股票差价收入	40,813,219.23

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	69,197.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	57,099.47
减：应收利息总额	15.44
买卖债券差价收入	12,083.03

##### 7.4.7.13.2 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。

#### 7.4.7.14 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。



#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内没有发生衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,084,465.48
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	1,084,465.48

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-8,058,180.36
——股票投资	-8,058,180.36
——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	-8,058,180.36

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,715,143.01
其他	1,821.29
合计	2,716,964.30

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,847,985.76
银行间市场交易费用	-

合计	1,847,985.76
----	--------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	54,000.00
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
汇划费	8,389.87
指数使用费	148,901.10
上市初费及年费	70,000.00
合计	331,290.97

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
郑旭	基金管理人持股 20%以上的股东
赵新宇	基金管理人持股 20%以上的股东
林琦	基金管理人持股 20%以上的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2020 年 4 月 3 日生效，无上年度可比期间及可比较数据。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额（元）	占当期股票成交总额的比例
申万宏源证券	1,012,797,214.47	70.37%

### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额（元）	占当期债券成交总额的比例
申万宏源证券	51,255.60	74.07%

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	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	3,500,100,000.00	60.76%

### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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	730,956.95	70.48%	158.84	100.00%

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	860,146.92
其中：支付销售机构的客户维护费	360,069.08

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,029.43

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。

**7.4.10.2.3 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 2020 年 4 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 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 (金融科技)	合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科技)	合计
合煦智远基金公司	-	2,964.64	2,964.64
申万宏源证券	-	2,511.26	2,511.26
合计	-	5,475.90	5,475.90

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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 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**

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

**7.4.10.5.2 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 (金融科技)	
	本期末 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
郑旭	228,255.55	0.2200%

林琦	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（金融科 C）	
	本期末 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
林琦	100.12	0.0007%

#### 7.4.10.6 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 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额（元）	当期利息收入（元）
申万宏源证券	73,398.13	26,360.46

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

##### 7.4.12.1.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2021 年 1 月 4 日	首次公开发行限售	11.33	16.34	8,337	94,458.21	136,226.58	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	首次公开发行	118.27	603.36	57	6,741.39	34,391.52	-

				限售						
300870	欧陆通	2020年 8月13 日	2021年 2月24 日	首次 公开发 行 限售	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300898	熊猫乳品	2020年 10月9 日	2021年 4月16 日	首次 公开发 行 限售	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300913	兆龙互连	2020年 11月27 日	2021年 6月7 日	首次 公开发 行 限售	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300895	铜牛信息	2020年 9月17 日	2021年 3月24 日	首次 公开发 行 限售	12.65	45.3	283	3,579.95	12,819.90	-
300907	康平科技	2020年 11月11 日	2021年 5月18 日	首次 公开发 行 限售	14.3	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300902	国安达	2020年 10月22 日	2021年 4月29 日	首次 公开发 行 限售	15.38	24.26	507	7,797.66	12,299.82	-
300861	美畅股份	2020年 8月6 日	2021年 2月24 日	首次 公开发 行 限售	43.76	51.1	233	10,196.08	11,906.30	-
300882	万胜智能	2020年 8月27 日	2021年 3月10 日	首次 公开发 行 限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300919	中伟股份	2020年 12月15 日	2021年 6月23 日	首次 公开发 行 限售	24.6	61.51	168	4,132.80	10,333.68	-
300884	狄耐克	2020年 11月5 日	2021年 5月12 日	首次 公开发 行 限售	24.87	33.51	295	7,336.65	9,885.45	-
300887	谱尼测试	2020年 9月9 日	2021年 3月16 日	首次 公开发 行	44.47	74.52	132	5,870.04	9,836.64	-

				限售						
300893	松原股份	2020年 9月17 日	2021年 3月24 日	首次 公开发 行 限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300860	锋尚文化	2020年 8月6 日	2021年 2月24 日	首次 公开发 行 限售	138.02	126.67	76	10,489.52	9,626.92	-
605277	新亚电子	2020年 12月25 日	2021年 1月6 日	新股 未上 市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
300918	南山智尚	2020年 12月15 日	2021年 6月22 日	首次 公开发 行 限售	4.97	8.94	957	4,756.29	8,555.58	-
300910	瑞丰新材	2020年 11月20 日	2021年 5月27 日	首次 公开发 行 限售	30.26	47.87	178	5,386.28	8,520.86	-
300922	天秦装备	2020年 12月18 日	2021年 6月25 日	首次 公开发 行 限售	16.05	31.58	255	4,092.75	8,052.90	-
300908	仲景食品	2020年 11月13 日	2021年 5月24 日	首次 公开发 行 限售	39.74	60.44	125	4,967.50	7,555.00	-
003030	祖名股份	2020年 12月25 日	2021年 1月6 日	新股 未上 市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年 12月24 日	2021年 1月4 日	新股 未上 市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2、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。

3、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。其中基金参与网下申购获得的新股或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；基金参与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。

#### **7.4.12.1.2 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。

#### **7.4.12.2 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。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 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。

##### **7.4.12.3.2 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。

#### **7.4.12.4 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。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 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内。

#### **7.4.13.2 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2020年12月31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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 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。

#### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **7.4.13.3.2 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“7.4.12 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 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	----------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	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	119,142,667.35	93.68

#### 7.4.13.4.3.2 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（2020年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	5,220,530.55
	2.业绩比较基准下降 5%	-5,220,530.55

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为118,744,281.59元，属于第二层次的余额为398,385.76元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	119,142,667.35	92.96
	其中：股票	119,142,667.35	92.96
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	8,698,270.77	6.79
8	其他资产	326,976.07	0.26
9	合计	128,167,914.19	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	17,625,137.72	13.86
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	67,568,543.23	53.13
J	金融业	31,154,883.98	24.50
K	房地产业	730,128.00	0.57
L	租赁和商务服务业	946,908.00	0.74
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	118,025,600.93	92.80

### 8.2.2 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	17,910.00	0.01
C	制造业	605,736.72	0.48
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	112,716.14	0.09
J	金融业	21,340.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,836.64	0.01
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	339,900.00	0.27

R	文化、体育和娱乐业	9,626.92	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,117,066.42	0.88

### 8.2.3 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。

## 8.3 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

### 8.3.1 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	438,100	13,581,100.00	10.68
2	600570	恒生电子	112,919	11,845,203.10	9.31
3	601318	中国平安	135,751	11,807,621.98	9.28
4	600588	用友网络	221,900	9,734,753.00	7.65
5	002410	广联达	121,552	9,571,004.48	7.53
6	000938	紫光股份	175,000	3,578,750.00	2.81
7	000977	浪潮信息	125,844	3,382,686.72	2.66
8	300033	同花顺	26,600	3,297,868.00	2.59
9	002439	启明星辰	88,921	2,597,382.41	2.04
10	002065	东华软件	243,923	2,024,560.90	1.59
11	600271	航天信息	132,800	1,673,280.00	1.32
12	002152	广电运通	152,500	1,628,700.00	1.28
13	300773	拉卡拉	52,200	1,561,824.00	1.23
14	000997	新大陆	96,600	1,476,048.00	1.16
15	002195	二三四五	649,900	1,468,774.00	1.15
16	300348	长亮科技	69,900	1,328,100.00	1.04
17	002153	石基信息	41,424	1,287,872.16	1.01
18	600410	华胜天成	139,400	1,235,084.00	0.97
19	002368	太极股份	47,299	1,234,976.89	0.97
20	600718	东软集团	117,100	1,219,011.00	0.96
21	300226	上海钢联	18,520	1,214,912.00	0.96
22	002268	卫士通	71,500	1,194,050.00	0.94
23	601519	大智慧	114,300	1,186,434.00	0.93
24	600446	金证股份	66,500	1,077,965.00	0.85
25	300674	宇信科技	31,500	1,068,795.00	0.84
26	300369	绿盟科技	69,100	1,055,848.00	0.83
27	000555	神州信息	62,600	970,300.00	0.76
28	300352	北信源	152,100	847,197.00	0.67



29	300803	指南针	25,500	831,300.00	0.65
30	600797	浙大网新	118,400	824,064.00	0.65
31	300085	银之杰	44,100	815,409.00	0.64
32	002183	怡亚通	184,900	806,164.00	0.63
33	300079	数码视讯	165,200	771,484.00	0.61
34	300339	润和软件	77,000	753,830.00	0.59
35	002285	世联行	148,400	730,128.00	0.57
36	600776	东方通信	56,100	664,785.00	0.52
37	002537	海联金汇	89,500	658,720.00	0.52
38	300377	赢时胜	70,891	621,714.07	0.49
39	300663	科蓝软件	25,600	582,912.00	0.46
40	300368	汇金股份	41,800	570,988.00	0.45
41	002376	新北洋	59,000	555,780.00	0.44
42	300468	四方精创	26,308	536,946.28	0.42
43	300322	硕贝德	40,900	536,608.00	0.42
44	002104	恒宝股份	75,400	525,538.00	0.41
45	300324	旋极信息	123,400	521,982.00	0.41
46	002649	博彦科技	56,000	504,560.00	0.40
47	300297	蓝盾股份	101,400	502,944.00	0.40
48	300465	高伟达	41,500	500,905.00	0.39
49	300386	飞天诚信	23,400	483,912.00	0.38
50	002777	久远银海	20,040	467,733.60	0.37
51	002177	御银股份	84,100	455,822.00	0.36
52	600318	新力金融	44,000	450,560.00	0.35
53	300349	金卡智能	35,300	446,545.00	0.35
54	002668	奥马电器	111,400	441,144.00	0.35
55	300130	新国都	37,400	433,466.00	0.34
56	300229	拓尔思	49,900	417,164.00	0.33
57	002197	证通电子	49,200	414,264.00	0.33
58	300579	数字认证	10,100	399,455.00	0.31
59	603232	格尔软件	14,158	378,868.08	0.30
60	300231	银信科技	42,300	378,585.00	0.30
61	300333	兆日科技	37,742	355,907.06	0.28
62	300248	新开普	39,000	345,930.00	0.27
63	600571	信雅达	45,000	341,100.00	0.27
64	002453	华软科技	58,200	336,978.00	0.26
65	300205	天喻信息	31,000	320,850.00	0.25
66	603383	顶点软件	10,160	319,735.20	0.25
67	002530	金财互联	39,900	311,220.00	0.24
68	002017	东信和平	33,900	309,846.00	0.24
69	300096	易联众	38,000	305,900.00	0.24
70	002315	焦点科技	18,000	297,360.00	0.23
71	002587	奥拓电子	51,100	283,094.00	0.22

72	000948	南天信息	28,100	282,124.00	0.22
73	300295	三六五网	21,200	263,940.00	0.21
74	300290	荣科科技	53,400	257,922.00	0.20
75	002095	生意宝	16,800	245,616.00	0.19
76	300542	新晨科技	14,990	217,355.00	0.17
77	002908	德生科技	15,000	204,150.00	0.16
78	300380	安硕信息	8,800	174,416.00	0.14
79	603106	恒银科技	23,500	169,435.00	0.13
80	300546	雄帝科技	9,700	164,997.00	0.13
81	300399	天利科技	9,500	157,700.00	0.12
82	300061	旗天科技	29,200	140,744.00	0.11
83	300479	神思电子	6,000	84,900.00	0.07

### 8.3.2 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	002044	美年健康	30,000	339,900.00	0.27
2	688528	秦川物联	8,337	136,226.58	0.11
3	600867	通化东宝	10,000	133,800.00	0.11
4	300451	创业慧康	6,000	81,180.00	0.06
5	002422	科伦药业	2,000	38,880.00	0.03
6	300896	爱美客	57	34,391.52	0.03
7	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.02
8	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.02
9	601838	成都银行	2,000	21,340.00	0.02
10	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
11	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
12	600988	赤峰黄金	1,000	17,910.00	0.01
13	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
14	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
15	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.01
16	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
17	300907	康平科技	473	12,700.05	0.01
18	300902	国安达	507	12,299.82	0.01
19	300861	美畅股份	233	11,906.30	0.01
20	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
21	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
22	300919	中伟股份	168	10,333.68	0.01
23	300884	狄耐克	295	9,885.45	0.01
24	300887	谱尼测试	132	9,836.64	0.01

25	300893	松原股份	276	9,682.08	0.01
26	300860	锋尚文化	76	9,626.92	0.01
27	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
28	300918	南山智尚	957	8,555.58	0.01
29	300910	瑞丰新材	178	8,520.86	0.01
30	300922	天秦装备	255	8,052.90	0.01
31	300908	仲景食品	125	7,555.00	0.01
32	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
33	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	86,658,916.07	68.14
2	601318	中国平安	63,281,725.57	49.76
3	600570	恒生电子	61,178,239.69	48.10
4	600588	用友网络	55,675,171.12	43.78
5	002410	广联达	36,056,046.18	28.35
6	000977	浪潮信息	32,372,863.15	25.45
7	000938	紫光股份	25,504,077.45	20.05
8	002439	启明星辰	21,657,372.60	17.03
9	002065	东华软件	20,811,242.34	16.36
10	300033	同花顺	20,238,776.77	15.91
11	600271	航天信息	16,886,543.49	13.28
12	600410	华胜天成	12,469,803.36	9.80
13	002152	广电运通	11,610,738.99	9.13
14	002195	二三四五	11,491,651.10	9.04
15	002268	卫士通	10,646,674.16	8.37
16	000997	新大陆	10,545,867.22	8.29
17	600718	东软集团	9,017,566.69	7.09
18	002368	太极股份	8,561,982.30	6.73
19	002153	石基信息	8,519,502.19	6.70
20	600446	金证股份	8,169,943.54	6.42
21	300369	绿盟科技	7,905,764.90	6.22
22	300226	上海钢联	7,698,918.40	6.05
23	300352	北信源	7,142,773.00	5.62
24	300348	长亮科技	7,013,073.38	5.51
25	600797	浙大网新	7,000,351.29	5.50
26	600776	东方通信	6,239,049.00	4.91
27	300324	旋极信息	5,957,388.96	4.68

28	300773	拉卡拉	5,728,270.37	4.50
29	000555	神州信息	5,617,387.00	4.42
30	601519	大智慧	5,568,883.00	4.38
31	300079	数码视讯	5,402,700.31	4.25
32	002183	怡亚通	5,351,212.00	4.21
33	002647	仁东控股	5,040,473.00	3.96
34	300339	润和软件	4,922,740.00	3.87
35	300322	硕贝德	4,424,821.18	3.48
36	300085	银之杰	4,322,844.84	3.40
37	300377	赢时胜	4,240,890.41	3.33
38	002376	新北洋	4,065,698.40	3.20
39	002104	恒宝股份	3,839,151.95	3.02
40	300465	高伟达	3,763,686.00	2.96
41	002777	久远银海	3,625,494.09	2.85
42	300663	科蓝软件	3,579,502.12	2.81
43	300229	拓尔思	3,561,627.00	2.80
44	300674	宇信科技	3,527,279.74	2.77
45	300468	四方精创	3,470,809.31	2.73
46	300130	新国都	3,359,790.00	2.64
47	300349	金卡智能	3,347,996.91	2.63
48	002657	中科金财	3,324,301.00	2.61
49	002649	博彦科技	3,251,036.95	2.56
50	002537	海联金汇	3,043,431.00	2.39
51	002668	奥马电器	2,949,286.00	2.32
52	002197	证通电子	2,928,514.80	2.30
53	300248	新开普	2,901,870.44	2.28
54	300297	蓝盾股份	2,753,256.28	2.16
55	002285	世联行	2,723,171.32	2.14
56	600571	信雅达	2,701,758.93	2.12
57	002017	东信和平	2,608,016.04	2.05
58	002530	金财互联	2,560,226.00	2.01
59	300300	海峡创新	2,545,652.00	2.00

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	88,377,491.84	69.49
2	600570	恒生电子	56,463,728.48	44.40
3	601318	中国平安	53,951,442.12	42.42
4	600588	用友网络	49,105,376.88	38.61
5	002410	广联达	31,426,850.12	24.71

6	000977	浪潮信息	27,987,768.75	22.01
7	000938	紫光股份	21,425,209.53	16.85
8	002439	启明星辰	18,534,495.20	14.57
9	002065	东华软件	17,655,501.01	13.88
10	300033	同花顺	17,438,407.23	13.71
11	600271	航天信息	13,328,867.55	10.48
12	600410	华胜天成	10,804,299.20	8.50
13	002152	广电运通	10,493,413.14	8.25
14	002195	二三四五	9,436,852.50	7.42
15	000997	新大陆	8,883,705.16	6.99
16	002268	卫士通	8,853,094.28	6.96
17	002153	石基信息	7,599,297.06	5.98
18	600718	东软集团	7,534,067.55	5.92
19	002368	太极股份	7,415,270.72	5.83
20	600446	金证股份	7,079,578.81	5.57
21	300369	绿盟科技	6,805,865.48	5.35
22	300226	上海钢联	6,796,369.00	5.34
23	002647	仁东控股	6,096,816.00	4.79
24	300352	北信源	6,020,218.96	4.73
25	300348	长亮科技	5,902,350.50	4.64
26	600797	浙大网新	5,779,072.00	4.54
27	600776	东方通信	5,032,178.22	3.96
28	002183	怡亚通	4,877,031.19	3.83
29	300324	旋极信息	4,821,547.76	3.79
30	601519	大智慧	4,508,418.00	3.54
31	000555	神州信息	4,486,929.00	3.53
32	300079	数码视讯	4,450,828.83	3.50
33	300339	润和软件	4,198,800.86	3.30
34	300322	硕贝德	3,734,305.00	2.94
35	300085	银之杰	3,536,369.81	2.78
36	002104	恒宝股份	3,473,542.00	2.73
37	300773	拉卡拉	3,441,743.00	2.71
38	002376	新北洋	3,383,282.00	2.66
39	300377	赢时胜	3,372,318.00	2.65
40	300465	高伟达	3,210,366.00	2.52
41	002657	中科金财	3,166,238.13	2.49
42	002777	久远银海	3,011,529.02	2.37
43	300229	拓尔思	2,980,728.00	2.34
44	300663	科蓝软件	2,919,716.00	2.30
45	300349	金卡智能	2,899,795.78	2.28
46	300468	四方精创	2,868,014.44	2.26
47	300130	新国都	2,744,338.46	2.16
48	002649	博彦科技	2,714,868.00	2.13

49	300248	新开普	2,551,230.18	2.01
----	--------	-----	--------------	------

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。

#### 8.4.3 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	764,991,410.70
卖出股票收入（成交）总额	678,603,782.22

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

基金投资的前十名证券中用友网络（证券代码：600588）在一年内受到罚款处罚，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

基金管理人分析认为，上述公司在常规业务过程中被监管机关给予小额罚款等行政处罚、其处罚的商业影响相比起其经营规模和利润而言比例极小。基金管理人经审慎分析，认为受罚情况对公司经营和价值应不会构成重大影响。

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

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	221,960.88
3	应收股利	-
4	应收利息	2,482.25

5	应收申购款	102,532.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,976.07

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 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	688528	秦川物联	136,226.58	0.11	首次公开发行限售

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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（金融科技）	3,717	27,913.28	5,441,917.81	5.25%	98,311,730.94	94.75%
合煦智远金融科技指数（LOF）C（金融科	1,197	11,510.93	-	-	13,778,585.19	100.00%



C)						
合计	4,914	23,917.83	5,441,917.81	4.63%	112,090,316.13	95.37%

## 9.2 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	9.77%
2	徐爱英	1,455,014.00	2.84%
3	蒋约文	1,258,377.00	2.46%
4	魏萍	1,222,023.00	2.39%
5	蔡丽娜	1,036,928.00	2.02%
6	边晓全	949,000.00	1.85%
7	王文芝	832,771.00	1.63%
8	王敬袖	800,046.00	1.56%
9	边双全	791,000.00	1.54%
10	周晓杨	732,649.00	1.43%

注：持有人为场内持有人。

## 9.3 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（金融科技）	633,911.37	0.6110%
	合煦智远金融科技指数（LOF）C（金融科C）	7,246.06	0.0526%
	合计	641,157.43	0.5455%

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。

## 9.4 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（金融科技）	10~50
	合煦智远金融科技指数（LOF）C（金融科C）	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放	合煦智远金融科技指数	0

式基金	(LOF) A (金融科技)	
	合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科 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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	合煦智远金融科技指数 (LOF) A (金融科技)	合煦智远金融科技指数 (LOF) C (金融科 C)
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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	42,319,252.28	23,154,302.62
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	459,998,992.85	19,780,216.39
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	103,753,648.75	13,778,585.19

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：报告期内，经合煦智远基金管理有限公司董事会审议通过，同意郑旭女士不再代为履行公司督察长职务，同意林琦先生辞去公司副总经理职务并转任公司督察长职务，林琦先生自 2020 年 8 月 22 日起任基金管理人督察长职务。上述变更事项已报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的重大人事变动：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人本报告期聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用为人民币 54,000.00 元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	1,012,797,214.47	70.37%	730,956.95	70.48%	-
安信证券	2	426,362,588.15	29.63%	306,177.69	29.52%	-

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；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) 本基金本报告期支付给申万宏源证券的交易佣金为 730,956.95 元, 支付给安信证券的交易佣金为 306,177.69 元。

### 11.7.2 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	51,255.60	74.07%	3,500,100,000.00	60.76%	-	-
安信证券	17,942.34	25.93%	2,260,800,000.00	39.24%	-	-

### 11.8 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持续完善客户身份信息的提示	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20201103
2	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 3 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 3 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	20201028
3	合煦智远基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200909
4	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	20200831
5	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)2020 年中期报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200829
6	合煦智远基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管	20200827

		理人网站、证监会基金电子披露网站	
7	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 2 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 2 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	20200721
8	合煦智远基金管理有限公司关于暂停北京辉腾汇富基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200613
9	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200506
10	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF) 开放申购、赎回、定期定额投资业务及开通跨系统转托管业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200429
11	合煦智远国证香蜜湖金融科技指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200428
12	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) 基金合同生效的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20200404

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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 3 月 31 日