

合煦智远消费主题股票型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：合煦智远基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12	投资组合报告附注	39
§8	基金份额持有人信息	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	41
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	41
§9	开放式基金份额变动	42
§10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	其他重大事件	44
§11	影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	45
§12	备查文件目录	45
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	45
12.3	查阅方式	45

§ 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	20,277,370.59 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	16,177,461.06 份	4,099,909.53 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，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林琦
	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田中心区金田路 4036 号荣超大厦 5 层 01-06		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田中心区金田路 4036 号荣超大厦 5 层 01-06		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	https://www.uvasset.com
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田中心区金田路 4036 号荣超大厦 5 层 01-06

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

	合煦智远消费主题股票发起式 A	合煦智远消费主题股票发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日
本期已实现收益	1,655,081.79	215,659.93
本期利润	-444,038.77	-305,221.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0280	-0.1134
本期加权平均净值利润率	-1.95%	-8.00%

本期基金份额净值增长率	-2.12%	-2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	1,674,098.34	366,824.11
期末可供分配基金份额利润	0.1035	0.0895
期末基金资产净值	21,661,432.41	5,428,584.79
期末基金份额净值	1.3390	1.3241
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	33.90%	32.41%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

合煦智远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	-6.23%	0.74%	-4.12%	0.76%	-2.11%	-0.02%
过去三个月	-9.15%	1.03%	1.37%	1.06%	-10.52%	-0.03%
过去六个月	-2.12%	1.36%	-3.66%	1.48%	1.54%	-0.12%
过去一年	21.14%	1.37%	31.54%	1.36%	-10.40%	0.01%
自基金合同生效起至今	33.90%	1.31%	49.99%	1.25%	-16.09%	0.06%

合煦智远消费主题股票发起式 C

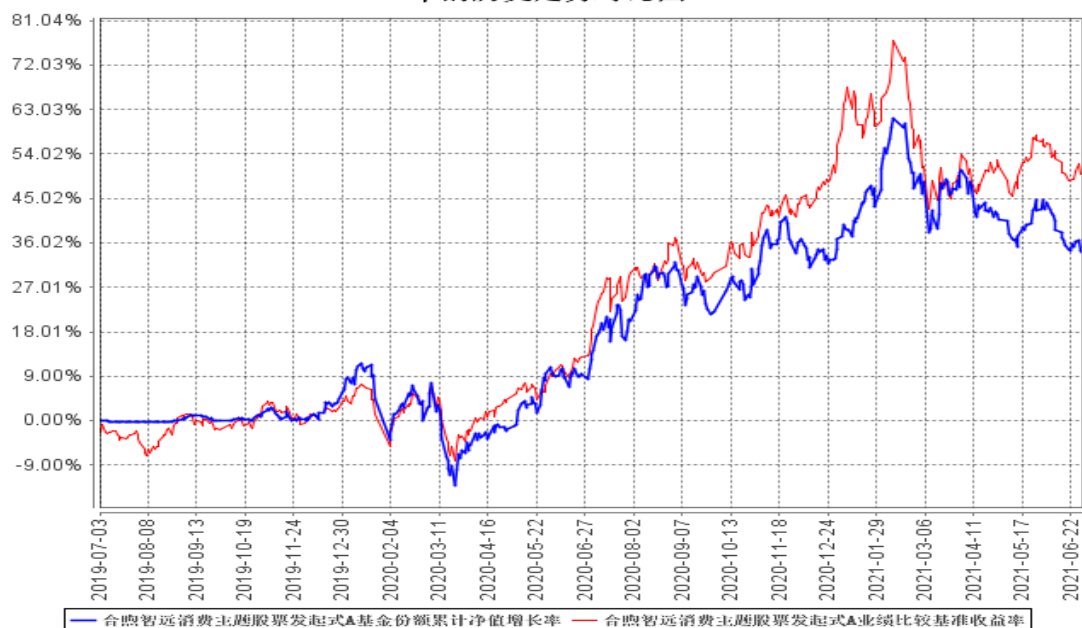
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去一个月	-6.27%	0.74%	-4.12%	0.76%	-2.15%	-0.02%
过去三个月	-9.26%	1.03%	1.37%	1.06%	-10.63%	-0.03%
过去六个月	-2.36%	1.36%	-3.66%	1.48%	1.30%	-0.12%
过去一年	20.55%	1.37%	31.54%	1.36%	-10.99%	0.01%
自基金合同生效起至今	32.41%	1.31%	49.99%	1.25%	-17.58%	0.06%

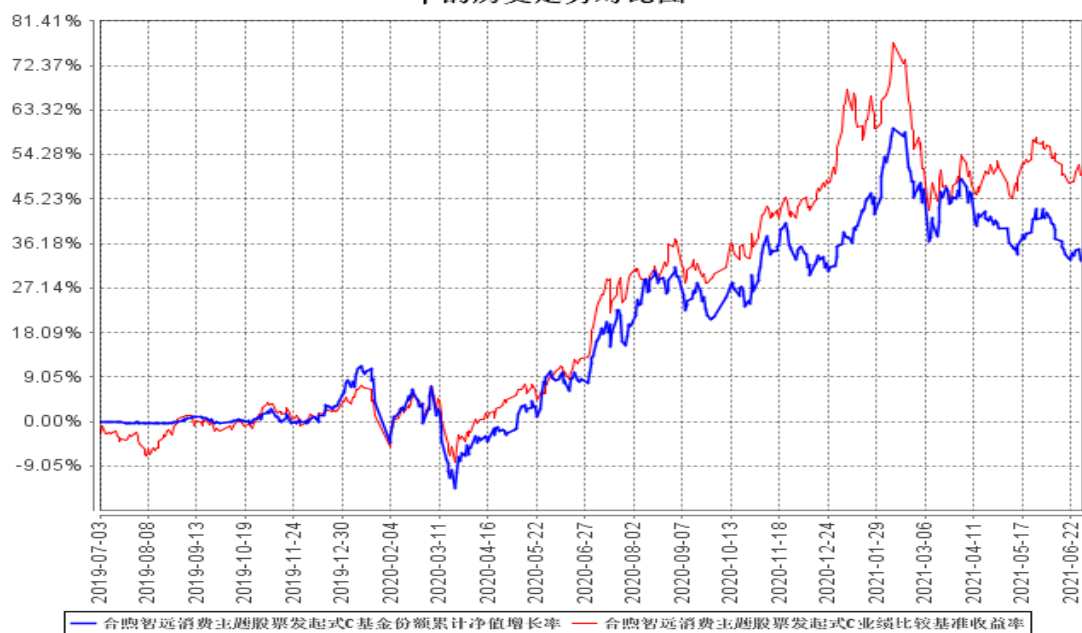
注：本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×75%+中证港股通主要消费综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×15%。

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。

截止报告期末，公司公募基金总规模 2.53 亿元，管理 3 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程卉超	本基金基金经理	2019 年 7 月 3 日	-	12 年	北京大学经济学硕士。2009 年至 2014 年就职于融通基金管理有限公司，担任研究员；2015 年至 2017 年就职于上海高

					毅资产管理合伙企业（有限合伙），担任高级研究员。2017 年 12 月加入合煦智远基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	--

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过系统和人工等多种方式在各业务环节严格控制公平交易的执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，内地消费指数下跌 4.25%；消费行业中涨幅居前的是汽车、纺织服装和轻工制造；涨幅靠后的是家电、农林牧渔和传媒。

消费之外的行业中，涨幅居前的有基础化工、钢铁和电力设备及新能源，涨幅靠后的有非银行金融、国防军工和房地产。

本基金从中长期风险和收益角度考虑，主要配置了价值型公司。

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-2.12%，C 类基金份额净值增长率为-2.36%，同期业绩比较基准收益率为-3.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，整体消费板块的风险回报吸引力仍然有限：二季度末内地消费指数 PE-TTM 估值处于过去十年 94% 的高水平。

未来我们将继续自下而上，加大研究范围，多角度比较，持续提高研究能力，发掘中长期风险回报吸引力大的投资机会，尽力创造更高的超额收益率。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定。

§ 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，本基金托管人在对合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金的托管过程中，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，合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金的管理人——合煦智远基金管理有限公司在合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对合煦智远基金管理有限公司编制和披露的合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2021 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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,759,852.35	510,363.37
结算备付金		1,650,327.70	1,650,327.70

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	22,998,928.29	20,769,748.46
其中：股票投资		22,998,928.29	20,769,748.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,800,001.80	2,300,002.30
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	702.16	5,475.61
应收股利		24,788.37	13,578.08
应收申购款		392,144.64	15,206.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,626,745.31	25,264,701.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,402,753.42	-
应付赎回款		71,681.46	223,504.52
应付管理人报酬		32,368.41	32,515.61
应付托管费		5,394.73	5,419.27
应付销售服务费		1,765.99	1,603.00
应付交易费用	6.4.7.7	5,335.89	5,473.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	17,428.21	30,092.45
负债合计		1,536,728.11	298,608.43
所有者权益:			
实收基金	-	20,277,370.59	18,269,324.04
未分配利润	6.4.7.10	6,812,646.61	6,696,769.27
所有者权益合计		27,090,017.20	24,966,093.31
负债和所有者权益总计		28,626,745.31	25,264,701.74

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 20,277,370.59 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 16,177,461.06 份，A 类基金份额净值 1.3390 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 4,099,909.53 份，C 类基金份额净值 1.3241 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-473,953.02	978,417.79
1. 利息收入		43,671.62	21,840.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,391.64	14,165.42
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		30,279.98	7,674.68
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,058,862.63	129,970.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,755,073.86	-198,322.75
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	303,788.77	328,293.61
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,620,002.24	781,083.84
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	43,514.97	45,522.99
减：二、费用		275,307.50	196,895.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	198,816.00	139,293.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,135.96	23,215.65
3. 销售服务费		9,538.37	6,629.79
4. 交易费用	6.4.7.19	16,311.08	12,675.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	17,506.09	15,080.54
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-749,260.52	781,522.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-749,260.52	781,522.41

6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	18,269,324.04	6,696,769.27	24,966,093.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-749,260.52	-749,260.52
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)	2,008,046.55	865,137.86	2,873,184.41
其中：1. 基金申购款	10,387,401.78	4,634,642.51	15,022,044.29
2. 基金赎回款	-8,379,355.23	-3,769,504.65	-12,148,859.88
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)	20,277,370.59	6,812,646.61	27,090,017.20
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	18,984,918.55	1,176,707.35	20,161,625.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	781,522.41	781,522.41
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)	-1,073,063.21	-88,286.50	-1,161,349.71
其中：1. 基金申购款	11,205,354.00	605,003.64	11,810,357.64
2. 基金赎回款	-12,278,417.21	-693,290.14	-12,971,707.35
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）	17,911,855.34	1,869,943.26	19,781,798.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.4 所采用的会计政策会计估计与上年度相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含

1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	272,656.61
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	1,487,195.74
合计	1,759,852.35

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 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,858,605.89	22,998,928.29	4,140,322.40
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		18,858,605.89	22,998,928.29	4,140,322.40

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,001.80	-
银行间市场	-	-
合计	1,800,001.80	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	25.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	66.14
应收结算备付金利息	610.38
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	702.16

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,335.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,335.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	72.12
应付证券出借违约金	-
预提费用	17,356.09
合计	17,428.21

6.4.7.9 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
上年度末	16,004,839.67	16,004,839.67
本期申购	4,210,309.64	4,210,309.64
本期赎回（以“-”号填列）	-4,037,688.25	-4,037,688.25
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	16,177,461.06	16,177,461.06

金额单位：人民币元

合煦智远消费主题股票发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额（元）
上年度末	2,264,484.37	2,264,484.37
本期申购	6,177,092.14	6,177,092.14
本期赎回（以“-”号填列）	-4,341,666.98	-4,341,666.98
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	4,099,909.53	4,099,909.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	-17,836.58	5,908,185.28	5,890,348.70
本期利润	1,655,081.79	-2,099,120.56	-444,038.77
本期基金份额交易产生的变动数	36,853.13	808.29	37,661.42

其中：基金申购款	315,704.99	1,661,502.67	1,977,207.66
基金赎回款	-278,851.86	-1,660,694.38	-1,939,546.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,674,098.34	3,809,873.01	5,483,971.35

单位：人民币元

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	-24,110.25	830,530.82	806,420.57
本期利润	215,659.93	-520,881.68	-305,221.75
本期基金份额交易产生的变动数	175,274.43	652,202.01	827,476.44
其中：基金申购款	435,349.09	2,222,085.76	2,657,434.85
基金赎回款	-260,074.66	-1,569,883.75	-1,829,958.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	366,824.11	961,851.15	1,328,675.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	517.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	598.29
结算备付金利息收入	12,275.87
其他	0.18
合计	13,391.64

注：“其他”为“申购款利息收入”。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,365,458.40
减：卖出股票成本总额	2,610,384.54
买卖股票差价收入	1,755,073.86

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内没有发生债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内没有发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内没有发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内没有发生衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	303,788.77
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	303,788.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-2,620,002.24
——股票投资	-2,620,002.24
——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	-2,620,002.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,504.37
基金转换费收入	10.60
合计	43,514.97

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

交易所市场交易费用	16,311.08
银行间市场交易费用	-
合计	16,311.08

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划费	150.00
合计	17,506.09

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 2021 年 1 月 1 日至 2021	上年度可比期间 2020 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 6 月 30 日	1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	198,816.00	139,293.52
其中：支付销售机构的客户维护费	21,723.31	14,568.10

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,135.96	23,215.65

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	合煦智远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	-	226.62	226.62
合计	-	226.62	226.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	235.07	235.07
合计	-	235.07	235.07

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	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	61.84%	-

份额单位：份

项目	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	64.16%	-

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

份额单位：份

关联方名称	合煦智远消费主题股票发起式 A			
	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额 (份)	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额 (份)	持有的基金份额占基金总份额的比例
郑旭	99,885.83	0.6174%	99,885.83	0.6241%
林琦	99.43	0.0006%	99.43	0.0006%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额 (元)	当期利息收入 (元)	期末余额 (元)	当期利息收入 (元)
中国工商银行	272,656.61	517.30	315,068.55	1,407.40

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内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。
(2020 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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 2021 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,759,852.35	-	-	-	1,759,852.35
结算备付金	1,650,327.70	-	-	-	1,650,327.70
交易性金融资产	-	-	-	22,998,928.29	22,998,928.29
买入返售金融资产	1,800,001.80	-	-	-	1,800,001.80
应收利息	-	-	-	702.16	702.16
应收股利	-	-	-	24,788.37	24,788.37
应收申购款	-	-	-	392,144.64	392,144.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,210,181.85	-	-	23,416,563.46	28,626,745.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,402,753.42	1,402,753.42
应付赎回款	-	-	-	71,681.46	71,681.46
应付管理人报酬	-	-	-	32,368.41	32,368.41
应付托管费	-	-	-	5,394.73	5,394.73
应付销售服务费	-	-	-	1,765.99	1,765.99
应付交易费用	-	-	-	5,335.89	5,335.89
其他负债	-	-	-	17,428.21	17,428.21
负债总计	-	-	-	1,536,728.11	1,536,728.11
利率敏感度缺口	5,210,181.85	-	-	21,879,835.35	27,090,017.20
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	510,363.37	-	-	-	510,363.37
结算备付金	1,650,327.70	-	-	-	1,650,327.70
交易性金融资产	-	-	-	20,769,748.46	20,769,748.46
买入返售金融资产	2,300,002.30	-	-	-	2,300,002.30
应收利息	-	-	-	5,475.61	5,475.61
应收股利	-	-	-	13,578.08	13,578.08
应收申购款	-	-	-	15,206.22	15,206.22

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,460,693.37	-	-	20,804,008.37	25,264,701.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	223,504.52	223,504.52
应付管理人报酬	-	-	-	32,515.61	32,515.61
应付托管费	-	-	-	5,419.27	5,419.27
应付销售服务费	-	-	-	1,603.00	1,603.00
应付交易费用	-	-	-	5,473.58	5,473.58
其他负债	-	-	-	30,092.45	30,092.45
负债总计	-	-	-	298,608.43	298,608.43
利率敏感度缺口	4,460,693.37	-	-	20,505,399.94	24,966,093.31

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	5,552,765.23	-	5,552,765.23
应收股利	-	24,788.37	-	24,788.37
资产合计	-	5,577,553.60	-	5,577,553.60
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	5,577,553.60	-	5,577,553.60

单位：人民币元

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	3,962,314.87	-	3,962,314.87
应收股利	-	13,578.08	-	13,578.08
资产合计	-	3,975,892.95	-	3,975,892.95
以外币计价的负债				
负债合计	-		-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,975,892.95	-	3,975,892.95

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	278,877.68	198,794.65
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-278,877.68	-198,794.65

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	22,998,928.29	84.90	20,769,748.46	83.19

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	22,998,928.29	84.90	20,769,748.46	83.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准之外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	980,923.83	1,272,523.93
	2.业绩比较基准下降 5%	-980,923.83	-1,272,523.93

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,998,928.29	80.34
	其中：股票	22,998,928.29	80.34
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	1,800,001.80	6.29
	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	3,410,180.05	11.91

8	其他资产	417,635.17	1.46
9	合计	28,626,745.31	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	16,157,563.06	59.64
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	195,400.00	0.72
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	1,093,200.00	4.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,446,163.06	64.40

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

单位：人民币元

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	3,723,067.07	13.74
日常消费品	587,057.40	2.17
医疗保健	76,397.43	0.28
通信服务	1,166,243.33	4.31
合计	5,552,765.23	20.50

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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	01999	敏华控股	156,000	2,422,151.60	8.94
2	603801	志邦家居	60,200	1,923,992.00	7.10
3	002572	索菲亚	75,000	1,815,000.00	6.70
4	600887	伊利股份	46,400	1,708,912.00	6.31
5	000333	美的集团	22,000	1,570,140.00	5.80
6	000651	格力电器	30,000	1,563,000.00	5.77
7	002925	盈趣科技	39,100	1,521,381.00	5.62
8	000895	双汇发展	39,900	1,268,820.00	4.68
9	600519	贵州茅台	600	1,234,020.00	4.56
10	00700	腾讯控股	2,400	1,166,243.33	4.31
11	002044	美年健康	120,000	1,093,200.00	4.04
12	00921	海信家电	70,000	624,392.83	2.30
13	603833	欧派家居	4,340	616,106.40	2.27
14	01112	H & H 国际控股	20,000	541,684.08	2.00
15	002304	洋河股份	2,500	518,000.00	1.91
16	603816	顾家家居	6,600	510,048.00	1.88
17	600872	中炬高新	10,100	424,402.00	1.57
18	06969	思摩尔国际	10,000	358,210.44	1.32
19	603180	金牌厨柜	5,600	267,064.00	0.99
20	002508	老板电器	5,000	232,500.00	0.86
21	002557	洽洽食品	5,000	215,500.00	0.80
22	00175	吉利汽车	10,000	203,443.56	0.75
23	002127	南极电商	20,000	195,400.00	0.72
24	603317	天味食品	5,100	150,093.00	0.55
25	000858	五粮液	500	148,945.00	0.55
26	000568	泸州老窖	500	117,970.00	0.44
27	02333	长城汽车	5,500	114,868.64	0.42
28	300577	开润股份	5,100	109,293.00	0.40
29	600298	安琪酵母	2,000	108,760.00	0.40
30	688526	科前生物	3,000	108,660.00	0.40
31	01513	丽珠医药	1,500	47,740.59	0.18
32	09633	农夫山泉	1,400	45,373.32	0.17
33	00241	阿里健康	2,000	28,656.84	0.11
34	300616	尚品宅配	100	8,851.00	0.03
35	001208	华菱线缆	842	6,508.66	0.02
36	300572	安车检测	100	3,244.00	0.01
37	603156	养元饮品	100	2,858.00	0.01
38	300824	北鼎股份	100	2,512.00	0.01
39	603385	惠达卫浴	100	983.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002044	美年健康	1,311,100.00	5.25
2	600519	贵州茅台	1,216,389.00	4.87
3	00700	腾讯控股	1,198,469.42	4.80
4	002304	洋河股份	474,520.00	1.90
5	600872	中炬高新	443,835.00	1.78
6	06969	思摩尔国际	356,929.87	1.43
7	002925	盈趣科技	329,800.00	1.32
8	603816	顾家家居	228,574.72	0.92
9	002557	洽洽食品	218,350.00	0.87
10	002127	南极电商	211,100.00	0.85
11	00175	吉利汽车	203,171.47	0.81
12	300572	安车检测	161,932.00	0.65
13	603317	天味食品	147,601.00	0.59
14	000858	五粮液	141,949.00	0.57
15	000910	大亚圣象	125,500.00	0.50
16	000568	泸州老窖	121,310.00	0.49
17	000895	双汇发展	118,263.00	0.47
18	300577	开润股份	115,900.00	0.46
19	02333	长城汽车	111,896.45	0.45
20	600289	安琪酵母	108,940.00	0.44

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	688169	石头科技	790,718.00	3.17
2	603801	志邦家居	615,983.00	2.47
3	600887	伊利股份	487,658.00	1.95
4	002508	老板电器	446,523.58	1.79
5	01999	敏华控股	353,519.58	1.42
6	000333	美的集团	307,320.14	1.23
7	603385	惠达卫浴	293,319.00	1.17
8	603180	金牌厨柜	266,400.00	1.07
9	01513	丽珠医药	245,798.30	0.98
10	002572	索菲亚	166,350.00	0.67
11	300572	安车检测	162,550.00	0.65

12	000910	大亚圣象	119,032.22	0.48
13	003035	南网能源	30,425.92	0.12
14	003040	楚天龙	17,828.10	0.07
15	003031	中瓷电子	15,310.50	0.06
16	001206	依依股份	15,288.60	0.06
17	003029	吉大正元	8,118.90	0.03
18	003028	振邦智能	8,031.36	0.03
19	001202	炬申股份	5,754.60	0.02
20	003032	传智教育	4,670.60	0.02

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	7,459,566.61
卖出股票收入（成交）总额	4,365,458.40

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内没有发生股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内没有发生国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有发生国债期货投资。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	24,788.37
4	应收利息	702.16
5	应收申购款	392,144.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,635.17

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（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
合煦智远消费主题股票发起式 A	1,168	13,850.57	10,003,417.01	61.84%	6,174,044.05	38.16%
合煦智远消费主题股票发起式 C	1,537	2,667.48	-	-	4,099,909.53	100.00%
合计	2,705	7,496.26	10,003,417.01	49.33%	10,273,953.58	50.67%

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	1,133,459.76	7.0064%
	合煦智远消费主题股票发起式 C	4,562.97	0.1113%
	合计	1,138,022.73	5.6123%

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

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	合煦智远消费主题股票发起式 A	0~10
	合煦智远消费主题股票发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	合煦智远消费主题股票发起式 A	>100
	合煦智远消费主题股票发起式 C	0
	合计	>100

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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

份额单位：份

项目	持有份额总数（份）	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数（份）	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,417.01	49.33	10,003,417.01	49.33	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,003,417.01	49.33	10,003,417.01	49.33	-

注：1、本基金自 2019 年 6 月 24 日至 2019 年 6 月 28 日止期间公开发售，于 2019 年 7 月 3 日基金合同正式生效。

- 2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额合计(含利息折份额)10,003,417.01 份。
- 3、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。

§ 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	16,004,839.67	2,264,484.37
本报告期基金总申购份额	4,210,309.64	6,177,092.14
减：报告期基金总赎回份额	4,037,688.25	4,341,666.98
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,177,461.06	4,099,909.53

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

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额（元）	占当期股票成交总额的比例	佣金（元）	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	11,797,943.74	100.00%	9,045.29	100.00%	-

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作为证券经纪商，本基金与证券经纪商中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佣金为 9,045.29 元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额（元）	占当期债券成交总额的比例	成交金额（元）	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额（元）	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	335,600,000.00	100.00%	-	-

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	20210430
2	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（更新）（2021 年第 1 号）、合煦智远基金管理有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210430
3	合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210422
4	合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2020 年年度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210331
5	合煦智远基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210325
6	合煦智远消费主题股票型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告、合煦智远基金管理有限公司旗下所有基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	20210122

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

份额单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额（份）	申购份额（份）	赎回份额（份）	持有份额（份）	份额占比
机构	1	20210101-20210630	10,003,417.01	0.00	0.00	10,003,417.01	49.33%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现的持有基金份额占比超过 20% 的单一份额持有人为发起式资金并处于锁定期内。本基金发起式资金持有基金份额占比超过 20%，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。发起式资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。							

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

2021 年 8 月 31 日