弘毅远方消费升级混合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:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 中期财务会计报告(未经审计) 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.3 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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 43
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 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 45

§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 50
§12 备查文件目录 50
12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金
基金简称	弘毅远方消费升级混合
基金主代码	006644
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月30日
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,152,845.39份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金深入挖掘基于人均收入和人口特征驱动的消费升级过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提上，追求基金资产的稳健持续增值。
投资策略	本基金采用自上而下的方法进行大类资产配置，通过对宏观经济、政策环境、证券市场走势的跟踪和综合分析，进行前瞻性的战略判断，合理确定基金在股票、债券、现金等各类别资产中的投资比例，并适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	弘毅远方基金管理有限公司	广发证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	郁双爽	崔瑞娟
	联系电话	021-53682888	020-66338888
	电子邮箱	service@honyfunds.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-920-8800	95575
传真		021-53682755	020-87555129
注册地址		上海市黄浦区中山东二路600号1幢30层（实际楼层28层）06单元	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层04-07单元	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200010	510627
法定代表人		黄薇薇	林传辉

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	www.honyfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	弘毅远方基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层04-07单元

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年01月01日- 2021年06月30日）
本期已实现收益	14,116,800.80
本期利润	6,631,621.57
加权平均基金份额本期利润	0.1649

本期加权平均净值利润率	7.48%
本期基金份额净值增长率	6.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021年06月30日）
期末可供分配利润	44,876,548.98
期末可供分配基金份额利润	1.2413
期末基金资产净值	81,029,394.37
期末基金份额净值	2.2413
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021年06月30日）
基金份额累计净值增长率	124.13%

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、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.59%	0.73%	-1.36%	0.59%	0.77%	0.14%
过去三个月	7.07%	0.87%	2.71%	0.71%	4.36%	0.16%
过去六个月	6.75%	1.25%	1.04%	0.96%	5.71%	0.29%
过去一年	24.64%	1.43%	18.89%	0.97%	5.75%	0.46%
自基金合同生效起至今	124.13%	1.40%	46.08%	0.98%	78.05%	0.42%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上证国债指数收益率×25%，每日进行再平衡过程。

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

注：本基金基金合同生效日为2019年1月30日。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

弘毅远方基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2017】2439号批准，由弘毅投资（北京）有限公司发起设立。注册资本2.5亿元人民币。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理7只开放式基金，即弘毅远方国企转型升级混合型发起式证券投资基金、弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金、弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金、弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金、弘毅远方经济新动力混合型发起式证券投资基金、弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金和弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金。

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）	证券	说明

		期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
周鹏	本基金基金经理；弘毅远方国企转型升级混合基金、弘毅远方高端制造混合基金基金经理；公司投资研究部副总经理	2020-09-11	-	6年	哥伦比亚大学商学院MBA。2010年加入弘毅投资，担任弘毅投资高级投资经理。期间作为主要成员参与多个PE项目投资。2015年起加入弘毅远方基金管理有限公司筹备组担任投资副总监，现任弘毅远方基金管理有限公司投资研究部副总经理。在加入弘毅投资之前，周鹏先生曾任高盛集团有限公司（Goldman Sachs）高级分析师，美国哈里斯公司分析师。

注：1、基金经理的任职日期及离任日期即本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金的基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资管理符合有关法律法规及基金合同的约定。

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

本基金的基金管理人建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。不同投资组合同一品种的同向交易指令依照价格优先、时间优先、比例分配原则处理，保证交易在各投资组合间的公正处理，保证各投资组合间的利益公平。同时，完善非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。

公司交易部和风控合规部进行日常投资交易行为监控。风控合规部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，并对不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金的基金管理人旗下管理的投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日总成交量5%的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

报告期内权益市场波动较大，结构上继续分化，上证综指累计涨幅3.40%，深证成指和创业板指涨幅分别为4.78%和17.22%。春节前在流动性宽松、爆款基金、年报预告超预期等因素推动下，核心资产带动指数快速拉升；春节后行情快速逆转，核心资产持续大幅回调。随着美债利率的快速上行，全球权益市场的波动均放大，核心资产进一步下挫。二季度后市场企稳反弹，电气设备、电子、汽车、化工、医药生物等领跑市场。上涨的主要驱动因素是经济上行（4月政治局会议提到"辩证看待一季度经济数据"和"要用好稳增长压力较小的窗口期"）和流动性预期转暖（4-5月份地方专项债券发行低于预期，以及汇率升值预期导致外资流入）。

本基金继续在保持对标的成长性要求的同时关注"安全边际"和"性价比",通过合理估值下的盈利提升获取回报，适度降低宏观及赛道波动对回报带来的影响。报告期内股票仓位保持相对稳定，重点配置与主题贴近、长期前景优良的大消费和科技消费赛道，整体持仓变化不大。选股层面坚持自下而上精选个股，重视国内品牌崛起、全球竞争力和全产业链布局，选择基本面扎实、发展趋势良好、关注度与估值还没有泡沫化的公司

作为组合的持仓，在少部分标的出现涨幅较大、出现拥挤和透支未来空间情况下选择基本面同样扎实但性价比更为合适的标的进行调仓，总体保持组合beta的稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方消费升级混合基金份额净值为2.2413元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.75%，同期业绩比较基准收益率为1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内市场波动较大，行情极致演化，不同行业的涨幅差距扩大，其中涨幅最大的行业和最小的行业相差接近40个百分点。我们认为本次极致行情是在流动性边际收紧下的结果，有限的资金涌向高景气度赛道，但从整体看市场并未偏离基本面进入全面估值拉升阶段，不少行业与公司的股价依然在低位徘徊，所以本轮行情大概率还未到尽头，重点在于分辨后续"结构性"变化的方向。

下半年来看，消费仍将处于弱复苏，出口继续受益于全球需求共振叠加补库存，可能延续增长但增速放缓，而制造业投资则随着通胀放缓及企业盈利提升而加速，基建和房地产投资有继续下行的压力。国内经济的增速受到基数影响相比上半年会有明显下降，但经济增速连续低于中国经济的潜在增长中枢的可能性低，叠加下半年地方债供给压力加大，预计货币政策下半年宽松幅度受控。而从全球来看，海外流动性收紧的风险也尚未落地，央行在货币政策执行季报里也新增了"防范外部冲击"的内容。因此在目前的市场条件下高景气赛道虽有可见的高业绩增速支撑，但估值可能难以持续上升，况且长期高成长具有天花板且过程中有不确定性，而永续高成长是不存在的，在基本面不变的情况下，更高的估值也就意味着更低的预期回报和更大的风险，部分估值与基本面不匹配的标的若基本面稍有风险或者短期业绩不达预期则波动可能就会较大，过去的"龙头躺赢"和"赛道躺赢"难以为继，中长期角度来看仍需考虑估值的合理性和安全边际。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由估值委员会确定相应证券的估值方法。估值委员会成员包括公司高级管理人员、投资研究部、基金运营部、风控合规部、信息技术部等相关人员。

基金管理人估值委员会成员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§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，本基金托管人在对弘毅远方消费升级混合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，弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金的管理人--弘毅远方基金管理有限公司在弘毅远方消费升级混合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。本报告期内，弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对弘毅远方基金管理有限公司编制和披露的弘毅远方消费升级混合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：弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,994,007.24	7,810,746.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	73,344,706.04	94,250,513.28
其中：股票投资		73,344,706.04	94,250,513.28
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	2,000,020.00	2,500,025.00
应收证券清算款		-	402,394.42
应收利息	6.4.7.5	2,044.92	2,718.70
应收股利		31,760.57	4,185.30
应收申购款		503,075.44	61,708.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		81,875,614.21	105,032,291.26
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		646,608.58	992,258.29

应付管理人报酬		99,425.79	133,797.33
应付托管费		13,256.76	17,839.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		0.30	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,928.41	174,452.50
负债合计		846,219.84	1,318,347.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	36,152,845.39	49,400,100.93
未分配利润	6.4.7.10	44,876,548.98	54,313,842.57
所有者权益合计		81,029,394.37	103,713,943.50
负债和所有者权益总计		81,875,614.21	105,032,291.26

注:报告截止日2021年6月30日，基金份额净值2.2413元，基金份额总额36,152,845.39份。

6.2 利润表

会计主体：弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		7,599,844.13	38,442,090.32
1.利息收入		70,583.13	147,169.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,414.12	69,785.82
债券利息收入		26.03	3,037.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		26,142.98	74,346.28

收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,919,724.76	34,206,123.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,209,172.12	33,566,843.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	30,211.77	6,000.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	680,340.87	633,279.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-7,485,179.23	3,729,924.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	94,715.47	358,872.65
减：二、费用		968,222.56	2,177,646.71
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	663,117.70	1,171,282.83
2．托管费	6.4.10.2.2	88,415.69	156,171.05
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.20	122,394.62	774,364.91
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		0.11	-
7．其他费用	6.4.7.21	94,294.44	75,827.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,631,621.57	36,264,443.61
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,631,621.57	36,264,443.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06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)	49,400,100.93	54,313,842.57	103,713,943.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,631,621.57	6,631,621.57
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）	-13,247,255.54	-16,068,915.16	-29,316,170.70
其中：1.基金申购款	6,329,234.98	7,748,766.78	14,078,001.76
2.基金赎回款	-19,576,490.52	-23,817,681.94	-43,394,172.46
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）	36,152,845.39	44,876,548.98	81,029,394.37
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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	132,813,239.18	45,897,728.38	178,710,967.56

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,264,443.61	36,264,443.61
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）	-76,459,296.59	-37,182,770.47	-113,642,067.06
其中：1.基金申购款	47,109,779.35	22,169,553.24	69,279,332.59
2.基金赎回款	-123,569,075.94	-59,352,323.71	-182,921,399.65
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）	56,353,942.59	44,979,401.52	101,333,344.11

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:

黄薇薇	杨超	黄怿俊
_____	_____	_____
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

弘毅远方消费升级混合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[2018]1762号《关于准予弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由弘毅远方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《弘毅远方消费升级混合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的发起式基金，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404,097,357.95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0009号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》于2019年1

月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为404,186,836.22份基金份额，其中认购资金利息折合89,478.27份基金份额。本基金的基金管理人为弘毅远方基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,200.02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《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证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：股票资产投资比例为基金资产的50%-95%，其中投资于消费升级主题相关证券比例不低于非现金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上证国债指数收益率×25%。

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》、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

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等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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]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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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06月30日
活期存款	4,440,924.35
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	1,553,082.89
合计	5,994,007.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	69,195,672.62	73,344,706.04	4,149,033.42
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		69,195,672.62	73,344,706.04	4,149,033.42

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工具。

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06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,020.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,020.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,921.92
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	123.00

应收结算备付金利息	-
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	2,044.92

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

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,633.97
应付证券出借违约金	-
应付审计费	25,787.07
应付信息披露费	59,507.37
合计	86,928.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	49,400,100.93	49,400,100.93
本期申购	6,329,234.98	6,329,234.98
本期赎回（以“-”号填列）	-19,576,490.52	-19,576,490.52
本期末	36,152,845.39	36,152,845.39

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,487,964.12	-9,174,121.55	54,313,842.57
本期利润	14,116,800.80	-7,485,179.23	6,631,621.57
本期基金份额交易产生的变动数	-19,012,828.82	2,943,913.66	-16,068,915.16
其中：基金申购款	9,397,385.73	-1,648,618.95	7,748,766.78
基金赎回款	-28,410,214.55	4,592,532.61	-23,817,681.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,591,936.10	-13,715,387.12	44,876,548.98

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	42,848.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,566.09
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	44,414.12

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	51,042,681.58
减：卖出股票成本总额	36,833,509.46
买卖股票差价收入	14,209,172.12

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	30,211.77
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	30,211.77

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	228,138.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	197,900.00
减：应收利息总额	26.81
买卖债券差价收入	30,211.77

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	680,340.87
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	680,340.87

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	-7,485,179.23
——股票投资	-7,485,179.23
——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	-7,485,179.23

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	94,711.96
转换费收入	3.51
合计	94,715.47

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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	122,394.62
银行间市场交易费用	-
合计	122,394.62

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	25,787.07
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	94,294.44

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

截至财务报表批准日，本基金无重大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

无。

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
弘毅远方基金管理有限公司（“弘毅远方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
弘毅投资（北京）有限公司（“弘毅投资”）	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	73,711,808.21	100.00%	497,314,356.35	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日

	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
广发证券	228,138.58	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	280,400,000.00	100.00%	973,600,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	60,525.21	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

广发证券	402,616.98	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	663,117.70	1,171,282.83
其中：支付销售机构的客户维护费	238,150.16	293,033.55

注：支付基金管理人弘毅远方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	88,415.69	156,171.05

注：支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
基金合同生效日（2019年01月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
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	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.66%	17.75%

注：基金管理人持有本基金份额系募集期内认购，适用基金招募说明书中规定的认购费率。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券-托管户	4,440,924.35	42,848.03	7,803,070.12	49,868.51
广发证券-证券户	1,553,082.89	1,566.09	2,095,500.07	19,695.94

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人广发证券存放在交通银行广东省分行营业部；本基金证券户的存款由基金托管人广发证券保管。按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未分配利润。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投

资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证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。本基金深入挖掘基于人均收入和人口特征驱动的消费升级过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提上，追求基金资产的稳健持续增值。

本基金的基金管理人建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的多层级立体风险管理体系。董事会及风险管理委员会、经营管理层及风险控制委员会、督察长、风控合规部以及各个业务部门、各岗位在各自职责范围内依法履行职责，形成高效、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人广发证券的托管账户，开立于交通银行股份有限公司，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；本基金尚未开展银行间同业市场交易。

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。

于2021年6月30日，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，当出现巨额赎回情形时，经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益。本基金的投资市场主要为证券交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券等），在正常情况下均具有良好的流动性。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%。单一投资者及其一致行动人主动持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%。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资产的公允价值。

综合上述各项流动性指标的监控结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

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、债券投资及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06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	5,994,007.24	-	-	-	5,994,007.24
交易性金融资产	-	-	-	73,344,706.04	73,344,706.04
买入返售金融资产	2,000,020.00	-	-	-	2,000,020.00
应收利息	-	-	-	2,044.92	2,044.92
应收股利	-	-	-	31,760.57	31,760.57
应收申购款	-	-	-	503,075.44	503,075.44
资产总计	7,994,027.24	-	-	73,881,586.97	81,875,614.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	646,608.58	646,608.58
应付管理人报酬	-	-	-	99,425.79	99,425.79
应付托管费	-	-	-	13,256.76	13,256.76
应交税费	-	-	-	0.30	0.30
其他负债	-	-	-	86,928.41	86,928.41
负债总计	-	-	-	846,219.84	846,219.84
利率敏感度缺口	7,994,027.24	-	-	73,035,367.13	81,029,394.37
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020年12月31日					
资产					
银行存款	7,810,746.11	-	-	-	7,810,746.11
交易性金融资产	-	-	-	94,250,513.28	94,250,513.28
买入返售金融资产	2,500,025.00	-	-	-	2,500,025.00
应收证券清算款	-	-	-	402,394.42	402,394.42
应收利息	-	-	-	2,718.70	2,718.70
应收股利	-	-	-	4,185.30	4,185.30
应收申购款	-	-	-	61,708.45	61,708.45
资产总计	10,310,771.11	-	-	94,721,520.15	105,032,291.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	992,258.29	992,258.29
应付管理人报酬	-	-	-	133,797.33	133,797.33
应付托管费	-	-	-	17,839.64	17,839.64
其他负债	-	-	-	174,452.50	174,452.50
负债总计	-	-	-	1,318,347.76	1,318,347.76
利率敏感度缺口	10,310,771.11	-	-	93,403,172.39	103,713,943.50

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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（不包括可转债），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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

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06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	-	14,231,879.68	-	14,231,879.68
应收股利	-	31,760.57	-	31,760.57
资产合计	-	14,263,640.25	-	14,263,640.25
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	-	14,263,640.25	-	14,263,640.25
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	-	19,694,544.33	-	19,694,544.33
应收股利	-	4,185.30	-	4,185.30
应收证券清算款	-	402,394.42	-	402,394.42
资产合计	-	20,101,124.05	-	20,101,124.05
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	-	20,101,124.05	-	20,101,124.05

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	713,182.01	1,005,056.20
	所有外币相对人民币贬值5%	-713,182.01	-1,005,056.20

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，主要采用自下而上的选股方法，通过对上市公司基本面和风险分析，精选出未来发展前景看好并且有助于推动人民生活品质提升的上市公司股票进行投资。本基金的基金管理人通过对宏观经济、政策环境、证券市场走势的跟踪和综合分析，进行前瞻性的战略判断，合理确定基金在股票、债券、现金等各类别资产中的投资比例，并适时进行动态调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产投资比例为基金资产的50%-95%，其中投资于消费升级主题相关证券比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	73,344,706.04	90.52	94,250,513.28	90.88
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	73,344,706.04	90.52	94,250,513.28	90.88

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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	4,060,655.55	5,829,510.90
	业绩比较基准下降5%	-4,060,655.55	-5,829,510.90

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 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	73,344,706.04	89.58
	其中：股票	73,344,706.04	89.58
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	2,000,020.00	2.44
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,994,007.24	7.32
8	其他各项资产	536,880.93	0.66
9	合计	81,875,614.21	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为14,231,879.68元，占基金资产净值比例为17.56%。

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

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	48,112,558.42	59.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,739,030.40	2.15
J	金融业	34,721.10	0.04
K	房地产业	1,842,500.00	2.27
L	租赁和商务服务业	3,105,300.00	3.83
M	科学研究和技术服务业	1,381,840.00	1.71
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	2,881,200.00	3.56
S	综合	-	-
	合计	59,112,826.36	72.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	435,593.88	0.54
医疗保健	5,474,653.72	6.76
信息技术	7,058,201.81	8.71
电信服务	1,263,430.27	1.56
合计	14,231,879.68	17.56

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 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	002415	海康威视	120,000	7,740,000.00	9.55
2	H02018	瑞声科技	146,000	7,058,201.81	8.71
3	600885	宏发股份	96,800	6,069,360.00	7.49
4	000895	双汇发展	143,600	4,566,480.00	5.64
5	000725	京东方 A	690,000	4,305,600.00	5.31
6	600438	通威股份	95,000	4,110,650.00	5.07
7	002001	新 和 成	132,000	3,785,760.00	4.67
8	H01177	中国生物制药	502,000	3,182,905.70	3.93

9	002027	分众传媒	330,000	3,105,300.00	3.83
10	300413	芒果超媒	42,000	2,881,200.00	3.56
11	300630	普利制药	51,000	2,672,400.00	3.30
12	002332	仙琚制药	190,000	2,382,600.00	2.94
13	002422	科伦药业	116,000	2,314,200.00	2.86
14	H01066	威高股份	152,000	2,291,748.02	2.83
15	600690	海尔智家	87,000	2,254,170.00	2.78
16	002050	三花智控	80,000	1,918,400.00	2.37
17	600185	格力地产	250,000	1,842,500.00	2.27
18	300607	拓斯达	52,000	1,809,600.00	2.23
19	300383	光环新网	120,000	1,726,800.00	2.13
20	000651	格力电器	30,000	1,563,000.00	1.93
21	000710	贝瑞基因	46,000	1,381,840.00	1.71
22	002991	甘源食品	21,000	1,266,930.00	1.56
23	H00700	腾讯控股	2,600	1,263,430.27	1.56
24	002833	弘亚数控	23,800	922,250.00	1.14
25	H00288	万洲国际	75,000	435,593.88	0.54
26	600521	华海药业	20,000	417,600.00	0.52
27	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
28	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
29	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
30	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
31	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

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	002991	甘源食品	3,017,694.30	2.91
2	300413	芒果超媒	2,341,556.00	2.26

3	300630	普利制药	2,333,065.00	2.25
4	300607	拓斯达	2,101,793.00	2.03
5	H01066	威高股份	1,830,532.69	1.76
6	000651	格力电器	1,787,198.00	1.72
7	002050	三花智控	1,675,491.00	1.62
8	H00700	腾讯控股	1,287,462.66	1.24
9	H01177	中国生物制药	918,997.72	0.89
10	H00288	万洲国际	862,976.25	0.83
11	002833	弘亚数控	851,375.00	0.82
12	H00175	吉利汽车	634,088.01	0.61
13	002422	科伦药业	539,770.00	0.52
14	600521	华海药业	418,300.00	0.40
15	000725	京东方 A	405,000.00	0.39
16	300395	菲利华	396,230.00	0.38
17	002179	中航光电	394,590.00	0.38
18	300383	光环新网	331,560.00	0.32
19	000895	双汇发展	249,715.00	0.24
20	000710	贝瑞基因	145,906.00	0.14

注：本项"买入金额"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。

7.4.2 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	603882	金域医学	7,697,139.00	7.42
2	H00700	腾讯控股	4,316,359.79	4.16
3	002475	立讯精密	3,952,451.00	3.81
4	H00268	金蝶国际	3,646,768.53	3.52
5	H01579	颐海国际	3,044,033.44	2.94
6	002415	海康威视	2,956,442.01	2.85

7	603259	药明康德	2,318,410.91	2.24
8	002027	分众传媒	2,023,071.00	1.95
9	600690	海尔智家	1,838,293.00	1.77
10	002216	三全食品	1,828,773.00	1.76
11	600885	宏发股份	1,705,664.00	1.64
12	002001	新 和 成	1,653,623.00	1.59
13	000100	TCL科技	1,489,770.00	1.44
14	601012	隆基股份	1,437,491.00	1.39
15	002422	科伦药业	1,373,345.00	1.32
16	H02018	瑞声科技	1,298,952.78	1.25
17	000725	京东方 A	1,075,265.00	1.04
18	600438	通威股份	958,705.00	0.92
19	002991	甘源食品	871,771.58	0.84
20	H00175	吉利汽车	869,499.59	0.84

注：本项"卖出金额"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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,412,881.45
卖出股票收入（成交）总额	51,042,681.58

注：本项"买入股票的成本（成交）总额"和"卖出股票的收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	31,760.57

4	应收利息	2,044.92
5	应收申购款	503,075.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,880.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限股票。

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，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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,883	12,540.01	10,360,948.65	28.66%	25,791,896.74	71.34%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	800,772.56	2.21%

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	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	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	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	10,000,200.02	27.66%	10,000,200.02	27.66%	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	10,000,200.02	27.66%	10,000,200.02	27.66%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年01月30日)基金份额总额	404,186,836.22
本报告期期初基金份额总额	49,400,100.93
本报告期基金总申购份额	6,329,234.98
减：本报告期基金总赎回份额	19,576,490.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,152,845.39

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人重大人事变动

经公司第一届董事会第十九次会议审议通过，自2021年1月18日起，郁双爽担任公司督察长，黄薇薇不再代任督察长职务。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、本报告期内，公司与前任总经理李湧关于公司第一届董事会第十一次会议决议效力确认纠纷一案，经上海市第二中级人民法院终审判决，驳回了李湧关于公司第一届董事会第十一次会议决议不成立的诉讼请求。李湧不服上海市第二中级人民法院作出的上述判决，向上海市高级人民法院提出再审申请，上海市高级人民法院经审理后驳回了其再审申请。

2、本报告期内未发生涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

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，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

广发证券	2	73,711,808.21	100.00%	60,525.21	100.00%	-

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	228,138.58	100.00%	280,400,000.00	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	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2020年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2021-01-01
2	弘毅远方基金管理有限公司关于住所变更公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2021-01-06
3	弘毅远方基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2021-01-20
4	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
5	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2021-01-21
6	弘毅远方基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2021-01-22

	法分子冒用公司名义进行诈骗活动的特别提示公告		
7	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书（2021年第1号）	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2021-02-09
8	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2021-02-09
9	弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2021-02-10
10	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
11	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金2020年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2021-03-30
12	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-21
13	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2021-04-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机	1	20210101-20210630	10,000,200.02	-	-	10,000,200.02	27.66%

构							
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。 2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。 3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。 4、基金运作发生重大变更的风险 极端情况下，单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产净值连续低于5000万元，需要根据基金合同约定采取相关解决措施，从而使得基金运作发生重大变更。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2021年2月10日发布《弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告》，公司股东弘毅投资（北京）有限公司向公司增加出资人民币3000万元。增资完成后，公司注册资本由人民币2.2亿元增加至人民币2.5亿元，弘毅投资（北京）有限公司持股比例仍为100%。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

2、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、关于申请募集注册弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站www.honyfunds.com查阅和下载。

弘毅远方基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日