
弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09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

报告送出日期:2021年10月26日

§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。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	弘毅远方高端制造混合
基金主代码	011886
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年06月01日
报告期末基金份额总额	72,930,300.90份
投资目标	本基金以自下而上选股策略为主，以基本面分析为立足点，深度挖掘、精选个股，同时辅以自上而下行业配置策略，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于高端制造主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期超额回报。
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	中证高端装备制造指数收益率×65%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%
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。本基金投资港股通标的股票，将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。本基金投资新三板精选层股票的，可能面临流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场股价波动风险、投资集中风险等。	
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	
下属分级基金的基金简称	弘毅远方高端制造混合A	弘毅远方高端制造混合C
下属分级基金的交易代码	011886	011887
报告期末下属分级基金的份额总额	56,112,013.09份	16,818,287.81份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	弘毅远方高端制造混合A	弘毅远方高端制造混合C
1.本期已实现收益	1,838,431.78	548,602.10
2.本期利润	-2,226,245.10	-643,577.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0333	-0.0287
4.期末基金资产净值	54,839,193.30	16,409,600.37
5.期末基金份额净值	0.9773	0.9757

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

弘毅远方高端制造混合A净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.93%	1.01%	0.89%	1.11%	-4.82%	-0.10%

自基金合同生效起至今	-2.27%	0.91%	6.05%	1.05%	-8.32%	-0.14%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

弘毅远方高端制造混合C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-4.05%	1.01%	0.89%	1.11%	-4.94%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-2.43%	0.91%	6.05%	1.05%	-8.48%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

弘毅远方高端制造混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月01日-2021年09月30日)



弘毅远方高端制造混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月01日-2021年09月30日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 06 月 01 日。基金合同生效日至报告期末，基金运作未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2021 年 9 月 30 日，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		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基金经理；公司投资研究部副总经理	2021-06-01	-	6 年	哥伦比亚大学商学院MB A。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。
樊可	本基金基金经理；弘毅远方经济新动力混合基金基金经理	2021-06-01	-	3 年	上海交通大学工商管理硕士。2018年8月加入弘毅远方基金管理有限公司，现任弘毅远方基金管理有限公司投资研究部基金经理。在加入弘毅远方基金管理有限公司之前，樊可先生先后担任中核集团秦山核电厂工程师、中国广核集团设计院高级工程师及高级主管、民生证券研究院高级研究员（高端制造）。

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。

4.1.1 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《公平交易管理办法》，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。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内市场震荡下行，上证综指自3591.20点下跌至3568.17点，跌幅0.64%，深证成指和创业板指跌幅分别为5.62%和6.69%。具体看，7月份央行宣布全面降准0.5个百分点，释放流动性约1万亿元用于置换MLF和弥补税期流动性缺口，提升了市场的风险偏好，沪深两市成交额在三季度中连续49个交易日破万亿，创历史记录，交易情绪较为活跃，因而指数整体调整时结构的分化较大。上游周期资源股领涨市场，有色金属、采掘和公用事业行业涨幅居前，而消费板块表现相对较差，医药生物、食品饮料和休闲服务行业跌幅居前。主要影响因素包括：1）三季度经济增长动能下降，叠加疫情的反复，社零消费数据持续不及预期；2）碳中和目标下能耗双控政策持续加码引发限电停产，部分上游原材料价格大幅上涨；3）双减、房地产政策和反垄断等造成对未来政策风险扩散的担忧。

展望四季度的经济增速在高基数下压力加大，消费、投资修复仍需时间，流动性预计维持合理充裕，大幅变动的可能性不大。我们认为在此背景下应更加注重企业盈利增长的确定性，以业绩的增长对冲可能的下行风险。

本基金报告期内仍处于建仓期，基于市场环境稳步提升权益仓位，截至报告期末股票仓位已符合基金合同有关投资比例的约定。在标的选择上重点配置包括新能源、军工、机械、自动化、汽车及电子等大制造相关的行业，遵循价值投资理念，以自下而上的原则，选择基本面扎实、长期发展趋势良好、盈利和估值匹配的公司进行配置，旨在为投资者创造长期稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方高端制造混合A基金份额净值为0.9773元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.93%，同期业绩比较基准收益率为0.89%；截至报告期末弘毅远方高端制造混合C基金份额净值为0.9757元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.05%，同期业绩比较基准收益率为0.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例
----	----	-------	-----------

			(%)
1	权益投资	62,779,687.96	87.73
	其中：股票	62,779,687.96	87.73
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	8,566,157.06	11.97
8	其他资产	213,175.31	0.30
9	合计	71,559,020.33	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7,219,556.21元，占基金资产净值比例为10.13%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	49,191,791.75	69.04
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	2,810,050.00	3.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	899,300.00	1.26
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,658,990.00	3.73
S	综合	-	-
	合计	55,560,131.75	77.98

5.2.2 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(%)
非日常生活消费品	4,345,449.23	6.10
医疗保健	1,326,698.03	1.86
信息技术	1,547,408.95	2.17
合计	7,219,556.21	10.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600885	宏发股份	63,000	3,929,940.00	5.52
2	600438	通威股份	75,000	3,820,500.00	5.36
3	002353	杰瑞股份	70,000	3,389,400.00	4.76
4	002415	海康威视	57,000	3,135,000.00	4.40
5	002352	顺丰控股	43,000	2,810,050.00	3.94
6	H00175	吉利汽车	150,000	2,792,833.65	3.92
7	300395	菲利华	55,000	2,736,800.00	3.84
8	300413	芒果超媒	61,000	2,658,990.00	3.73

9	603728	鸣志电器	134,930	2,250,632.40	3.16
10	000725	京东方 A	445,000	2,247,250.00	3.15

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	835640	富士达	22,000	558,580.00	0.78
2	835185	贝特瑞	1,800	292,914.00	0.41
3	835368	连城数控	1,200	141,588.00	0.20
合计	-	-	25,000	993,082.00	1.39

5.4 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。

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

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	5,515.52
4	应收利息	-652.05
5	应收申购款	208,311.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	213,175.31

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方高端制造混合 A	弘毅远方高端制造混合 C
--	-----------------	-----------------

报告期期初基金份额总额	73,297,794.71	26,826,494.90
报告期期间基金总申购份额	1,911,013.90	2,422,623.79
减：报告期期间基金总赎回份额	19,096,795.52	12,430,830.88
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	56,112,013.09	16,818,287.81

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或转换本基金的情况。

§8 报告期末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 自有资金	-	-	-	-	-
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	10,001,400.14	13.71%	10,001,400.14	13.71%	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,400.14	13.71%	10,001,400.14	13.71%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方高端制造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高端制造混合型发起式证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方高端制造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。

10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

10.3 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。