

弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月28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。

本报告期自2021年2月8日起至12月31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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 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	61
8.7 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	61
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	61
8.9 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	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3 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	64
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§10 开放式基金份额变动	65
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金	
基金简称	弘毅远方港股通智选领航混合	
基金主代码	011157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年02月08日	
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	565,606,111.35份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C
下属分级基金的交易代码	011157	011158
报告期末下属分级基金的份额总额	448,278,169.08份	117,327,942.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过持续、深入的产业及基本面研究，叠加大数据工具的使用，在沪港深市场内，参考全球投资者通用的核心资产定价标准，挖掘具有发展潜力和估值优势的引领创新及升级的优质公司。在严格控制基本面风险、流动性风险及估值风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金紧密跟踪国内外市场环境变化，通过对各个主要经济体的运行态势、央行政策变化、证券市场状况、国际资金及情绪动态等因素的紧密跟踪及深入研究，自上而下的判断宏观经济运行周期及发展趋势，分析评估各类资产与市场的风险和预期收益，确定不同市场间股票、现金等大类资产的配置比例，并适时进行调整。与此同时，深入了解各行业状况、以自下而上

	的视角，挖掘行业的价值性和成长性，结合对基本面与走势趋势性的把握，综合评估产业在不同时间段、不同市场间的风险收益水平。采用动态策略，适时调整资产配置比例，有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益，力求实现基金财产的长期稳定增值。本基金对于港股通标的股票的投资，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×75%+中债综合全价(总值)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。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郁双爽
	联系电话	021-53682888
	电子邮箱	service@honyfunds.com
客户服务电话	400-920-8800	95527
传真	021-53682755	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路1788号
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	杭州市拱墅区延安路368号
邮政编码	200010	310006
法定代表人	黄薇薇	张荣森(代为履行法定代表人职责)

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于2022年1月14日以书面传签方式召开第六届董事会2022年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.honyfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
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、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2021年02月08日（基金合同生效日）- 2021年12月31日	
	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C
本期已实现收益	-90,886,026.69	-25,398,628.62
本期利润	-96,390,642.66	-25,290,145.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1943	-0.1789
本期加权平均净值利润率	-20.89%	-19.19%
本期基金份额净值增长率	-20.63%	-20.99%

3.1.2 期末数据和指标	2021年末	
期末可供分配利润	-92,485,407.75	-24,622,699.06
期末可供分配基金份额利润	-0.2063	-0.2099
期末基金资产净值	355,792,761.33	92,705,243.21
期末基金份额净值	0.7937	0.7901
3.1.3 累计期末指标	2021年末	
基金份额累计净值增长率	-20.63%	-20.99%

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

弘毅远方港股通智选领航混合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
过去三个月	-4.98%	1.22%	-4.76%	0.75%	-0.22%	0.47%
过去六个月	-23.89%	1.46%	-15.15%	0.93%	-8.74%	0.53%
自基金合同生效起至今	-20.63%	1.27%	-16.10%	0.90%	-4.53%	0.37%

弘毅远方港股通智选领航混合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	-5.10%	1.22%	-4.76%	0.75%	-0.34%	0.47%

过去六个月	-24.09%	1.46%	-15.15%	0.93%	-8.94%	0.53%
自基金合同生效起至今	-20.99%	1.26%	-16.10%	0.90%	-4.89%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×75%+中债综合全价(总值)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

弘毅远方港股通智选领航混合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02月08日-2021年12月31日)



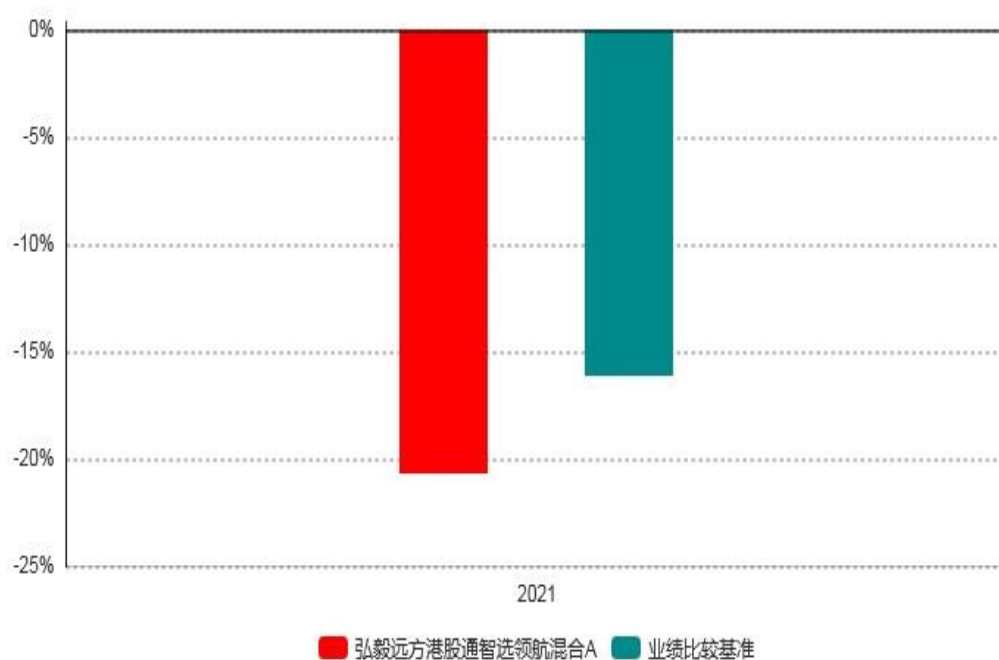
弘毅远方港股通智选领航混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

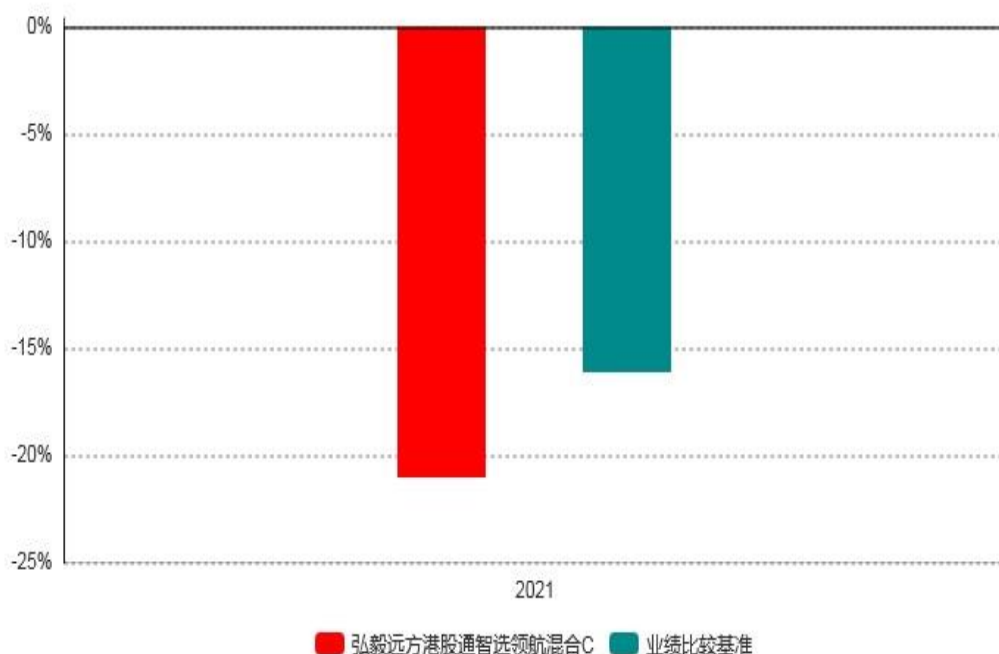
(2021年02月08日-2021年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 8 日。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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。

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





注：图示日期为 2021 年 2 月 8 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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（截至2021年12月31日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2021年12月31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、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）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许智程	本基金基金经理	2021-02-08	-	13 年	英国帝国理工学院金融学硕士。2020年1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，许智程先生先后担任彭博有限合伙企业高级证券专家、国泰君安咨询服务有限公司高级证券分析员、大华继显（香港）有限公司中小市值及工业研究主管和前方基金管理有限公司投资经理兼高级证券分析员。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金的基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资研究的负责人、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，投资决策委员会和分管投资研究的负责人等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须履行严格的审批程序。

（2）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。

（3）建立全公司适用的备选标的库和交易对手备选库，明确备选库的建立和维护程序。在全公司适用备选标的库的基础上，根据不同投资组合各自的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的备选标的库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

（4）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。

（5）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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

2021年疫情在全球范围继续蔓延、疫苗快速落地，全球强劲复苏，中国GDP实现双位数增长。2021年宏观经济向上，信用收缩，权益市场主要靠业绩驱动，整体估值收缩。全年，上证综指自期初3473.07点上涨至3639.78点，累计涨幅4.80%，实现年度三连阳。深证成指和创业板指涨幅分别为2.67%和12.02%；受互联网监管政策影响，恒生指数和恒生科技指涨幅分别为-14.08%和-32.70%。2021年中小盘占优，小盘指数全年上涨22.7%，而中盘指数小幅上涨9.2%，大盘指数上涨-4.5%。

从节奏上看，一季度以茅指数为代表的抱团股春节前大幅走高，春节后大幅回落；二季度市场情绪转暖，宁组合成为市场交易主线，成长风格占优；三季度受能耗双控的影响，周期股大幅上行；四季度经济下行压力增大，受保供稳价等政策密集调控的影响，大宗商品价格回落，周期股随之走弱，成长板块总体维持高景气度，表现强势。

从行业上看，高景气行业中电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁涨幅位居前五。消费行业受疫情反复的影响，盈利下行，消费风格在2021年持续回调，食品饮料、医药、家电等主要消费行业表现不佳。金融地产板块受地产严监管政策的影响，银行、地产、非银收益均为负。全年来看，碳中和是2021年投资主线。无论是光伏、风电等新能源链条，还是煤炭等传统能源，2021年的超额收益均受益于新一轮能源革命的大环境。此外，专精特新政策推动部分中小市值股票上涨。综合来看，景气度策略是2021年最有效的策略，有限的资金涌向高景气度下的业绩确定性。

我们年度的策略，主要围绕着寻找优质价值成长型标的而展开，用穿越周期的视角，寻找性价比高的中长期收益。年内基金重点关注的配置方向包括：1）竞争力不断增强、具备国际比较优势的重点科技、能源、材料、制造、医药等领域；2）中长期的国产替代机会；3）有商业模式优势的优秀公司；以及4）在诸多不确定事件演绎的过程中（如缺芯片、地产行业危机、奥密克戎进展、地缘政治事件等），结合情绪、资金等维度，聚焦短中期估值能够修复的投资逻辑。

基于市场环境、估值、潜在增速、资金青睐情况，基金保持中高仓位。虽然市场年内波幅较大，但大多数我们关注公司的基本面依然支持震荡向上的主方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方港股通智选领航混合A基金份额净值为0.7937元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-20.63%，同期业绩比较基准收益率为-16.10%；截至报

告期末弘毅远方港股通智选领航混合C基金份额净值为0.7901元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-20.99%，同期业绩比较基准收益率为-16.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，我们认为经济向下压力仍存在，政策将持续发力稳增长。经济压力方面，预计2022年出口将回落，出口受益于价格的因素将减弱，高基数下出口下行，同时房地产投资仍将继续下行，从而加大经济下行压力。消费短期难以恢复到疫情前，恢复正常关键在于疫情控制，随着疫苗的推进和新冠药的获批，国内疫情预计将得到很好的控制，并有利于消费者信心恢复和消费行业复苏。今年主要的经济动力来自于投资端，发行的专项债将逐步形成有效投资，预计稳增长政策将持续发力，制造业投资和基建投资增速将加快。

流动性方面，2022年全球流动性进入收紧周期，美联储加息箭在弦上，其他国家预计也将跟随收紧货币政策。国内货币政策将以我为主，以稳为主，结构性政策维持平稳偏松，整体流动性充裕。2022年1月，央行降准降息体现了货币政策的支持已经逐渐开始发力，货币政策助力稳增长、产业转型、双碳和就业。同时居民财富管理搬家，资金持续流入股市，微观流动性充裕下市场不乏结构性机会。

政策方向上，中共中央政治局2021年12月6日召开会议，会议强调政策“稳字当头、稳中求进”，“着力稳定宏观经济大盘”，政策稳增长意图明显。中央经济工作会的基本精神大体延续了政治局会议的总基调，2022年的经济工作重点之一是“稳增长”，同时也强调，经济工作要稳字当头、稳中求进，各地区各部门要担负起稳定宏观经济责任，各方面要积极推出有利于经济稳定的政策，政策发力适当靠前。

港股端而言，市场在经历了较大幅度下跌之后，目前呈现出较为明显的低风险属性。美国缩减流动性所必须考虑的因素过于复杂，风险溢价有向外转移的趋势。虽地缘政治事件加大了全球资金的恐慌性，但流动性环境对港股的影响趋于钝化。经验而言，地缘政治所带来的冲击偏向短期，在恐慌奇点之后，往往反弹也会在低估值、高增速市场显现。叠加港股正受到地产流动性事件、本地疫情爆发、国内监管政策预期加强等事件性因素的影响，而诸多事件性因素也即将明朗化，情况都将会看到好转的契机，代表着港股在经历深跌后，反弹的确定性也在逐步增加。

对A股的判断而言，虽中期维度看，不认为赛道股的行情已经结束，但推高2021年赛道股的重要因素出现边际放缓，预期的下降将会为部分行业带来估值压力。结合绝对基本面、相对基本面、国内外贴现率、政策环境等因素，我们认为股市存量资金将会向政策溢价赛道倾斜。在此背景下，认为A股会持续再平衡。在市场的估值寻锚过程中，我们坚持“增长是最重要抓手”的观点。

从本次两会政府工作报告来看，2022年经济增速目标为5.5%，政策传递出的稳增长信号强烈。而全球2022年GDP增速普遍下降，通胀压力不减，全球供应链仍将紊乱，效

率低下，优质的增长变得更为稀缺，不仅代表着中国出口需求及被依赖性依然重要，也代表着港股、A股部分物美价廉公司的稀缺性的凸显。美国货币政策回归正常化，购债及加息背景下，就业及经济有望缓慢恢复常态，此过程中，必要的流动性不会缺失，且需要中国在出口、气候、地缘政治等方面的配合；叠加疫情的磨底好转，海外的情绪与预期差有望收窄，并且朝着有利于中国经济的方向发展。

基于此我们认为，短期内海外资金以及南下资金对在港上市的中国优质资产的风险偏好会逐步改善。近期，A股及海外股市出现高位调整，结合增速及估值，港股市场的吸引力持续凸显。一方面，我们认为针对科技平台、社会服务、生物医药等领域的监管已在情绪端得到充分反映，宏观方向的稳增长预期也有所升温，目前的市场已经呈现出布局的机会，对于已经跌至历史估值区间低位的科技、生物医药类公司尤为明显。长期而言，我们相信中国产业及消费升级趋势的延续。我们持续重点看好具备政策利好的板块，如物联网、智能驾驶、新能源、先进制造、大消费及医药等板块中的优质企业，并且结合了“避风港”、“攻守兼备”、“通胀输出”、“文创出海”、“疫情解封”、“资金倾斜”、“预期差加大”等横向维度标签，构成我们下一阶段的重点关注方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》和相关法律法规的要求，公司恪尽职守，依法履行基金管理人的职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本年度主要的监察稽核工作如下：

（一）持续推动及规范公司的制度体系建设，组织拟定公司2021年制度体系建设规划并跟进落实

本年度内公司重点对制度规范体系进行查漏补缺，结合公司业务发展规划，牵头组织公司各部门拟定2021年制度体系建设规划，由各部门跟进落实并定期回顾，确保公司的制度体系建设可以有效支持现有的业务发展。

（二）加大审计力度，扩大内部审计覆盖面

本年度内，公司完成各季度员工及关联人投资申报稽核、通信管理稽核、基金直播内容稽核等定期或不定期稽核，并开展投研交专项审计、人力资源专项审计、公司治理专项审计、运营专项审计、IT专项审计、反洗钱年度专项审计及投资者适当性管理自查等专项审计工作，扩大审计覆盖面。

（三）建立公司及部门内部培训机制，深化公司合规文化建设

本年度内，公司继续主动加强合规文化建设，多次组织召开公司内部合规培训对公司员工进行合规宣导，同时继续加快新员工以及特殊岗位员工上岗前合规培训的时效，并要求各部门落实内部培训责任，强调对各工作节点的风险点的识别管控，将风险防范落实到业务第一线。另外，公司对投资研究体系相关工作机制进行分析、梳理，优化相

关业务流程，帮助其更好防范风险与提升合规观念，从而真正以“维护投资者利益优先、公平对待投资者”的原则约束员工的执业行为，进而建立健全更具内生性的公司合规风控文化。

（四）持续完善基金产品的风险管控措施

本年度内，公司重点对固定收益业务、新三板股票业务（北京证券交易所股票）等进行了梳理，旨在完善相关业务流程，确保各项业务合法、合规开展。

公司持续利用信息技术手段提高风险控制和监测的水平和能力，完善各类投资业务在事前、事中和事后的风险管控机制，提升风险管理水平，有效防范合规风险和操作风险。

4.7 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验。

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。

4.8 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 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人--弘毅远方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年年度报告中财务指标、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复核，以上内容真实、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(2022)第21037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	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金(以下简称"弘毅远方港股通智选领航混合")的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年2月8日(基金合同生效日)至2021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。 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,公允反映了弘毅远方港股通智选领航混合2021年12月31日的财务状况以及2021年2月8日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于弘毅远方港股通智选领航混合,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	弘毅远方港股通智选领航混合的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司(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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估弘毅远方港股通智选领航混合的持续经营能力,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弘毅远方港股通智选领航混合、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督弘毅远方港股通智选领航混合的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。

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：(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。(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。(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。(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，就可能导致对弘毅远方港股通智选领航混合持续经营能力产生重大疑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弘毅远方港股通智选领航混合不能持续经营。(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。

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。
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	张勇 柴瀚英
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2022-03-23

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	23,034,107.48
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	412,774,041.53
其中：股票投资		412,774,041.53
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		-
应收利息	7.4.7.5	5,939.50
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.6	14,014,000.00
资产总计		449,828,088.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021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		467,712.02
应付管理人报酬		580,226.45
应付托管费		96,704.38
应付销售服务费		39,866.53
应付交易费用	7.4.7.7	-
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	145,574.59
负债合计		1,330,083.97
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	565,606,111.35
未分配利润	7.4.7.10	-117,108,106.81
所有者权益合计		448,498,004.54
负债和所有者权益总计		449,828,088.51

注：1、报告截止日2021年12月31日，基金份额总额565,606,111.35份，其中弘毅远方港股通智选领航混合A的基金份额净值0.7937元，基金份额总额448,278,169.08份，基金资产净值355,792,761.33元；弘毅远方港股通智选领航混合C的基金份额净值0.7901元，基金份额总额117,327,942.27份，基金资产净值92,705,243.21元。

2、本财务报表的实际编制期间为2021年2月8日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年02月08日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
一、收入		-103,691,455.07
1.利息收入		689,638.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	466,111.34
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		206,361.04
证券出借利息收入		-
其他利息收入		17,165.62
2.投资收益（损失以“-”填列）		-99,207,381.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-105,165,853.12
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
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	5,958,471.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,396,133.04
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	222,421.38
减：二、费用		17,989,333.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,966,268.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,327,711.42

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	591,122.75
4. 交易费用	7.4.7.19	7,955,746.27
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	7.4.7.20	148,484.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-121,680,788.35
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-121,680,788.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021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)	717,738,823.89	-	717,738,823.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-121,680,788.35	-121,680,788.35
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）	-152,132,712.54	4,572,681.54	-147,560,031.00
其中：1.基金申购款	26,735,490.51	-2,971,493.35	23,763,997.16
2.基金赎回款	-178,868,203.05	7,544,174.89	-171,324,028.16
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）	565,606,111.35	-117,108,106.81	448,498,004.54

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：

黄薇薇

杨超

黄怵俊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

弘毅远方港股通智选领航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[2020]3447号《关于准予弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，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《弘毅远方港股通智选领航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，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717,658,924.18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(2021)第0110号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年2月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为717,738,823.89份基金份额，其中认购资金利息折合79,899.71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，基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,138.90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《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金招募说明书》，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、申购基金份额时收取认购、申购费用，而不计提销售服务费的基金份额，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的基金份额，称为C类基金份额。各基金份额类别分别设置代码、计算公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方港股通智选领航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、创业板及其他经中国证监会允许上市的股

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)、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、股指期货、股票期权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:股票资产的比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:恒生指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 75%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司于2022年3月23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》、《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》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2021年2月8日(基金合同生效日)至2021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2021年12月31日的财务状况以及2021年2月8日(基金合同生效日)至2021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2021年2月8日(基金合同生效日)至2021年12月31日。

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

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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和债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和债券，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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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。

(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。

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 2021年12月31日
活期存款	993,823.94
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	22,040,283.54
合计	23,034,107.48

注: 其他存款本期末余额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 2021年12月31日
----	--------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		418,170,174.57	412,774,041.53	-5,396,133.04
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		418,170,174.57	412,774,041.53	-5,396,133.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	80.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,693.30
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	3,165.62
合计	5,939.50

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
其他应收款	-
待摊费用	-
期货备付金	14,014,000.00
合计	14,014,000.00

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	574.59
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	70,000.00
预提费用-信息披露费	75,000.00
合计	145,574.59

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 弘毅远方港股通智选领航混合A

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方港股通智选领航混合A)	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
------------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	542,156,264.37	542,156,264.37
本期申购	8,969,719.10	8,969,719.10
本期赎回（以“-”号填列）	-102,847,814.39	-102,847,814.39
本期末	448,278,169.08	448,278,169.08

7.4.7.9.2 弘毅远方港股通智选领航混合C

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方港股通智选领航混合C)	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	175,582,559.52	175,582,559.52
本期申购	17,765,771.41	17,765,771.41
本期赎回（以“-”号填列）	-76,020,388.66	-76,020,388.66
本期末	117,327,942.27	117,327,942.27

注：1、如果本报告期间发生红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、本基金自2021年1月18日至2021年2月3日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币717,658,924.18元，折合为717,658,924.18份基金份额(其中A类基金份额542,100,800.30份，C类基金份额175,558,123.88份)。根据《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》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79,899.71元在本基金成立后，折合为79,899.71份基金份额(其中A类基金份额55,464.07份，C类基金份额24,435.64份)，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 弘毅远方港股通智选领航混合A

单位：人民币元

项目 (弘毅远方港股通智选领航混合A)	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	-90,886,026.69	-5,504,615.97	-96,390,642.66
本期基金份额交易产	5,627,922.24	-1,722,687.33	3,905,234.91

生的变动数			
其中：基金申购款	-887,864.56	-57,918.45	-945,783.01
基金赎回款	6,515,786.80	-1,664,768.88	4,851,017.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,258,104.45	-7,227,303.30	-92,485,407.75

7.4.7.10.2 弘毅远方港股通智选领航混合C

单位：人民币元

项目 (弘毅远方港股通智选 领航混合C)	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	-25,398,628.62	108,482.93	-25,290,145.69
本期基金份额交易产生的变动数	2,661,068.94	-1,993,622.31	667,446.63
其中：基金申购款	-1,882,803.16	-142,907.18	-2,025,710.34
基金赎回款	4,543,872.10	-1,850,715.13	2,693,156.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,737,559.68	-1,885,139.38	-24,622,699.06

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	67,419.26
定期存款利息收入	252,000.00
其他存款利息收入	146,685.57
结算备付金利息收入	-
其他	6.51
合计	466,111.34

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,969,652,291.51
减：卖出股票成本总额	2,074,818,144.63
买卖股票差价收入	-105,165,853.12

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,958,471.71
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	5,958,471.71

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-5,396,133.04
——股票投资	-5,396,133.04
——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	-5,396,133.04

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	222,421.38
合计	222,421.38

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 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	7,955,746.27
银行间市场交易费用	-
合计	7,955,746.27

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	--

	日
审计费用	70,000.00
信息披露费	75,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,484.00
合计	148,484.00

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

截至财务报表批准日，本基金无重大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
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
浙商银行股份有限公司("浙商银行")	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,966,268.84
其中：支付销售机构的客户维护费	2,471,493.35

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,327,711.42

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C	合计
浙商银行	0.00	42,314.53	42,314.5

			3
弘毅远方基金	0.00	13,091.95	13,091.95
合计	0.00	55,406.48	55,406.48

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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。

2、本基金A类份额不收取销售服务费。

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

无。

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

无。

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

无。

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

弘毅远方港股通智选领航混合A

关联方名称	本期末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
弘毅投资	10,000,138.90	2.23%

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 2021年02月08日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入

浙商银行	993,823.94	67,419.26
------	------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2021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

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
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-19	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-

301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
H01114	BRILLIANCE CHI	2021-03-31	重大事项停牌	5.97	-	-	1,534,000	8,943,825.62	9,155,648.32	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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允许上市的股票）、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）、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、股指期货、股票期权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。本基金通过持续、深入、系统、全面的产业及基本面研究，叠加大数据工具的使用，在沪港深市场内，参考全球投资者通用的核心资产定价标准，挖掘具有发展潜力和估值优势的引领创新及升级的优质公司。在严格控制基本面风险、流动性风险及估值风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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、切实可行的多层次立体风险管理体系。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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人浙商银行开立的托管账户，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；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12月31日，本基金无债券投资。

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2021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 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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	23,034,107.48	-	-	-	23,034,107.48
其他资	14,014,000.00	-	-	-	14,014,000.00

产					
交易性金融资产	-	-	-	412,774,041.53	412,774,041.53
应收利息	-	-	-	5,939.50	5,939.50
资产总计	37,048,107.48	-	-	412,779,981.03	449,828,088.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	467,712.02	467,712.02
应付管理人报酬	-	-	-	580,226.45	580,226.45
应付托管费	-	-	-	96,704.38	96,704.38
应付销售服务费	-	-	-	39,866.53	39,866.53
其他负债	-	-	-	145,574.59	145,574.59
负债总计	-	-	-	1,330,083.97	1,330,083.97
利率敏感度缺口	37,048,107.48	-	-	411,449,897.06	448,498,004.54

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2021年12月31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。

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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-	349,880,673.91	-	349,880,673.91
资产合计	-	349,880,673.91	-	349,880,673.91
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	-	349,880,673.91	-	349,880,673.91

7.4.13.4.2.2 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12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	17,494,033.70
	所有外币相对人民币贬值5%	-17,494,033.70

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，优先甄选出未来发展前景优良的龙头上市公司股票进行投资。本基金紧密跟踪国内外市场环境变化，通过对各个主要经济体的运行态势、央行政策变化、证券市场状况、国际资金及情绪动态等因素的紧密跟踪及深入研究，自上而下的判断宏观经济运行周期及发展趋势，分析评估各类资产与市场的风险和预期收益，确定不同市场间股票、现金等大类资产的配置比例，并适时进行调整。

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60%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。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 2021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	412,774,041.53	92.03
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	412,774,041.53	92.03

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年12月31日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

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2021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403,548,490.03元，属于第二层次的余额为9,161,152.81元，属于第三层次的余额为64,398.69元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于2021年1月1日，本基金未持有第三层次资产。2021年度购买第三层次金额为19,663.83元，当期计入损益的利得或损失金额为44,734.86元。于2021年12月31日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为64,398.69元（2020年12月31日：无）。其中，2021年12月31日仍持有的资产计入2021年度损益的未实现的利得或损失的变动为44,734.86元（2020年度，无）。

于2021年12月31日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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 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	412,774,041.53	91.76
	其中：股票	412,774,041.53	91.76
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	23,034,107.48	5.12
8	其他各项资产	14,019,939.50	3.12
9	合计	449,828,088.51	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349,880,673.91元，占基金资产净值比例为78.01%。

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	62,880,239.18	14.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
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	-	-
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	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	62,893,367.62	14.02

8.2.2 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(%)
基础材料	14,067,233.15	3.14
非日常生活消费品	92,781,902.08	20.69
日常消费品	16,358,360.93	3.65
医疗保健	49,940,246.66	11.13
工业	53,930,412.65	12.02
信息技术	5,274,002.38	1.18
电信服务	50,249,781.85	11.20
公用事业	21,494,426.02	4.79
地产业	45,784,308.19	10.21
合计	349,880,673.91	78.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 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	H00700	腾讯控股	89,200	33,314,387.46	7.43
2	H03690	美团－W	160,000	29,485,926.40	6.57
3	000333	美的集团	309,800	22,866,338.00	5.10
4	H01211	比亚迪股份	103,000	22,451,132.48	5.01
5	H00902	华能国际电力股份	5,046,000	21,494,426.02	4.79
6	H03898	时代电气	391,700	14,459,464.49	3.22
7	H00257	光大环境	2,785,000	14,254,120.16	3.18
8	H02269	药明生物	188,000	14,225,749.44	3.17
9	H02600	中国铝业	3,992,000	14,067,233.15	3.14
10	600519	贵州茅台	6,700	13,735,000.00	3.06
11	H00688	中国海外发展	874,000	13,191,191.10	2.94
12	H02669	中海物业	1,870,000	12,644,102.24	2.82
13	H00867	康哲药业	1,161,000	12,359,021.47	2.76
14	H06049	保利物业	223,600	11,206,581.57	2.50
15	H02128	中国联塑	1,069,000	9,788,961.28	2.18
16	H01316	耐世特	1,230,000	9,734,672.64	2.17
17	H00291	华润啤酒	178,000	9,292,269.28	2.07
18	H01024	快手－W	156,900	9,242,677.75	2.06
19	H01114	BRILLIANCE CHI	1,534,000	9,155,648.32	2.04
20	H01109	华润置地	326,000	8,742,433.28	1.95
21	H01801	信达生物	218,500	8,619,650.20	1.92
22	H01800	中国交通建设	2,480,000	8,597,227.52	1.92
23	H00175	吉利汽车	484,000	8,428,801.92	1.88
24	H01765	希望教育	6,632,000	8,133,484.80	1.81
25	300207	欣旺达	183,800	7,749,008.00	1.73
26	H02400	心动公司	238,200	7,692,716.64	1.72
27	688408	中信博	42,864	7,565,924.64	1.69
28	H03613	同仁堂国药	644,000	7,066,091.65	1.58

29	H02357	中航科工	1,550,000	6,830,639.20	1.52
30	H00425	敏实集团	192,000	5,392,235.52	1.20
31	H06869	长飞光纤光缆	498,500	5,274,002.38	1.18
32	H01177	中国生物制药	1,104,000	4,928,361.98	1.10
33	300750	宁德时代	8,200	4,821,600.00	1.08
34	H01093	石药集团	594,000	4,113,492.77	0.92
35	002821	凯莱英	7,600	3,306,000.00	0.74
36	H09995	荣昌生物－B	47,500	3,025,324.40	0.67
37	002475	立讯精密	56,400	2,774,880.00	0.62
38	H09926	康方生物－B	96,000	2,668,646.40	0.60
39	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
40	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
41	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
42	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
43	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
44	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
45	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
46	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	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	占期末基金资产净值比例(%)
1	H00700	腾讯控股	69,081,490.13	15.40
2	H03690	美团－W	64,259,764.83	14.33
3	H00772	阅文集团	51,963,819.46	11.59
4	H00257	光大环境	51,703,663.00	11.53
5	H00175	吉利汽车	48,718,782.91	10.86
6	H00728	中国电信	42,461,683.88	9.47
7	H02269	药明生物	40,478,531.08	9.03

8	H01308	海丰国际	38,511,314.59	8.59
9	H01810	小米集团－W	37,044,944.60	8.26
10	H02331	李宁	35,491,701.01	7.91
11	H00941	中国移动	34,272,544.91	7.64
12	H09992	泡泡玛特	32,447,564.89	7.23
13	000100	TCL科技	32,320,204.00	7.21
14	H02669	中海物业	32,214,983.94	7.18
15	H02400	心动公司	31,942,714.58	7.12
16	H00268	金蝶国际	31,729,119.97	7.07
17	H00867	康哲药业	31,592,145.70	7.04
18	H00291	华润啤酒	31,400,818.12	7.00
19	H02600	中国铝业	30,535,017.95	6.81
20	H02357	中航科工	28,512,664.51	6.36
21	H02128	中国联塑	27,634,219.20	6.16
22	000333	美的集团	26,796,057.28	5.97
23	H02020	安踏体育	26,499,538.64	5.91
24	H00902	华能国际电力股份	26,388,898.35	5.88
25	H01316	耐世特	25,234,964.44	5.63
26	H00780	同程旅行	24,922,697.54	5.56
27	H01765	希望教育	24,490,469.16	5.46
28	H01093	石药集团	23,775,548.93	5.30
29	688408	中信博	23,588,341.33	5.26
30	H00819	天能动力	22,668,393.62	5.05
31	600519	贵州茅台	22,209,510.00	4.95
32	H01211	比亚迪股份	22,080,662.63	4.92
33	H02318	中国平安	21,584,320.00	4.81
34	H00460	四环医药	20,930,495.76	4.67
35	H02382	舜宇光学科技	20,921,579.06	4.66
36	H00669	创科实业	20,523,532.58	4.58
37	H06049	保利物业	20,453,981.11	4.56
38	H01800	中国交通建设	20,278,242.60	4.52

39	H00688	中国海外发展	19,867,936.83	4.43
40	H02319	蒙牛乳业	19,732,295.97	4.40
41	H00358	江西铜业股份	19,074,648.41	4.25
42	H03606	福耀玻璃	17,957,572.04	4.00
43	H01929	周大福	17,862,421.33	3.98
44	H06060	众安在线	17,843,873.87	3.98
45	H00881	中升控股	17,502,553.14	3.90
46	H03993	洛阳钼业	17,407,210.76	3.88
47	300413	芒果超媒	17,248,293.00	3.85
48	000725	京东方 A	17,162,922.00	3.83
49	H01801	信达生物	16,888,409.50	3.77
50	H00564	郑煤机	16,455,312.44	3.67
51	H01088	中国神华	16,216,354.48	3.62
52	002129	中环股份	16,216,291.80	3.62
53	H00288	万洲国际	16,149,509.45	3.60
54	600882	妙可蓝多	15,723,540.00	3.51
55	H01928	金沙中国有限公司	15,448,452.96	3.44
56	H06690	海尔智家	15,156,787.32	3.38
57	H03898	时代电气	15,147,992.75	3.38
58	300207	欣旺达	15,100,026.70	3.37
59	H00522	ASM PACIFIC	15,094,673.48	3.37
60	H02018	瑞声科技	14,706,328.07	3.28
61	H06110	滔搏	14,296,222.74	3.19
62	H00883	中国海洋石油	14,251,040.56	3.18
63	H02899	紫金矿业	14,136,580.64	3.15
64	300308	中际旭创	14,050,350.41	3.13
65	H01717	澳优	13,445,813.68	3.00
66	H01381	粤丰环保	13,414,352.34	2.99
67	H00285	比亚迪电子	13,219,916.16	2.95
68	600048	保利发展	13,146,709.00	2.93
69	603517	绝味食品	13,118,751.00	2.93

70	H01833	平安好医生	12,809,784.85	2.86
71	H01109	华润置地	12,655,905.03	2.82
72	H01055	中国南方航空股份	12,616,868.28	2.81
73	H01347	华虹半导体	12,535,450.30	2.79
74	H02380	中国电力	12,496,883.65	2.79
75	600884	杉杉股份	12,066,827.70	2.69
76	H01066	威高股份	11,938,347.38	2.66
77	H03331	维达国际	11,763,518.37	2.62
78	300059	东方财富	11,720,206.00	2.61
79	H02333	长城汽车	11,617,045.63	2.59
80	H01024	快手—W	11,615,676.27	2.59
81	H02313	申洲国际	11,526,524.52	2.57
82	H01999	敏华控股	11,510,102.39	2.57
83	H01177	中国生物制药	11,477,066.86	2.56
84	H06186	中国飞鹤	11,330,434.69	2.53
85	H00981	中芯国际	10,928,762.04	2.44
86	600129	太极集团	10,841,017.00	2.42
87	601888	中国中免	10,835,221.00	2.42
88	H09922	九毛九	10,773,335.38	2.40
89	603605	珀莱雅	10,717,444.00	2.39
90	300896	爱美客	10,352,951.92	2.31
91	H01585	雅迪控股	10,287,060.65	2.29
92	002049	紫光国微	10,219,570.00	2.28
93	603596	伯特利	10,176,225.00	2.27
94	002156	通富微电	10,141,248.00	2.26
95	H01995	旭辉永升服务	10,096,017.51	2.25
96	H01521	方达控股	9,899,458.81	2.21
97	H00027	银河娱乐	9,765,023.84	2.18
98	002833	弘亚数控	9,755,023.00	2.18
99	H01359	中国信达	9,499,309.43	2.12
100	002158	汉钟精机	9,450,835.00	2.11

101	H00762	中国联通	9,431,823.05	2.10
102	H01951	锦欣生殖	9,335,540.75	2.08
103	H03613	同仁堂国药	9,102,305.03	2.03
104	H03988	中国银行	9,015,500.14	2.01

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。

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	H00772	阅文集团	48,832,766.11	10.89
2	H01308	海丰国际	44,912,730.33	10.01
3	H02331	李宁	43,480,329.89	9.69
4	H00728	中国电信	42,361,165.33	9.45
5	H00175	吉利汽车	38,051,253.56	8.48
6	H00257	光大环境	35,631,952.84	7.94
7	H01810	小米集团－W	31,859,233.28	7.10
8	H00941	中国移动	31,712,041.82	7.07
9	H00268	金蝶国际	31,597,854.61	7.05
10	H02020	安踏体育	29,344,584.07	6.54
11	H09992	泡泡玛特	27,747,595.92	6.19
12	000100	TCL科技	27,637,557.00	6.16
13	H02269	药明生物	26,055,347.68	5.81
14	H03690	美团－W	25,278,824.43	5.64
15	H00700	腾讯控股	24,601,159.75	5.49
16	H02669	中海物业	24,190,636.44	5.39
17	H00780	同程旅行	23,267,901.23	5.19
18	H00291	华润啤酒	21,611,099.52	4.82
19	H01929	周大福	21,521,092.91	4.80
20	H02357	中航科工	21,104,095.37	4.71

21	H02382	舜宇光学科技	20,627,331.05	4.60
22	H00669	创科实业	20,489,825.20	4.57
23	H02600	中国铝业	20,108,813.99	4.48
24	H02318	中国平安	19,844,202.08	4.42
25	H01093	石药集团	19,506,694.27	4.35
26	H02128	中国联塑	18,770,778.14	4.19
27	H03606	福耀玻璃	18,330,996.01	4.09
28	H00881	中升控股	17,762,685.31	3.96
29	H02319	蒙牛乳业	17,705,930.40	3.95
30	H00867	康哲药业	16,835,650.10	3.75
31	H00819	天能动力	16,149,806.32	3.60
32	688408	中信博	15,931,126.11	3.55
33	H00358	江西铜业股份	15,906,900.80	3.55
34	H02400	心动公司	15,898,642.81	3.54
35	H00288	万洲国际	15,875,778.72	3.54
36	H01316	耐世特	15,875,016.86	3.54
37	600882	妙可蓝多	15,490,566.00	3.45
38	H01088	中国神华	15,447,084.79	3.44
39	H00460	四环医药	15,407,293.85	3.44
40	H00522	ASM PACIFIC	15,147,364.53	3.38
41	000725	京东方 A	15,034,960.00	3.35
42	002129	中环股份	14,693,217.72	3.28
43	H06060	众安在线	14,512,546.66	3.24
44	H02018	瑞声科技	14,245,840.62	3.18
45	002049	紫光国微	14,056,471.00	3.13
46	H00285	比亚迪电子	13,998,243.67	3.12
47	300413	芒果超媒	13,918,893.00	3.10
48	H00564	郑煤机	13,855,332.51	3.09
49	600884	杉杉股份	13,661,687.00	3.05
50	H03993	洛阳钼业	13,641,925.86	3.04
51	H01717	澳优	13,496,619.41	3.01

52	H02380	中国电力	13,407,635.50	2.99
53	H06690	海尔智家	13,304,568.26	2.97
54	600048	保利发展	13,175,162.00	2.94
55	H06110	滔搏	13,084,536.65	2.92
56	H01765	希望教育	13,009,749.82	2.90
57	300308	中际旭创	12,876,972.10	2.87
58	H00883	中国海洋石油	12,768,158.98	2.85
59	H01928	金沙中国有限公司	12,708,924.35	2.83
60	H01055	中国南方航空股份	12,344,211.55	2.75
61	H01381	粤丰环保	12,038,779.40	2.68
62	H01066	威高股份	11,921,650.31	2.66
63	H01521	方达控股	11,822,780.46	2.64
64	H01999	敏华控股	11,429,531.22	2.55
65	603517	绝味食品	11,409,899.27	2.54
66	H02899	紫金矿业	11,403,181.24	2.54
67	603596	伯特利	11,303,390.00	2.52
68	H01833	平安好医生	11,206,376.72	2.50
69	603605	珀莱雅	11,114,819.00	2.48
70	H02333	长城汽车	11,030,183.09	2.46
71	002156	通富微电	10,923,269.48	2.44
72	300896	爱美客	10,852,830.99	2.42
73	H01800	中国交通建设	10,765,415.91	2.40
74	H03331	维达国际	10,574,239.57	2.36
75	H01347	华虹半导体	10,364,544.49	2.31
76	300059	东方财富	10,093,618.92	2.25
77	H02313	申洲国际	9,996,272.67	2.23
78	600519	贵州茅台	9,959,385.00	2.22
79	002158	汉钟精机	9,944,122.00	2.22
80	002230	科大讯飞	9,930,984.00	2.21
81	H09922	九毛九	9,922,654.11	2.21
82	002833	弘亚数控	9,802,637.60	2.19

83	H00902	华能国际电力股份	9,686,255.75	2.16
84	600129	太极集团	9,531,686.00	2.13
85	H06186	中国飞鹤	9,486,745.00	2.12
86	H01585	雅迪控股	9,465,789.34	2.11
87	601888	中国中免	9,351,346.00	2.09
88	H00981	中芯国际	9,313,185.11	2.08
89	H03988	中国银行	9,100,603.75	2.03

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。

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	2,492,988,319.20
卖出股票收入（成交）总额	1,969,652,291.51

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

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 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司因在收购猿辅导股权过程中构成未依法申报违法实施的经营者集中，被国家市场监督管理总局处以50万元人民币罚款的行政处罚。因在收购Bitauto Holdings Limited股权、收购上海阑途信息技术有限公司股权过程中构成未依法申报违法实施的经营者集中，被国家市场监督管理总局处以50万元人民币罚款的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪国家相关法律法规、行业政策、产业结构、以及该公司的各项情况，认为该项处罚不会影响公司的长期可投资价值，且能够对行业的有序发展起到一定的积极作用。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内基金投资的前十名证券除腾讯控股外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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	-

4	应收利息	5,939.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	14,014,000.00
9	合计	14,019,939.50

8.12.4 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。

8.12.5 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中不存在流通受限情况。

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，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	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
弘毅 远方 港股 通智 选领 航混 合A	3,969	112,944.86	26,289,047.86	5.86%	421,989,121.22	94.14%

弘毅 远方 港股 通智 选领 航混 合C	5,3 16	22,070.72	1,180,151.38	1.01%	116,147,790.89	98.99%
合计	9,2 85	60,916.11	27,469,199.24	4.86%	538,136,912.11	95.14%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	弘毅远方港股通智选领航混合A	2,364,188.06	0.5274%
	弘毅远方港股通智选领航混合C	149,666.43	0.1276%
	合计	2,513,854.49	0.4445%

9.3 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	弘毅远方港股通智选领航混合A	0~10
	弘毅远方港股通智选领航混合C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	弘毅远方港股通智选领航混合A	>=100
	弘毅远方港股通智选领航混合C	-
	合计	>=100

9.4 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	-	-	-	-	-
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	10,000,138.90	1.77%	10,000,138.90	1.77%	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,138.90	1.77%	10,000,138.90	1.77%	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C
基金合同生效日(2021年02月08日)基金份额总额	542,156,264.37	175,582,559.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,969,719.10	17,765,771.41
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	102,847,814.39	76,020,388.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	448,278,169.08	117,327,942.27

注：如果本报告期间发生红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

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未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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。本年度支付给所聘任的会计师事务所7万元人民币。

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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	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	3,323,147,394.25	74.50%	2,408,689.31	75.33%	-

兴业 证券	2	1,137,270,909.07	25.50%	788,636.36	24.67%	-
----------	---	------------------	--------	------------	--------	---

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		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	-	-	374,500,000.00	47.90%	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	407,400,000.00	52.10%	-	-	-	-

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	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2021-01-07
2	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金托管协议	公司网站	2021-01-07
3	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金招募说明书	公司网站	2021-01-07
4	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	证券日报、公司网站	2021-01-07
5	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2021-01-07
6	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	公司网站	2021-01-07

7	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	公司网站	2021-01-07
8	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	证券日报、公司网站	2021-01-20
9	弘毅远方基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券日报、公司网站	2021-01-22
10	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同生效的公告	证券日报、公司网站	2021-02-09
11	弘毅远方基金管理有限公司关于新增旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证券日报、公司网站	2021-02-09
12	弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证券日报、公司网站	2021-02-10
13	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021-04-15
14	关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021-04-27
15	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年半年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2021-07-01
16	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金 2021 年第二季度报告提示性公告	证券日报	2021-07-20
17	弘毅远方港股通智选领航混合型发	公司网站	2021-07-20

	起式证券投资基金2021年第二季度报告		
18	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告提示性公告	证券日报	2021-08-28
19	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年中期报告	公司网站	2021-08-28
20	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年10月13日暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	证券日报、公司网站	2021-10-13
21	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金 2021 年第三季度报告提示性公告	证券日报	2021-10-26
22	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年第三季度报告	公司网站	2021-10-26
23	弘毅远方基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证券日报、公司网站	2021-11-17
24	关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金2021年底及2022年非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	公司网站	2021-12-23
25	弘毅远方基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告	证券日报、公司网站	2021-12-29

§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

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		达到或者超过20%的时间区间					
个人	1	20210208-20211231	200,007,333.33	-	-	200,007,333.33	35.36%
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。							

12.2 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%。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金托管协议》；

- 4、《弘毅远方港股通智选领航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港股通智选领航混合型发起式证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方港股通智选领航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。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 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

二〇二二年三月二十九日