

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

2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	64
7.1 期末基金资产组合情况	64
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
7.3 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	67
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	76
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	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 期末上市基金前十名持有人	78

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	78
§9 开放式基金份额变动.....	78
§10 重大事件揭示.....	79
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8 其他重大事件.....	80
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§12 备查文件目录.....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	弘毅远方国证民企领先100ETF
场内简称	民企领先100ETF
基金主代码	159973
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年07月16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	371,976,423.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019年08月09日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

	本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过3%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时，基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	国证民企领先100指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	罗琦
	联系电话	021-53682888	020-66338888
	电子邮箱	service@honyfunds.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-920-8800	95575
传真		021-53682755	020-87553363-6847
注册地址		上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层（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	上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
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

§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 (2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	1,534,474.67
本期利润	-11,762,486.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0316
本期加权平均净值利润率	-2.24%
本期基金份额净值增长率	-2.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	82,396,127.40
期末可供分配基金份额利润	0.2215
期末基金资产净值	504,289,674.73
期末基金份额净值	1.3557
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	35.57%

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	4.64%	1.17%	4.00%	1.18%	0.64%	-0.01%
过去三个月	-5.41%	1.06%	-6.88%	1.07%	1.47%	-0.01%
过去六个月	-2.28%	1.03%	-4.04%	1.04%	1.76%	-0.01%
过去一年	-20.01%	1.21%	-22.35%	1.23%	2.34%	-0.02%
过去三年	-5.33%	1.54%	-10.97%	1.56%	5.64%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	35.57%	1.51%	26.15%	1.52%	9.42%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为国证民企领先100指数收益率。

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

弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年07月16日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2019年7月16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3.1亿元人民币（截至2023年6月30日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2023年6月30日，本基金管理人共管理8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、弘毅远方久盈混合型证券投资基金、弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金、弘毅远方中短债债券型证券投资基金。

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		
马佳	本基金基金经理;弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理；金融工程部总经理	2022-09-06	-	13年	华东理工大学数学与应用数学学士。曾任上海海烟物流发展有限公司财务部财务分析员、德勤华永会计师事务所企业风险管理服务部经理、太平洋资产管理有限责任公司合规与风险管理部董事。2018年7月加入弘毅远方基金管理有限公司，曾任风控合规部负责人。

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

作为ETF基金，本基金跟踪的标的指数为国证民企领先100指数，主要采取完全复制法的投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

指数走势上，国证民企领先100指数报告期内下跌4.04%，同期沪深300和上证指数分别下跌0.75%和上涨3.65%。

基金运作层面，报告期内，本基金严格遵守基金合同，认真对待投资者申购、赎回等事项，保障基金的正常运作，运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方国证民企领先100ETF基金份额净值为1.3557元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.28%，同期业绩比较基准收益率为-4.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们在2022年年度报告中提到，2023年民营企业发展环境将持续优化，而展望下半年，各项政策落地有望促进民营经济发展壮大。2022年12月，习近平总书记在2022年中央经济工作会议上强调，坚持“两个毫不动摇”，要从制度和法律上把对国企民企平等对待的要求落下来，从政策和舆论上鼓励支持民营经济和民营企业发展壮大。2023年7月，《中共中央国务院关于促进民营经济发展壮大的意见》正式公布，以高规格的方式围绕持续优化民营经济发展环境、加大对民营经济政策支持力度、强化民营经济发展法治保障、着力推动民营经济实现高质量发展、促进民营经济人士健康成长等方面提出31条政策措施，并明确为贯彻落实，后续会完善政策的配套措施，着力解决民营经济发展中面临的阶段性突出困难和问题。

国证民企领先100指数纳入了全市场各个行业的龙头民营企业，主要覆盖制造、科技、消费三大类行业的优质公司，指数的营收和归母净利润保持高速增长，但指数估值已回到本基金上市以来的最低点。展望未来，龙头民营企业将在政策助力下获得更好的发展，而本基金作为全市场唯一的民企主题ETF，兼备中短期投资机会和长期投资价值，为投资者投资民营企业提供了多样化的投资工具。

本基金将继续紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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。

4.7 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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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，弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数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国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2023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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,646,119.80	2,951,865.27
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	500,721,737.26	510,940,938.30
其中：股票投资		500,721,737.26	510,940,938.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,699,104.27	2,999,144.18
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		86,155.90	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	159,829.40	23,167.65
资产总计		505,312,946.63	516,915,115.40
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		122,318.45	133,193.30
应付托管费		81,545.64	88,795.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,745.65	1,606.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	816,662.16	639,358.54
负债合计		1,023,271.90	862,953.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	371,976,423.00	371,976,423.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	132,313,251.73	144,075,738.52
净资产合计		504,289,674.73	516,052,161.52
负债和净资产总计		505,312,946.63	516,915,115.40

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.3557元，基金份额总额371,976,423.00份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-10,262,653.41	-77,978,994.07
1.利息收入		668,176.34	69,336.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,004.74	10,935.47
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		17,532.83	12,745.17
证券出借利息收入		642,638.77	45,655.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,366,131.71	-123,949.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,581,218.49	-4,172,341.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	71,715.88	544,801.19
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	4,875,634.32	3,503,590.74
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-13,296,961.46	-77,924,380.77

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、营业总支出		1,499,833.38	1,644,860.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	781,265.02	874,035.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	520,843.38	582,690.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2,313.76	165.37
8. 其他费用	6.4.7.16	195,411.22	187,970.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,762,486.79	-79,623,855.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,762,486.79	-79,623,855.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,762,486.79	-79,623,855.05

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	371,976,423.00	-	144,075,738.52	516,052,161.52

资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	371,976,423.00	-	144,075,738.52	516,052,161.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-11,762,486.79	-11,762,486.79
（一）、综合收益总额	-	-	-11,762,486.79	-11,762,486.79
（二）、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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产（基金净值）	371,976,423.00	-	132,313,251.73	504,289,674.73
项 目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	370,976,423.00	-	337,155,282.20	708,131,705.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	370,976,423.00	-	337,155,282.20	708,131,705.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-79,359,282.38	-79,359,282.38
（一）、综合收益总额	-	-	-79,623,855.05	-79,623,855.05
（二）、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）	-	-	264,572.67	264,572.67
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	-	1,381,542.19	3,381,542.19
2.基金赎回款	-2,000,000.00	-	-1,116,969.52	-3,116,969.52

(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	370,976,423.00	-	257,795,999.82	628,772,422.82

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

丁旺

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

弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]997号《关于准予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注册的批复》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《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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384,975,999.00元(含募集股票市值),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0384号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2019年7月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为384,976,423.00份基金份额,其中认购资金利息折合424.00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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备

选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为：国证民企领先100指数收益率。

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》、《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质

上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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相关交易费用及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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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。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净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，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，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、市盈率法、现金流量折现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。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。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。

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[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[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 2023年06月30日
活期存款	170,727.94
等于：本金	170,622.22

加：应计利息	105.72
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	2,475,391.86
等于：本金	2,475,137.92
加：应计利息	253.94
减：坏账准备	-
合计	2,646,119.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	445,732,613.40	-	500,721,737.26	54,989,123.86
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	445,732,613.40	-	500,721,737.26	54,989,123.86

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,699,104.27	-
银行间市场	-	-
合计	1,699,104.27	-

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	17,937.00
待摊费用	141,892.40
合计	159,829.40

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-IOPV计算费	29,916.99
预提费用-审计费	89,752.78
预提费用-信息披露费	494,507.37
应付指数使用费	202,485.02
合计	816,662.16

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	371,976,423.00	371,976,423.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	371,976,423.00	371,976,423.00

6.4.7.8 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
本期期初	80,861,652.73	63,214,085.79	144,075,738.52
本期利润	1,534,474.67	-13,296,961.46	-11,762,486.79
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,396,127.40	49,917,124.33	132,313,251.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	2,393.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,611.09
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	8,004.74

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,581,218.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,581,218.49

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	48,145,216.72
减：卖出股票成本总额	50,629,109.62
减：交易费用	97,325.59
买卖股票差价收入	-2,581,218.49

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	71.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	71,644.54
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	71,715.88

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	438,005.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	366,200.00
减：应计利息总额	73.32
减：交易费用	87.60
买卖债券差价收入	71,644.54

6.4.7.12 贵金属投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,875,634.32
其中：证券出借权益补偿收入	507,229.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,875,634.32

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-13,296,961.46
——股票投资	-13,296,961.46
——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	-13,296,961.46

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

指数使用费	78,126.48
固定注册登记费	17,307.60
IOPV计算费	10,716.99
合计	195,411.22

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

本基金于2019年7月16日成立，是全市场首只在券商结算模式下的交易型开放式指数证券投资基金，自成立之日起一直采用“场外实物申购、赎回”模式。为了更好地满足投资者投资理财需求、进一步提高产品的竞争力，本基金自2023年7月24日起转换申购赎回模式，从“场外实物申购、赎回”模式，变更为“深市股票实物申赎、沪市股票现金替代”的场内申赎模式，本次转换完成后本基金的产品运作效率、投资者的资金使用效率将得到显著提升。

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、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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	87,917,879.67	100.00%	155,526,796.44	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	438,005.46	100.00%	2,478,305.10	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	170,200,000.00	100.00%	139,100,000.00	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 2023年01月01日至2023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	39,950.56	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	51,180.17	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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	781,265.02	874,035.23
其中：支付销售机构的客户维护费	376.52	510.58

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0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023 年06月30日	2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	520,843.38	582,690.23

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 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期										
2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2023062000003086	华东医药	2023-06-20	51,120.00	1,200	14	320.00%	63.62	52,044.00	45.44
广发证券	2023062000003088	圣邦股份	2023-06-20	543,753.00	6,300	14	320.00%	676.67	517,419.00	483.34
广发证券	2023062100004691	广汇能源	2023-06-21	441,168.00	60,600	14	320.00%	549.01	415,716.00	352.93
广发证券	2023062600000998	恒生电子	2023-06-26	90,460.00	2,000	14	320.00%	112.57	88,580.00	32.16
广发证券	2023062600044601	传音控股	2023-06-26	758,576.00	5,200	14	320.00%	944.01	764,400.00	269.72
广发证券	2023062600045781	金山办公	2023-06-26	1,863,069.00	3,900	14	320.00%	2,318.49	1,841,658.00	662.42
广发证券	202306260003	三七互娱	2023-06-26	983,133.00	31,300	14	320.00%	1,223.45	1,091,744.00	349.56

	7460									
广发证券	202306 260003 7147	晶澳科技	2023-0 6-26	488,70 9.00	11,700	14	320.0 0%	608.17	487,89 0.00	173.76
广发证券	202306 260004 4736	科大讯飞	2023-0 6-26	2,667, 264.00	36,800	14	320.0 0%	3,319. 26	2,500, 928.00	948.36
广发证券	202306 280005 3960	三花智控	2023-0 6-28	1,171, 140.00	39,300	14	320.0 0%	1,457. 42	1,189, 218.00	208.20
广发证券	202306 290000 0909	海大集团	2023-0 6-29	52,17 3.00	1,100	14	320.0 0%	64.93	51,52 4.00	4.64
广发证券	202306 290000 0911	华东医药	2023-0 6-29	86,02 0.00	2,000	14	320.0 0%	107.05	86,74 0.00	7.65

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	363,643.00	363,643.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	363,643.00	363,643.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.10%	0.10%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	170,727.94	2,393.65	345,325.99	2,785.47
广发证券-证券户	2,475,391.86	5,611.09	4,532,731.98	8,141.03

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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	受限期	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
301486	致尚科技	2023-06-30	5个交易日	新股未上市	57.66	57.66	3,273	188,721.18	188,721.18	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个交易日	新股未上	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-

			日	市						
301202	朗威股份	2023-06-28	5个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新限售	19.86	18.06	3,246	64,465.56	58,622.76	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	2,059	22,854.90	35,085.36	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	515	12,154.00	33,305.05	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	6,086	34,629.34	32,925.26	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	291	22,348.80	31,413.45	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.89	657	15,616.89	28,178.73	-

301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	创业板打新限售	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	30.85	23.63	1,089	33,595.65	25,733.07	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	科创板打新限售	152.38	135.97	173	26,361.74	23,522.81	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	科创板打新限售	26.74	40.68	553	14,787.22	22,496.04	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板打新限售	26.80	22.32	1,005	26,934.00	22,431.60	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	创业板打新限售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	573	20,713.95	21,848.49	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板打	57.66	57.66	364	20,988.24	20,988.24	-

				新限售						
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	39.99	36.71	554	22,154.46	20,337.34	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	38.13	31.03	653	24,898.89	20,262.59	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板打新限售	43.67	53.05	365	15,939.55	19,363.25	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	211	15,825.00	19,150.36	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	1,551	18,767.10	18,720.57	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	50.00	30.71	608	30,400.00	18,671.68	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	755	15,983.35	17,742.50	-

301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	创业板打新限售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	745	8,850.60	15,659.90	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.03	131	16,479.80	15,461.93	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	创业板打新限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	581	17,581.06	14,716.73	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	744	18,786.00	14,649.36	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	87.41	53.24	264	23,075.36	14,055.36	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-

				新限售						
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	创业板打新限售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打新限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	1,694	11,146.52	12,840.52	-
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	143	18,000.84	12,410.97	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板打新限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	19.99	16.90	734	14,672.66	12,404.60	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-

				新限售						
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	创业板打新限售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	73.45	46.64	209	15,351.05	9,747.76	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	511	9,095.80	9,141.79	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	创业板打新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	创业板打新限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	创业板打新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	科创板打新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	632	6,547.52	7,482.88	-
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板打新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	562	6,552.92	6,890.12	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、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。

4、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设定限售期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。

5、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2023年07月10日-2023年07月10日	45.54	65,600	2,987,424.00
2	000301	东方盛虹	2023年07月04日-2023年07月04日	11.82	43,400	512,988.00
3	000963	华东医药	2023年07月04日-2023年07月13日	43.37	3,200	138,784.00
4	002001	新和成	2023年07月14日-2023年07月	15.40	10,000	154,000.00

			14日			
5	002050	三花智控	2023年07月12日-2023年07月12日	30.26	39,300	1,189,218.00
6	002074	国轩高科	2023年07月10日-2023年07月10日	27.62	21,700	599,354.00
7	002180	纳思达	2023年07月10日-2023年07月10日	34.25	2,700	92,475.00
8	002230	科大讯飞	2023年07月10日-2023年07月10日	67.96	36,800	2,500,928.00
9	002241	歌尔股份	2023年07月10日-2023年07月10日	17.75	51,300	910,575.00
10	002311	海大集团	2023年07月13日-2023年07月13日	46.84	1,100	51,524.00
11	002352	顺丰控股	2023年07月13日-2023年07月14日	45.09	12,200	550,098.00
12	002410	广联达	2023年07月10日-2023年07月10日	32.49	27,100	880,479.00
13	002459	晶澳科技	2023年07	41.70	32,600	1,359,420.0

			月10日-20 23年07月 10日			0
14	002555	三七互娱	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	34.88	31,300	1,091,744.0 0
15	002603	以岭药业	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	25.69	16,200	416,178.00
16	002714	牧原股份	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	42.15	51,900	2,187,585.0 0
17	002938	鹏鼎控股	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	24.29	12,600	306,054.00
18	300014	亿纬锂能	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	60.50	26,100	1,579,050.0 0
19	300015	爱尔眼科	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	18.55	85,600	1,587,880.0 0
20	300033	同花顺	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	175.28	4,100	718,648.00
21	300059	东方财富	2023年07 月05日-20 23年07月	14.20	60,400	857,680.00

			13日			
22	300450	先导智能	2023年07月10日-2023年07月10日	36.17	20,700	748,719.00
23	300496	中科创达	2023年07月10日-2023年07月10日	96.35	7,200	693,720.00
24	300628	亿联网络	2023年07月11日-2023年07月11日	35.07	9,500	333,165.00
25	300661	圣邦股份	2023年07月04日-2023年07月04日	82.13	6,300	517,419.00
26	300750	宁德时代	2023年07月13日-2023年07月13日	228.79	2,400	549,096.00
27	300759	康龙化成	2023年07月11日-2023年07月14日	38.28	11,800	451,704.00
28	300763	锦浪科技	2023年07月10日-2023年07月10日	104.10	4,200	437,220.00
29	300896	爱美客	2023年07月10日-2023年07月10日	444.95	1,800	800,910.00
30	300957	贝泰妮	2023年07	88.88	2,600	231,088.00

			月11日-20 23年07月 11日			
31	300979	华利集团	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	48.74	3,100	151,094.00
32	600089	特变电工	2023年07 月05日-20 23年07月 25日	22.29	20,900	465,861.00
33	600233	圆通速递	2023年07 月12日-20 23年07月 12日	14.56	33,200	483,392.00
34	600256	广汇能源	2023年07 月05日-20 23年07月 12日	6.86	93,800	643,468.00
35	600438	通威股份	2023年07 月11日-20 23年07月 12日	34.31	54,900	1,883,619.0 0
36	600460	士兰微	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	30.27	17,300	523,671.00
37	600522	中天科技	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	15.91	57,300	911,643.00
38	600570	恒生电子	2023年07 月10日-20 23年07月	44.29	2,000	88,580.00

			10日			
39	600584	长电科技	2023年07月12日-2023年07月12日	31.17	28,500	888,345.00
40	600660	福耀玻璃	2023年07月14日-2023年07月14日	35.85	2,100	75,285.00
41	600703	三安光电	2023年07月11日-2023年07月11日	17.24	50,600	872,344.00
42	600745	闻泰科技	2023年07月14日-2023年07月14日	48.90	17,900	875,310.00
43	600803	新奥股份	2023年07月03日-2023年07月03日	18.98	18,300	347,334.00
44	601100	恒立液压	2023年07月10日-2023年07月13日	64.33	8,900	572,537.00
45	601138	工业富联	2023年07月10日-2023年07月10日	25.20	74,400	1,874,880.00
46	601615	明阳智能	2023年07月03日-2023年07月14日	16.88	36,800	621,184.00
47	601689	拓普集团	2023年07	80.70	8,600	694,020.00

			月11日-20 23年07月 11日			
48	601865	福莱特	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	38.51	12,500	481,375.00
49	603195	公牛集团	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	96.06	2,400	230,544.00
50	603198	迎驾贡酒	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	63.80	4,400	280,720.00
51	603392	万泰生物	2023年07 月12日-20 23年07月 12日	66.77	2,700	180,279.00
52	603605	珀莱雅	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	112.40	4,300	483,320.00
53	603659	璞泰来	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	38.22	18,900	722,358.00
54	603799	华友钴业	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	45.91	26,200	1,202,842.0 0
55	603806	福斯特	2023年07 月05日-20 23年07月	37.19	12,400	461,156.00

			05日			
56	603833	欧派家居	2023年07月12日-2023年07月12日	95.80	3,400	325,720.00
57	605117	德业股份	2023年07月10日-2023年07月10日	149.55	3,100	463,605.00
58	605499	东鹏饮料	2023年07月10日-2023年07月10日	172.90	1,900	328,510.00
59	688036	传音控股	2023年07月10日-2023年07月10日	147.00	5,200	764,400.00
60	688111	金山办公	2023年07月10日-2023年07月10日	472.22	3,900	1,841,658.00
61	688126	沪硅产业	2023年07月13日-2023年07月13日	20.90	2,000	41,800.00
62	688303	大全能源	2023年07月12日-2023年07月12日	40.45	11,000	444,950.00
63	688363	华熙生物	2023年07月10日-2023年07月10日	89.16	3,500	312,060.00
64	688561	奇安信	2023年07	51.81	2,900	150,249.00

			月10日-20 23年07月 10日			
65	688599	天合光能	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	42.61	23,400	997,074.00
合计					1,374,400	47,120,314.00

注：单一股票存在单笔或多笔出借，到期日不同，存在到期日区间。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具（权证、股指期货等）、债券回购、银行存款、同业存单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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金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2023年6月30日，本基金无债券投资(2022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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2023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，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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。

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%。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 2023 年 0 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,646,119.80	-	-	-	2,646,119.80
交易性金融资产	-	-	-	500,721,737.26	500,721,737.26
买入返售金融资产	1,699,104.27	-	-	-	1,699,104.27
应收股利	-	-	-	86,155.90	86,155.90
其他资产	-	-	-	159,829.40	159,829.40
资产总计	4,345,224.07	-	-	500,967,722.56	505,312,946.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	122,318.45	122,318.45
应付托管费	-	-	-	81,545.64	81,545.64

应交税费	-	-	-	2,745.65	2,745.65
其他负债	-	-	-	816,662.16	816,662.16
负债总计	-	-	-	1,023,271.90	1,023,271.90
利率敏感度缺口	4,345,224.07	-	-	499,944,450.66	504,289,674.73
上年度末 2022 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	2,951,865.27	-	-	-	2,951,865.27
交易性金融资产	-	-	-	510,940,938.30	510,940,938.30
买入返售金融资产	2,999,144.18	-	-	-	2,999,144.18
其他资产	-	-	-	23,167.65	23,167.65
资产总计	5,951,009.45	-	-	510,964,105.95	516,915,115.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	133,193.30	133,193.30
应付托管费	-	-	-	88,795.54	88,795.54
应交税费	-	-	-	1,606.50	1,606.50
其他负债	-	-	-	639,358.54	639,358.54
负债总计	-	-	-	862,953.88	862,953.88
利率敏感度缺口	5,951,009.45	-	-	510,101,152.07	516,052,161.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023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(2022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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。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 2023年06月30日		上年度末 2022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	500,721,737.26	99.29	510,940,938.30	99.01

产—股票投资				
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	500,721,737.26	99.29	510,940,938.30	99.01

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	24,691,825.41	28,583,568.14
	业绩比较基准下降5%	-24,691,825.41	-28,583,568.14

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	498,819,174.59	508,178,091.03
第二层次	693,078.36	-
第三层次	1,209,484.31	2,762,847.27
合计	500,721,737.26	510,940,938.30

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	500,721,737.26	99.09
	其中：股票	500,721,737.26	99.09

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,699,104.27	0.34
	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	2,646,119.80	0.52
8	其他各项资产	245,985.30	0.05
9	合计	505,312,946.63	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为47,120,314.00元，占净值比例9.34%。

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（指数投资）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	17,013,273.90	3.37
B	采矿业	5,847,953.00	1.16
C	制造业	391,327,525.44	77.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,398,826.00	0.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,767,006.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	10,866,930.00	2.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,669,461.66	8.06
J	金融业	17,773,838.80	3.52
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	4,732,882.00	0.94
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	6,389,454.75	1.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	498,787,151.55	98.91

7.2.2 报告期末（积极投资）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	1,693,231.30	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	9,265.63	0.00
F	批发和零售业	43,399.47	0.01
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	92,675.14	0.02
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,389.36	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,934,585.71	0.38

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	210,160	48,082,506.40	9.53
2	000333	美的集团	411,500	24,245,580.00	4.81
3	002594	比亚迪	71,800	18,543,786.00	3.68
4	600276	恒瑞医药	339,606	16,267,127.40	3.23
5	601012	隆基绿能	521,546	14,952,723.82	2.97
6	300059	东方财富	1,046,774	14,864,190.80	2.95
7	002475	立讯精密	383,200	12,434,840.00	2.47
8	000063	中兴通讯	263,910	12,018,461.40	2.38
9	300124	汇川技术	160,450	10,302,494.50	2.04
10	002230	科大讯飞	148,200	10,071,672.00	2.00
11	300274	阳光电源	84,200	9,820,246.00	1.95
12	002352	顺丰控股	197,800	8,918,802.00	1.77
13	002714	牧原股份	208,826	8,802,015.90	1.75
14	600031	三一重工	499,400	8,305,022.00	1.65
15	300498	温氏股份	447,480	8,211,258.00	1.63
16	600438	通威股份	220,800	7,575,648.00	1.50

17	601138	工业富联	299,600	7,549,920.00	1.50
18	600690	海尔智家	320,700	7,530,036.00	1.49
19	688111	金山办公	15,700	7,413,854.00	1.47
20	300015	爱尔眼科	344,445	6,389,454.75	1.27
21	300014	亿纬锂能	105,100	6,358,550.00	1.26
22	600089	特变电工	278,400	6,205,536.00	1.23
23	603501	韦尔股份	63,100	6,186,324.00	1.23
24	002466	天齐锂业	86,500	6,047,215.00	1.20
25	603288	海天味业	124,649	5,839,805.65	1.16
26	600570	恒生电子	131,614	5,829,184.06	1.16
27	002460	赣锋锂业	94,100	5,736,336.00	1.14
28	603986	兆易创新	51,820	5,505,875.00	1.09
29	002459	晶澳科技	131,320	5,476,044.00	1.09
30	603799	华友钴业	105,720	4,853,605.20	0.96
31	002050	三花智控	158,350	4,791,671.00	0.95
32	600660	福耀玻璃	123,900	4,441,815.00	0.88
33	002555	三七互娱	126,100	4,398,368.00	0.87
34	002271	东方雨虹	161,050	4,390,223.00	0.87
35	002709	天赐材料	100,700	4,147,833.00	0.82
36	300122	智飞生物	92,750	4,099,550.00	0.81
37	688599	天合光能	94,400	4,022,384.00	0.80
38	600522	中天科技	230,500	3,667,255.00	0.73
39	002241	歌尔股份	206,500	3,665,375.00	0.73
40	300316	晶盛机电	51,500	3,651,350.00	0.72
41	300142	沃森生物	136,900	3,621,005.00	0.72
42	600584	长电科技	114,800	3,578,316.00	0.71
43	002410	广联达	109,440	3,555,705.60	0.71
44	600745	闻泰科技	72,200	3,530,580.00	0.70
45	600703	三安光电	203,600	3,510,064.00	0.70
46	600196	复星医药	107,600	3,324,840.00	0.66
47	300896	爱美客	7,400	3,292,630.00	0.65

48	603993	洛阳钼业	611,700	3,260,361.00	0.65
49	600588	用友网络	156,140	3,200,870.00	0.63
50	002311	海大集团	65,500	3,068,020.00	0.61
51	688036	传音控股	20,800	3,057,600.00	0.61
52	300408	三环集团	104,100	3,055,335.00	0.61
53	300450	先导智能	83,600	3,023,812.00	0.60
54	603659	璞泰来	76,425	2,920,963.50	0.58
55	300347	泰格医药	45,100	2,910,754.00	0.58
56	300033	同花顺	16,600	2,909,648.00	0.58
57	300496	中科创达	29,200	2,813,420.00	0.56
58	601689	拓普集团	34,600	2,792,220.00	0.55
59	000963	华东医药	63,800	2,767,006.00	0.55
60	300782	卓胜微	28,272	2,731,923.36	0.54
61	002180	纳思达	75,867	2,598,444.75	0.52
62	600256	广汇能源	377,200	2,587,592.00	0.51
63	601615	明阳智能	148,387	2,504,772.56	0.50
64	600702	舍得酒业	20,100	2,491,395.00	0.49
65	688126	沪硅产业	118,600	2,478,740.00	0.49
66	601877	正泰电器	88,300	2,441,495.00	0.48
67	002074	国轩高科	87,600	2,419,512.00	0.48
68	600989	宝丰能源	189,800	2,393,378.00	0.47
69	601100	恒立液压	35,856	2,306,616.48	0.46
70	601633	长城汽车	91,600	2,305,572.00	0.46
71	603806	福斯特	61,966	2,304,515.54	0.46
72	300454	深信服	19,700	2,231,025.00	0.44
73	600460	士兰微	69,600	2,106,792.00	0.42
74	300661	圣邦股份	25,320	2,079,531.60	0.41
75	000301	东方盛虹	174,600	2,063,772.00	0.41
76	300751	迈为股份	12,152	2,058,305.76	0.41
77	002001	新 和 成	133,288	2,052,635.20	0.41
78	603392	万泰生物	29,304	1,956,628.08	0.39

79	601865	福莱特	50,600	1,948,606.00	0.39
80	600233	圆通速递	133,800	1,948,128.00	0.39
81	603605	珀莱雅	17,300	1,944,520.00	0.39
82	605117	德业股份	12,840	1,920,222.00	0.38
83	300433	蓝思科技	163,200	1,919,232.00	0.38
84	300999	金龙鱼	47,400	1,895,526.00	0.38
85	300759	康龙化成	47,600	1,822,128.00	0.36
86	688303	大全能源	44,300	1,791,935.00	0.36
87	300763	锦浪科技	16,900	1,759,290.00	0.35
88	002603	以岭药业	65,300	1,677,557.00	0.33
89	603260	合盛硅业	22,100	1,547,442.00	0.31
90	600803	新奥股份	73,700	1,398,826.00	0.28
91	300628	亿联网络	38,320	1,343,882.40	0.27
92	605499	东鹏饮料	7,700	1,331,330.00	0.26
93	603833	欧派家居	13,700	1,312,460.00	0.26
94	688363	华熙生物	14,200	1,266,072.00	0.25
95	002938	鹏鼎控股	50,800	1,233,932.00	0.24
96	688561	奇安信	22,300	1,155,363.00	0.23
97	603198	迎驾贡酒	17,700	1,129,260.00	0.22
98	300957	贝泰妮	10,800	959,904.00	0.19
99	603195	公牛集团	9,764	937,929.84	0.19
100	300979	华利集团	12,800	623,872.00	0.12

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	301486	致尚科技	3,637	209,709.42	0.04
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
4	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02

5	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
6	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
7	688249	晶合集成	3,246	58,622.76	0.01
8	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
9	688472	阿特斯	2,059	35,085.36	0.01
10	688361	中科飞测	515	33,305.05	0.01
11	688469	中芯集成	6,086	32,925.26	0.01
12	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
13	301325	曼恩斯特	291	31,413.45	0.01
14	301358	湖南裕能	657	28,178.73	0.01
15	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.01
16	301260	格力博	1,089	25,733.07	0.01
17	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
18	688531	日联科技	173	23,522.81	0.00
19	688582	芯动联科	553	22,496.04	0.00
20	301303	真兰仪表	1,005	22,431.60	0.00
21	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
22	688146	中船特气	573	21,848.49	0.00
23	688484	南芯科技	554	20,337.34	0.00
24	301291	明阳电气	653	20,262.59	0.00
25	688543	国科军工	365	19,363.25	0.00
26	688458	美芯晟	211	19,150.36	0.00
27	688352	颀中科技	1,551	18,720.57	0.00
28	301246	宏源药业	608	18,671.68	0.00
29	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
30	688552	航天南湖	755	17,742.50	0.00
31	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
32	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
33	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
34	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
35	001287	中电港	745	15,659.90	0.00

36	688581	安杰思	131	15,461.93	0.00
37	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
38	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
39	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
40	688570	天玛智控	581	14,716.73	0.00
41	301305	朗坤环境	744	14,649.36	0.00
42	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
43	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
44	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
45	301322	绿通科技	264	14,055.36	0.00
46	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
47	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
48	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
49	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
50	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
51	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
52	601061	中信金属	1,694	12,840.52	0.00
53	688623	双元科技	143	12,410.97	0.00
54	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
55	301439	泓淋电力	734	12,404.60	0.00
56	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
57	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
58	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
59	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
60	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
61	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
62	301345	涛涛车业	209	9,747.76	0.00
63	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
64	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
65	603135	中重科技	511	9,141.79	0.00
66	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00

67	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
68	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
69	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
70	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
71	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
72	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
73	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
74	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
75	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
76	601065	江盐集团	632	7,482.88	0.00
77	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
78	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
79	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
80	601133	柏诚股份	562	6,890.12	0.00
81	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
82	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
83	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
84	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
85	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
86	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
87	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
88	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
89	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002555	三七互娱	4,280,098.00	0.83
2	600584	长电科技	3,639,510.00	0.71

3	300033	同花顺	2,746,851.00	0.53
4	300750	宁德时代	2,710,187.35	0.53
5	300454	深信服	2,429,368.00	0.47
6	000301	东方盛虹	1,927,434.00	0.37
7	603605	珀莱雅	1,916,995.00	0.37
8	002603	以岭药业	1,765,531.00	0.34
9	300763	锦浪科技	1,607,811.00	0.31
10	688561	奇安信	1,328,961.15	0.26
11	603198	迎驾贡酒	991,701.00	0.19
12	688303	大全能源	875,632.77	0.17
13	601012	隆基绿能	837,154.00	0.16
14	605499	东鹏饮料	660,461.00	0.13
15	688249	晶合集成	644,536.44	0.12
16	000333	美的集团	524,421.00	0.10
17	002594	比亚迪	437,913.00	0.08
18	300059	东方财富	387,125.00	0.08
19	688343	云天励飞	361,769.04	0.07
20	600276	恒瑞医药	361,641.00	0.07

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	600732	爱旭股份	2,173,324.00	0.42
2	603606	东方电缆	1,875,925.00	0.36
3	300769	德方纳米	1,692,181.00	0.33
4	002756	永兴材料	1,584,807.20	0.31
5	603185	弘元绿能	1,233,672.00	0.24
6	601127	赛力斯	1,205,784.00	0.23

7	002120	韵达股份	1,149,083.00	0.22
8	603486	科沃斯	1,148,733.88	0.22
9	300919	中伟股份	1,082,982.00	0.21
10	000333	美的集团	947,349.00	0.18
11	688343	云天励飞	914,647.00	0.18
12	002594	比亚迪	875,630.00	0.17
13	688515	裕太微	840,406.52	0.16
14	600276	恒瑞医药	728,737.00	0.14
15	300059	东方财富	704,143.00	0.14
16	003022	联泓新科	647,271.00	0.13
17	688249	晶合集成	587,983.00	0.11
18	600588	用友网络	538,398.00	0.10
19	001286	陕西能源	499,277.32	0.10
20	002475	立讯精密	449,831.00	0.09

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	53,706,870.04
卖出股票收入（成交）总额	48,145,216.72

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 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 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	应收清算款	-
3	应收股利	86,155.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	17,937.00
7	待摊费用	141,892.40
8	其他	-

9	合计	245,985.30
---	----	------------

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	000063	中兴通讯	2,987,424.00	0.59	转融通证券出借
2	002230	科大讯飞	2,500,928.00	0.50	转融通证券出借
3	300059	东方财富	857,680.00	0.17	转融通证券出借
4	300750	宁德时代	549,096.00	0.11	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	301486	致尚科技	209,709.42	0.04	新股未上市
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.03	新股未上市
3	301292	海科新源	116,421.76	0.02	新股未上市
4	301202	朗威股份	79,009.20	0.02	新股未上市
5	688603	天承科技	76,505.00	0.02	新股未上市

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	户均持有的基金份	持有人结构
----	----------	-------

人户数(户)	额	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
366	1,016,329.03	485,343.00	0.13%	371,491,080.00	99.87%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	涂建华	369,176,982.00	99.25%
2	钱中明	574,400.00	0.15%
3	弘毅远方基金管理有限公司	363,643.00	0.10%
4	康建林	120,000.00	0.03%
5	刘登科	111,100.00	0.03%
6	张俊平	100,000.00	0.03%
7	杭州瀚泽网络科技有限公司	96,900.00	0.03%
8	钱红波	82,400.00	0.02%
9	丘立峰	72,090.00	0.02%
10	高志宏	50,000.00	0.01%
11	陈小玲	50,000.00	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年07月16日)基金份额总额	384,976,423.00
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	371,976,423.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	371,976,423.00

§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，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议并通过了《关于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转换申购、赎回基金份额方式的议案》。本次大会决定的事项自表决通过之日起生效，即本次大会于2023年6月12日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。本次大会决议通过后，基金管理人将启动申购、赎回模式的转换工作，为保护基金份额持有人利益，基金管理人将设置场内申购、赎回的转换期，转换期期间，本基金暂停申购、赎回业务，转换期的具体安排基金管理人将另行公告。转换期结束后，本基金将取消场外申赎模式，变更为“深市股票实物申赎、沪市股票现金替代”的场内申赎模式，具体修改后的《基金合同》生效日期另行公告。

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，基金管理人未发生重大人事变动。
- 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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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6万元人民币。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未发生受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	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	87,917,879.67	100.00%	39,950.56	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	438,005.46	100.00%	170,200,000.00	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2022年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2023-01-01

2	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2022年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-01-18
3	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2022年第四季度报告提示性公告	上海证券报	2023-01-18
4	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	2023-01-20
5	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更新的招募说明书（2023年第1号）	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-01-20
6	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2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-03-28
7	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2022年年度报告提示性公告	上海证券报	2023-03-28
8	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2023年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-04-21
9	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2023年第一季度报告提示性公告	上海证券报	2023-04-21
10	弘毅远方基金管理有限公司关于以通讯方式召开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基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、公司网站	2023-05-10

11	弘毅远方基金管理有限公司 关于以通讯方式召开弘毅远 方国证民企领先100交易型 开放式指数证券投资基金基 金份额持有人大会的第一次 提示性公告	中国证监会基金电子披露网 站、上海证券报、公司网站	2023-05-11
12	弘毅远方基金管理有限公司 关于以通讯方式召开弘毅远 方国证民企领先100交易型 开放式指数证券投资基金基 金份额持有人大会的第二次 提示性公告	中国证监会基金电子披露网 站、上海证券报、公司网站	2023-05-12
13	弘毅远方基金管理有限公司 关于以通讯方式召开弘毅远 方国证民企领先100交易型 开放式指数证券投资基金基 金份额持有人大会计票日开 始停牌的提示性公告	中国证监会基金电子披露网 站、上海证券报、公司网站	2023-06-09
14	弘毅远方基金管理有限公司 关于以通讯方式召开弘毅远 方国证民企领先100交易型 开放式指数证券投资基金基 金份额持有人大会表决结果 暨决议生效的公告	中国证监会基金电子披露网 站、上海证券报、公司网站	2023-06-13
15	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、上海证券报、公司网站	2023-06-14

§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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
个人	1	20230101-2 0230630	369,176,982.0 0	-	-	369,176,98 2.00	99.25%
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、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。 3、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2023年6月14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》，基金管理人股东弘毅投资（北京）有限公司向基金管理人增加出资6000万元，增资完成后，基金管理人注册资本由人民币2.5亿元增加至人民币3.1亿元。

§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国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《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基金合同》；
- 3、《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托管协议》；
- 4、《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国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内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。