

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2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	631,564,256.08份
投资目标	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。
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

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	<p>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。</p>	
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	
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	497,417,322.32份	134,146,933.76份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年04月01日 - 2021年06月30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
1.本期已实现收益	-4,183,983.37	-1,754,842.81
2.本期利润	41,331,536.35	12,105,310.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0779	0.0743
4.期末基金资产净值	518,718,015.92	139,618,390.93
5.期末基金份额净值	1.0428	1.0408

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净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.20%	0.94%	0.16%	0.66%	8.04%	0.28%
自基金合同生效起至今	4.28%	0.93%	-1.12%	0.85%	5.40%	0.08%

弘毅远方港股通智选领航混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.07%	0.94%	0.16%	0.66%	7.91%	0.28%
自基金合同生效起至今	4.08%	0.93%	-1.12%	0.85%	5.20%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

弘毅远方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06月30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06月30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 2021 年 6 月 30 日，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资管理符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

受到海内外政策与相关预期较大幅变动的的影响，市场在二季度内持续大幅波动。本基金建仓恰逢市场的高点，我们在二季度内依然将规避风险、躲避回撤作为重要目标。4月底，市场迎来了一系列的利好信息，我们增加了组合的进攻性，聚焦于核心消费、工业、科技类赛道。

展望下半年，宏观经济基本面仍然坚韧，经济及信贷数据与微观调研也印证了市场稳定的判断。我们认为增长能力及其确定性将成为年内投资的重要因素。根据行业中长期空间、成长性、商业模式、预期差等维度，二季度持续增加了科技、互联网、计算机、可选消费、交通运输、原材料等行业重点公司的持仓。长期而言，本基金仍力争以较小的波动，持续体现明显的成长风格，捕捉港股为主上市公司的增长机会。

4.5 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1.0428元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.20%，同期业绩比较基准收益率为0.16%；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1.0408元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.07%，同期业绩比较基准收益率为0.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	619,648,277.74	91.34
	其中：股票	619,648,277.74	91.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	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	57,517,559.48	8.48
8	其他资产	1,251,510.63	0.18
9	合计	678,417,347.85	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 499,986,124.85 元，占基金资产净值比例为 75.95%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	100,181,389.54	15.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	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	19,422,007.42	2.95
J	金融业	34,721.10	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	119,662,152.89	18.18

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	16,889,493.27	2.57
非日常生活消费品	212,828,601.96	32.33
日常消费品	38,354,344.84	5.83
金融	16,737,002.14	2.54
医疗保健	35,142,366.27	5.34
工业	42,340,074.61	6.43
信息技术	32,171,083.48	4.89
电信服务	75,578,762.49	11.48
地产业	29,944,395.79	4.55
合计	499,986,124.85	75.95

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	H03690	美团-W	104,700	27,912,855.83	4.24
2	H00700	腾讯控股	52,100	25,317,198.91	3.85
3	H00291	华润啤酒	384,000	22,286,430.72	3.39
4	H02020	安踏体育	146,000	22,207,216.70	3.37
5	H02669	中海物业	3,085,000	21,305,824.44	3.24
6	H02269	药明生物	162,000	19,181,607.41	2.91
7	H01810	小米集团-W	845,600	18,997,384.90	2.89
8	H02357	中航科工	4,345,000	18,583,092.26	2.82
9	H00728	中国电信	7,570,000	18,329,640.70	2.78
10	H01316	耐世特	2,020,000	18,152,657.28	2.76

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

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

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。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,084,704.82
4	应收利息	4,774.28
5	应收申购款	162,031.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,251,510.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C
报告期期初基金份额总额	542,156,264.37	175,582,559.52

报告期期间基金总申购份额	1,773,956.26	1,236,417.46
减：报告期期间基金总赎回份额	46,512,898.31	42,672,043.22
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	497,417,322.32	134,146,933.76

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发起份 额承诺 持有期 限
基金管理人 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	1.58%	10,000,138.90	1.58%	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,138.90	1.58%	10,000,138.90	1.58%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	期初份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额

		超过20%的时间区间					
个人	1	20210401-20210630	200,007,333.33	-	-	200,007,333.33	31.67%
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险</p> <p>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。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险</p> <p>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。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险</p> <p>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。</p> <p>4、基金运作发生重大变更的风险</p> <p>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。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方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。

10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

10.3 查阅方式

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

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