

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

2024年第1季度报告

2024年03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:广发证券股份有限公司

报告送出日期:2024年04月19日

§1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年4月18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2024年1月1日起至2024年3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 弘毅远方国证民企领先100ETF |
| 场内简称 | 民企ETF |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 200,976,423.00份 |
| 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 |

| | |
|--------|--|
| | <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 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。 |
| 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 |

§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（2024年01月01日 - 2024年03月31日） |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -27,098,046.10 |
| 2.本期利润 | -15,393,611.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0532 |
| 4.期末基金资产净值 | 227,375,830.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1314 |

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 | 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 | -0.64% | 1.50% | -0.44% | 1.52% | -0.20% | -0.02% |
| 过去六个月 | -7.58% | 1.32% | -7.82% | 1.33% | 0.24% | -0.01% |
| 过去一年 | -21.06% | 1.19% | -23.18% | 1.20% | 2.12% | -0.01% |
| 过去三年 | -33.88% | 1.38% | -38.71% | 1.40% | 4.83% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.14% | 1.46% | 4.08% | 1.48% | 9.06% | -0.02% |

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-2024年03月31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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
| | | | | |

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|----|--------------------------------------|------------|------|-----|--|
| 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 | - | 14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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人旗下管理的投资组合参与的交易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

本基金跟踪国证民企领先100指数，该指数从实际控制人为非国有独资、非国有控股及非外资控股的上市公司中选取100只各行业龙头企业、流动性好且盈利可持续的证券作为指数样本，为投资者提供优质民营企业的投资标的。报告期内本基金主要采取完全复制法，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动进行相应调整。

指数走势上，国证民企领先100指数报告期内下跌0.44%，同期沪深300和中证500分别上涨3.10%和下跌2.64%。

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。

本报告期内利好民营经济的政策持续出台。3月21日，在浙江温州举办的促进民营经济发展壮大现场会上，国家发展改革委正式发布了三项专项行动，以进一步促进民营经济发展壮大。同一天，国务院新闻办公室举行近期投资、财政、金融有关数据及政策新闻发布会，国家发展和改革委员会副主任刘苏社在发布会现场表示，目前正在研究起草民营经济促进法，为更好促进民营经济发展提供法治保障，为民间投资营造稳定、可预期的制度环境。

一季度国内经济呈现低位企稳，民营经济在此过程中表现亮眼。2024年1-2月份，进出口总额66,138亿元，同比增长8.7%。其中，民营企业进出口增长17.7%，占进出口总额的比重为54.6%，比上年同期提高4.2个百分点。2024年1-2月份全国规模以上工业企业利润增长10.2%。其中，民营企业实现利润总额2,465.4亿元，增长12.7%。

4.5 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1.1314元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.44%。

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 | 222,972,145.57 | 97.78 |
| | 其中：股票 | 222,972,145.57 | 97.78 |
| 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 | 5,061,288.53 | 2.22 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 228,033,434.10 | 100.00 |

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（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 | 9,248,181.90 | 4.07 |
| B | 采矿业 | 4,143,096.00 | 1.82 |
| C | 制造业 | 176,397,866.56 | 77.58 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 749,232.00 | 0.33 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,038,500.00 | 0.46 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,837,900.00 | 2.57 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息 技术服务业 | 12,260,522.84 | 5.39 |
| J | 金融业 | 8,489,406.86 | 3.73 |
| 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 | 2,070,732.00 | 0.91 |
| 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 | 2,427,456.00 | 1.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 222,662,894.16 | 97.93 |

5.2.2 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 | 269,575.63 | 0.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,725.25 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息 技术服务业 | 6,536.72 | 0.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,097.60 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,750.21 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施 管理业 | 7,566.00 | 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |

| | | | |
|--|----|------------|------|
| | 合计 | 309,251.41 | 0.14 |
|--|----|------------|------|

5.2.3 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。

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 报告期末指数投资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 | 300750 | 宁德时代 | 110,860 | 21,081,137.60 | 9.27 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 213,600 | 13,717,392.00 | 6.03 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 178,206 | 8,192,129.82 | 3.60 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 37,600 | 7,635,056.00 | 3.36 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 554,974 | 7,153,614.86 | 3.15 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 202,400 | 5,952,584.00 | 2.62 |
| 7 | 601012 | 隆基绿能 | 273,746 | 5,340,784.46 | 2.35 |
| 8 | 300124 | 汇川技术 | 84,850 | 5,194,517.00 | 2.28 |
| 9 | 002714 | 牧原股份 | 109,626 | 4,730,361.90 | 2.08 |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 44,400 | 4,608,720.00 | 2.03 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 301526 | 国际复材 | 7,190 | 29,191.40 | 0.01 |
| 2 | 688652 | 京仪装备 | 376 | 15,927.36 | 0.01 |
| 3 | 301508 | 中机认检 | 419 | 15,750.21 | 0.01 |
| 4 | 688709 | 成都华微 | 781 | 15,151.40 | 0.01 |
| 5 | 601096 | 宏盛华源 | 3,312 | 14,904.00 | 0.01 |

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
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
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.3 其他资产构成
无。

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 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 | 301526 | 国际复材 | 29,191.40 | 0.01 | 创业板打新限售 |
| 2 | 688652 | 京仪装备 | 15,927.36 | 0.01 | 科创板打新限售 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|------|---------|
| 3 | 301508 | 中机认检 | 15,750.21 | 0.01 | 创业板打新限售 |
| 4 | 688709 | 成都华微 | 15,151.40 | 0.01 | 科创板打新限售 |
| 5 | 601096 | 宏盛华源 | 14,904.00 | 0.01 | 新股锁定 |

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 375,976,423.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 176,000,000.00 |
| 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 | 200,976,423.00 |

§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

单位：份

| | |
|--------------------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 363,643.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 363,643.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.18 |

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 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% | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| | | | | | | | |

| 别 | | 0%的时间 区间 | | | | | |
|--|---|-----------------------|--------------------|---|--------------------|--------------------|--------|
| 个人 | 1 | 20240101~ 20240331 | 369,176,98 2.00 | - | 174,200,000. 00 | 194,976,98 2.00 | 97.01% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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。