

# 弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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2024年8月29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2024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 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
§5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
§7 投资组合报告 .....	44
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
7.3 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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
§8 基金份额持有人信息 .....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56

8.3 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 .....	56
§9 开放式基金份额变动 .....	57
§10 重大事件揭示 .....	57
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
§12 备查文件目录 .....	60
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金	
基金简称	弘毅远方汽车产业升级混合	
基金主代码	015527	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年12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	130,910,386.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	弘毅远方汽车产业升级混合A	弘毅远方汽车产业升级混合C
下属分级基金的交易代码	015527	015528
报告期末下属分级基金的份额总额	39,333,915.74份	91,576,470.31份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以自下而上选股策略为主，以基本面分析为立足点，深度挖掘、精选个股，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于汽车产业升级主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期超额回报。
投资策略	本基金采用自上而下的方法进行大类资产配置，通过对宏观经济、政策环境、证券市场走势的跟踪和综合分析，进行前瞻性的战略判断，合理确定基金在股票、存托凭证、债券、现金等各类别资产中的投资比例，并适时进行动态调整。本基金重点投资于汽车产业升级相关的优质上市公司，主要包括以下领域：1) 汽车的动力升级：主要包括新能源汽车整车制造，锂电池和燃料电池产业链制造（电池材料、电池装备等），及新能源电机、电控产业的企业。2) 汽车的驾驶体验升级：聚焦汽车产业与人工智能、大数据等新兴技术相结合，以智能驾驶为主要业务方向的企业，其中

	既包括提供设备的硬件企业，也包括提供数据和实现智能化操作的软件或服务的企业。3) 汽车的品牌升级：聚焦内部大循环建设过程中消费升级的机遇，寻找能够通过改进产品设计、提高产品质量和技术含量等途径提高品牌影响力和认可度，进而实现品牌升级的自主车企与零部件、服务厂商。
业绩比较基准	中证智能电动汽车指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×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。本基金若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	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	gfluoqi@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	中国证券报
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	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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	弘毅远方汽车产业升级混合A	弘毅远方汽车产业升级混合C
本期已实现收益	-3,560,165.13	-2,567,721.34
本期利润	-3,938,299.42	-4,442,787.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0929	-0.0838
本期加权平均净值利润率	-12.89%	-11.65%
本期基金份额净值增长率	-11.52%	-11.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-12,204,490.92	-28,910,313.43
期末可供分配基金份额利润	-0.3103	-0.3157
期末基金资产净值	27,571,584.24	63,717,718.28
期末基金份额净值	0.7010	0.6958
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	

基金份额累计净值增长率	-29.90%	-30.42%
-------------	---------	---------

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

##### 弘毅远方汽车产业升级混合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
过去一个月	-3.27%	0.85%	-2.31%	0.82%	-0.96%	0.03%
过去三个月	-5.51%	1.12%	-2.03%	1.05%	-3.48%	0.07%
过去六个月	-11.52%	1.41%	-4.54%	1.25%	-6.98%	0.16%
过去一年	-22.07%	1.25%	-17.94%	1.09%	-4.13%	0.16%
自基金合同生效起至今	-29.90%	1.12%	-22.29%	1.05%	-7.61%	0.07%

##### 弘毅远方汽车产业升级混合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
过去一个月	-3.31%	0.85%	-2.31%	0.82%	-1.00%	0.03%
过去三个月	-5.63%	1.12%	-2.03%	1.05%	-3.60%	0.07%
过去六个月	-11.73%	1.41%	-4.54%	1.25%	-7.19%	0.16%
过去一年	-22.42%	1.25%	-17.94%	1.09%	-4.48%	0.16%
自基金合同生效起至今	-30.42%	1.12%	-22.29%	1.05%	-8.13%	0.07%



注：本基金的业绩比较基准为中证智能电动汽车指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×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



注：本基金基金合同生效日为2022年12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3.5亿元人民币（截至2024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2024年6月30日，本基金管理人共管理6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		
樊可	本基金基金经理	2022-12-16	-	6年	上海交通大学工商管理硕士。曾任中核集团秦山核电厂工程师、中国广核集团设计院高级工程师及高级主管、民生证券研究院高级研究员（高端制造）。2018年8月加入弘毅远方基金管理有限公司，曾任投资研究部高级研究员、投资研究部副总经理、弘毅远方经济新动力混合型发起式证券投资基金的基金经理和弘毅远方高端制造混合型发起式证券投资基金的基金经理。

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。

3、本基金管理人于2024年7月30日发布《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2024年7月30日起，增聘王哲宇先生担任本基金的基金经理，与樊可先生共同管理本基金。

4、本基金管理人于2024年8月15日发布《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2024年8月15日起，樊可先生不再担任本基金的基金经理，由王哲宇先生独立管理本基金。

#### 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遵规守信情况的说明

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

2024年上半年A股和H股市场受多重因素影响，波动较大。一季度A股市场经历了一轮V型震荡行情，元旦之后以中证1000和国证2000为代表的小盘股受多种交易因素共振的影响大幅下挫，至2月5日区间最大跌幅在30%左右，Wind全A指数区间跌幅也达到了17%，小盘股比例较高的创业板综合指数区间跌幅也达到了27%左右。2月6号之后，在各项稳定市场政策的催化下，以及长期资金逐步入市，主要指数迎来了反转，并在之后的一个多月中收复了失地。二季度A股市场相对稳定，呈现整体震荡略下行的走势，并在6月份出现了一轮显著的下跌。

2024年上半年整体表现看，上证指数、沪深300和恒生指数分别上涨0.43%、1.38%和3.96%。虽然指数整体波动不大，但市场结构上差异较大，表现较好的红利指数上半年涨幅超过8%，相对落后的中证2000和科创100的跌幅均超过20%；行业间也同样分化显著，表现最好的银行板块上涨18%，相对落后的计算机板块跌幅达到23%。2024年上半年本产品净值下跌11.15%，落后于中证智能电动汽车指数（下跌7.51%）。

上半年本产品持仓主方向保持稳定，聚焦汽车产业升级方向，深度挖掘汽车产业景气度、智能驾驶渗透率提升、竞争格局变化等方向蕴含的投资机会。一季度本产品在汽车板块精选了包括整车和零部件标的、汽车电子业务进展较好的电子或计算机标的。此外，我们也关注到低空经济等新兴的主题方向，以及有色等周期性方向的机会，阶段性持有了部分相关标的。二季度本产品继续聚焦汽车产业升级趋势，围绕汽车板块寻找潜在的投资机会，重点持有了24年销量预期较好的整车标的，如比亚迪、零跑汽车等，以及业绩稳健且低估的汽车零部件标的。二季度本产品也持有了部分电子、化工和交运个股，涉及存储、PCB、长丝和航运等几个方向个股。

除A股标的之外，本产品也持有了一部分的港股仓位，重点方向与A股一致，主要基于这些港股标的稀缺性和估值合理性。随着美联储降息时点的逐步临近，我们认为港股可能会比A股更先受益，并出现上行。展望后市，我们也会继续关注港股市场的投资机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方汽车产业升级混合A基金份额净值为0.7010元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-11.52%,同期业绩比较基准收益率为-4.54%;截至报告期末弘毅远方汽车产业升级混合C基金份额净值为0.6958元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-11.73%,同期业绩比较基准收益率为-4.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2023年四季报中,我们提出“当前阶段市场博弈的关键在于经济预期”,从上半年行情来看,基本演绎了“对经济的悲观预期—预期逐步修复—预期再度走弱”的过程。从国内宏观指标来看,经历了3-4月份的逐步走强之后,5月份开始再度疲软,一定程度上影响了市场的信心。市场对二季度A股市场盈利预期也进行了下调。我们认为上述情况可能是由于政策落地的节奏的影响,后续随着新增国债发行的加速、“三大工程”实物工作量的逐步落地、各项促销费政策的落地,国内经济将呈现逐步走稳的趋势,并为企业盈利的修复提供坚实的基础,从而有助于A股市场的逐步走高。

展望未来半年到一年的经济走势,我们认为最困难的时候正在度过。一方面,随着二十届三中全会的胜利召开,大会形成的《中共中央关于进一步全面深化改革、推进中国式现代化的决定》为未来五到十年的发展指明了方向,其中重点关注的“产业体系大而不强、全而不精,关键核心技术受制于人的状况”必将成为未来产业政策关注的重点。另一方面,针对上半年经济疲软的情况,近期政策端开始发力,进一步推动设备更新、耐用品消费的政策落地,并加大了补贴力度。我们认为这一政策,既能够直接刺激经济,也在一定程度上回应了市场的期望,有助于增强市场的信心。向后展望,我们维持年初的判断:从我国内生经济周期角度,2季度末PPI同比已下行至历史底部,后续随着地产企稳,经济弱复苏,PPI同比可能见底略有回升,带动盈利增速向上,国内经济将进入被动去库存复苏期。

海外方面,美联储加息动作一直是主导市场的核心变量。在美联储停止加息之后,全球市场已经提前开始交易降息预期,虽然受美国通胀、就业等各项数据的影响,交易颇为波折,但从贵金属价格、美股科技股走势来看,均反映了市场对未来降息的预期。我们认为除了美国的通胀和就业数据外,日益临近的美国大选也已成为一个重要的影响因素,因为不同候选人的政策导向差异较大,不可预期性在加强。向后展望,我们会密切关注上述因素,一方面体现在利率对市场定价的影响,一方面体现在大选结果对未来出口数据的影响。

具体到汽车行业,4月份在汽车消费政策预期的刺激下,汽车板块表现相对较好,但在政策落地后,汽车销量数据呈现出了慢热的现象。不同于以往的“减税降费”政策,本轮汽车消费支持政策核心在于“以旧换新”,有一定的认知挑战,刺激效果显现的速度要慢于前几轮政策。另一方面部分海外市场对中国出口汽车采取了一些增加贸易壁垒的措施,也一定程度上加剧了市场的悲观预期。7月底中央政府进一步明确了汽车消费政策的补贴金额和适用范围,力度超预期,有望为下半年汽车行业发展注入新的动力。目

前我们仍维持“2024年国内汽车产/销量保持中个位数增长”的预期，以及“汽车智能化是未来几年行业变化的重点”的判断，我们会继续在这些方向上深度挖掘各类投资机会，寻找新质生产力领域真正的领跑者。

#### 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汽车产业升级混合型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，弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金的管理人--弘毅远方基金管理有限公司在弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金的投资运作、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，弘毅远方汽车产业升级混合型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汽车产业升级混合型证券投资基金2024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：弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	14,101,413.82	4,394,115.89
结算备付金		117,014.82	116,601.97
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	77,911,473.32	42,722,013.06
其中：股票投资		77,911,473.32	42,722,013.06
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	-	-
应收清算款		-	1,400,117.99
应收股利		79,296.25	-
应收申购款		359,388.35	628.04

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		92,568,586.56	48,633,476.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,010,355.30	167,640.73
应付管理人报酬		95,381.94	49,787.74
应付托管费		15,896.97	8,297.96
应付销售服务费		28,032.07	5,595.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	129,617.76	110,030.46
负债合计		1,279,284.04	341,352.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	130,910,386.05	61,032,758.82
未分配利润	6.4.7.7	-39,621,083.53	-12,740,634.64
净资产合计		91,289,302.52	48,292,124.18
负债和净资产总计		92,568,586.56	48,633,476.95

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额130,910,386.05份，其中弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金A类基金份额的基金份额净值0.7010元，基金份额总额39,333,915.74份，基金资产净值27,571,584.24元；弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金C类基金份额的基金份额净值0.6958元，基金份额总额91,576,470.31份，基金资产净值63,717,718.28元。



## 6.2 利润表

会计主体：弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
一、营业总收入		-7,745,279.52	-8,870,956.36
1.利息收入		55,113.58	263,052.37
其中：存款利息收入	6.4.7.8	55,113.58	226,614.24
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		-	36,438.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-5,629,156.09	-11,212,035.40
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-6,223,244.78	-11,501,807.16
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	594,088.69	289,771.76
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,253,200.78	1,960,602.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	81,963.77	117,423.88
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>635,807.73</b>	<b>1,025,698.74</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	405,533.74	730,507.83
2.托管费	6.4.10.2.2	67,588.96	97,401.03
3.销售服务费	6.4.10.2.3	93,068.21	108,529.73
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	69,616.82	89,260.15
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-8,381,087.25</b>	<b>-9,896,655.10</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-8,381,087.25</b>	<b>-9,896,655.10</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-8,381,087.25</b>	<b>-9,896,655.10</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	61,032,758.82	-12,740,634.64	48,292,124.18

二、本期期初净资产	61,032,758.82	-12,740,634.64	48,292,124.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	69,877,627.23	-26,880,448.89	42,997,178.34
（一）、综合收益总额	-	-8,381,087.25	-8,381,087.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	69,877,627.23	-18,499,361.64	51,378,265.59
其中：1.基金申购款	124,353,577.92	-34,041,614.80	90,311,963.12
2.基金赎回款	-54,475,950.69	15,542,253.16	-38,933,697.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	130,910,386.05	-39,621,083.53	91,289,302.52
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	268,137,069.60	-193,718.70	267,943,350.90
二、本期期初净资产	268,137,069.60	-193,718.70	267,943,350.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-195,996,741.31	-7,124,429.77	-203,121,171.08
（一）、综合收益	-	-9,896,655.10	-9,896,655.10

总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-195,996,741.31	2,772,225.33	-193,224,515.98
其中: 1.基金申购款	1,624,171.55	-139,275.46	1,484,896.09
2.基金赎回款	-197,620,912.86	2,911,500.79	-194,709,412.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	72,140,328.29	-7,318,148.47	64,822,179.82

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

黄恽俊

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

弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金(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[2022]574号《关于准予弘毅远方汽车产业升级混合型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《弘毅远方汽车产业升级混合型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268,131,147.67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(2022)第1019号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金基金合同》于2022年12月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为268,137,069.60份基金份额,其中认

购资金利息折合5,921.93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《弘毅远方汽车产业升级混合型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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方汽车产业升级混合型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(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证)、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)。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中投资于汽车产业升级主题相关股票比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；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：中证智能电动汽车指数收益率×70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金基金合同》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。

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基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 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。

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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	3,152,854.32
等于：本金	3,150,786.86

加：应计利息	2,067.46
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	10,948,559.50
等于：本金	10,947,850.68
加：应计利息	708.82
减：坏账准备	-
合计	14,101,413.82

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	79,511,472.67	-	77,911,473.32	-1,599,999.35
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	79,511,472.67	-	77,911,473.32	-1,599,999.35

#### 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

无余额。

##### 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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.94
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-审计费	89,835.26
预提费用-信息披露费	39,781.56
合计	129,617.76

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 弘毅远方汽车产业升级混合A

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方汽车产业升级混合 A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,761,045.02	44,761,045.02
本期申购	630,179.13	630,179.13
本期赎回（以“-”号填列）	-6,057,308.41	-6,057,308.41

本期末	39,333,915.74	39,333,915.74
-----	---------------	---------------

#### 6.4.7.6.2 弘毅远方汽车产业升级混合C

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方汽车产业升级混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,271,713.80	16,271,713.80
本期申购	123,723,398.79	123,723,398.79
本期赎回（以“-”号填列）	-48,418,642.28	-48,418,642.28
本期末	91,576,470.31	91,576,470.31

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 6.4.7.7.1 弘毅远方汽车产业升级混合A

单位：人民币元

项目 (弘毅远方汽车产业升级混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,284,082.39	987,571.82	-9,296,510.57
本期期初	-10,284,082.39	987,571.82	-9,296,510.57
本期利润	-3,560,165.13	-378,134.29	-3,938,299.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,639,756.60	-167,278.11	1,472,478.49
其中：基金申购款	-190,868.69	21,355.15	-169,513.54
基金赎回款	1,830,625.29	-188,633.26	1,641,992.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,204,490.92	442,159.42	-11,762,331.50

##### 6.4.7.7.2 弘毅远方汽车产业升级混合C

单位：人民币元

项目 (弘毅远方汽车产业升级混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,805,755.34	361,631.27	-3,444,124.07
本期期初	-3,805,755.34	361,631.27	-3,444,124.07
本期利润	-2,567,721.34	-1,875,066.49	-4,442,787.83
本期基金份额交易产生的变动数	-22,536,836.75	2,564,996.62	-19,971,840.13
其中：基金申购款	-37,734,867.76	3,862,766.50	-33,872,101.26
基金赎回款	15,198,031.01	-1,297,769.88	13,900,261.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,910,313.43	1,051,561.40	-27,858,752.03

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	48,761.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,939.73
结算备付金利息收入	412.85
其他	-
合计	55,113.58

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	229,725,815.65
减：卖出股票成本总额	235,389,587.50
减：交易费用	559,472.93
买卖股票差价收入	-6,223,244.78

**6.4.7.10 基金投资收益**

无。

**6.4.7.11 债券投资收益**

无。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	594,088.69
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	594,088.69

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-2,253,200.78
——股票投资	-2,253,200.78
——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	-2,253,200.78

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	81,960.88
转换费收入	2.89
合计	81,963.77

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
合计	69,616.82

#### 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**

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

**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、注册登记机构、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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	502,558,064.19	100.00%	302,161,104.88	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	-	-	387,500,000.00	100.00%

**6.4.10.1.5 基金交易**

无。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024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	361,122.04	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	222,292.57	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 2024年01月01日至2 024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	405,533.74	730,507.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	182,320.35	329,956.98
应支付基金管理人的净管理费	223,213.39	400,550.85

注：1、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%/1.20%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、自2023年8月7日起，本基金管理费率由1.50%调整为1.20%。

3、根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至202 4年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,588.96	97,401.03

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



单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	弘毅远方汽车产业升级混合 A	弘毅远方汽车产业升级混合 C	合计
弘毅远方 基金	0.00	0.00	0.00
广发证券	0.00	26,510.28	26,510.28
合计	0.00	26,510.28	26,510.28
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	弘毅远方汽车产业升级混合 A	弘毅远方汽车产业升级混合 C	合计
弘毅远方 基金	0.00	18,145.21	18,145.21
广发证券	0.00	79,482.78	79,482.78
合计	0.00	97,627.99	97,627.99

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。

#### 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固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.4.2 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**

无。

**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自有资金投资本基金的情况**

弘毅远方汽车产业升级混合A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年01月01日 至2023年06月30 日
报告期初持有的基金份额	8,994,987.79	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,994,987.79	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.87%	-

**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 2024年01月01日至2024年06月30 日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	3,150,786.86	48,761.00	2,234,592.00	113,913.89
广发证券- 证券户	10,947,850.68	5,939.73	4,849,989.07	8,861.20

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而导致的流通受限股票。

##### 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

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。

#### 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(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证)、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。本基金以自下而上选股策略为主，以基本面分析为立足点，深度挖掘、精选个股，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于汽车产业升级主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期超额回报。

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內。

#### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人广发证券开立于交通银行股份有限公司的托管账户，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2024年6月30日，本基金无债券投资。（2023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2024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，可赎回基金份额净值(净资产)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。（2023年12月31日：同）

#### 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，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。

### 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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,101,413.82	-	-	-	14,101,413.82
结算备付金	117,014.82	-	-	-	117,014.82
交易性金融资产	-	-	-	77,911,473.32	77,911,473.32
应收股利	-	-	-	79,296.25	79,296.25
应收申购款	-	-	-	359,388.35	359,388.35
资产总计	14,218,428.64	-	-	78,350,157.92	92,568,586.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,010,355.30	1,010,355.30
应付管理人报	-	-	-	95,381.94	95,381.94

酬					
应付托管费	-	-	-	15,896.97	15,896.97
应付销售服务费	-	-	-	28,032.07	28,032.07
其他负债	-	-	-	129,617.76	129,617.76
负债总计	-	-	-	1,279,284.04	1,279,284.04
利率敏感度缺口	14,218,428.64	-	-	77,070,873.88	91,289,302.52
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,394,115.89	-	-	-	4,394,115.89
结算备付金	116,601.97	-	-	-	116,601.97
交易性金融资产	-	-	-	42,722,013.06	42,722,013.06
应收清算款	-	-	-	1,400,117.99	1,400,117.99
应收申购款	-	-	-	628.04	628.04
资产总计	4,510,717.86	-	-	44,122,759.09	48,633,476.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	167,640.73	167,640.73
应付管理人报	-	-	-	49,787.74	49,787.74

酬					
应付托管费	-	-	-	8,297.96	8,297.96
应付销售服务费	-	-	-	5,595.88	5,595.88
其他负债	-	-	-	110,030.46	110,030.46
负债总计	-	-	-	341,352.77	341,352.77
利率敏感度缺口	4,510,717.86	-	-	43,781,406.32	48,292,124.18

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2024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（2023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。本基金持有以非记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	-	15,682,429.84	-	15,682,429.84
应收股利	-	79,296.25	-	79,296.25
资产合计	-	15,761,726.0	-	15,761,726.0



		9		9
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	-	15,761,726.09	-	15,761,726.09
项目	上年度末 2023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	-	7,895,369.26	-	7,895,369.26
资产合计	-	7,895,369.26	-	7,895,369.26
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	-	7,895,369.26	-	7,895,369.26

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	788,086.30	394,768.46
所有外币相对人民币贬值5%	-788,086.30	-394,768.46	

#### 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。本基金的基金管理人通过对宏观经济、政策环境、证券市场走势的跟踪

和综合分析，进行前瞻性的战略判断，合理确定基金在股票、存托凭证、债券、现金等各类别资产中的投资比例，并适时进行动态调整。

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%，其中投资于汽车产业升级主题相关股票比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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 2024年06月30日		上年度末 2023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 (%)
交易性金融资产—股票投资	77,911,473.32	85.35	42,722,013.06	88.47
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	77,911,473.32	85.35	42,722,013.06	88.47

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	3,719,234.17	1,840,277.58
	业绩比较基准下降5%	-3,719,234.17	-1,840,277.58

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	77,911,473.32	42,722,013.06
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	77,911,473.32	42,722,013.06

###### 6.4.14.2.2 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2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：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	77,911,473.32	84.17
	其中：股票	77,911,473.32	84.17
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	14,218,428.64	15.36
8	其他各项资产	438,684.60	0.47
9	合计	92,568,586.56	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15682429.84元，占基金资产净值比例为17.18%。

### 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	54,016,241.48	59.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,681,352.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,768,250.00	3.03
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	2,763,200.00	3.03
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	62,229,043.48	68.17

**7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	11,101,077.43	12.16
工业	293,180.19	0.32
信息技术	4,288,172.22	4.70
合计	15,682,429.84	17.18

**7.3 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	002594	比亚迪	21,000	5,255,250.00	5.76
2	H09863	零跑汽车	195,300	4,777,003.63	5.23
3	000625	长安汽车	330,100	4,433,243.00	4.86
4	601799	星宇股份	39,000	4,369,560.00	4.79
5	300750	宁德时代	23,900	4,302,717.00	4.71
6	H01810	小米集团-W	278,000	4,181,388.66	4.58
7	601127	赛力斯	40,200	3,663,024.00	4.01
8	H00425	敏实集团	320,000	3,545,579.26	3.88
9	002920	德赛西威	40,000	3,483,600.00	3.82
10	603986	兆易创新	34,300	3,279,766.00	3.59
11	688187	时代电气	60,000	2,962,800.00	3.25
11	H03898	时代电气	10,100	283,916.49	0.31
12	600183	生益科技	148,990	3,137,729.40	3.44
13	600066	宇通客车	110,100	2,840,580.00	3.11
14	688188	柏楚电子	15,000	2,768,250.00	3.03
15	603588	高能环境	440,000	2,763,200.00	3.03
16	603225	新凤鸣	176,000	2,743,840.00	3.01
17	601233	桐昆股份	170,000	2,713,200.00	2.97
18	603713	密尔克卫	50,100	2,681,352.00	2.94
19	600418	江淮汽车	110,100	1,743,984.00	1.91
20	600482	中国动力	80,000	1,558,400.00	1.71
21	H01316	耐世特	450,000	1,445,685.12	1.58
22	603596	伯特利	35,000	1,361,500.00	1.49
23	300679	电连技术	29,096	1,170,532.08	1.28
24	H09690	途虎-W	50,100	1,063,112.48	1.16
25	002997	瑞鹄模具	14,300	457,171.00	0.50

26	002126	银轮股份	21,900	381,279.00	0.42
27	002463	沪电股份	10,200	372,300.00	0.41
28	600699	均胜电子	23,700	351,234.00	0.38
29	600522	中天科技	20,400	323,340.00	0.35
30	300360	炬华科技	19,000	323,000.00	0.35
31	603786	科博达	5,000	320,750.00	0.35
32	002487	大金重工	12,300	281,424.00	0.31
33	000887	中鼎股份	22,400	274,176.00	0.30
34	H09868	小鹏汽车— W	10,000	269,696.94	0.30
35	601689	拓普集团	5,000	268,050.00	0.29
36	603308	应流股份	20,200	250,884.00	0.27
37	601179	中国西电	26,000	209,040.00	0.23
38	601766	中国中车	27,000	202,770.00	0.22
39	603507	振江股份	6,000	196,920.00	0.22
40	002906	华阳集团	7,200	192,672.00	0.21
41	300394	天孚通信	1,400	123,788.00	0.14
42	H00285	比亚迪电子	3,000	106,783.56	0.12
43	603501	韦尔股份	1,000	99,370.00	0.11
44	601058	赛轮轮胎	7,000	98,000.00	0.11
45	002409	雅克科技	1,500	94,365.00	0.10
46	688472	阿特斯	8,000	81,440.00	0.09
47	600346	恒力石化	5,000	69,750.00	0.08
48	300001	特锐德	1,000	20,120.00	0.02
49	H03808	中国重汽	500	9,263.70	0.01
50	603236	移远通信	100	4,673.00	0.01

## 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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	002920	德赛西威	8,127,915.00	16.83
2	002594	比亚迪	7,945,768.35	16.45
3	H02015	理想汽车—W	7,450,030.18	15.43
4	002050	三花智控	6,349,188.12	13.15
5	601689	拓普集团	6,211,301.00	12.86
6	H00425	敏实集团	5,713,531.84	11.83
7	H01810	小米集团—W	5,599,006.12	11.59
8	H09863	零跑汽车	5,333,235.10	11.04
9	300750	宁德时代	5,235,374.60	10.84
10	002156	通富微电	5,048,332.00	10.45
11	601799	星宇股份	5,020,691.00	10.40
12	002475	立讯精密	4,682,612.00	9.70
13	000625	长安汽车	4,628,943.00	9.59
14	603338	浙江鼎力	4,587,609.00	9.50
15	603596	伯特利	4,543,215.00	9.41
16	601899	紫金矿业	4,499,350.00	9.32
17	603225	新凤鸣	4,306,115.00	8.92
18	601233	桐昆股份	4,219,083.00	8.74
19	603713	密尔克卫	3,836,568.00	7.94
20	601717	郑煤机	3,742,166.00	7.75
21	H00175	吉利汽车	3,736,139.05	7.74
22	601127	赛力斯	3,594,723.00	7.44
23	H09868	小鹏汽车—W	3,570,478.79	7.39
24	002463	沪电股份	3,505,537.00	7.26
25	688187	时代电气	3,239,341.36	6.71
26	300129	泰胜风能	3,173,298.00	6.57
27	002984	森麒麟	3,103,216.00	6.43
28	601058	赛轮轮胎	3,090,985.00	6.40
29	002371	北方华创	3,075,230.00	6.37



30	600418	江淮汽车	3,064,825.00	6.35
31	600183	生益科技	3,038,648.20	6.29
32	688188	柏楚电子	3,022,695.88	6.26
33	300124	汇川技术	3,000,801.00	6.21
34	603986	兆易创新	2,988,350.00	6.19
35	300394	天孚通信	2,985,212.00	6.18
36	603588	高能环境	2,887,249.00	5.98
37	600933	爱柯迪	2,870,514.00	5.94
38	000338	潍柴动力	2,857,197.00	5.92
39	600066	宇通客车	2,781,565.00	5.76
40	603728	鸣志电器	2,760,150.00	5.72
41	688326	经纬恒润	2,502,210.88	5.18
42	300274	阳光电源	2,440,072.00	5.05
43	000100	TCL科技	2,349,092.00	4.86
44	002555	三七互娱	2,198,850.00	4.55
45	688025	杰普特	2,121,978.45	4.39
46	300228	富瑞特装	2,116,329.00	4.38
47	600741	华域汽车	2,020,540.00	4.18
48	002028	思源电气	2,016,280.00	4.18
49	688009	中国通号	1,962,699.85	4.06
50	002073	软控股份	1,937,091.00	4.01
51	600686	金龙汽车	1,935,601.00	4.01
52	603993	洛阳钼业	1,911,000.00	3.96
53	603786	科博达	1,868,643.00	3.87
54	000951	中国重汽	1,831,954.00	3.79
55	600522	中天科技	1,829,974.00	3.79
56	601766	中国中车	1,789,310.00	3.71
57	601500	通用股份	1,767,365.00	3.66
58	603337	杰克股份	1,728,709.00	3.58
59	688595	芯海科技	1,726,821.21	3.58
60	600547	山东黄金	1,699,077.00	3.52

61	002179	中航光电	1,674,601.00	3.47
62	H01316	耐世特	1,648,592.74	3.41
63	600660	福耀玻璃	1,640,443.00	3.40
64	603179	新泉股份	1,637,157.00	3.39
65	603129	春风动力	1,621,868.60	3.36
66	603979	金诚信	1,616,952.41	3.35
67	600845	宝信软件	1,608,493.00	3.33
68	601100	恒立液压	1,600,104.00	3.31
69	002373	千方科技	1,539,228.00	3.19
70	600482	中国动力	1,514,082.00	3.14
71	688375	国博电子	1,483,527.37	3.07
72	603297	永新光学	1,470,540.00	3.05
73	301236	软通动力	1,462,687.00	3.03
74	603305	旭升集团	1,432,912.40	2.97
75	300842	帝科股份	1,324,000.00	2.74
76	002436	兴森科技	1,245,773.00	2.58
77	600733	北汽蓝谷	1,244,668.00	2.58
78	000603	盛达资源	1,225,000.00	2.54
79	002001	新和成	1,201,737.00	2.49
80	003021	兆威机电	1,187,408.00	2.46
81	603283	赛腾股份	1,174,223.00	2.43
82	300415	伊之密	1,166,332.00	2.42
83	300679	电连技术	1,165,584.20	2.41
84	002011	盾安环境	1,122,562.00	2.32
85	H09690	途虎-W	1,086,953.02	2.25
86	600498	烽火通信	1,074,883.00	2.23
87	688472	阿特斯	1,066,803.00	2.21
88	301387	光大同创	1,025,559.00	2.12
89	300083	创世纪	1,019,814.00	2.11
90	301308	江波龙	1,008,480.00	2.09
91	688680	海优新材	1,004,827.13	2.08

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	H02015	理想汽车—W	8,481,547.39	17.56
2	601689	拓普集团	7,643,447.00	15.83
3	002156	通富微电	6,889,798.00	14.27
4	002594	比亚迪	6,796,801.00	14.07
5	002050	三花智控	6,333,557.00	13.12
6	002475	立讯精密	5,805,575.00	12.02
7	002984	森麒麟	5,521,243.13	11.43
8	601058	赛轮轮胎	5,082,711.00	10.52
9	600933	爱柯迪	4,890,174.00	10.13
10	601899	紫金矿业	4,886,581.00	10.12
11	H00175	吉利汽车	4,790,402.94	9.92
12	603338	浙江鼎力	4,336,305.00	8.98
13	603596	伯特利	4,219,355.00	8.74
14	002463	沪电股份	4,215,032.00	8.73
15	601717	郑煤机	3,896,699.00	8.07
16	002920	德赛西威	3,410,991.00	7.06
17	300124	汇川技术	3,234,377.32	6.70
18	002371	北方华创	3,110,038.00	6.44
19	300129	泰胜风能	3,101,012.00	6.42
20	H09863	零跑汽车	3,013,869.67	6.24
21	H01810	小米集团—W	2,969,055.48	6.15
22	603728	鸣志电器	2,964,157.00	6.14
23	603179	新泉股份	2,850,619.00	5.90

24	000338	潍柴动力	2,845,892.00	5.89
25	002179	中航光电	2,721,075.00	5.63
26	603993	洛阳钼业	2,639,749.00	5.47
27	300394	天孚通信	2,638,062.00	5.46
28	688326	经纬恒润	2,635,434.54	5.46
29	H09868	小鹏汽车-W	2,627,887.77	5.44
30	600699	均胜电子	2,531,879.97	5.24
31	300274	阳光电源	2,521,356.00	5.22
32	688002	睿创微纳	2,427,122.00	5.03
33	603501	韦尔股份	2,370,221.00	4.91
34	000100	TCL科技	2,335,455.00	4.84
35	600547	山东黄金	2,334,034.00	4.83
36	002555	三七互娱	2,328,592.00	4.82
37	601799	星宇股份	2,120,211.00	4.39
38	600741	华域汽车	2,046,908.00	4.24
39	000034	神州数码	1,977,122.00	4.09
40	002028	思源电气	1,941,431.00	4.02
41	688009	中国通号	1,929,987.90	4.00
42	603979	金诚信	1,924,703.00	3.99
43	300228	富瑞特装	1,918,429.00	3.97
44	603225	新凤鸣	1,916,108.00	3.97
45	002456	欧菲光	1,896,600.00	3.93
46	002126	银轮股份	1,800,084.00	3.73
47	002073	软控股份	1,788,815.00	3.70
48	000951	中国重汽	1,742,952.00	3.61
49	603129	春风动力	1,732,449.00	3.59
50	603786	科博达	1,722,773.00	3.57
51	600660	福耀玻璃	1,689,707.00	3.50
52	601100	恒立液压	1,689,390.00	3.50
53	688025	杰普特	1,686,451.53	3.49
54	600845	宝信软件	1,677,921.00	3.47

55	601500	通用股份	1,673,697.00	3.47
56	603337	杰克股份	1,654,314.00	3.43
57	600686	金龙汽车	1,618,555.00	3.35
58	601233	桐昆股份	1,592,720.00	3.30
59	600522	中天科技	1,557,365.00	3.22
60	688375	国博电子	1,556,759.84	3.22
61	601766	中国中车	1,543,858.00	3.20
62	603305	旭升集团	1,519,631.00	3.15
63	603297	永新光学	1,460,023.00	3.02
64	600733	北汽蓝谷	1,438,800.00	2.98
65	H00425	敏实集团	1,427,982.67	2.96
66	300842	帝科股份	1,418,715.00	2.94
67	688595	芯海科技	1,415,257.31	2.93
68	002373	千方科技	1,372,501.00	2.84
69	600418	江淮汽车	1,320,271.00	2.73
70	000603	盛达资源	1,300,647.00	2.69
71	603283	赛腾股份	1,285,156.00	2.66
72	002011	盾安环境	1,245,666.00	2.58
73	300750	宁德时代	1,190,840.00	2.47
74	300415	伊之密	1,130,349.00	2.34
75	301236	软通动力	1,129,509.00	2.34
76	002001	新和成	1,122,840.00	2.33
77	003021	兆威机电	1,039,848.00	2.15
78	688472	阿特斯	994,866.54	2.06
79	600498	烽火通信	978,701.00	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。

#### 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	272,832,248.54
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	229,725,815.65
--------------	----------------

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

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	79,296.25
4	应收利息	-
5	应收申购款	359,388.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	438,684.60

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

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 汽车 产业 升级	612	64,271.10	8,994,987.79	22.8 7%	30,338,927.95	77.13%

混合A						
弘毅 远方 汽车 产业 升级 混合C	6,5 01	14,086.52	0.00	0.0 0%	91,576,470.31	100.0 0%
合计	7,1 13	18,404.38	8,994,987.79	6.8 7%	121,915,398.26	93.13%

### 8.2 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	弘毅远方汽车产业 升级混合A	100,838.45	0.26%
	弘毅远方汽车产业 升级混合C	1,813.77	0.00%
	合计	102,652.22	0.08%

### 8.3 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	弘毅远方汽车产业 升级混合A	10~50
	弘毅远方汽车产业 升级混合C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	弘毅远方汽车产业 升级混合A	-
	弘毅远方汽车产业 升级混合C	-
	合计	-



**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	弘毅远方汽车产业升级 混合A	弘毅远方汽车产业升级 混合C
基金合同生效日(2022年12月16日)基金份额总额	81,901,057.93	186,236,011.67
本报告期期初基金份额总额	44,761,045.02	16,271,713.80
本报告期基金总申购份额	630,179.13	123,723,398.79
减：本报告期基金总赎回份额	6,057,308.41	48,418,642.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,333,915.74	91,576,470.31

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

**§10 重大事件揭示****10.1 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。

**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，基金管理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**

本基金自基金合同生效日起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。

**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**

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年06月25日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	公司债券投资决策不审慎，且未能做好基金投资者结构与基金资产流动性的匹配管理。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成改正
其他	无
措施2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	副总经理
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年06月25日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	作为公司高级管理人员，对公司存在的相关问题负有责任。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	无
其他	无

**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	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	佣金	占当期佣金总	

	数量		交总额的 比例		量的比 例	
广发 证券	2	502,558,064.19	100.0 0%	361,122.04	100.0 0%	-

注：1、本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，具备健全的内部控制制度，合规风控能力较强，交易能力、投研综合实力较强的证券经纪服务商提供服务。

2、本基金管理人完成内部审批程序后与证券经纪服务商、基金托管人签署证券经纪服务协议，对账户管理、数据传输、证券交易、资金管理、交易监控、费用收取等事项进行约定，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

3、本基金本报告期内交易单元未发生变更情况。

4、本基金管理人已于2024年6月30日前根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金动态调整工作。

#### 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

无。

#### 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	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-19
2	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
3	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-03-28
4	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2023年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-28
5	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	公司网站、中国证券报	2024-04-10

	息资料的公告		
6	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-04-19
7	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金2024年第1季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-19
8	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、公司网站、中国证券报	2024-04-25
9	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金（A类份额）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	2024-06-13
10	弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金（C类份额）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	2024-06-13

## §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

本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2024年4月25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人民币4000万元，增资完成后，基金管理人注册资本由人民币3.1亿元增加至人民币3.5亿元。

## §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汽车产业升级混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方汽车产业升级混合型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汽车产业升级混合型证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方汽车产业升级混合型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](http://www.honyfunds.com)查阅和下载。