

# 弘毅远方国企转型升级混合型发起式证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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:华泰证券股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24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7月1日起至2024年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	弘毅远方国企转型升级混合
基金主代码	006369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年10月31日
报告期末基金份额总额	32,065,019.01份
投资目标	本基金围绕中国国企转型升级过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券、衍生品等各类别资产中的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
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。
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	弘毅远方国企转型升级混合A	弘毅远方国企转型升级混合C
下属分级基金的交易代码	006369	013530
报告期末下属分级基金的份额总额	26,942,854.86份	5,122,164.15份

注：本基金自 2021 年 9 月 10 日起增加 C 类基金份额。

### §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07月01日 - 2024年09月30日)	
	弘毅远方国企转型升级混合A	弘毅远方国企转型升级混合C
1.本期已实现收益	-5,814,639.35	-1,083,730.10
2.本期利润	4,226,821.90	781,418.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.1553	0.1518
4.期末基金资产净值	34,628,408.16	6,485,184.63
5.期末基金份额净值	1.2853	1.2661

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、本基金自 2021 年 9 月 10 日起增加 C 类基金份额。

#### 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

弘毅远方国企转型升级混合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	14.03%	1.46%	11.62%	1.09%	2.41%	0.37%
过去六个月	8.35%	1.27%	10.61%	0.87%	-2.26%	0.40%
过去一年	-3.87%	1.32%	8.40%	0.76%	-12.27%	0.56%

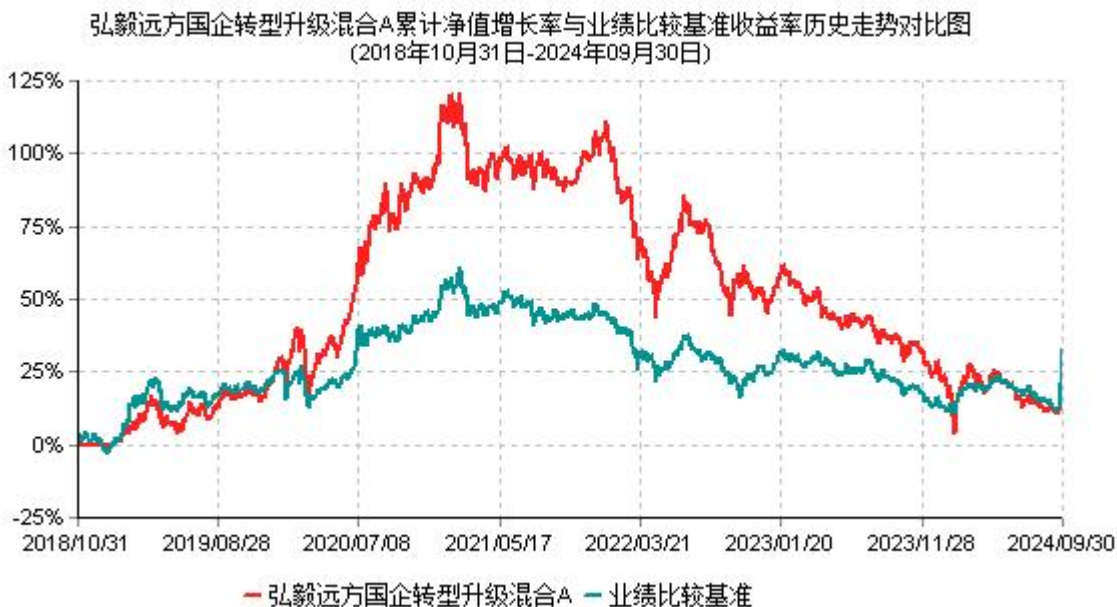
过去三年	-29.30%	1.18%	-8.10%	0.76%	-21.20%	0.42%
过去五年	15.07%	1.23%	12.52%	0.83%	2.55%	0.40%
自基金合同生效起至今	32.80%	1.19%	32.19%	0.84%	0.61%	0.35%

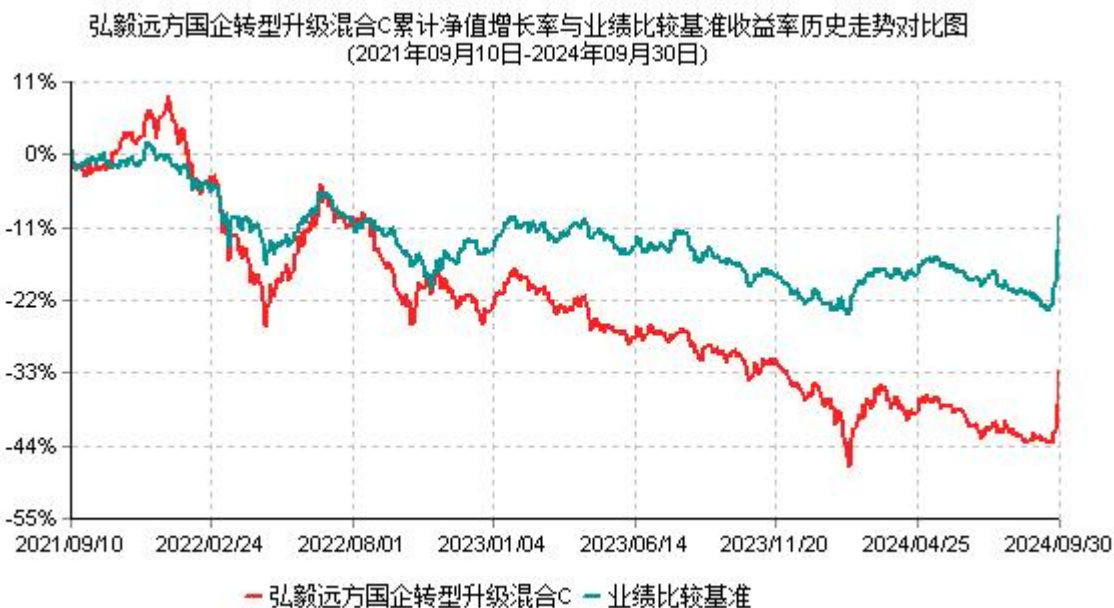
## 弘毅远方国企转型升级混合C净值表现

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	13.88%	1.46%	11.62%	1.09%	2.26%	0.37%
过去六个月	8.08%	1.27%	10.61%	0.87%	-2.53%	0.40%
过去一年	-4.35%	1.32%	8.40%	0.76%	-12.75%	0.56%
过去三年	-30.35%	1.18%	-8.10%	0.76%	-22.25%	0.42%
自基金合同生效起至今	-32.56%	1.17%	-9.38%	0.76%	-23.18%	0.41%

注：本基金自2021年9月10日起增加C类基金份额。

### 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





注：本基金基金合同生效日为2018年10月31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。本基金自2021年9月10日起增加C类基金份额。

## §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		
章劲	本基金基金经理；弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金；公司副总经理兼首席投资官	2022-07-08	-	19年	上海大学信息学学士。曾任上海银行资金营运中心自营业务科经理，华夏基金管理有限公司基金经理，华泰资产管理公司证券投资事业部固定收益投资部总经理、证券投资总监、投资管理部总经理，华泰保兴基金管理有限公司副总经理兼首席投资官等职务。2022年2月加入弘毅远方基金管理有限公司，曾任弘毅远方中短债债券型证券投资基

					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。

#### 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

2024年三季度国内经济增长动能有所减弱，各项高频指标都呈现持续下滑趋势，在此背景下9月26日的政治局会议，超市场预期聚焦当下的经济问题，提出一揽子政策方案，出现明显的政策加码动作。政治局会议对财政、货币和房地产政策都有明确直接表态：1）财政方面，保证必要的财政支出，更好发挥政府投资带动作用；2）货币方面，要降低存款准备金率，实施有力度的降息；3）房地产方面，首次提出促进房地产市场止跌回稳，目标很明确；4）资本市场方面，延续此前证监会的政策态度。三季度股票市场在增量政策出台前依旧普遍下跌，且前期强势板块也频频出现补跌的情形。在政策驱动之下，9月下旬A股市场结束了持续的阴跌，迎来了暴风骤雨般的上涨，市场成交额迅速放大，市场参与者普遍转向乐观。自9月24日央行等金融部委新闻发布会以来，上证指数五个交易日（9/24-9/30）上涨幅度高达21%。最终三季度股票市

场迎来久违的大涨，上证指数、深证综指、沪深300、创业板指、恒生指数分别上涨12.44%、19.00%、16.07%、29.21%和19.27%。

报告期内，本基金加强了对基金净值回撤的控制，在7月1日至9月13日股票市场普遍下行区间，本基金净值下跌4.71%，明显优于同期上证指数、深证综指、沪深300和创业板指的表现（同期上证指数、深证综指、沪深300和创业板指分别下跌8.87%、9.78%、8.74%和8.81%）。9月下旬股票市场出现惊天逆转走势，虽然本基金也适度增加了股票仓位，并对持仓结构进行了一定幅度的优化，增强了持仓的进攻性，但市场的上涨幅度和上涨速度远超我们的预测和判断，而股票持续快速上行的走势，也给我们的加仓和调仓工作都带来了难度。由于股票仓位的不足和持仓结构未能优化到位，本基金在季末股市上行期间的净值表现一般。

展望未来，我们认为自上而下政策转变后，增量政策都将逐步落地，带动市场信心改善和基本面的见底回升，后续关键在于如何把握股票市场行情的核心主线。本基金目前依旧重点关注：1、医药行业：虽然反腐短期内对医药行业的投资带来压力，但从中长期看则有利于治疗属性确切的产品放量，产业的资源配置会更加合理高效。近年来国内医疗企业从产品力到创新力都得到全面提升，很多细分领域进入快速进口替代阶段。而中国人口老龄化的加速，为国内医疗行业的快速发展提供了更为广阔的市场。我们相信国内的医药企业必将迎来新一轮的发展机遇期。2、科技产业：随着人工智能的蓬勃兴起，机器人、智能驾驶等AI应用也离我们的生活越来越近。而国家为了解决核心技术受制于人的状况，国内自主创新的力度必将得以加强。我们相信我国的科技产业在不远的将来必将给中国的资本市场带来精彩夺目的表现。本基金将紧跟股票市场运行的主要脉络，坚持价值成长的投资理念，积极挖掘基本面优秀、盈利增长良好、价值被低估的个股。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方国企转型升级混合A基金份额净值为1.2853元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.03%，同期业绩比较基准收益率为11.62%；截至报告期末弘毅远方国企转型升级混合C基金份额净值为1.2661元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.88%，同期业绩比较基准收益率为11.62%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续20个工作日以上资产净值低于5000万元的情形，出现该情形的时间范围为2024年7月1日至2024年9月30日。

本基金管理人已经向中国证监会报告并提出解决方案，本基金的信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费等各类固定费用自2024年6月21日起由本基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

## §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	29,552,166.68	71.63
	其中：股票	29,552,166.68	71.63
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	11,703,403.14	28.37
8	其他资产	1,086.50	0.00
9	合计	41,256,656.32	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,258,140.00	3.06
C	制造业	17,566,566.68	42.73
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	60,000.00	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政 业	949,420.00	2.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	2,498,480.00	6.08
J	金融业	4,910,230.00	11.94
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	1,772,380.00	4.31
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	536,950.00	1.31
S	综合	-	-
	合计	29,552,166.68	71.88

### 5.3 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	601211	国泰君安	100,000	1,847,000.00	4.49
2	002371	北方华创	4,700	1,720,106.00	4.18
3	300750	宁德时代	6,300	1,586,907.00	3.86
4	688016	心脉医疗	10,029	1,133,277.00	2.76
5	603259	药明康德	21,000	1,099,560.00	2.67
6	601456	国联证券	73,000	918,340.00	2.23
7	002807	江阴银行	200,000	856,000.00	2.08
8	601808	中海油服	53,000	852,240.00	2.07
9	000001	平安银行	69,000	842,490.00	2.05
10	300031	宝通科技	43,000	828,610.00	2.02

### 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

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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,086.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,086.50

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601211	国泰君安	1,847,000.00	4.49	停牌

#### 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

	弘毅远方国企转型升级 混合A	弘毅远方国企转型升级 混合C
报告期期初基金份额总额	30,182,469.77	5,639,276.74
报告期期间基金总申购份额	10,264.15	104,254.08
减：报告期期间基金总赎回份额	3,249,879.06	621,366.67
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	26,942,854.86	5,122,164.15

- 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；  
3、本基金自2021年9月10日起增加C类基金份额。

## §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

	弘毅远方国企转型升级 混合A	弘毅远方国企转型升级 混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	6,000,800.08	735,402.27
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	6,000,800.08	735,402.27
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	22.27	14.36

### 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、赎回或转换本基金的情况。

## §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	持有份额	发起份额总数	发起份额	发起份额
----	-------	------	--------	------	------

	数	占基金总 份额比例		占基金总 份额比例	承诺持有 期限
基金管理人固有 资金	6,736,202.35	21.01%	6,000,800.08	18.71%	3年
基金管理人高级 管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	6,736,202.35	21.01%	6,000,800.08	18.71%	-

### §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超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240703 - 20240930	6,736,202.35	-	-	6,736,202.35	21.01%
产品特有风险							
<p><b>1、基金净值大幅波动的风险</b> 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><b>2、赎回申请延期办理的风险</b> 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><b>3、基金投资策略难以实现的风险</b> 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><b>4、基金运作发生重大变更的风险</b> 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

基金管理人于2024年9月25日发布《弘毅远方基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告》，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）的原则和有关要求，基金管理人与基金托管人协商一致，决定对本公司旗下基金（ETF基金除外）持有的“国泰君安”（证券代码：601211）股票进行估值调整，自2024年9月24日起按指数收益法进行估值。待该股票的交易体现出活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时将不再另行公告。

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