

**弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金**

**2019 年半年度报告**

2019 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:2019 年 08 月 28 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。本半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2019年8月23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2019年1月30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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46

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.....	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金
基金简称	弘毅远方消费升级混合
基金主代码	006644
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01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
报告期末基金份额总额	234,840,433.46份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金深入挖掘基于人均收入和人口特征驱动的消费升级过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的稳健持续增值。
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、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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上证国债指数收益率×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。本基金将投资港股通标的股票，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	马佳	崔瑞娟
	联系电话	021-53682888	020-66338888
	电子邮箱	service@honyfunds.com	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-920-8800	95575
传真		021-53682755	020-87555129
注册地址		上海市黄浦区圆明园路149号 SO301	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		上海市黄浦区圆明园路149号 哈密大楼6楼	广州市天河区马场路26号广 发证券大厦34楼
邮政编码		200002	510627
法定代表人		郭文	孙树明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	www.honyfunds.com
基金半年度报告备置地点	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	上海市黄浦区圆明园路149号哈密大 楼6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（2019年01月30日（基金合同生效日）- 2019年0 6月30日）
本期已实现收益	14,537,485.43
本期利润	48,851,266.35
加权平均基金份额本期利润	0.1484
本期加权平均净值利润率	13.98%

本期基金份额净值增长率	14.38%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	9,050,593.99
期末可供分配基金份额利润	0.0385
期末基金资产净值	268,621,926.11
期末基金份额净值	1.1438
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	14.38%

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、本基金基金合同生效日为2019年1月30日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满六个月。

## 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 <sup>①</sup>	份额净值增长率标准差 <sup>②</sup>	业绩比较基准收益率 <sup>③</sup>	业绩比较基准收益率标准差 <sup>④</sup>	① -③	② -④
过去一个月	8.39%	1.10%	4.20%	0.85%	4.19%	0.25%
过去三个月	6.55%	1.40%	-0.48%	1.10%	7.03%	0.30%
自基金合同生效起至今	14.38%	1.23%	14.53%	1.18%	-0.15%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上证国债指数收益率×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

弘毅远方消费升级混合型发起式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



注：本基金基金合同生效日为2019年1月30日，基金合同生效日至报告期末，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2019年6月30日，本基金尚处于建仓期。

## §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1.7亿元人民币。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2019年6月30日，本基金管理人共管理2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与弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金。

#### 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		



张鸿羽	总经理助理、首席投资官、基金经理	2019-01-30	-	19年	上海财经大学经济学硕士。2018年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总经理助理、首席投资官。在加入弘毅远方之前，张鸿羽女士曾任汇祥资产管理有限公司副总经理、投资经理；交银施罗德基金管理有限公司专户投资经理、基金经理、研究部总经理；上投摩根基金管理有限公司、广发证券股份有限公司高级研究员。
-----	------------------	------------	---	-----	--

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。不同投资合同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和每年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，本基金的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

报告期内，年初至4月上中旬在宽松信用下的流动性释放、中美贸易争端缓和、内外资加大配置净流入的共振下，市场在价值、成长、先进制造、周期等主题之间切换，估值中枢不断抬升，成交活跃。4月中旬以后，在这些因素出现边际改变的情况下，市场情绪和风险偏好明显受到影响和压制，A股的波动开始加大，回调明显。

报告期内，本基金仍处于建仓期，综合考量市场因素，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，精选了景气消费细分子行业和个股进行重点配置。整体的配置较为均衡，一方面规避业绩不稳定、不确定的小股票；另一方面精选核心股票，但对太过拥挤的股票我们也保持了一定慎重。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方消费升级混合基金份额净值为1.1438元，本报告期内，基金份额净值增长率为14.38%，同期业绩比较基准收益率为14.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年市场预计维持复杂的区间震荡局面，后市观察市场的走势可以从下面三个维度看：1) 中美之间贸易摩擦改善的程度；2) 国内政策上支持的力度；3) 经济基本面恢复的速度。行情的好转和持续需要上述催化剂发酵，如果有三个条件共振，行情会有爆发力；如果只是有一个或者两个条件达到，也会有波段行情。

展望下半年，中美贸易摩擦以及全球经济和局势的不确定性升级。国内政策上有进一步宽松的倾向，尽管力度不一定很大，预计后续仍然有相关的措施出台，支持经济发展。从内生动能看，被动去库存阶段可能已经启动，下半年经济有望企稳。

#### 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，由估值小组确定相应证券的估值方法。估值小组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。

基金管理人估值小组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**

本基金本报告期内无需预警说明。

### **§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消费升级混合型发起式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，弘毅远方消费升级混合型发起式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消费升级混合型发起式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，弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本半年度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消费升级混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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：弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	14,610,140.18
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	230,309,017.85
其中：股票投资		227,311,417.85
基金投资		-
债券投资		2,997,600.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	25,000,250.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	33,516.26
应收股利		85,798.16
应收申购款		11,034.48
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		270,049,756.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

		2019年06月30日
<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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		959,895.49
应付管理人报酬		319,941.70
应付托管费		42,658.91
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	105,334.72
负债合计		1,427,830.82
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	234,840,433.46
未分配利润	6.4.7.10	33,781,492.65
所有者权益合计		268,621,926.11
负债和所有者权益总计		270,049,756.93

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.1438元，基金份额总额234,840,433.46份。

2、本财务报表的实际编制期间为2019年1月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
<b>一、收入</b>		52,345,242.02
1.利息收入		1,450,474.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	536,646.73
债券利息收入		101,585.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		812,242.04
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,910,816.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,812,449.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-32,717.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	2,131,084.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	34,313,780.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	670,170.12
<b>减：二、费用</b>		3,493,975.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,166,994.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	288,932.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	988,287.14
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-

7. 其他费用	6.4.7.21	49,761.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		48,851,266.35
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		48,851,266.35

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2019年01月30日(基金合同生效日)至2019年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年01月30日(基金合同生效日)至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	404,186,836.22	-	404,186,836.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,851,266.35	48,851,266.35
三、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)	-169,346,402.76	-15,069,773.70	-184,416,176.46
其中: 1.基金申购款	5,588,083.95	555,671.01	6,143,754.96
2.基金赎回款	-174,934,486.71	-15,625,444.71	-190,559,931.42
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	234,840,433.46	33,781,492.65	268,621,926.11

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:

郭文

黄薇薇

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

弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金(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[2018]1762号《关于准予弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册,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《弘毅远方消费升级混合型发起式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的发起式基金,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404,097,357.95元,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0009号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》于2019年1月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为404,186,836.22份基金份额,其中认购资金利息折合89,478.27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")。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,200.02份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方消费升级混合型发起式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(含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、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或票据)、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、权证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:股票资产投资比例为基金资产的50%-95%,其中投资于消费升级主题相关证券比例不低于非现金资产的80%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;本基金应当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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+上证国债指数收益率×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<年度报告和半年度报告>》、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》、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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

本基金2019年1月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值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。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

#### 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

##### (1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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，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。

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

本基金持有的股票投资、债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。

#### 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。

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。

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

本基金的管理人报酬、托管费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。

其他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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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所有者权益转出。

#### 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

根据本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，本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，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，本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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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、资产支持证券和私募债券除外)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。本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、资产支持证券和私募债券除外)，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。本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[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费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 2019年06月30日
活期存款	703,370.49
定期存款	-
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	13,906,769.69
合计	14,610,140.18

注: 定期存款的存款期限指票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193,001,236.93	227,311,417.85	34,310,180.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	2,994,000.00	2,997,600.00	3,600.00
交易所市场			

	银行间市场	-	-	-
	合计	2,994,000.00	2,997,600.00	3,600.00
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	195,995,236.93	230,309,017.85	34,313,780.92

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 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 2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,250.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,250.00	-

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	646.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,542.80
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	31,327.40

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	33,516.26

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,407.96
预提费用	49,761.76
暂收股利款	53,165.00
合计	105,334.72

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	404,186,836.22	404,186,836.22
本期申购	5,588,083.95	5,588,083.95
本期赎回（以“-”号填列）	-174,934,486.71	-174,934,486.71
本期末	234,840,433.46	234,840,433.46



注：1、本基金自2019年1月7日至2019年1月25日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币404,097,357.95元。根据《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入89,478.27元在本基金成立后，折算为89,478.27份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则申购份额中包含该业务；

3、如果本报告期间发生转换出业务，则赎回份额中包含该业务。

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	14,537,485.43	34,313,780.92	48,851,266.35
本期基金份额交易产生的变动数	-5,486,891.44	-9,582,882.26	-15,069,773.70
其中：基金申购款	166,156.10	389,514.91	555,671.01
基金赎回款	-5,653,047.54	-9,972,397.17	-15,625,444.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,050,593.99	24,730,898.66	33,781,492.65

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
活期存款利息收入	253,537.74
定期存款利息收入	257,222.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	25,886.77
合计	536,646.73

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出股票成交总额	292,483,515.06
减：卖出股票成本总额	278,671,065.46
买卖股票差价收入	13,812,449.60

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-32,717.60
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	-32,717.60

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,026,865.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,293,717.60
减：应收利息总额	765,865.80
买卖债券差价收入	-32,717.60

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,131,084.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,131,084.35

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
1.交易性金融资产	34,313,780.92
——股票投资	34,310,180.92
——债券投资	3,600.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	34,313,780.92

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金赎回费收入	670,170.12
合计	670,170.12

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、持有期少于7日的基金份额，相应的赎回费率不低于1.5%，并全额计入基金财产。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
交易所市场交易费用	988,287.14
银行间市场交易费用	-
合计	988,287.14

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
审计费用	27,142.64
信息披露费	22,619.12
合计	49,761.76

**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、基金注册登记机构、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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	763,050,301.35	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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
广发证券	23,287,717.60	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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
广发证券	6,537,000,000.00	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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019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	692,515.82	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）征管费等）。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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,166,994.21
其中：支付销售机构的客户维护费	556,084.15

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1.50%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×1.50%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	288,932.56

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 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金合同生效日（2019年01月30日）持有的基金份额	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.26%

注：本基金基金合同生效日为2019年1月30日。基金管理人持有本基金份额系募集期内认购，适用基金招募说明书中规定的认购费率。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 2019年01月30日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司-托管户	703,370.49	253,537.74
广发证券股份有限公司-证券户	13,906,769.69	25,886.77

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019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	可流通日	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



300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股认购	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
--------	------	------------	------------	------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

#### 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。

#### 6.4.13 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。本基金将投资港股通标的股票，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。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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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或票据）、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、权证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。本基金深入挖掘基于人均收入和人口特征驱动的消费升级过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的稳健持续增值。

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2019年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资。

#### 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2019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(所有者权益)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。

##### 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 2019年06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	14,610,140.18	-	-	-	14,610,140.18

交易性金融资产	2,997,600.00	-	-	227,311,417.85	230,309,017.85
买入返售金融资产	25,000,250.00	-	-	-	25,000,250.00
应收利息	-	-	-	33,516.26	33,516.26
应收股利	-	-	-	85,798.16	85,798.16
应收申购款	-	-	-	11,034.48	11,034.48
资产总计	42,607,990.18	-	-	227,441,766.75	270,049,756.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	959,895.49	959,895.49
应付管理人报酬	-	-	-	319,941.70	319,941.70
应付托管费	-	-	-	42,658.91	42,658.91
其他负债	-	-	-	105,334.72	105,334.72
负债总计	-	-	-	1,427,830.82	1,427,830.82
利率敏感度缺口	42,607,990.18	-	-	226,013,935.93	268,621,926.11

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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2019年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.12%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	-	20,541,450.86	-	20,541,450.86
应收股利	-	85,798.16	-	85,798.16

资产合计	-	20,627,249.02	-	20,627,249.02
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	-	20,627,249.02	-	20,627,249.02

注：本基金合同生效日为2019年1月30日。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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 2019年06月30日
	所有外币相对人民币升值5%	1,031,362.45
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,031,362.45

#### 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，精选出未来发展前景看好并且有助于推动人民生活品质提升的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、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50%-95%，其中投资于消费升级主题相关证券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%；本基金应当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 2019年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	227,311,417.85	84.62
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,997,600.00	1.12
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	230,309,017.85	85.74

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2019年6月30日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	227,311,417.85	84.17
	其中：股票	227,311,417.85	84.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,997,600.00	1.11
	其中：债券	2,997,600.00	1.11

	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	25,000,250.00	9.26
	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	14,610,140.18	5.41
8	其他各项资产	130,348.90	0.05
9	合计	270,049,756.93	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 20,541,450.86 元，占基金资产净值比例为 7.65%。

## 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	167,737.50	0.06
C	制造业	116,826,682.28	43.49
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	8,214,782.40	3.06
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	29,562,569.07	11.01
J	金融业	18,732,154.00	6.97
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	33,242,935.14	12.38
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	206,769,966.99	76.97

### 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(元)	占基金资产净值比例 (%)
日常消费品	749,074.47	0.28
非日常生活消费品	19,792,376.39	7.37
合计	20,541,450.86	7.65

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	002475	立讯精密	977,000	24,219,830.00	9.02
2	000858	五粮液	204,400	24,108,980.00	8.98
3	000333	美的集团	450,000	23,337,000.00	8.69
4	600763	通策医疗	243,046	21,531,445.14	8.02
5	H02331	李宁	1,221,500	19,792,376.39	7.37
6	601318	中国平安	211,400	18,732,154.00	6.97
7	600570	恒生电子	264,555	18,029,423.25	6.71
8	600519	贵州茅台	13,200	12,988,800.00	4.84
9	002422	科伦药业	405,300	12,049,569.00	4.49
10	300347	泰格医药	151,900	11,711,490.00	4.36
11	002410	广联达	349,454	11,493,542.06	4.28
12	000963	华东医药	316,440	8,214,782.40	3.06
13	000651	格力电器	149,000	8,195,000.00	3.05
14	600887	伊利股份	240,800	8,045,128.00	2.99



15	603345	安井食品	30,400	1,562,560.00	0.58
16	002511	中顺洁柔	127,100	1,560,788.00	0.58
17	H01579	颐海国际	21,000	749,074.47	0.28
18	300450	先导智能	9,200	309,120.00	0.12
19	603288	海天味业	2,600	273,000.00	0.10
20	600968	海油发展	47,250	167,737.50	0.06
21	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
22	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
23	603863	松炷资源	1,612	37,204.96	0.01
24	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
25	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
26	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	27,953,337.00	10.41
2	002027	分众传媒	27,497,785.80	10.24
3	000858	五粮液	25,390,125.60	9.45
4	600570	恒生电子	24,175,299.40	9.00
5	002475	立讯精密	22,310,154.31	8.31
6	000963	华东医药	20,703,173.60	7.71
7	002410	广联达	20,185,190.00	7.51
8	000063	中兴通讯	19,991,534.50	7.44
9	300308	中际旭创	19,981,756.00	7.44
10	002230	科大讯飞	19,817,266.50	7.38
11	600521	华海药业	18,647,984.74	6.94
12	600763	通策医疗	16,449,002.75	6.12
13	601318	中国平安	16,315,735.00	6.07

14	300413	芒果超媒	14,495,071.00	5.40
15	002773	康弘药业	13,040,170.56	4.85
16	000651	格力电器	12,999,360.00	4.84
17	002422	科伦药业	12,585,725.00	4.69
18	600519	贵州茅台	12,558,659.00	4.68
19	H02331	李宁	12,115,198.36	4.51
20	002035	华帝股份	11,998,218.00	4.47
21	300347	泰格医药	10,007,466.00	3.73
22	603345	安井食品	9,744,858.00	3.63
23	600887	伊利股份	9,494,886.00	3.53
24	600036	招商银行	8,397,355.00	3.13
25	603517	绝味食品	8,203,286.00	3.05
26	300146	汤臣倍健	8,087,939.00	3.01
27	300144	宋城演艺	6,728,506.00	2.50

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002027	分众传媒	29,599,583.64	11.02
2	300308	中际旭创	27,367,034.00	10.19
3	600521	华海药业	20,105,948.52	7.48
4	000063	中兴通讯	20,071,276.00	7.47
5	002230	科大讯飞	19,155,181.00	7.13
6	002035	华帝股份	15,687,758.96	5.84
7	002773	康弘药业	12,690,071.70	4.72
8	300413	芒果超媒	12,517,477.56	4.66
9	000858	五粮液	11,698,298.00	4.35
10	000963	华东医药	11,313,917.10	4.21

11	002410	广联达	11,049,399.00	4.11
12	603345	安井食品	8,544,032.00	3.18
13	600036	招商银行	8,384,670.00	3.12
14	600570	恒生电子	8,380,031.20	3.12
15	603517	绝味食品	7,509,292.00	2.80
16	000333	美的集团	6,941,970.00	2.58
17	000651	格力电器	6,442,537.18	2.40
18	300146	汤臣倍健	6,440,601.00	2.40
19	300144	宋城演艺	6,233,796.76	2.32
20	600048	保利地产	5,020,060.22	1.87

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	471,672,302.39
卖出股票收入（成交）总额	292,483,515.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,997,600.00	1.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	2,997,600.00	1.12

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19国债01	30,000	2,997,600.00	1.12

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 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 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。

#### 7.11.3 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。

## 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	85,798.16
4	应收利息	33,516.26
5	应收申购款	11,034.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,348.90

### 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无流通受限股票。

### 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	持有人结构
----	---------	-------

人户数(户)	份额	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
1,263	185,938.59	164,861,478.37	70.20%	69,978,955.09	29.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	14,375,043.90	6.12%

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

### 8.4 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	10,000,200.02	4.26%	10,000,200.02	4.26%	3年
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	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	4.26%	10,000,200.02	4.26%	-

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年01月30日)基金份额总额	404,186,836.22
----------------------------	----------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,588,083.95
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	174,934,486.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	234,840,433.46

注：1、本基金基金合同生效日为2019年1月30日；  
2、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；  
3、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

本报告期内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，本基金管理人于2019年1月26日发布公告，经公司第一届董事会第四次会议审议通过，聘任黄薇薇女士担任公司副总经理职务。

2、本报告期内，本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

本报告期内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

1、基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

2、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

(1) 2019年3月25日，基金托管人广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号），指出广发证券存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理

及审慎开展业务等问题，决定对广发证券采取责令改正的行政监管措施，要求广发证券应于2019年6月30日之前予以改正，并向广东局提交书面整改报告。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系，并及时向广东证监局报送了整改报告。

(2) 2019年4月19日，因基金托管人广发证券存在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形，广东证监局向广发证券下发了《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]28号），责成广发证券对相关问题予以改正，提交书面整改报告，并严格追究相关责任人员责任。

对此，广发证券高度重视，责令相关部门进行整改，组织对监管规定进行再学习，对相关人员进行内部问责，并及时向广东证监局报送了整改报告。

(3) 2019年8月5日，基金托管人广发证券收到《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书[2019]31号），因对广发控股（香港）有限公司风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等问题，中国证券监督管理委员会对广发证券采取了限制增加场外衍生品业务规模6个月、限制增加新业务种类6个月的行政监管措施。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

除上述事项外，本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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	4	763,050,301.35	100.00%	692,515.82	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	23,287,717.60	100.00%	6,537,000,000.00	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关于弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同生效的公告	证券时报	2019-01-31
2	关于弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务并参加销售机构优惠活动的公告	证券时报	2019-04-12
3	弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告	证券时报	2019-04-19
4	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金开放日常转换业务的公告	证券时报	2019-05-07

## §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

单位：份

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	20190130-20190630	100,007,000.00	0.00	0.00	100,007,000.00	42.59%
	2	20190517-20190630	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	21.29%

### 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、赎回申请延期办理的风险

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。

#### 3、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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## §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消费升级混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方消费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消费升级混合型发起式证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方消费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。

### 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。

弘毅远方基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十八日