

弘毅远方国证消费 100 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 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2022年3月28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。

本报告期自2021年1月1日起至12月31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	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 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	61
8.7 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	61
8.8 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	61
8.9 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	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	62
§9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.4 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	64
§10 开放式基金份额变动	64
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	弘毅远方国证消费100ETF
场内简称	消费100ETF
基金主代码	159986
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月19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	65,152,218.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020-01-20

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年</p>

	跟踪误差不超过3%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时，基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	国证消费100指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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
	联系电话	021-53682888
	电子邮箱	service@honyfunds.com
客户服务电话	400-920-8800	95575
传真	021-53682755	020-87555129
注册地址	上海市黄浦区中山东二路600号1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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.honyfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年	2020年	2019年12月19日 (基金合同生效日)-2019年12月31日
本期已实现收益	14,112,298.47	41,751,619.19	-123,019.30
本期利润	-9,457,642.39	66,181,064.71	2,816,022.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1212	0.4439	0.0133
本期加权平均净值利润率	-8.19%	38.13%	1.34%
本期基金份额净值增长率	-5.88%	51.20%	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	28,798,301.62	26,415,840.33	-123,019.30
期末可供分配基金份额利润	0.4420	0.4466	-0.0006
期末基金资产净值	93,950,519.62	90,628,718.46	213,968,240.75
期末基金份额净值	1.4420	1.5321	1.0133
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	44.20%	53.21%	1.33%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	3.76%	0.97%	3.30%	0.99%	0.46%	-0.02%
过去六个月	-7.29%	1.25%	-9.78%	1.26%	2.49%	-0.01%
过去一年	-5.88%	1.47%	-9.68%	1.49%	3.80%	-0.02%
自基金合同生效起至今	44.20%	1.55%	37.48%	1.57%	6.72%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：国证消费 100 指数收益率。

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

弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月19日-2021年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2019年12月19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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为 2019 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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2.5亿元人民币（截至2021年12月31日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2021年12月31日，本基金管理人共管理7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、弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金、弘毅远方经济新动力混合型发起式证券投资基金、弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金、弘毅远方高端制造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		
戴家伟	本基金基金经理；弘毅远方国证民企领先100ETF基金经理	2019-12-19	-	11年	南京大学国际贸易学硕士。2016年1月加入弘毅远方基金管理有限公司筹备组，现任弘毅远方基金管理有限公司金融工程部基金经理。在加入弘毅投资前，戴家伟先生曾任平安信托有限公司产品总监、广发基金管理有限公司产品经理等职务。

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。

4.1.3 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 公平交易制度和控制方法**

本基金的基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资研究的负责人、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，投资决策委员会和分管投资研究的负责人等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须履行严格的审批程序。

(2) 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。

(3) 建立全公司适用的备选标的库和交易对手备选库，明确备选库的建立和维护程序。在全公司适用备选标的库的基础上，根据不同投资组合各自的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的备选标的库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

(4) 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。

(5) 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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

作为ETF基金，本基金跟踪的标的指数为国证消费100指数，主要采取完全复制法投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

指数走势上，国证消费100指数报告期内上涨-9.68%，同期沪深300和上证综指分别上涨-5.20%和4.80%。

基金运作层面，报告期内，本基金严格遵守基金合同，认真对待投资者申购、赎回等事项，保障基金的正常运作，运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方国证消费100ETF基金份额净值为1.4420元，本报告期内，基金份额净值增长率为-5.88%，同期业绩比较基准收益率为-9.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，我们预计房地产投资、消费将依然承压，叠加出口高基数，使得经济向下的压力仍存在，另一方面预计稳增长政策将持续发力，制造业投资和基建投资增速将加快。国内货币政策将以我为主，以稳为主，结构性政策维持平稳偏松，整体流动性充裕。

回顾2021年，A股整体中小盘风格较大盘风格表现占优；行业板块表现分化，新能源和上游周期板块表现较好，而家电、医药、社服则发生了一定程度的回调。预计2022年市场在稳增长政策支持、高成长景气赛道、景气反转等为代表的成长和价值板块表现上将更加均衡。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》和相关法律法规的要求，公司恪尽职守，依法履行基金管理人的职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本年度主要的监察稽核工作如下：

（一）持续推动及规范公司的制度体系建设，组织拟定公司2021年制度体系建设规划并跟进落实

本年度内公司重点对制度规范体系进行查漏补缺，结合公司业务发展规划，牵头组织公司各部门拟定2021年制度体系建设规划，由各部门跟进落实并定期回顾，确保公司的制度体系建设可以有效支持现有的业务发展。

（二）加大审计力度，扩大内部审计覆盖面

本年度内，公司完成各季度员工及关联人投资申报稽核、通信管理稽核、基金直播内容稽核等定期或不定期稽核，并开展投研交专项审计、人力资源专项审计、公司治理

专项审计、运营专项审计、IT专项审计、反洗钱年度专项审计及投资者适当性管理自查等专项审计工作，扩大审计覆盖面。

（三）建立公司及部门内部培训机制，深化公司合规文化建设

本年度内，公司继续主动加强合规文化建设，多次组织召开公司内部合规培训对公司员工进行合规宣导，同时继续加快新员工以及特殊岗位员工上岗前合规培训的时效，并要求各部门落实内部培训责任，强调对各工作节点的风险点的识别管控，将风险防范落实到业务第一线。另外，公司对投资研究体系相关工作机制进行分析、梳理，优化相关业务流程，帮助其更好防范风险与提升合规观念，从而真正以“维护投资者利益优先、公平对待投资者”的原则约束员工的执业行为，进而建立健全更具内生性的公司合规风控文化。

（四）持续完善基金产品的风险管控措施

本年度内，公司重点对固定收益业务、新三板股票业务（北京证券交易所股票）等进行了梳理，旨在完善相关业务流程，确保各项业务合法、合规开展。

公司持续利用信息技术手段提高风险控制和监测的水平和能力，完善各类投资业务在事前、事中和事后的风险管控机制，提升风险管理水平，有效防范合规风险和操作风险。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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国证消费100交易型开放式指数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，弘毅远方国证消费100交易型开放式指数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国证消费100交易型开放式指数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，弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第21035号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容

	<p>我们审计了弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"弘毅远方国证消费100ETF")的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了弘毅远方国证消费100ETF2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于弘毅远方国证消费100ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>弘毅远方国证消费100ETF的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估弘毅远方国证消费100ETF的持续经营能力,披露与</p>

	<p>持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算弘毅远方国证消费100ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督弘毅远方国证消费100ETF的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对弘毅远方国证消费100ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得</p>

	的信息。然而，未来的事项或情况可能导致弘毅远方国证消费100ETF不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 柴瀚英
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2022-03-23

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,647,286.14	880,275.99
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	92,539,567.14	89,682,886.18
其中：股票投资		92,539,567.14	89,682,886.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	187,831.97
应收利息	7.4.7.5	243.42	98.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		94,187,096.70	90,751,092.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,081.93	22,484.39
应付托管费		8,027.35	7,494.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	204,467.80	92,395.04
负债合计		236,577.08	122,374.21
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	65,152,218.00	59,152,218.00
未分配利润	7.4.7.10	28,798,301.62	31,476,500.46

所有者权益合计		93,950,519.62	90,628,718.46
负债和所有者权益总计		94,187,096.70	90,751,092.67

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.4420元，基金份额总额65,152,218.00份。

7.2 利润表

会计主体：弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
一、收入		-8,427,169.24	67,354,056.93
1.利息收入		8,993.37	7,775.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,532.14	7,775.42
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		461.23	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,004,062.13	42,916,759.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,855,105.54	40,762,214.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	1,148,956.59	2,154,544.48
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-23,569,940.86	24,429,445.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	129,716.12	76.79
减：二、费用		1,030,473.15	1,172,992.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	347,801.39	524,062.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	115,933.80	174,687.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	88,703.45	109,308.01
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	7.4.7.20	478,034.51	364,933.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-9,457,642.39	66,181,064.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-9,457,642.39	66,181,064.71

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	59,152,218.00	31,476,500.46	90,628,718.46

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,457,642.39	-9,457,642.39
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)	6,000,000.00	6,779,443.55	12,779,443.55
其中：1.基金申购款	61,000,000.00	37,146,916.86	98,146,916.86
2.基金赎回款	-55,000,000.00	-30,367,473.31	-85,367,473.31
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)	65,152,218.00	28,798,301.62	93,950,519.62
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	211,152,218.00	2,816,022.75	213,968,240.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,181,064.71	66,181,064.71
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)	-152,000,000.00	-37,520,587.00	-189,520,587.00
其中：1.基金申购款	23,000,000.00	1,677,784.29	24,677,784.29
2.基金赎回	-175,000,000.00	-39,198,371.29	-214,198,371.29

款			
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）	59,152,218.00	31,476,500.46	90,628,718.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄薇薇

杨超

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]1602号《关于准予弘毅远方国证消费100交易型开放式指数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《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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211,126,972.00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(2019)第0743号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年12月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为211,152,218.00份基金份额，其中认购资金利息折合25,246.00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《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、股指期货

货、债券回购、银行存款、同业存单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：投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为：国证消费100指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司于2022年3月23日批准报出。

7.4.2 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》、《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度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2021年12月31日财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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、资产支持证券和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在

资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。本基金目前暂无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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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或资产支持证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。

7.4.4.5 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、资产支持证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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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和债券，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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	182,731.31	880.90
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	1,464,554.83	879,395.09
合计	1,647,286.14	880,275.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,741,020.43	92,539,567.14	3,798,546.71
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	88,741,020.43	92,539,567.14	3,798,546.71
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	62,314,398.61	89,682,886.18	27,368,487.57
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	62,314,398.61	89,682,886.18	27,368,487.57
----	---------------	---------------	---------------

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	106.07	0.44
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	137.35	98.09
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	243.42	98.53

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	60,000.00	57,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	-
应付指数使用费	24,467.80	35,395.04
合计	204,467.80	92,395.04

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,152,218.00	59,152,218.00
本期申购	61,000,000.00	61,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-55,000,000.00	-55,000,000.00
本期末	65,152,218.00	65,152,218.00

7.4.7.10 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
上年度末	26,415,840.33	5,060,660.13	31,476,500.46
本期利润	14,112,298.47	-23,569,940.86	-9,457,642.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,140,453.07	7,919,896.62	6,779,443.55
其中：基金申购款	30,162,557.96	6,984,358.90	37,146,916.86
基金赎回款	-31,303,011.03	935,537.72	-30,367,473.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,387,685.73	-10,589,384.11	28,798,301.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	2,929.27	391.79
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	4,251.41	5,600.29
结算备付金利息收入	1,351.46	1,783.34
其他	-	-
合计	8,532.14	7,775.42

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至20 20年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,939,248.27	3,501,228.16
股票投资收益——赎回差价收入	9,915,857.27	37,260,986.56
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	13,855,105.54	40,762,214.72

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	48,027,217.92	46,952,237.76
减：卖出股票成本总额	44,087,969.65	43,451,009.60
买卖股票差价收入	3,939,248.27	3,501,228.16

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
赎回基金份额对价总额	85,367,473.31	214,198,371.29
减：现金支付赎回款总额	-4,315,362.69	-12,805,731.71
减：赎回股票成本总额	79,766,978.73	189,743,116.44
赎回差价收入	9,915,857.27	37,260,986.56

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,148,956.59	2,154,544.48
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	1,148,956.59	2,154,544.48

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日

1.交易性金融资产	-23,569,940.86	24,429,445.52
——股票投资	-23,569,940.86	24,429,445.52
——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	-23,569,940.86	24,429,445.52

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	129,716.12	76.79
合计	129,716.12	76.79

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	88,703.45	109,308.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	88,703.45	109,308.01

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	60,000.00	57,000.00
信息披露费	120,000.00	75,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	129,072.76	82,933.83
注册登记费	150,000.00	150,000.00
IOPV服务费	18,961.75	-
合计	478,034.51	364,933.83

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		股票成交总额的比例		股票成交总额的比例
广发证券	91,298,325.14	100.00%	111,563,786.04	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	3,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31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	32,607.39	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
广发证券	52,458.08	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	347,801.39	524,062.80
其中：支付销售机构的客户维护费	10,875.97	17,325.12

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0.30%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×0.30%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	115,933.80	174,687.58

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0.10%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×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	182,731.31	2,929.27	880.90	391.79
广发证券-证券户	1,464,554.83	4,251.41	879,395.09	5,600.29

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	2,680	28,193.60	28,193.60	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	458	2,367.86	20,248.18	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	26.06	593	4,915.97	15,453.58	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	229	2,725.10	10,408.05	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	30.44	324	3,447.36	9,862.56	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	222	3,012.54	8,549.22	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-03-01	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
3010	读客	2021-	2022-	新股	1.55	20.88	403	624.6	8,41	-

25	文化	07-06	01-19	流通受限				5	4.64	
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	221	2,316.08	8,106.28	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	116	2,216.76	7,879.88	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股流通受限	10.07	16.76	429	4,320.03	7,190.04	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股流通受限	12.20	22.72	284	3,464.80	6,452.48	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	456	2,421.36	6,156.00	-
301041	金百	2021-08-02	2022-02-11	新股	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-

	泽			流通受限						
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	123	2,792.10	6,029.46	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	243	2,041.20	5,802.84	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	199	2,851.67	5,363.05	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	150	3,870.00	5,047.50	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	新股流通受限	26.91	43.36	111	2,987.01	4,812.96	-
301126	达嘉	2021-11-30	2022-06-07	新股	12.37	19.23	249	3,080.13	4,788.27	-

	维康			流通受限						
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,76 2.56	4,60 8.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股流通受限	5.77	12.14	368	2,12 3.36	4,46 7.52	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,83 9.85	4,46 0.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	177	2,62 3.14	4,29 4.02	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	95	2,48 6.15	4,26 1.70	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,75 0.54	4,14 6.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,01 3.12	4,08 6.72	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	123	2,37 8.82	4,04 9.16	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股流通受限	10.45	11.22	353	3,68 8.85	3,96 0.66	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	109	1,89 6.60	3,93 5.99	-
301168	通灵	2021-12-02	2022-06-10	新股	39.08	52.13	69	2,69 6.52	3,59 6.97	-

	股份			流通受限						
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	116	3,145.92	3,547.28	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	23.38	29.93	113	2,641.94	3,382.09	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	92	2,693.76	2,944.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	新股流通受限	27.81	31.14	94	2,614.14	2,927.16	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	49	3,242.82	2,774.38	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	54	3,136.32	2,691.90	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	98	2,729.30	2,691.08	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	48	2,111.52	2,436.96	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	83	2,550.59	2,418.62	-
301088	戎美	2021-10-19	2022-04-28	新股	33.16	24.67	98	3,249.68	2,417.66	-

	股份			流通受限						
--	----	--	--	------	--	--	--	--	--	--

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（国债、央行票据、地方

政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、债券回购、银行存款、同业存单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。

7.4.13.2 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2021年12月31日，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2021年12月31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，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 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。

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%。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	1,647,286.14	-	-	-	1,647,286.14
交易性金融资产	-	-	-	92,539,567.14	92,539,567.14
应收利息	-	-	-	243.42	243.42
资产总计	1,647,286.14	-	-	92,539,810.56	94,187,096.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,081.93	24,081.93
应付托管费	-	-	-	8,027.35	8,027.35
其他负债	-	-	-	204,467.80	204,467.80
负债总计	-	-	-	236,577.08	236,577.08
利率敏感度缺口	1,647,286.14	-	-	92,303,233.48	93,950,519.62
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	880,275.99	-	-	-	880,275.99
交易性金融资产	-	-	-	89,682,886.18	89,682,886.18
应收证券清算款	-	-	-	187,831.97	187,831.97
应收利息	-	-	-	98.53	98.53
资产总计	880,275.99	-	-	89,870,816.68	90,751,092.67

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,484.39	22,484.39
应付托管费	-	-	-	7,494.78	7,494.78
其他负债	-	-	-	92,395.04	92,395.04
负债总计	-	-	-	122,374.21	122,374.21
利率敏感度缺口	880,275.99	-	-	89,748,442.47	90,628,718.46

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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(2020年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	92,539,567.14	98.50	89,682,886.18	98.96
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	92,539,567.14	98.50	89,682,886.18	98.96

7.4.13.4.3.2 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	4,568,253.98	4,430,000.02

	业绩比较基准下降5%	-4,568,253.98	-4,430,000.02
--	------------	---------------	---------------

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为92,189,336.00元，属于第二层次的余额为33,698.09元，属于第三层次的余额为316,533.05元。(2020年12月31日：第一层次89,682,886.18元，无第二层次及第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于2021年1月1日，本基金未持有第三层次资产。2021年度购买第三层次资产金额为130,222.29元，计入当期损益的利得或损失金额为186,310.76元。于2021年12月31日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为316,533.05元(2020年12月31日：无)。2021年12月31日仍持有的资产计入2021年度损益的未实现利得或损失的变动为186,310.76元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则

第37号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021年的比较数据将不作重述。

(3) 基金申购款

于2021年度,本基金申购基金份额的对价总额为98,146,916.86元,其中包括以股票支付的申购款104,411,322.00元和以现金支付的申购款-6,264,405.14元(2020年度:基金申购份额的对价总额为24,677,784.29元,其中以股票支付的申购款22,593,391.00元和以现金支付的申购款2,084,393.29元)。

(4) 除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	92,539,567.14	98.25
	其中:股票	92,539,567.14	98.25
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	1,647,286.14	1.75

8	其他各项资产	243.42	0.00
9	合计	94,187,096.70	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,581,429.52	2.75
B	采矿业	-	-
C	制造业	74,236,756.14	79.02
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	524,228.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,820,556.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,846,171.10	6.22
J	金融业	346,992.00	0.37
K	房地产业	310,464.00	0.33
L	租赁和商务服务业	974,610.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	3,519,700.00	3.75
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,023,715.44	2.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,184,622.20	98.12

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	253,295.22	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.01
F	批发和零售业	11,673.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,436.96	0.00
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	33,574.78	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	9,589.03	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.02
R	文化、体育和娱乐业	16,891.92	0.02
S	综合	-	-
	合计	354,944.94	0.38

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000858	五粮液	21,600	4,809,456.00	5.12
2	000333	美的集团	57,500	4,244,075.00	4.52
3	601012	隆基股份	48,760	4,203,112.00	4.47
4	600887	伊利股份	66,900	2,773,674.00	2.95
5	603259	药明康德	23,000	2,727,340.00	2.90
6	002594	比亚迪	10,000	2,681,200.00	2.85
7	002475	立讯精密	53,127	2,613,848.40	2.78
8	002415	海康威视	45,600	2,385,792.00	2.54
9	000568	泸州老窖	8,900	2,259,443.00	2.40
10	600276	恒瑞医药	44,164	2,239,556.44	2.38
11	603501	韦尔股份	6,400	1,988,928.00	2.12
12	300760	迈瑞医疗	5,000	1,904,000.00	2.03
13	300014	亿纬锂能	14,800	1,749,064.00	1.86
14	000725	京东方 A	338,200	1,707,910.00	1.82
15	002241	歌尔股份	28,500	1,541,850.00	1.64
16	002352	顺丰控股	22,200	1,530,024.00	1.63
17	002714	牧原股份	28,042	1,496,321.12	1.59
18	603288	海天味业	13,350	1,403,218.50	1.49
19	600438	通威股份	31,200	1,402,752.00	1.49
20	600690	海尔智家	45,700	1,365,973.00	1.45
21	000063	中兴通讯	35,600	1,192,600.00	1.27
22	002304	洋河股份	7,000	1,153,110.00	1.23
23	300015	爱尔眼科	27,198	1,149,931.44	1.22
24	002049	紫光国微	5,100	1,147,500.00	1.22
25	603986	兆易创新	6,516	1,145,838.60	1.22
26	002129	中环股份	26,300	1,098,025.00	1.17
27	300498	温氏股份	56,340	1,085,108.40	1.15
28	300122	智飞生物	8,700	1,084,020.00	1.15

29	002230	科大讯飞	20,500	1,076,455.00	1.15
30	600745	闻泰科技	8,300	1,073,190.00	1.14
31	300142	沃森生物	18,900	1,062,180.00	1.13
32	600703	三安光电	28,000	1,051,680.00	1.12
33	000661	长春高新	3,600	977,040.00	1.04
34	002027	分众传媒	119,000	974,610.00	1.04
35	002371	北方华创	2,700	936,954.00	1.00
36	000100	TCL科技	148,300	915,011.00	0.97
37	600570	恒生电子	14,322	890,112.30	0.95
38	600660	福耀玻璃	17,000	801,380.00	0.85
39	300347	泰格医药	6,200	792,360.00	0.84
40	002821	凯莱英	1,800	783,000.00	0.83
41	600050	中国联通	193,800	761,634.00	0.81
42	002410	广联达	11,500	735,770.00	0.78
43	600588	用友网络	19,810	710,782.80	0.76
44	002311	海大集团	9,400	689,020.00	0.73
45	600196	复星医药	13,100	641,114.00	0.68
46	002179	中航光电	6,300	633,528.00	0.67
47	000625	长安汽车	39,540	600,612.60	0.64
48	300408	三环集团	13,400	597,640.00	0.64
49	000538	云南白药	5,700	596,505.00	0.63
50	000799	酒鬼酒	2,800	595,000.00	0.63
51	603806	福斯特	4,400	574,420.00	0.61
52	601633	长城汽车	11,800	572,772.00	0.61
53	300207	欣旺达	12,700	535,432.00	0.57
54	300661	圣邦股份	1,700	525,300.00	0.56
55	300433	蓝思科技	22,800	523,944.00	0.56
56	600460	士兰微	9,600	520,320.00	0.55
57	600763	通策医疗	2,600	517,400.00	0.55
58	300454	深信服	2,700	515,700.00	0.55
59	600584	长电科技	16,400	508,728.00	0.54

60	300496	中科创达	3,600	498,312.00	0.53
61	002001	新和成	15,800	491,696.00	0.52
62	601138	工业富联	41,200	491,104.00	0.52
63	002236	大华股份	20,100	471,948.00	0.50
64	603369	今世缘	8,500	462,400.00	0.49
65	300601	康泰生物	4,200	413,868.00	0.44
66	002920	德赛西威	2,900	410,379.00	0.44
67	002555	三七互娱	15,100	408,002.00	0.43
68	000895	双汇发展	12,600	397,530.00	0.42
69	000876	新希望	24,800	377,208.00	0.40
70	000938	紫光股份	16,000	365,600.00	0.39
71	600132	重庆啤酒	2,400	363,168.00	0.39
72	000963	华东医药	8,900	357,780.00	0.38
73	600600	青岛啤酒	3,600	356,400.00	0.38
74	603882	金域医学	3,200	356,384.00	0.38
75	300033	同花顺	2,400	346,992.00	0.37
76	002007	华兰生物	11,840	345,017.60	0.37
77	603486	科沃斯	2,200	332,090.00	0.35
78	601799	星宇股份	1,600	326,800.00	0.35
79	600183	生益科技	13,500	317,925.00	0.34
80	000069	华侨城 A	44,100	310,464.00	0.33
81	002841	视源股份	3,800	309,320.00	0.33
82	300223	北京君正	2,300	308,200.00	0.33
83	300003	乐普医疗	13,500	305,505.00	0.33
84	300595	欧普康视	5,200	298,324.00	0.32
85	300628	亿联网络	3,600	293,220.00	0.31
86	603160	汇顶科技	2,700	290,979.00	0.31
87	002120	韵达股份	14,200	290,532.00	0.31
88	603833	欧派家居	1,880	277,300.00	0.30
89	603345	安井食品	1,600	273,248.00	0.29
90	002568	百润股份	4,500	269,235.00	0.29

91	300529	健帆生物	5,000	266,500.00	0.28
92	600779	水井坊	2,200	263,978.00	0.28
93	002938	鹏鼎控股	6,100	258,823.00	0.28
94	601966	玲珑轮胎	7,000	255,850.00	0.27
95	002414	高德红外	10,400	251,784.00	0.27
96	600845	宝信软件	4,100	249,403.00	0.27
97	002600	领益智造	33,200	244,352.00	0.26
98	603816	顾家家居	3,000	231,480.00	0.25
99	002024	苏宁易购	40,400	166,448.00	0.18
100	002032	苏泊尔	1,700	105,808.00	0.11

8.3.2 期末积极投资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	301136	招标股份	2,680	28,193.60	0.03
2	301069	凯盛新材	458	20,248.18	0.02
3	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.02
4	301018	申菱环境	593	15,453.58	0.02
5	300994	久祺股份	229	10,408.05	0.01
6	301020	密封科技	324	9,862.56	0.01
7	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
8	301040	中环海陆	222	8,549.22	0.01
9	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.01
10	301025	读客文化	403	8,414.64	0.01
11	301111	粤万年青	221	8,106.28	0.01
12	301089	拓新药业	116	7,879.88	0.01
13	301066	万事利	344	7,856.96	0.01
14	301055	张小泉	355	7,731.90	0.01
15	301149	隆华新材	429	7,190.04	0.01

16	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.01
17	301180	万祥科技	284	6,452.48	0.01
18	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.01
19	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.01
20	301028	东亚机械	456	6,156.00	0.01
21	301041	金百泽	215	6,065.15	0.01
22	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.01
23	301118	恒光股份	123	6,029.46	0.01
24	300814	中富电路	243	5,802.84	0.01
25	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.01
26	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01
27	301038	深水规院	266	5,381.18	0.01
28	301133	金钟股份	199	5,363.05	0.01
29	301211	亨迪药业	150	5,047.50	0.01
30	301059	金三江	259	4,998.70	0.01
31	301101	明月镜片	111	4,812.96	0.01
32	301126	达嘉维康	249	4,788.27	0.01
33	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.01
34	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
35	301078	孩子王	368	4,467.52	0.00
36	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
37	301037	保立佳	177	4,294.02	0.00
38	301138	华研精机	95	4,261.70	0.00
39	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
40	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
41	301049	超越科技	123	4,049.16	0.00
42	301090	华润材料	353	3,960.66	0.00
43	301063	海锅股份	109	3,935.99	0.00
44	301168	通灵股份	69	3,596.97	0.00
45	301182	凯旺科技	116	3,547.28	0.00
46	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

47	301036	双乐股份	113	3,382.09	0.00
48	301199	迈赫股份	92	2,944.00	0.00
49	301100	风光股份	94	2,927.16	0.00
50	301189	C奥尼	49	2,774.38	0.00
51	301093	华兰股份	54	2,691.90	0.00
52	301190	善水科技	98	2,691.08	0.00
53	301179	泽宇智能	48	2,436.96	0.00
54	301193	家联科技	83	2,418.62	0.00
55	301088	戎美股份	98	2,417.66	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	3,216,165.00	3.55
2	300760	迈瑞医疗	1,893,382.00	2.09
3	300015	爱尔眼科	1,571,704.00	1.73
4	000661	长春高新	986,398.00	1.09
5	300122	智飞生物	948,997.00	1.05
6	300014	亿纬锂能	945,598.00	1.04
7	300498	温氏股份	882,270.85	0.97
8	000333	美的集团	878,059.00	0.97
9	601012	隆基股份	868,533.00	0.96
10	000858	五粮液	860,342.00	0.95
11	300347	泰格医药	836,555.00	0.92
12	300496	中科创达	803,180.00	0.89
13	300595	欧普康视	782,530.00	0.86
14	603882	金域医学	706,947.00	0.78
15	000799	酒鬼酒	677,617.00	0.75
16	002594	比亚迪	660,050.00	0.73

17	603501	韦尔股份	639,452.00	0.71
18	600276	恒瑞医药	622,745.00	0.69
19	300601	康泰生物	608,954.00	0.67
20	002415	海康威视	606,725.00	0.67

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。

8.4.2 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	000651	格力电器	2,898,371.57	3.20
2	600276	恒瑞医药	1,421,966.40	1.57
3	000858	五粮液	1,352,398.00	1.49
4	000333	美的集团	1,344,130.01	1.48
5	000661	长春高新	1,235,834.00	1.36
6	600763	通策医疗	1,198,712.00	1.32
7	000568	泸州老窖	1,179,078.00	1.30
8	002821	凯莱英	1,165,047.00	1.29
9	300015	爱尔眼科	1,081,174.98	1.19
10	601012	隆基股份	1,072,852.00	1.18
11	002371	北方华创	1,000,163.00	1.10
12	002594	比亚迪	780,532.00	0.86
13	300558	贝达药业	748,052.00	0.83
14	603288	海天味业	742,574.70	0.82
15	300676	华大基因	722,237.00	0.80
16	600887	伊利股份	706,961.00	0.78
17	300498	温氏股份	630,983.00	0.70
18	603658	安图生物	612,396.40	0.68
19	002475	立讯精密	589,785.00	0.65
20	603160	汇顶科技	576,086.00	0.64

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。

8.4.3 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	45,870,248.20
卖出股票收入（成交）总额	48,027,217.92

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	-
4	应收利息	243.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	243.42

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301136	招标股份	28,193.60	0.03	新股未上市
2	301069	凯盛新材	20,248.18	0.02	创业板打新限售
3	301060	兰卫医学	18,161.78	0.02	创业板打新限售
4	301018	申菱环境	15,453.58	0.02	创业板打新限售
5	300994	久祺股份	10,408.05	0.01	创业板打新限售

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,078	21,167.06	29,078,821.00	44.63%	36,073,397.00	55.37%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	西藏东方企慧投资有限公司	28,481,775.00	43.72%
2	黄庆生	990,500.00	1.52%
3	胡洪国	900,000.00	1.38%
4	张文勇	836,000.00	1.28%
5	涂建华	629,300.00	0.97%
6	福州开发区数为资产管理有限公司—数为消费增强私募证券投资基金	597,046.00	0.92%

7	苏桦	501,900.00	0.77%
8	钱中明	497,300.00	0.76%
9	张科达	497,200.00	0.76%
10	陆梓楠	412,100.00	0.63%

9.3 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	0.00	0.00%

9.4 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年12月19日)基金份额总额	211,152,218.00
本报告期期初基金份额总额	59,152,218.00
本报告期基金总申购份额	61,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	55,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	65,152,218.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人重大人事变动

经公司第一届董事会第十九次会议审议通过，自2021年1月18日起，郁双爽担任公司督察长，黄薇薇不再代任督察长职务。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、本报告期内，公司与前任总经理李湧关于公司第一届董事会第十一次会议决议效力确认纠纷一案，经上海市第二中级人民法院终审判决，驳回了李湧关于公司第一届董事会第十一次会议决议不成立的诉讼请求。李湧不服上海市第二中级人民法院作出的上述判决，向上海市高级人民法院提出再审申请，上海市高级人民法院经审理后驳回了其再审申请。

2、本报告期内未发生涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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。本年度支付给所聘任的会计师事务所6万元人民币。

11.6 管理人、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，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	2	91,298,325.14	100.00%	32,607.39	100.00%	-

11.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
----	------	--------	------	------

名称	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	-	-	3,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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旗下基金2020年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2021-01-01
2	弘毅远方基金管理有限公司关于住所变更公告	证券时报、公司网站	2021-01-06
3	弘毅远方国证消费100交易型开放式证券投资基金场内交易价格溢价风险提示公告	证券时报、公司网站	2021-01-07
4	弘毅远方国证消费100交易型开放式证券投资基金场内交易价格溢价风险第二次提示公告	证券时报、公司网站	2021-01-08
5	弘毅远方国证消费100交易型开放式证券投资基金场内交易价格溢价风险第三次提示公告	证券时报、公司网站	2021-01-09
6	弘毅远方国证消费100交易型开放式证券投资基金场内交易价格溢价风险第四次提示公告	证券时报、公司网站	2021-01-12
7	弘毅远方国证消费100交易型开放式证券投资基金场内交易价格溢价风险提示公告	证券时报、公司网站	2021-01-20
8	弘毅远方基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、公司网站	2021-01-20
9	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2020年第四季度报告提示性	证券时报	2021-01-21

	公告		
10	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2020年第四季度报告	公司网站	2021-01-21
11	弘毅远方基金管理有限公司关于旗下指数基金标的指数相关信息的公告	证券时报、公司网站	2021-01-30
12	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2021年第1号）	公司网站	2021-02-09
13	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站	2021-02-09
14	弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证券时报、公司网站	2021-02-10
15	弘毅远方基金管理有限公司关于公司旗下部分基金2020年年度报告的提示性公告	证券时报	2021-03-30
16	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告	公司网站	2021-03-30
17	弘毅远方基金管理有限公司关于修改弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同的公告	证券时报、公司网站	2021-03-31
18	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同	公司网站	2021-03-31
19	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金托管协议	公司网站	2021-03-31
20	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2021年第2号）	公司网站	2021-03-31
21	弘毅远方国证消费100交易型开放	公司网站	2021-03-31

	式指数证券投资基金基金产品资料概要更新		
22	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-21
23	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站	2021-04-21
24	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年半年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2021-07-01
25	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年第二季度报告提示性公告	证券时报	2021-07-20
26	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年第二季度报告	公司网站	2021-07-20
27	弘毅远方基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	证券时报、公司网站	2021-08-21
28	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告提示性公告	证券时报	2021-08-28
29	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年中期报告	公司网站	2021-08-28
30	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年第三季度报告提示性公告	证券时报	2021-10-26
31	弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年第三季度报告	公司网站	2021-10-26
32	弘毅远方基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投	证券时报、公司网站	2021-11-17

	资于北京证券交易所股票的公告		
33	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息资料的公告	证券时报、公司网站	2021-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210101-20211231	34,156,375.00	-	5,674,600.00	28,481,775.00	43.72%
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p> <p>3、基金运作发生重大变更的风险 极端情况下，单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产净值连续低于5000万元，需要根据基金合同约定采取相关解决措施，从而使得基金运作发生重大变更。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于2021年2月10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》，公司股东弘毅投资（北京）有限公司向公司增加出资人民币3000万元。增资完成后，公司注册资本由人民币2.2亿元增加至人民币2.5亿元，弘毅投资（北京）有限公司持股比例仍为100%。

2、本报告期，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号--指数基金指引》（以下简称“《指引》”）等法律法规的规定以及《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）和《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》（以下简称“托管协议”）的约定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，弘毅远方基金管理有限公司决定对本基金基金合同和托管协议进行修改，并同时招募说明书进行更新。本次修改系按《指引》要求对本基金法律文件进行修订。具体可参见基金管理人于2021年3月31日发布的《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告》及修改后的基金合同、托管协议和招募说明书。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、关于申请募集注册弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

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

弘毅远方基金管理有限公司
二〇二二年三月二十九日