

# 弘毅远方国企转型升级混合型发起式证券投资基金

**2022年第1季度报告**

**2022年03月31日**

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22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2022年4月21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2022年1月1日起至3月31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  | 39,721,889.08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   | 弘毅远方国企转型升级 |

|                 |                |               |
|-----------------|----------------|---------------|
|                 | 混合A            | 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 | 36,659,633.58份 | 3,062,255.50份 |

### §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(2022年01月01日 - 2022年03月31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      | 961,541.68                     | 63,733.03     |
| 2.本期利润         | -17,081,660.55                 | -1,356,259.73 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.4539                        | -0.4606       |
| 4.期末基金资产净值     | 58,599,281.38                  | 4,882,577.84  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.5985                         | 1.5944        |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

弘毅远方国企转型升级混合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      | -21.89% | 1.40%     | -10.03%    | 1.02%         | -11.86% | 0.38% |
| 过去六个月      | -12.07% | 1.15%     | -8.76%     | 0.82%         | -3.31%  | 0.33% |
| 过去一年       | -14.43% | 1.06%     | -10.32%    | 0.79%         | -4.11%  | 0.27% |
| 过去三年       | 48.15%  | 1.25%     | 11.45%     | 0.89%         | 36.70%  | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 65.16%  | 1.19%     | 31.24%     | 0.91%         | 33.92%  | 0.28% |

## 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      | -22.00% | 1.40%     | -10.03%    | 1.02%         | -11.97% | 0.38% |
| 过去六个月      | -12.29% | 1.15%     | -8.76%     | 0.82%         | -3.53%  | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | -15.08% | 1.11%     | -10.03%    | 0.80%         | -5.05%  | 0.31% |

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

弘毅远方国企转型升级混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年10月31日-2022年03月31日)



弘毅远方国企转型升级混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年09月10日-2022年03月31日)



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 |        |   |
| 周鹏 | 本基金基金经理；弘毅远方高端制造混合基金基金经理；公司投资研究部副总经理 | 2018-10-31  | -    | 7 年    | 哥伦比亚大学商学院 MB A。2010 年加入弘毅投资，担任弘毅投资高级投资经理。期间作为主要成员参与多个 PE 项目投资。2015 年起加入弘毅远方基金管理有限公司筹备组担任投资副总监，现任弘毅远方基金管理有限公司投资研究部副总经理。在加入 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 弘毅投资之前，周鹏先生曾任高盛集团有限公司（Goldman Sachs）高级分析师，美国哈里斯公司分析师。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、基金经理的任职日期及离任日期即本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下管理的投资组合参与的交易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

报告期内市场震荡下行，上证综指自期初3639.78点下跌至3252.20点，累计涨跌幅-10.65%，深证成指和创业板指涨跌幅分别为-18.44%和-19.96%，市场整体的风险偏好较低，低估值的周期股表现相对较好，成长股表现落后，其中煤炭、房地产等行业涨幅居前，电子、军工和汽车等行业跌幅居前。主要的影响因素包括：（1）对国内疫情扩散及经济下行压力增大的担忧；（2）对地缘政治冲突引发外溢效应的担心；（3）通胀

预期上行和海外流动性收紧；（4）海外监管风险对中概股和港股风险偏好的压制和传导。

在经济下行压力下，稳增长政策逐步发力，未来一段时间在排除疫情扩散干扰后，宏观经济和市场情绪有望迎来改善：政府工作报告中2022年经济增速目标为5.5%，政策传递出的稳增长信号非常强烈；全年赤字率虽然按2.8%安排，但在多渠道资金支持下，全年财政支出增速将高达8.4%，且对地方的转移支付增速将达到18%，力度明显提升；3月金稳会的表态稳定市场悲观的情绪，会议表达了对稳增长的坚定支持，明确了房地产市场未来的发展思路，同时对于市场关注的中概股、平台经济、港股等问题给予了明确的定调，此外还释放欢迎长期机构投资者增加持股比例等积极信号；地缘政治冲突可能的边际改善。

报告期内本基金股票仓位基本保持稳定，个股层面延续自下而上的风格，在我们重点覆盖的先进制造、科技和消费三大赛道中，选择持有基本面扎实、发展趋势良好、关注度与估值尚未泡沫化的上市公司，期内成长股大幅调整后性价比提升进行了增配，行业上军工和消费占比提升的部分偏价值的基建与汽车占比下降，但总体仍保持beta的稳定。

#### 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1.5985元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-21.89%，同期业绩比较基准收益率为-10.03%；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1.5944元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-22.00%，同期业绩比较基准收益率为-10.03%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)         | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 55,585,572.34 | 86.86         |
|    | 其中：股票  | 55,585,572.34 | 86.86         |
| 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      | 8,289,919.77  | 12.95  |
| 8 | 其他资产              | 120,068.65    | 0.19   |
| 9 | 合计                | 63,995,560.76 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末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              | 50,014,543.34 | 78.79        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,987,041.00  | 4.71         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| 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       | 268,800.00    | 0.42         |
| 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        | 2,315,188.00  | 3.65         |



|   |    |               |       |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | -             | -     |
|   | 合计 | 55,585,572.34 | 87.56 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 5.3 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  | 002415 | 海康威视 | 115,000 | 4,715,000.00 | 7.43         |
| 2  | 300395 | 菲利华  | 61,200  | 3,440,052.00 | 5.42         |
| 3  | 300630 | 普利制药 | 72,000  | 3,128,400.00 | 4.93         |
| 4  | 002352 | 顺丰控股 | 65,000  | 2,970,500.00 | 4.68         |
| 5  | 002001 | 新和成  | 90,000  | 2,851,200.00 | 4.49         |
| 6  | 600438 | 通威股份 | 65,000  | 2,774,850.00 | 4.37         |
| 7  | 002050 | 三花智控 | 165,000 | 2,742,300.00 | 4.32         |
| 8  | 002241 | 歌尔股份 | 74,000  | 2,545,600.00 | 4.01         |
| 9  | 603728 | 鸣志电器 | 150,500 | 2,438,100.00 | 3.84         |
| 10 | 002594 | 比亚迪  | 10,600  | 2,435,880.00 | 3.84         |

### 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

#### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 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   | 120,068.65 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 120,068.65 |

### 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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**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<br>混合A | 弘毅远方国企转型升级<br>混合C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 39,773,229.73     | 3,677,541.96      |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 608,427.32        | 717,979.71        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 3,722,023.47      | 1,333,266.17      |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -                 | -                 |
| 报告期期末基金份额总额                   | 36,659,633.58     | 3,062,255.50      |

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<br>混合A | 弘毅远方国企转型升级<br>混合C |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额             | 8,500,800.08      | 0.00              |
| 报告期期间买入/申购总份额                | 0.00              | 0.00              |
| 报告期期间卖出/赎回总份额                | 2,500,000.00      | 0.00              |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额             | 6,000,800.08      | 0.00              |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金<br>总份额比例（%） | 16.37             | 0.00              |

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）      | 交易金额（元）      | 适用费率 |
|----|------|------------|--------------|--------------|------|
| 1  | 转出   | 2022-02-07 | 2,500,000.00 | 4,506,500.00 | 0    |
| 合计 |      |            | 2,500,000.00 | 4,506,500.00 |      |

**§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   | 6,000,800.08 | 15.11%       | 6,000,800.08 | 15.11%       | 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          | 6,000,800.08 | 15.11%       | 6,000,800.08 | 15.11%       | -          |

### §9 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

### §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。