

弘毅远方国证消费 100 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:2022 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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8月26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2022年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 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 | 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 | 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 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| §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 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 44 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 52 |
| §8 基金份额持有人信息 | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 54 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |

| | |
|---|----|
| 8.4 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 | 54 |
| §9 开放式基金份额变动 | 54 |
| §10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 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 | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 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 | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 10.8 其他重大事件 | 56 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| 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 | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| §12 备查文件目录 | 58 |
| 12.1 备查文件目录 | 58 |
| 12.2 存放地点 | 58 |
| 12.3 查阅方式 | 58 |

§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 | 35,152,218.00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年01月20日 |

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%,年跟</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 | 020-87553363-6731 |
| 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 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.honyfunds.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人办公场所 |

2.5 其他相关资料

| | | |
|--------|----------------|----------------|
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 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（2022年01月01日- 2022年06月30日） |
|---------------|-------------------------------|
| 本期已实现收益 | -8,894,806.02 |
| 本期利润 | -16,250,230.48 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2793 |
| 本期加权平均净值利润率 | -23.20% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2022年06月30日） |
| 期末可供分配利润 | 9,467,791.93 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2693 |
| 期末基金资产净值 | 44,620,009.93 |
| 期末基金份额净值 | 1.2693 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2022年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.93% |

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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|-------|--------|
| 过去一个月 | 11.77% | 1.37% | 11.34% | 1.41% | 0.43% | -0.04% |
| 过去三个月 | 10.50% | 1.73% | 9.61% | 1.75% | 0.89% | -0.02% |
| 过去六个月 | -11.98% | 1.72% | -13.15% | 1.74% | 1.17% | -0.02% |
| 过去一年 | -18.39% | 1.49% | -21.65% | 1.51% | 3.26% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.93% | 1.58% | 19.40% | 1.60% | 7.53% | -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-2022年06月30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。

§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。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2022年6月30日，本基金管理人共管理8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和弘毅远方久盈混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | - | 12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 公平交易制度的执行情况

本基金的基金管理人建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。不同投资组合同一品种的同向交易指令依照价格优先、时间优先、比例分配原则处理，保证交易在各投资组合间的公正处理，保证各投资组合间的利益公平。同时，完善非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。

公司交易部和风控合规部进行日常投资交易行为监控。风控合规部分别于每季度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

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的投资策略，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指数报告期内下跌13.15%，同期沪深300和上证综指分别下跌9.22%和6.63%。

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1.2693元，本报告期内，基金份额净值增长率为-11.98%，同期业绩比较基准收益率为-13.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，在国内稳增长政策逐渐加码，疫情防控政策不断优化，境外不利因素边际减弱的背景下，A股先抑后扬。

展望下半年，国内经济复苏趋势已成，但鉴于房地产风险化解进程中、消费弱复苏、高景气成长赛道拥挤等情况，建议对相关板块进行均衡配置。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本基金将继续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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由估值委员会确定相应证券的估值方法。估值委员会成员包括公司高级管理人员、投资研究部、基金运营部、风控合规部、信息技术部等相关人员。

基金管理人估值委员会成员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续20个工作日资产净值低于5000万元的情形，出现该情形的时间范围为2022年6月2日至2022年6月30日。

§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、基金费用开支及利润分配等问题上，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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对弘毅远方基金管理有限公司编制和披露的弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2022年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 431,819.86 | 1,647,286.14 |
| 结算备付金 | | 35,280.08 | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 44,193,078.13 | 92,539,567.14 |
| 其中：股票投资 | | 44,193,078.13 | 92,539,567.14 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | 138,693.45 | 243.42 |
| 资产总计 | | 44,798,871.52 | 94,187,096.70 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|---------------|---------------|
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 10,823.38 | 24,081.93 |
| 应付托管费 | | 3,607.78 | 8,027.35 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 164,430.43 | 204,467.80 |
| 负债合计 | | 178,861.59 | 236,577.08 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 35,152,218.00 | 65,152,218.00 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 9,467,791.93 | 28,798,301.62 |
| 净资产合计 | | 44,620,009.93 | 93,950,519.62 |
| 负债和净资产总计 | | 44,798,871.52 | 94,187,096.70 |

注:报告截止日2022年6月30日, 基金份额净值1.2693元, 基金份额总额35,152,218.00份。

6.2 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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日 |
|----------------|---------|---------------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -16,018,450.00 | -665,245.97 |
| 1.利息收入 | | 4,462.08 | 4,378.37 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 3,295.73 | 4,378.37 |
| 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 | | 1,166.35 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -8,667,487.62 | 13,915,375.55 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -9,212,198.35 | 13,236,688.07 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 43,833.99 | - |
| 资产支持证券投资 | | | |
| 收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 500,876.74 | 678,687.48 |
| 以摊余成本计量的 | | | |
| 金融资产终止确认 | | | |
| 产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失 | | | |
| 以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -7,355,424.46 | -14,707,610.74 |
| 4.汇兑收益（损失以“-” | | | |
| 号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-” | | | |
| 号填列） | 6.4.7.17 | - | 122,610.85 |
| 减：二、营业总支出 | | 231,780.48 | 556,917.44 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 105,383.41 | 195,142.26 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 35,127.81 | 65,047.39 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产 | | | |
| 支出 | | - | - |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|---------------|
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 0.08 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 91,269.18 | 296,727.79 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -16,250,230.48 | -1,222,163.41 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -16,250,230.48 | -1,222,163.41 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -16,250,230.48 | -1,222,163.41 |

6.3 净资产（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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
|----------------------|-------------------------------|--------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 65,152,218.00 | - | 28,798,301.62 | 93,950,519.62 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 65,152,218.00 | - | 28,798,301.62 | 93,950,519.62 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -30,000,000.00 | - | -19,330,509.69 | -49,330,509.69 |
| （一）、综合收益 | - | - | -16,250,230.48 | -16,250,230.48 |

| | | | | |
|--|------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 总额 | | | | |
| (二)、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) | -30,000,000.00 | - | -3,080,279.21 | -33,080,279.21 |
| 其中: 1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | -30,000,000.00 | - | -3,080,279.21 | -33,080,279.21 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 35,152,218.00 | - | 9,467,791.93 | 44,620,009.93 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 59,152,218.00 | - | 31,476,500.46 | 90,628,718.46 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 59,152,218.00 | - | 31,476,500.46 | 90,628,718.46 |
| 三、本期增减变动 | 19,000,000.00 | - | 11,927,267.47 | 30,927,267.47 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 额(减少以“-”号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -1,222,163.41 | -1,222,163.41 |
| (二)、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) | 19,000,000.00 | - | 13,149,430.88 | 32,149,430.88 |
| 其中: 1.基金申购款 | 57,000,000.00 | - | 35,783,812.66 | 92,783,812.66 |
| 2.基金赎回款 | -38,000,000.00 | - | -22,634,381.78 | -60,634,381.78 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 78,152,218.00 | - | 43,403,767.93 | 121,555,985.93 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

黄薇薇

丁旺

黄恽俊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

弘毅远方国证消费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、衍生工具(权证、股指期货等)、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。

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2022年上半年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2022年6月30日的财务状况以及2022年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下述6.4.4.1至 6.4.4.4中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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、资产支持证券投资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、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和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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相关交易费用及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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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。

以摊余成本计量的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。

6.4.5 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和应收利息，金额分别为1,647,286.14元和243.42元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和其他资产-应收利息，金额分别为1,647,529.56元和0.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为92,539,567.14元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为92,539,567.14元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为24,081.93元、8,027.35元和204,467.80元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为24,081.93元、8,027.35元和204,467.80元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 3,271.06 |

| | |
|--------------|------------|
| 等于：本金 | 3,248.80 |
| 加：应计利息 | 22.26 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | 428,548.80 |
| 等于：本金 | 428,507.68 |
| 加：应计利息 | 41.12 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 431,819.86 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | | |
|---------------|--------------------|------|---------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 47,749,955.88 | - | 44,193,078.13 | -3,556,877.75 |
| 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 | 47,749,955.88 | - | 44,193,078.13 | -3,556,877.75 |

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。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|-------|--------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | 138,693.45 |
| 合计 | 138,693.45 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30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 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 89,752.78 |
| 应付信息披露费 | 39,671.58 |
| 应付指数使用费 | 35,006.07 |
| 合计 | 164,430.43 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|---------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 65,152,218.00 | 65,152,218.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -30,000,000.00 | -30,000,000.00 |
| 本期末 | 35,152,218.00 | 35,152,218.00 |

6.4.7.8 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 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初 | 39,387,685.73 | -10,589,384.11 | 28,798,301.62 |
| 本期利润 | -8,894,806.02 | -7,355,424.46 | -16,250,230.48 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -16,506,457.45 | 13,426,178.24 | -3,080,279.21 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -16,506,457.45 | 13,426,178.24 | -3,080,279.21 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 13,986,422.26 | -4,518,630.33 | 9,467,791.93 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-----------|-------------------------------|----------|
| | 活期存款利息收入 | 3,263.96 |
| 定期存款利息收入 | - | |
| 其他存款利息收入 | 31.77 | |
| 结算备付金利息收入 | - | |
| 其他 | - | |
| 合计 | 3,295.73 | |

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -1,927,401.25 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -7,284,797.10 |
| 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 | -9,212,198.35 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 8,258,729.81 |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,171,473.40 |
| 减：交易费用 | 14,657.66 |
| 买卖股票差价收入 | -1,927,401.25 |

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 33,080,279.21 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 3,001,167.21 |
| 减：赎回股票成本总额 | 37,363,909.10 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -7,284,797.10 |

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 20.98 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 43,813.01 |
| 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 | 43,833.99 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 189,872.60 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 146,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 21.61 |
| 减：交易费用 | 37.98 |
| 买卖债券差价收入 | 43,813.01 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 500,876.74 |
| 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 | 500,876.74 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | -7,355,424.46 |
| ——股票投资 | -7,355,424.46 |
| ——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 | -7,355,424.46 |

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |

| | |
|---------|-----------|
| 信息披露费 | 39,671.58 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 10,538.27 |
| 固定注册登记费 | 11,306.55 |
| 合计 | 91,269.18 |

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 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股 票成交总 额的比例 |

| | | | | |
|------|---------------|---------|---------------|---------|
| 广发证券 | 14,465,998.71 | 100.00% | 59,569,736.81 | 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 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 广发证券 | 189,872.60 | 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 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 广发证券 | 15,400,000.00 | 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 2022年01月01日至2022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 | 5,440.00 | 100.00% | - | - |
| 关联方名 | 上年度可比期间 | | | |

| 称 | 2021年01月01日至2021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 | 19,219.58 | 100.00% | - | - |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 105,383.41 | 195,142.26 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,034.32 | 5,069.53 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 35,127.81 | 65,047.39 |

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。

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 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|----------|-------------------------------|----------|------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 广发证券-托管户 | 3,271.06 | 2,088.30 | 250,069.08 | 822.30 |
| 广发证券-证券户 | 428,548.80 | 1,175.66 | 1,309,652.26 | 2,409.05 |

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人广发证券存放在交通银行广东省分行营业部；本基金证券户的存款由基金托管人广发证券保管。按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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 | 受限期 | 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 |
| 301201 | 诚达药业 | 2022-01-12 | 6个月 | 创业板打新限售 | 72.69 | 71.54 | 56 | 4,070.64 | 4,006.24 | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022-01-07 | 6个月 | 创业板打新限售 | 15.64 | 20.38 | 164 | 2,564.96 | 3,342.32 | - |
| 300834 | 星辉环材 | 2022-01-06 | 6个月 | 创业板打新限售 | 55.57 | 30.03 | 55 | 3,056.35 | 1,651.65 | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022-01-04 | 6个月 | 创业板打新限售 | 64.08 | 37.52 | 30 | 1,922.40 | 1,125.60 | - |

注：1、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。

2、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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。

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2022年6月30日，本基金无债券投资(2021年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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2022年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

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。

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。

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 2022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 | 431,819.86 | - | - | - | 431,819.86 |
| 结算备付金 | 35,280.08 | - | - | - | 35,280.08 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 44,193,078.13 | 44,193,078.13 |
| 其他资产 | - | - | - | 138,693.45 | 138,693.45 |
| 资产总计 | 467,099.94 | - | - | 44,331,771.58 | 44,798,871.52 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 10,823.38 | 10,823.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,607.78 | 3,607.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 164,430.43 | 164,430.43 |
| 负债总计 | - | - | - | 178,861.59 | 178,861.59 |
| 利率敏感度缺口 | 467,099.94 | - | - | 44,152,909.99 | 44,620,009.93 |
| 上年度末 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 | - | - | - | 24,081.93 | 24,081.93 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 报酬 | | | | | |
| 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 |

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2022年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

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 2022年06月30日 | | 上年度末 2021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 | 44,193,078.13 | 99.04 | 92,539,567.14 | 98.50 |
| 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 | 44,193,078.13 | 99.04 | 92,539,567.14 | 98.50 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 业绩比较基准上涨5% | 2,179,094.55 | 4,568,253.98 |
| | 业绩比较基准下降5% | -2,179,094.55 | -4,568,253.98 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 44,182,952.32 | 92,189,336.00 |
| 第二层次 | - | 33,698.09 |
| 第三层次 | 10,125.81 | 316,533.05 |
| 合计 | 44,193,078.13 | 92,539,567.14 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 44,193,078.13 | 98.65 |
| | 其中：股票 | 44,193,078.13 | 98.65 |
| 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 | 467,099.94 | 1.04 |
| 8 | 其他各项资产 | 138,693.45 | 0.31 |
| 9 | 合计 | 44,798,871.52 | 100.00 |

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（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 | 1,528,772.94 | 3.43 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 35,029,875.16 | 78.51 |
| 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 | 225,800.00 | 0.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,151,534.00 | 2.58 |
| H | 住宿和餐饮业 | 157,250.00 | 0.35 |
| I | 信息传输、软件和信息技术 | 2,475,245.98 | 5.55 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| | 术服务业 | | |
| J | 金融业 | 124,995.00 | 0.28 |
| K | 房地产业 | 159,005.00 | 0.36 |
| L | 租赁和商务服务业 | 438,796.00 | 0.98 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,950,860.00 | 4.37 |
| 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 | 911,199.46 | 2.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 44,153,333.54 | 98.95 |

7.2.2 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 | 39,744.59 | 0.09 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 39,744.59 | 0.09 |

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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 | 601012 | 隆基绿能 | 37,004 | 2,465,576.52 | 5.53 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 11,800 | 2,382,774.00 | 5.34 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 31,400 | 1,896,246.00 | 4.25 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 5,400 | 1,800,846.00 | 4.04 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 36,400 | 1,417,780.00 | 3.18 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 12,500 | 1,299,875.00 | 2.91 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 4,800 | 1,183,392.00 | 2.65 |
| 8 | 600438 | 通威股份 | 16,900 | 1,011,634.00 | 2.27 |
| 9 | 002475 | 立讯精密 | 29,327 | 990,959.33 | 2.22 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 26,064 | 966,713.76 | 2.17 |
| 11 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,900 | 908,280.00 | 2.04 |
| 12 | 002415 | 海康威视 | 25,000 | 905,000.00 | 2.03 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 15,742 | 870,060.34 | 1.95 |
| 14 | 002352 | 顺丰控股 | 14,400 | 803,664.00 | 1.80 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 15 | 000725 | 京东方 A | 203,400 | 801,396.00 | 1.80 |
| 16 | 603288 | 海天味业 | 7,985 | 721,524.60 | 1.62 |
| 17 | 002304 | 洋河股份 | 3,900 | 714,285.00 | 1.60 |
| 18 | 600690 | 海尔智家 | 24,700 | 678,262.00 | 1.52 |
| 19 | 300015 | 爱尔眼科 | 14,898 | 666,983.46 | 1.49 |
| 20 | 300498 | 温氏股份 | 30,940 | 658,712.60 | 1.48 |
| 21 | 603501 | 韦尔股份 | 3,500 | 605,605.00 | 1.36 |
| 22 | 300122 | 智飞生物 | 4,900 | 543,949.00 | 1.22 |
| 23 | 002049 | 紫光国微 | 2,800 | 531,216.00 | 1.19 |
| 24 | 603986 | 兆易创新 | 3,716 | 528,452.36 | 1.18 |
| 25 | 002241 | 歌尔股份 | 15,400 | 517,440.00 | 1.16 |
| 26 | 300142 | 沃森生物 | 10,400 | 503,256.00 | 1.13 |
| 27 | 000063 | 中兴通讯 | 19,400 | 495,282.00 | 1.11 |
| 28 | 002230 | 科大讯飞 | 11,200 | 461,664.00 | 1.03 |
| 29 | 000625 | 长安汽车 | 26,422 | 457,629.04 | 1.03 |
| 30 | 000661 | 长春高新 | 1,900 | 443,498.00 | 0.99 |
| 31 | 002371 | 北方华创 | 1,600 | 443,392.00 | 0.99 |
| 32 | 002027 | 分众传媒 | 65,200 | 438,796.00 | 0.98 |
| 33 | 600522 | 中天科技 | 17,700 | 408,870.00 | 0.92 |
| 34 | 600660 | 福耀玻璃 | 9,500 | 397,195.00 | 0.89 |
| 35 | 000100 | TCL科技 | 81,800 | 391,822.00 | 0.88 |
| 36 | 600745 | 闻泰科技 | 4,600 | 391,506.00 | 0.88 |
| 37 | 300347 | 泰格医药 | 3,400 | 389,130.00 | 0.87 |
| 38 | 600703 | 三安光电 | 15,500 | 380,990.00 | 0.85 |
| 39 | 600050 | 中国联通 | 107,700 | 372,642.00 | 0.84 |
| 40 | 002410 | 广联达 | 6,300 | 342,972.00 | 0.77 |
| 41 | 600570 | 恒生电子 | 7,822 | 340,569.88 | 0.76 |
| 42 | 600196 | 复星医药 | 7,200 | 317,448.00 | 0.71 |
| 43 | 002179 | 中航光电 | 4,940 | 312,800.80 | 0.70 |
| 44 | 000733 | 振华科技 | 2,300 | 312,731.00 | 0.70 |
| 45 | 002311 | 海大集团 | 5,100 | 306,051.00 | 0.69 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 46 | 002821 | 凯莱英 | 1,000 | 289,000.00 | 0.65 |
| 47 | 000799 | 酒鬼酒 | 1,500 | 278,715.00 | 0.62 |
| 48 | 600460 | 士兰微 | 5,200 | 270,400.00 | 0.61 |
| 49 | 000538 | 云南白药 | 4,380 | 264,508.20 | 0.59 |
| 50 | 300759 | 康龙化成 | 2,750 | 261,855.00 | 0.59 |
| 51 | 300496 | 中科创达 | 2,000 | 260,960.00 | 0.58 |
| 52 | 300661 | 圣邦股份 | 1,400 | 254,828.00 | 0.57 |
| 53 | 601633 | 长城汽车 | 6,700 | 248,168.00 | 0.56 |
| 54 | 300207 | 欣旺达 | 7,800 | 246,480.00 | 0.55 |
| 55 | 600763 | 通策医疗 | 1,400 | 244,216.00 | 0.55 |
| 56 | 600584 | 长电科技 | 9,000 | 243,000.00 | 0.54 |
| 57 | 603369 | 今世缘 | 4,700 | 239,700.00 | 0.54 |
| 58 | 600588 | 用友网络 | 10,910 | 236,856.10 | 0.53 |
| 59 | 002920 | 德赛西威 | 1,600 | 236,800.00 | 0.53 |
| 60 | 002001 | 新和成 | 10,380 | 236,767.80 | 0.53 |
| 61 | 000963 | 华东医药 | 5,000 | 225,800.00 | 0.51 |
| 62 | 601138 | 工业富联 | 22,900 | 225,336.00 | 0.51 |
| 63 | 300408 | 三环集团 | 7,400 | 222,740.00 | 0.50 |
| 64 | 603806 | 福斯特 | 3,360 | 220,147.20 | 0.49 |
| 65 | 300390 | 天华超净 | 2,500 | 218,500.00 | 0.49 |
| 66 | 000876 | 新希望 | 13,700 | 209,610.00 | 0.47 |
| 67 | 600233 | 圆通速递 | 10,200 | 207,978.00 | 0.47 |
| 68 | 600600 | 青岛啤酒 | 2,000 | 207,840.00 | 0.47 |
| 69 | 000895 | 双汇发展 | 6,800 | 199,240.00 | 0.45 |
| 70 | 002180 | 纳思达 | 3,900 | 197,418.00 | 0.44 |
| 71 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,300 | 190,580.00 | 0.43 |
| 72 | 000938 | 紫光股份 | 9,800 | 190,120.00 | 0.43 |
| 73 | 600563 | 法拉电子 | 900 | 184,644.00 | 0.41 |
| 74 | 002236 | 大华股份 | 11,100 | 182,262.00 | 0.41 |
| 75 | 002555 | 三七互娱 | 8,400 | 178,332.00 | 0.40 |
| 76 | 601689 | 拓普集团 | 2,605 | 178,260.15 | 0.40 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 77 | 002008 | 大族激光 | 5,200 | 172,276.00 | 0.39 |
| 78 | 300601 | 康泰生物 | 3,680 | 166,262.40 | 0.37 |
| 79 | 000977 | 浪潮信息 | 6,200 | 164,176.00 | 0.37 |
| 80 | 603833 | 欧派家居 | 1,080 | 162,734.40 | 0.36 |
| 81 | 000069 | 华侨城 A | 24,500 | 159,005.00 | 0.36 |
| 82 | 002841 | 视源股份 | 2,100 | 158,172.00 | 0.35 |
| 83 | 600754 | 锦江酒店 | 2,500 | 157,250.00 | 0.35 |
| 84 | 300454 | 深信服 | 1,500 | 155,670.00 | 0.35 |
| 85 | 601799 | 星宇股份 | 900 | 153,900.00 | 0.34 |
| 86 | 002252 | 上海莱士 | 25,700 | 152,401.00 | 0.34 |
| 87 | 300628 | 亿联网络 | 2,000 | 152,300.00 | 0.34 |
| 88 | 002007 | 华兰生物 | 6,540 | 149,112.00 | 0.33 |
| 89 | 300223 | 北京君正 | 1,400 | 148,750.00 | 0.33 |
| 90 | 603486 | 科沃斯 | 1,200 | 146,268.00 | 0.33 |
| 91 | 002120 | 韵达股份 | 8,200 | 139,892.00 | 0.31 |
| 92 | 300433 | 蓝思科技 | 12,400 | 137,268.00 | 0.31 |
| 93 | 600183 | 生益科技 | 7,500 | 127,425.00 | 0.29 |
| 94 | 600845 | 宝信软件 | 2,300 | 125,580.00 | 0.28 |
| 95 | 300033 | 同花顺 | 1,300 | 124,995.00 | 0.28 |
| 96 | 600779 | 水井坊 | 1,200 | 111,048.00 | 0.25 |
| 97 | 002414 | 高德红外 | 8,480 | 109,137.60 | 0.24 |
| 98 | 002938 | 鹏鼎控股 | 3,600 | 108,756.00 | 0.24 |
| 99 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,300 | 84,682.00 | 0.19 |
| 100 | 002032 | 苏泊尔 | 1,000 | 56,340.00 | 0.13 |

7.3.2 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 | 601089 | 福元医药 | 1,066 | 22,439.30 | 0.05 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----|----------|------|
| 2 | 001268 | 联合精密 | 259 | 7,179.48 | 0.02 |
| 3 | 301201 | 诚达药业 | 56 | 4,006.24 | 0.01 |
| 4 | 301158 | 德石股份 | 164 | 3,342.32 | 0.01 |
| 5 | 300834 | 星辉环材 | 55 | 1,651.65 | 0.00 |
| 6 | 301196 | 唯科科技 | 30 | 1,125.60 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 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 | 002594 | 比亚迪 | 368,844.00 | 0.39 |
| 2 | 600522 | 中天科技 | 339,794.00 | 0.36 |
| 3 | 000733 | 振华科技 | 304,252.00 | 0.32 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 273,861.00 | 0.29 |
| 5 | 300759 | 康龙化成 | 246,674.00 | 0.26 |
| 6 | 600233 | 圆通速递 | 228,270.00 | 0.24 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 207,680.00 | 0.22 |
| 8 | 300390 | 天华超净 | 192,348.00 | 0.20 |
| 9 | 002180 | 纳思达 | 190,000.00 | 0.20 |
| 10 | 002008 | 大族激光 | 166,914.00 | 0.18 |
| 11 | 600563 | 法拉电子 | 166,332.00 | 0.18 |
| 12 | 601689 | 拓普集团 | 164,924.90 | 0.18 |
| 13 | 000977 | 浪潮信息 | 162,368.00 | 0.17 |
| 14 | 300496 | 中科创达 | 150,266.00 | 0.16 |
| 15 | 002252 | 上海莱士 | 148,104.00 | 0.16 |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 143,251.00 | 0.15 |
| 17 | 601012 | 隆基绿能 | 135,945.00 | 0.14 |
| 18 | 600754 | 锦江酒店 | 135,148.00 | 0.14 |
| 19 | 002049 | 紫光国微 | 132,000.00 | 0.14 |
| 20 | 002352 | 顺丰控股 | 126,504.00 | 0.13 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|----------------|
| 1 | 300014 | 亿纬锂能 | 860,659.00 | 0.92 |
| 2 | 002129 | TCL中环 | 670,908.00 | 0.71 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 640,744.00 | 0.68 |
| 4 | 002371 | 北方华创 | 327,213.00 | 0.35 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 244,449.00 | 0.26 |
| 6 | 300661 | 圣邦股份 | 243,117.00 | 0.26 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 236,082.00 | 0.25 |
| 8 | 603345 | 安井食品 | 215,184.00 | 0.23 |
| 9 | 002821 | 凯莱英 | 203,224.00 | 0.22 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 202,916.00 | 0.22 |
| 11 | 000799 | 酒鬼酒 | 190,328.00 | 0.20 |
| 12 | 603816 | 顾家家居 | 179,796.00 | 0.19 |
| 13 | 600763 | 通策医疗 | 160,730.00 | 0.17 |
| 14 | 002920 | 德赛西威 | 160,622.00 | 0.17 |
| 15 | 603160 | 汇顶科技 | 153,582.00 | 0.16 |
| 16 | 603882 | 金域医学 | 135,162.00 | 0.14 |
| 17 | 300529 | 健帆生物 | 134,154.00 | 0.14 |
| 18 | 300595 | 欧普康视 | 133,920.00 | 0.14 |
| 19 | 300003 | 乐普医疗 | 133,441.00 | 0.14 |
| 20 | 000100 | TCL科技 | 133,364.00 | 0.14 |

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 | 6,544,317.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,258,729.81 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 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 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 138,693.45 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 138,693.45 |

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**7.12.5.1 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的情况。

7.12.5.2 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 | 301201 | 诚达药业 | 4,006.24 | 0.01 | 创业板打新限售 |
| 2 | 301158 | 德石股份 | 3,342.32 | 0.01 | 创业板打新限售 |
| 3 | 300834 | 星辉环材 | 1,651.65 | 0.00 | 创业板打新限售 |

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 |
| 2,817 | 12,478.60 | 0.00 | 0.00% | 35,152,218.00 | 100.00% |

8.2 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 | 黄庆生 | 990,500.00 | 2.82% |
| 2 | 张文勇 | 900,000.00 | 2.56% |
| 3 | 胡洪国 | 900,000.00 | 2.56% |
| 4 | 涂建华 | 629,300.00 | 1.79% |
| 5 | 张科达 | 544,400.00 | 1.55% |
| 6 | 钱中明 | 529,600.00 | 1.51% |
| 7 | 陆梓楠 | 412,100.00 | 1.17% |
| 8 | 黄思佳 | 400,000.00 | 1.14% |
| 9 | 谢玉仙 | 376,400.00 | 1.07% |
| 10 | 潘家同 | 370,500.00 | 1.05% |

8.3 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% |

8.4 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 |

§9 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 | 65,152,218.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 30,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 35,152,218.00 |

§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，基金管理人重大人事变动

经公司第二届董事会第十四次会议审议通过，自2022年4月20日起，杨超先生不再担任公司首席信息官职务。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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。

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 | 2 | 14,465,998.71 | 100.00% | 5,440.00 | 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 | 189,872.60 | 100.00% | 15,400,000.00 | 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旗下基金2021年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告 | 公司网站 | 2022-01-01 |
| 2 | 弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告提示性公告 | 证券时报 | 2022-01-22 |
| 3 | 弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2021年第四季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2022-01-22 |
| 4 | 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（2022年第1号） | 中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2022-01-29 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|-------------------------|------------|
| 5 | 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 | 中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2022-01-29 |
| 6 | 弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2021年年度报告提示性公告 | 证券时报 | 2022-03-29 |
| 7 | 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 | 中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2022-03-29 |
| 8 | 弘毅远方基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站 | 2022-04-20 |
| 9 | 弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2022年第一季度报告提示性公告 | 证券时报 | 2022-04-22 |
| 10 | 弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金2022年第一季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2022-04-22 |

§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

| 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 | 20220101-20220601 | 28,481,775.00 | 0.00 | 28,481,775.00 | 0.00 | 0.00% |
| 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、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。

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2022年4月20日发布《弘毅远方基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自2022年4月20日起，杨超不再担任公司首席信息官。

§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。

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查阅和下载。

