

弘毅远方中短债债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:宁波银行股份有限公司

送出日期:2024 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29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2024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	6
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§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所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误！未定义书签。
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方中短债债券型证券投资基金		
基金简称	弘毅远方中短债债券		
基金主代码	017545		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023年05月23日		
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司		
基金托管人	宁波银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	148,023,410.63份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	弘毅远方中短 债A	弘毅远方中短 债C	弘毅远方中 短债E
下属分级基金的交易代码	017545	017546	020415
报告期末下属分级基金的份额总额	105,657,922. 15份	36,139,358.2 3份	6,226,130.25 份

注：本基金自2024年1月3日起增加E类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过重点投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策）、流动性水平（包括资金面供求情况、证券市场估值水平）的深入研究分析以及市场情绪的合理判断，紧密追踪债券市场、货币市场的预期风险和收益，并据此对本基金资产在债券、现金之间的投资比例进行动态调整，谋求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率×90%+一年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平低于股

	票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
--	----------------------

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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郁双爽	朱广科
	联系电话	021-53682888	0574-87050338
	电子邮箱	service@honyfunds.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		400-920-8800	0574-83895886
传真		021-53682755	0574-89103213
注册地址		上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层（实际楼层28层）06单元	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码		200010	315100
法定代表人		黄薇薇	陆华裕

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	弘毅远方基金管理有限公司	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

§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(2024年01月01日-2024年06月30日)		
	弘毅远方中短债A	弘毅远方中短债C	弘毅远方中短债E
本期已实现收益	2,772,665.99	5,825,385.21	329,463.52
本期利润	1,513,241.41	5,896,492.20	2,161.74
加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0124	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.97%	1.21%	0.01%
本期基金份额净值增长率	0.90%	0.82%	0.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)		
期末可供分配利润	987,373.99	248,109.18	55,581.97
期末可供分配基金份额利润	0.0093	0.0069	0.0089
期末基金资产净值	106,645,296.14	36,387,467.41	6,281,712.22
期末基金份额净值	1.0093	1.0069	1.0089
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	2.93%	2.69%	0.83%

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

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

3、本基金自2024年1月3日起增加E类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

弘毅远方中短债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.27%	0.01%	0.34%	0.01%	-0.07%	0.00%
过去三个月	-0.17%	0.09%	1.09%	0.03%	-1.26%	0.06%
过去六个月	0.90%	0.07%	2.13%	0.02%	-1.23%	0.05%
过去一年	2.62%	0.05%	3.54%	0.02%	-0.92%	0.03%
自基金合同 生效起至今	2.93%	0.05%	4.00%	0.02%	-1.07%	0.03%

弘毅远方中短债C

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	0.29%	0.01%	0.34%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去三个月	-0.20%	0.09%	1.09%	0.03%	-1.29%	0.06%
过去六个月	0.82%	0.07%	2.13%	0.02%	-1.31%	0.05%
过去一年	2.43%	0.05%	3.54%	0.02%	-1.11%	0.03%
自基金合同 生效起至今	2.69%	0.04%	4.00%	0.02%	-1.31%	0.02%

弘毅远方中短债E

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	0.28%	0.01%	0.34%	0.01%	-0.06%	0.00%
过去三个月	-0.18%	0.09%	1.09%	0.03%	-1.27%	0.06%
自基金合同 生效起至今	0.83%	0.07%	2.15%	0.02%	-1.32%	0.05%

注：本基金自2024年1月3日起增加E类基金份额。

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

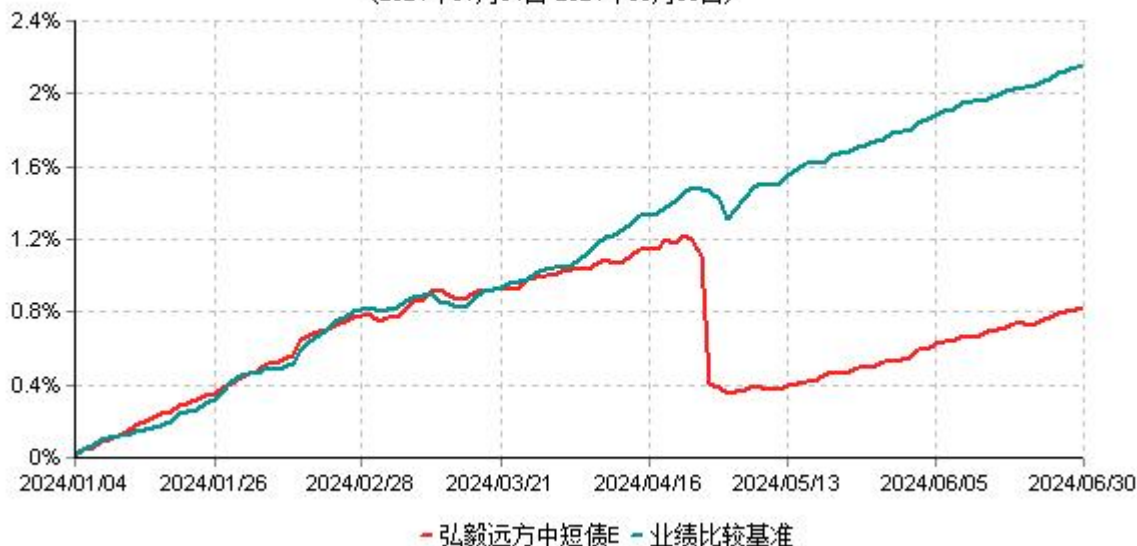
弘毅远方中短债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年05月23日-2024年06月30日)



弘毅远方中短债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
(2023年05月23日-2024年06月30日)



弘毅远方中短债E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年01月04日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年5月23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2024年1月3日起增加E类基金份额。

§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3.5亿元人民币（截至2024年6月30日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2024年6月30日，本基金管理人共管理6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、弘毅远方久盈混合型证券投资基金、弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金、弘毅远方中短债债券型证券投资基金。

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		
章劲	本基金基金经理；弘毅远方国企转型升级混合型发起式证券投资基金基金经理；弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金基金经理；公司副总经理兼首席投资官	2023-06-02	2024-07-25	19年	上海大学信息学学士。曾任上海银行资金营运中心自营业务科经理，华夏基金管理有限公司基金经理，华泰资产管理公司证券投资事业部固定收益投资部总经理、证券投资总监、投资管理部总经理，华泰保兴基金管理有限公司副总经理兼首席投资官等职务。2022年2月加入弘毅远方基金管理有限公司。
伍银	本基金基金经理；弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理	2023-09-06	-	11年	上海财经大学金融硕士。曾任永诚财产保险股份有限公司固定收益研究员、永诚保险资产管理有限公司固定收益投资经理。2023年8月加入弘毅远方基金管理有限公司。

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。

3、本基金管理人于2024年7月25日发布《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金经理变更公告》，自2024年7月25日起，由伍银女士独立管理本基金，章劲先生不再担任本基金的基金经理。

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

2024年上半年，国内经济结构在持续转型中，经济呈现明显边际复苏态势，节奏上二季度较一季度环比略走弱。结构上看，今年以来经济复苏的主要拉动项是制造业投资与出口，消费表现平淡，地产投资是拖累项，不过相关政策在二季度密集出台，特别是5月以来地产支持政策出台，自上而下托底维稳目标明确。不过从广义流动性角度看，社融存量增速在上半年有所走低，主要源于今年地方政府债发行后置、信贷“挤水分”，货币政策环境整体偏向宽松。

2024年上半年债市收益率持续下行，仅在4月末出现短暂回调。一季度市场对于经济增长预期较为悲观，再加上年初降准降息落地、资金面宽松等因素，10年国债收益

率正式下破 2.30%。4 月初，市场利率定价自律机制倡议，要求银行业金融机构禁止通过手工补息的方式高息揽储，受此影响原来空转的资金回到广义基金体系，资金利率和债券收益率均大幅下行，10 年国债收益率于 4 月下旬最低下行至 2.23%，创二十年新低；4 月末央行提示债券市场利率风险，债市短期出现明显调整，但随着央行在短期流动性投放方面慷慨，尽管 5 月发布多项关于地产政策的调整，但 5-6 月地产销售和微观数据并未迅速改善，且公布的各项宏观经济数据仍然偏弱，10 年国债收益率缓慢再度下行至 2.20% 附近。

报告期内，本基金积极把握中短久期票息类资产的配置机会，精选个券的同时做好资产端与负债端匹配，同时综合运用宏微观视角，把握中长端利率的波段机会。此外，在今年债券利率快速下行且信用债出现“利率化”趋势的背景下，我们提升了组合投资管理的精细度，通过把握曲线形态、品种利差以及保持灵活的组合久期弹性，来提升增厚组合收益的胜率。

不过 4 月末市场的变化及个券的波动与原本策略预期出现一定偏差，基金组合净值出现了较大回撤，二季度组合业绩整体不理想，在此，作为基金经理，对给投资者造成的损失深感歉意。在中国经济面临百年未有之大变局以及债市生态也在发生快速革新的背景下，过去的经验未必适合现在，传统投资范式可能会面临挑战，我们深刻地意识到调整并理清自己的投资体系、提高市场应变能力的重要性。5 月份以来综合基金组合的情况及市场研判，我们迅速调整了组合仓位及重点投资策略，优化利率债、金融次级债及高等级信用债更为均衡的配比，以高等级信用债作为底仓配置，捕捉利率债及金融次级债的投资机会来兼顾组合的收益性及流动性，5 月中旬以来组合净值在持续修复前期回撤中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方中短债A基金份额净值为1.0093元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.90%，同期业绩比较基准收益率为2.13%；截至报告期末弘毅远方中短债C基金份额净值为1.0069元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.82%，同期业绩比较基准收益率为2.13%；截至报告期末弘毅远方中短债E基金份额净值为1.0089元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率为2.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前瞻来看，基于新旧动能转换的大背景仍未变化，在预期社会融资成本持续降低的背景下，推动债券收益率中枢逐步下行的驱动因素短期仍看不到被扭转，且目前金融数据显示实体经济融资需求偏弱，货币政策仍有宽松空间。从供需关系看，下半年特别是三季度债券供给预计加速，在供需角力下预计要到 8 月下旬至 9 月资产荒环境才有机会

出现较明显的缓解。在基本面仍处于缓慢修复及货币政策维持宽松环境的背景下，预计债市整体进入低利率、新均衡阶段，利率将延续区间震荡下行态势。

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

本报告期内本基金进行了利润分配，符合相关法律法规规定和本基金基金合同的约定。具体如下：

弘毅远方中短债A：权益登记日为2024年6月20日，每10份基金份额分红0.20元。

弘毅远方中短债C：权益登记日为2024年6月20日，每10份基金份额分红0.20元。

弘毅远方中短债E：权益登记日为2024年6月20日，每10份基金份额分红0.20元。

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

无。

§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，本托管人在弘毅远方中短债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：弘毅远方中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,444,870.87	8,978,925.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	140,264,635.10	662,960,436.96
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		137,218,134.55	662,960,436.96
资产支持证券投资		3,046,500.55	-
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	7,090,070.90	65,078,389.88

应收清算款		300,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	42,198,361.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		150,099,576.87	779,216,113.81
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		-	4,000,658.92
应付清算款		-	-
应付赎回款		455,514.79	7,941,323.14
应付管理人报酬		40,236.93	184,587.20
应付托管费		6,706.12	30,764.52
应付销售服务费		7,616.43	90,751.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,503.41	96,477.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	263,523.42	173,585.19
负债合计		785,101.10	12,518,148.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	148,023,410.63	752,448,330.10
未分配利润	6.4.7.7	1,291,065.14	14,249,635.19
净资产合计		149,314,475.77	766,697,965.29
负债和净资产总计		150,099,576.87	779,216,113.81

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额148,023,410.63份，其中弘毅远方中短债债券型证券投资基金A类基金份额的基金份额净值1.0093元，基金份额总额

105,657,922.15份，基金资产净值106,645,296.14元；弘毅远方中短债债券型证券投资基金C类基金份额的基金份额净值1.0069元，基金份额总额36,139,358.23份，基金资产净值36,387,467.41元；弘毅远方中短债债券型证券投资基金E类基金份额的基金份额净值1.0089元，基金份额总额6,226,130.25份，基金资产净值6,281,712.22元。

6.2 利润表

会计主体：弘毅远方中短债债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年05月23日（基 金合同生效日）至202 3年06月30日
一、营业总收入		9,731,192.81	807,970.96
1.利息收入		396,255.04	807,970.96
其中：存款利息收入	6.4.7.8	201,883.56	799,837.40
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		194,371.48	8,133.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		10,732,460.83	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	10,688,362.15	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.10	44,098.68	-
贵金属投资收益	6.4.7.11	-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益		-	-

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	-1,515,619.37	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	118,096.31	-
减：二、营业总支出		2,319,297.46	113,591.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,012,660.57	73,501.79
2.托管费	6.4.10.2.2	168,776.76	12,250.29
3.销售服务费	6.4.10.2.3	491,639.54	4,229.13
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		491,833.64	-
其中：卖出回购金融资产支出		491,833.64	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		46,279.35	-
8.其他费用	6.4.7.15	108,107.60	23,609.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7,411,895.35	694,379.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7,411,895.35	694,379.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,411,895.35	694,379.93

6.3 净资产变动表

会计主体：弘毅远方中短债债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	752,448,330.10	14,249,635.19	766,697,965.29
二、本期期初净资产	752,448,330.10	14,249,635.19	766,697,965.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-604,424,919.47	-12,958,570.05	-617,383,489.52
（一）、综合收益总额	-	7,411,895.35	7,411,895.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-604,424,919.47	-17,341,851.82	-621,766,771.29
其中：1.基金申购款	1,889,783,386.41	49,027,420.90	1,938,810,807.31
2.基金赎回款	-2,494,208,305.88	-66,369,272.72	-2,560,577,578.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-3,028,613.58	-3,028,613.58
四、本期期末净资产	148,023,410.63	1,291,065.14	149,314,475.77
项目	上年度可比期间		
	2023年05月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	244,998,256.66	-	244,998,256.66

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,624,968.72	699,341.84	-6,925,626.88
（一）、综合收益总额	-	694,379.93	694,379.93
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,624,968.72	4,961.91	-7,620,006.81
其中：1.基金申购款	80,534,454.32	217,000.20	80,751,454.52
2.基金赎回款	-88,159,423.04	-212,038.29	-88,371,461.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	237,373,287.94	699,341.84	238,072,629.78

注：本基金基金合同生效日为2023年5月23日，故上年度可比区间为2023年5月23日（基金合同生效日）至2023年6月30日。

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

黄怿俊

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

弘毅远方中短债债券型证券投资基金(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[2022]2819号《关于准予弘毅远方中短债债券型证券投资基金注册的批复》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《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基

金为契约型开放式，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244,990,305.72元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0280号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金合同》于2023年5月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为244,998,256.66份基金份额，其中认购资金利息折合7,950.94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，基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称“宁波银行”)。

根据《弘毅远方中短债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具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)。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金所投资的中短期债券是指剩余期限不超过3年(含)的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1-3年)指数收益率×90%+一年期定期存款利率(税后)×10%

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基

金合同》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。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值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

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	2,436,454.51
等于：本金	2,435,548.29
加：应计利息	906.22
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	8,416.36
等于：本金	8,394.70

加：应计利息	21.66
减：坏账准备	-
合计	2,444,870.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	135,238,276.19	1,892,934.55	137,218,134.55	86,923.81
	合计	135,238,276.19	1,892,934.55	137,218,134.55	86,923.81
资产支持证券	3,045,000.00	500.55	3,046,500.55	1,000.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	138,283,276.19	1,893,435.10	140,264,635.10	87,923.81	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,090,070.90	-

银行间市场	-	-
合计	7,090,070.90	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,015.58
其中：交易所市场	-
银行间市场	39,015.58
应付利息	-
预提费用-审计费	89,835.26
预提费用-信息披露费	134,672.34
合计	263,523.42

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 弘毅远方中短债A

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	186,447,956.90	186,447,956.90
本期申购	53,234,904.32	53,234,904.32
本期赎回(以“-”号填列)	-134,024,939.07	-134,024,939.07
本期末	105,657,922.15	105,657,922.15

6.4.7.6.2 弘毅远方中短债C

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	566,000,373.20	566,000,373.20
本期申购	1,744,388,967.04	1,744,388,967.04
本期赎回（以“-”号填列）	-2,274,249,982.01	-2,274,249,982.01
本期末	36,139,358.23	36,139,358.23

6.4.7.6.3 弘毅远方中短债E

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债E)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	92,159,515.05	92,159,515.05
本期赎回（以“-”号填列）	-85,933,384.80	-85,933,384.80
本期末	6,226,130.25	6,226,130.25

- 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2024年1月3日起增加E类基金份额。

6.4.7.7 未分配利润**6.4.7.7.1 弘毅远方中短债A**

单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,271,441.67	472,146.96	3,743,588.63
本期期初	3,271,441.67	472,146.96	3,743,588.63
本期利润	2,772,665.99	-1,259,424.58	1,513,241.41
本期基金份额交易产	-2,065,840.94	-87,255.04	-2,153,095.98

生的变动数			
其中：基金申购款	1,263,846.99	115,272.64	1,379,119.63
基金赎回款	-3,329,687.93	-202,527.68	-3,532,215.61
本期已分配利润	-2,116,360.07	-	-2,116,360.07
本期末	1,861,906.65	-874,532.66	987,373.99

6.4.7.7.2 弘毅远方中短债C

单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,074,568.28	1,431,478.28	10,506,046.56
本期期初	9,074,568.28	1,431,478.28	10,506,046.56
本期利润	5,825,385.21	71,106.99	5,896,492.20
本期基金份额交易产生的变动数	-13,554,015.99	-1,825,021.04	-15,379,037.03
其中：基金申购款	36,884,817.93	8,252,553.83	45,137,371.76
基金赎回款	-50,438,833.92	-10,077,574.87	-60,516,408.79
本期已分配利润	-775,392.55	-	-775,392.55
本期末	570,544.95	-322,435.77	248,109.18

6.4.7.7.3 弘毅远方中短债E

单位：人民币元

项目 (弘毅远方中短债E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	329,463.52	-327,301.78	2,161.74
本期基金份额交易产生的变动数	-65,749.07	256,030.26	190,281.19
其中：基金申购款	2,278,090.75	232,838.76	2,510,929.51
基金赎回款	-2,343,839.82	23,191.50	-2,320,648.32
本期已分配利润	-136,860.96	-	-136,860.96

本期末	126,853.49	-71,271.52	55,581.97
-----	------------	------------	-----------

注：本基金自2024年1月3日起增加E类基金份额。

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	200,600.34	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	1,283.22	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	201,883.56	

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	17,399,047.32	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,710,685.17	
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	10,688,362.15	

6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	2,758,599,777.65	

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,710,193,516.60
减：应计利息总额	55,064,577.57
减：交易费用	52,368.65
买卖债券差价收入	-6,710,685.17

6.4.7.10 资产支持证券投资收益

6.4.7.10.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	44,098.68
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	44,098.68

6.4.7.10.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	6,990,936.88
减：卖出资产支持证券成本总额	6,955,000.00
减：应计利息总额	35,936.88
减：交易费用	-

资产支持证券投资收益	-
------------	---

6.4.7.11 贵金属投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-1,515,619.37
——股票投资	-
——债券投资	-1,516,619.37
——资产支持证券投资	1,000.00
——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	-1,515,619.37

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	118,096.31
合计	118,096.31

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	108,107.60

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、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司("宁波银行")	基金托管人
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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

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 2024年01月01 日至2024年06 月30日	上年度可比期间 2023年05月23日（基金合 同生效日）至2023年06月3 0日
当期发生的基金应支付的管理费	1,012,660.57	73,501.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	414,305.30	6,110.08
应支付基金管理人的净管理费	598,355.27	67,391.71

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 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年05月23日（基金合 同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	168,776.76	12,250.29

注：支付基金托管人宁波银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	弘毅远方中短债A	弘毅远方中短债C	弘毅远方中短债E	合计
弘毅远方基金	0.00	11,245.40	0.16	11,245.56
合计	0.00	11,245.40	0.16	11,245.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年05月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	弘毅远方中短债A	弘毅远方中短债C	弘毅远方中短债E	合计
弘毅远方基金	0.00	0.00	-	0.00
合计	0.00	0.00	-	0.00

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给弘毅远方基金管理有限公司，再由弘毅远方基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.20% / 当年天数。

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日E类基金资产净值0.02%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给弘毅远方基金管理有限公司，再由弘毅远方基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日E类基金资产净值×0.02%/当年天数。

3、本基金A类份额不收取销售服务费。

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**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年05月23日（基金合同生效日）至2023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
宁波银行股份有限公司	2,436,454.51	200,600.34	177,613,894.88	799,837.37

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管。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——固定净值型货币市场基金之外的基金

弘毅远方中短债A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2024- 06-20	2024-06- 20	0.200	2,106,57 4.85	9,785.22	2,116,36 0.07	-
合计			0.200	2,106,57 4.85	9,785.22	2,116,36 0.07	-

弘毅远方中短债C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2024- 06-20	2024-06- 20	0.200	732,524. 88	42,867.67	775,392. 55	-
合计			0.200	732,524. 88	42,867.67	775,392. 55	-

弘毅远方中短债E

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2024- 06-20	2024-06- 20	0.200	127,345. 77	9,515.19	136,860. 96	-
合计			0.200	127,345. 77	9,515.19	136,860. 96	-

6.4.12 期末（2024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**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金，而低于股票型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人宁波银行的托管账户，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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2024年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为85.08%（2023年12月31日：81.14%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	13,141,240.09	227,192,410.38
合计	13,141,240.09	227,192,410.38

注：未评级部分为短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,046,500.55	-
合计	3,046,500.55	-

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	93,206,900.86	307,321,876.85
AAA以下	-	-
未评级	30,869,993.60	128,446,149.73
合计	124,076,894.46	435,768,026.58

注：未评级部分为中期票据和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，当出现巨额赎回情形时，经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益。本基金的投资市场主要为证券交易所、银行间同业市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券等），在正常情况下均具有良好的流动性。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。单一投资者及其一致行动人主动持有基金份额数不得达到或超过基金份额总

数的50%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

综合上述各项流动性指标的监控结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险，利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,444,870.87	-	-	-	2,444,870.87
交易性金融资产	98,557,405.67	41,707,229.43	-	-	140,264,635.10
买入返售金融资产	7,090,070.90	-	-	-	7,090,070.90
应收清算款	-	-	-	300,000.00	300,000.00
资产总计	108,092,347.44	41,707,229.43	-	300,000.00	150,099,576.87

负债					
应付赎回款	-	-	-	455,514.79	455,514.79
应付管理人报酬	-	-	-	40,236.93	40,236.93
应付托管费	-	-	-	6,706.12	6,706.12
应付销售服务费	-	-	-	7,616.43	7,616.43
应交税费	-	-	-	11,503.41	11,503.41
其他负债	-	-	-	263,523.42	263,523.42
负债总计	-	-	-	785,101.10	785,101.10
利率敏感度缺口	108,092,347.44	41,707,229.43	-	-485,101.10	149,314,475.77
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,978,925.06	-	-	-	8,978,925.06
交易性金融资产	377,417,663.33	285,542,773.63	-	-	662,960,436.96
买入返售金融资产	65,078,389.88	-	-	-	65,078,389.88
应收申购款	-	-	-	42,198,361.91	42,198,361.91
资产总计	451,474,978.27	285,542,773.63	-	42,198,361.91	779,216,113.81

计					
负债					
卖出回购金融资产款	4,000,658.92	-	-	-	4,000,658.92
应付赎回款	-	-	-	7,941,323.14	7,941,323.14
应付管理人报酬	-	-	-	184,587.20	184,587.20
应付托管费	-	-	-	30,764.52	30,764.52
应付销售服务费	-	-	-	90,751.68	90,751.68
应交税费	-	-	-	96,477.87	96,477.87
其他负债	-	-	-	173,585.19	173,585.19
负债总计	4,000,658.92	-	-	8,517,489.60	12,518,148.52
利率敏感度缺口	447,474,319.35	285,542,773.63	-	33,680,872.31	766,697,965.29

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	280,232.05	1,358,728.85
	市场利率上升25个基点	-278,816.72	-1,351,309.96

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。

本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	137,218,134.55	91.90	662,960,436.96	86.47
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	137,218,134.55	91.90	662,960,436.96	86.47

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	140,264,635.10	662,960,436.96
第三层次	-	-
合计	140,264,635.10	662,960,436.96

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。

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	140,264,635.10	93.45
	其中：债券	137,218,134.55	91.42
	资产支持证券	3,046,500.55	2.03
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,090,070.90	4.72
	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	2,444,870.87	1.63
8	其他各项资产	300,000.00	0.20
9	合计	150,099,576.87	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,805,268.72	41.39
	其中：政策性金融债	10,180,131.51	6.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	13,141,240.09	8.80
6	中期票据	62,271,625.74	41.71
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	137,218,134.55	91.90

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	102382345	23泰达投资MTN003	100,000	10,562,688.52	7.07
2	102382227	23平煤化MTN001	100,000	10,543,874.32	7.06
3	2123002	21建信人寿01	100,000	10,511,923.50	7.04
4	2128002	21工商银行二级01	100,000	10,505,443.84	7.04
5	102382043	23平安租赁MTN003	100,000	10,459,338.80	7.00

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	144122	24新保A1	100,000	3,046,500.55	2.04

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国债期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平煤神马控股集团有限公司、建信人寿保险股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国人民财产保险股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形。

本基金管理人对上述证券的投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现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	300,000.00
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	-

8	其他	-
9	合计	300,000.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	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
弘毅远方中短债A	573	184,394.28	100,002,432.94	94.65%	5,655,489.21	5.35%
弘毅远方中短债C	4,813	7,508.70	0.00	0.00%	36,139,358.23	100.00%
弘毅远方中短债E	1,281	4,860.37	0.00	0.00%	6,226,130.25	100.00%

合计	6,667	22,202.40	100,002,432.94	67.56%	48,020,977.69	32.44%
----	-------	-----------	----------------	--------	---------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	弘毅远方中短债A	12,689.74	0.01%
	弘毅远方中短债C	146,932.29	0.41%
	弘毅远方中短债E	40,176.57	0.65%
	合计	199,798.60	0.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	弘毅远方中短债A	0
	弘毅远方中短债C	0
	弘毅远方中短债E	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	弘毅远方中短债A	0~10
	弘毅远方中短债C	0
	弘毅远方中短债E	-
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方中短债A	弘毅远方中短债C	弘毅远方中短债E
基金合同生效日(2023年05月23日)	224,009,451.84	20,988,804.82	-

基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	186,447,956.90	566,000,373.20	-
本报告期基金总申购份额	53,234,904.32	1,744,388,967.04	92,159,515.05
减：本报告期基金总赎回份额	134,024,939.07	2,274,249,982.01	85,933,384.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	105,657,922.15	36,139,358.23	6,226,130.25

- 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2024年1月3日起增加E类基金份额。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年06月25日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	公司债券投资决策不审慎，且未能做好基金投资者结构与基金资产流动性的匹配管理。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成改正
其他	无
措施2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	副总经理
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年06月25日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	作为公司高级管理人员，对公司存在的相关问题负有责任。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	无
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的专门基金托管部门及高级管理人员未发生受稽查或处罚等情况。

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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
广发证券	2	-	-	2,246.18	100.00%	-

注：1、本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，具备健全的内控制度，合规风控能力较强，交易能力、投研综合实力较强的证券经纪服务商提供服务。

2、本基金管理人完成内部审批程序后与证券经纪服务商、基金托管人签署证券经纪服务协议，对账户管理、数据传输、证券交易、资金管理、交易监控、费用收取等事项进行约定，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

3、本基金本报告期内交易单元未发生变更情况。

4、本基金管理人已于2024年6月30日前根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金动态调整工作。

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	32,049,716.78	100.00%	152,754,000.00	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	关于弘毅远方中短债债券型证券投资基金增加E类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站、上海证券报	2024-01-03
2	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03

3	弘毅远方中短债债券型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03
4	弘毅远方中短债债券型证券投资基金更新的招募说明书（2024年第1号）	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03
5	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03
6	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03
7	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新E类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-03
8	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2023年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-01-19
9	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2023年第4季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
10	弘毅远方中短债债券型证券投资基金2024年春节假期前暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站、上海证券报	2024-02-07
11	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2023年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-03-28
12	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2023年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-28
13	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	公司网站、上海证券报	2024-04-10

	息资料的公告		
14	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2024年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-04-19
15	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金2024年第1季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-19
16	弘毅远方中短债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站、上海证券报	2024-06-05
17	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-06-13
18	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-06-13
19	弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新E类份额	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2024-06-13
20	弘毅远方中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站、上海证券报	2024-06-19
21	关于弘毅远方中短债债券型证券投资基金分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站、上海证券报	2024-06-19

§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	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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

别		0%的时间 区间					
机 构	1	20240514 - 20240522	-	48,918,892. 48	48,918,892. 48	-	0.00%
	2	20240426 - 20240630	100,002,333. 33	0.00	0.00	100,002,33 3.33	67.56%
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、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p> <p>4、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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2024年4月25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》，基金管理人股东弘毅投资（北京）有限公司向基金管理人增加出资人民币4000万元，增资完成后，基金管理人注册资本由人民币3.1亿元增加至人民币3.5亿元。

§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中短债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方中短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方中短债债券型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中短债债券型证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内弘毅远方中短债债券型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。