

弘毅远方久盈混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§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	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62

8.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	63
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3	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	64
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	65
§10	开放式基金份额变动	65
§11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4	基金投资策略的改变	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8	其他重大事件	67
§12	影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	71
§13	备查文件目录	71
13.1	备查文件目录	71
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方久盈混合型证券投资基金	
基金简称	弘毅远方久盈混合	
基金主代码	013694	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年06月07日	
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,892,978.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C
下属分级基金的交易代码	013694	013695
报告期末下属分级基金的份额总额	12,060,584.52份	40,832,393.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在综合分析多方面因素的基础上，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间进行配置，同时采取股票投资和债券投资策略，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	郁双爽	韩笑微
	联系电话	021-53682888	010-68858113
	电子邮箱	service@honyfunds.com	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-920-8800	95580
传真		021-53682755	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200010	100808
法定代表人		黄薇薇	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.honyfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年06月07日（基金合同生效日）-2022年12月31
---------------	-------	---------------------------------

	日			
	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C
本期已实现收益	-101,436.49	-3,042,694.75	257,540.41	1,099,629.61
本期利润	106,945.28	-247,634.61	-598,305.35	-2,393,100.29
加权平均基金份额本期利润	0.0088	-0.0034	-0.0167	-0.0174
本期加权平均净值利润率	0.89%	-0.34%	-1.70%	-1.77%
本期基金份额净值增长率	-2.51%	-2.68%	-1.50%	-1.61%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-493,970.01	-1,788,052.15	-510,537.51	-1,824,298.03
期末可供分配基金份额利润	-0.0410	-0.0438	-0.0150	-0.0161
期末基金资产净值	11,582,340.59	39,096,234.40	33,492,039.73	111,271,483.36
期末基金份额净值	0.9603	0.9575	0.9850	0.9839
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-3.97%	-4.25%	-1.50%	-1.61%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

弘毅远方久盈混合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		
过去三个月	-2.15%	0.27%	-0.37%	0.16%	-1.78%	0.11%
过去六个月	-1.42%	0.30%	-0.58%	0.17%	-0.84%	0.13%
过去一年	-2.51%	0.31%	1.50%	0.17%	-4.01%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-3.97%	0.36%	1.39%	0.19%	-5.36%	0.17%

弘毅远方久盈混合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
过去三个月	-2.20%	0.27%	-0.37%	0.16%	-1.83%	0.11%
过去六个月	-1.51%	0.30%	-0.58%	0.17%	-0.93%	0.13%
过去一年	-2.68%	0.31%	1.50%	0.17%	-4.18%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-4.25%	0.36%	1.39%	0.19%	-5.64%	0.17%

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

弘毅远方久盈混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年06月07日-2023年12月31日)

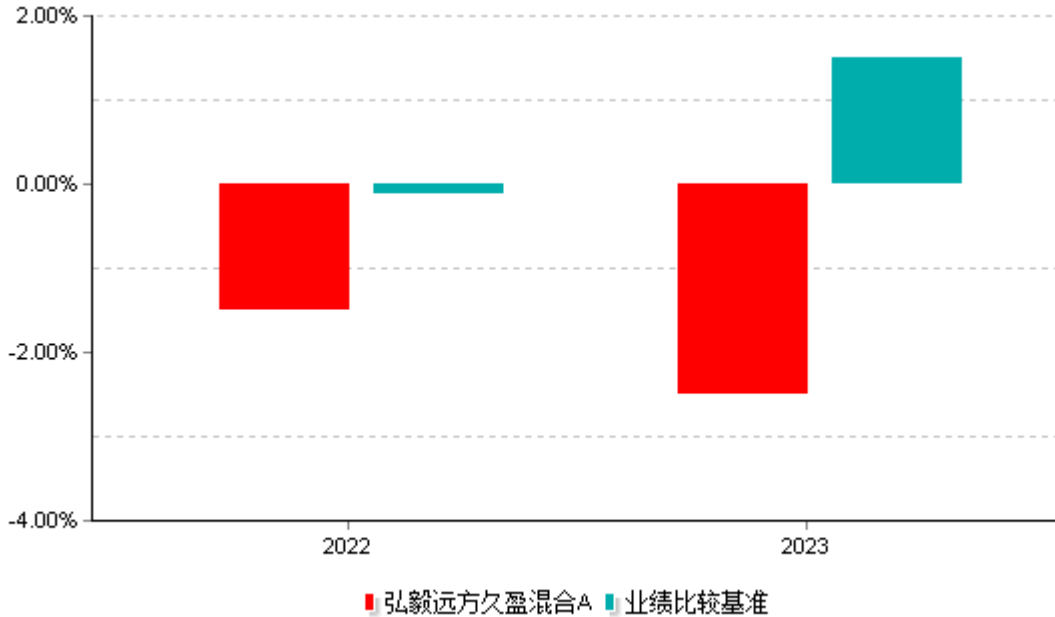


弘毅远方久盈混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年06月07日-2023年12月31日)

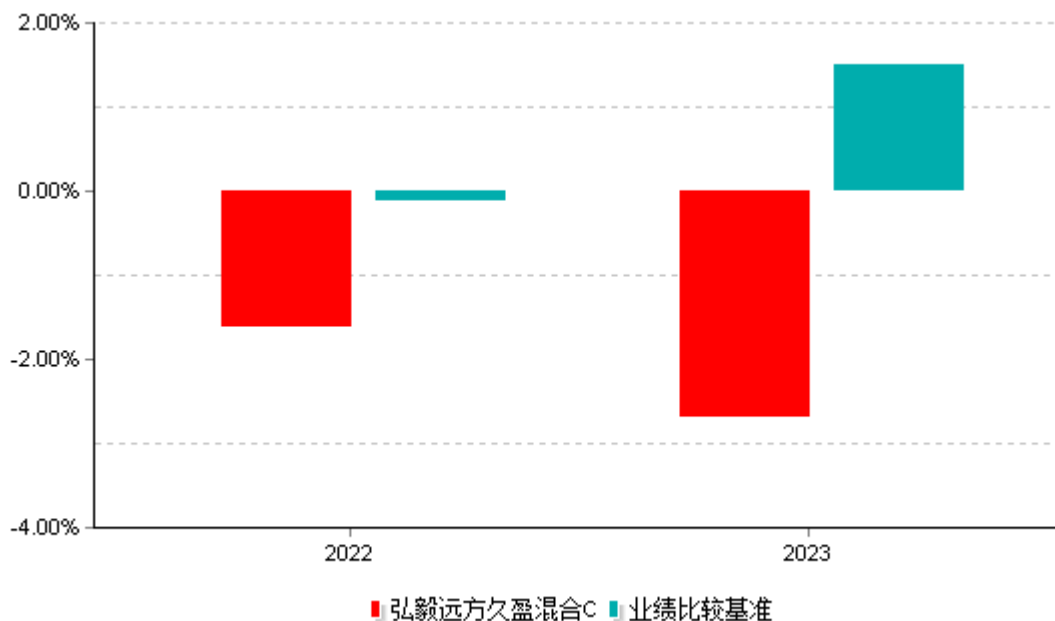


注：本基金基金合同生效日为2022年06月07日。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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



注：图示日期为2022年6月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：图示日期为2022年6月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

弘毅远方基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2017】2439号批准，由弘毅投资（北京）有限公司发起设立。注册资本3.1亿元人民币（截至2023年12月31日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。

截至2023年12月31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、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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
伍银	本基金基金经理；弘毅远方中短债债券型证券投资基金基金经理；	2023-09-06	-	10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部投资经理。2023年8月加入弘毅远方基金管理有限公司。
马佳	本基金基金经理；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基金经理；金融工程部总经理	2023-06-02	-	13年	华东理工大学数学与应用数学学士。曾任上海海烟物流发展有限公司财务部财务分析员、德勤华永会计师事务所企业风险管理部经理、太平洋资产管理有限责任公司合规与风险管理部董事。2018年7月加入弘毅远方基金管理有限公司，曾任风控合规部负责人。
葛亮	本基金基金经理	2022-06-07	2023-07-12	9年	上海财经大学硕士。曾任上海银行资产管理部研究员、华安基金管理有限公司集中交易室债券交易员和上海农商银行资产管理部投资经理。2020年12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、基金管理人于2023年6月2日发布《弘毅远方基金管理有限公司久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2023年6月2日起，增聘马佳先生担任本基金的基金经理，与葛亮先生共同管理本基金。

4、基金管理人于2023年7月12日发布《弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2023年7月12日起，由马佳先生独立管理本基金，葛亮先生不再担任本基金的基金经理。

5、基金管理人于2023年9月6日发布《弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2023年9月6日起，增聘伍银女士为本基金基金经理，与马佳先生共同管理本基金。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金的基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。制度中包含的主要控制方法如下：

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

(2) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。

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

(4) 公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。不同投资组合同一品种的同向交易指令依照价格优先、时间优先、比例分配原则处理，保证交易在各投资组合间的公正处理，保证各投资组合间的利益公平。同时，完善非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。

(5) 公司交易部和风控合规部进行日常投资交易行为监控。风控合规部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，并对不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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

2023年中外延续周期错位，与年初多数投资者的预期相反。美国经济衰退、美联储加息结束不断被证伪；中国经济复苏强度低于预期，出行链快速恢复，但微观主体信心恢复较慢，经济总体处于弱复苏状态，并且在经济运行中存在修复节奏波动起伏、宏观数据与微观感受存在差异、需求不足矛盾仍存、物价与资产价格较弱等特征。伴随着经济的弱修复，叠加国际地缘政经冲突加剧，2023年国内各类资产表现分化，整体表现为避险资产表现整体优于风险资产。

从资本市场的表现来看，2023年股票市场先扬后抑，自8月开始外资持续流出，股市增量资金不足，市场转向以中证1000、中证2000为代表的小盘风格。虽然政府出台了一系列旨在支撑经济增长的政策组合拳，包括降准降息、多项减税降费政策、放松房地产调控、解决民营经济融资问题等重磅政策，但由于经济复苏强度持续低于预期、房地产风险释放和地缘政治担忧等各方面因素，股票市场整体表现不佳。

2023年债市整体呈现牛市行情，经济处于修复阶段但复苏基础不牢固、总量货币政策宽松、金融机构风险偏好下降是主要影响因素，全年债券利率呈现N型震荡下行态势，10年期国债收益率在2.54%-2.94%波动，1年期国债收益率在1.73%-2.40%波动。此外，

“资产荒”贯穿全年，信用债全年表现偏强，信用利差明显压缩。年内利率走势主要分四个阶段，春节前“强预期”推动利率上行筑顶，春节后至8月中旬“弱现实”推动利率创年内低点，8月下旬至10月中旬的稳地产政策落地及政府债发行引发利率反弹回升，10月下旬至年末经济基本面再度转弱叠加银行降存款利率推动利率再度震荡下探并接近年内低点。

报告期内，本基金主要配置资产为股票和债券，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。本基金权益资产主要选择具备较强防御和价值属性的标的，以分散化的投资模式，持仓以大盘风格为主。债券投资方面，主要持有政金债和少量信用债，杠杆水平整体维持中性偏低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方久盈混合A基金份额净值为0.9603元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.51%，同期业绩比较基准收益率为1.50%；截至报告期末弘毅远方久盈混合C基金份额净值为0.9575元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.68%，同期业绩比较基准收益率为1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，2023年末中央政治局会议和中央经济工作会议先后召开，“高质量发展”摆在优先位置，传达出2024年经济增速目标相对积极，预计2024年名义GDP增速有望微升，经济增长结构存在不少亮点，但新旧动能转换的大背景仍未变化。此外，市场预期的经济回暖需要更多条件，一是财政总量还需要进一步扩张，二是推动经济循环回归和内生动能修复，需要实质性改善实体部门的资产负债表。经济修复节奏方面，预计2024年经济增速上半年高、下半年低，二季度经济同比增速因基数效应可能达到全年高点；在内生循环滞后修复的情况下，经济波浪式运行的基因依旧存在，数据波动、预期波动和市场波动可能继续维持。宏观政策方面，2024年财政政策仍将积极发力，货币政策辅助财政政策提质增效，其中财政政策的重心仍在于中央加杠杆、货币政策的要点则是如何有效地降社会融资成本及防止资金空转以协调财政。流动性方面，中央金融工作会议提出“融资成本持续下降”，预计2024年贷款利率将继续走低，对应存款利率等都有下行空间，而在稳增长要求下，货币政策需要提供合理充裕的流动性环境，预计资金面将维持在中性水平，市场利率围绕政策利率波动。资本市场方面，2024年股市持续走低，截至2月第1周主动权益类基金年初跌幅已超2023年全年，伴随股市持续下跌和债市持续上涨，沪深300股息率已超过10年国债收益率60BP左右，处于非常罕见的极值位置。2月初以来市场连续上涨，对股债收益比已经有所修复，我们认为市场和经济的反转不太可能一蹴而就，但2024年对股市的表现不应太悲观。

权益投资方面，投资标的方面仍然以分散化的投资模式，聚焦于具备投资价值的股票，考虑到现阶段股债收益比处于历史比较极值的位置，将会维持现有权益资产的仓位权重，未来将等待时机适当调整权益与固收的仓位占比。

基于新旧动能转换的大背景仍未变化，在预期实体融资成本持续降低的背景下，我们预计债券收益率中枢逐步下行的趋势或将在2024年继续，10年国债收益率可能在2.40%-2.60%之间波动，利率走势可能延续“低趋势、窄波动”特征。同时，化债与资本新规的影响或进一步体现，短久期、高票息资产更加稀缺，债券市场结构性资产荒可能继续演绎，机构投资者波段交易与票息挖掘或更加极致。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本年度主要的监察稽核工作如下：

（一）紧密跟踪法律法规和监管要求，持续推动及规范公司的制度体系建设

本年度内公司重点对制度规范体系进行查漏补缺，结合公司业务发展规划，牵头组织拟定制度体系建设规划。2023年修订或更新了薪酬管理、基金经理考核、新股申购业务管理、声誉风险管理、销售机构管理、信息技术、资产支持证券业务管理等多项内部制度，确保公司制度体系可有效支持业务发展。

（二）持续推进定期或不定期稽核及审计

本年度内，公司完成各季度员工及关联人投资申报稽核、通信管理稽核等定期或不定期稽核，并开展投研交专项审计、销售专项审计、投资者适当性管理自查等专项审计工作。针对审计发现问题进行沟通，制定整改方案，并持续跟踪整改落实情况。

（三）持续完善基金产品的风险管控措施

本年度内，公司对网下打新业务、固定收益业务等开展了系统性合规及风险评估，旨在完善相关业务流程，不断优化风险管控措施，确保各项业务合法、合规开展。

公司持续利用信息技术手段提高风险控制和监测的水平和能力，秉承全员风险管理的理念，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理及投资组合的合规监督，督促投研交易业务合规开展，努力确保各项风险管理制度落实到位。进一步完善各类投资业务在事前、事中和事后的风险管控机制，提升风险管理水平，有效防范合规风险和操作风险。

（四）有序组织监管报备和信息披露工作

本年度内，公司梳理了监管报备和信息披露的各项要求，根据公司业务实际情况履行基金管理人职责，确保监管报备及信息披露工作真实、准确、完整，保障了基金份额持有人的知情权，未发生违规行为。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金管理人估值委员会成员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续20个工作日以上资产净值低于5000万的情形，出现该情形的时间范围是2023年8月22日至2023年10月16日、2023年11月16日至2023年12月22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久盈混合型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，弘毅远方久盈混合型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久盈混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，

在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，弘毅远方久盈混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对弘毅远方基金管理有限公司编制和披露的弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第26362号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	弘毅远方久盈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了弘毅远方久盈混合型证券投资基金(以下简称"弘毅远方久盈混合")的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表、2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了弘毅远方久盈混合2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表

	<p>审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于弘毅远方久盈混合，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>弘毅远方久盈混合的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估弘毅远方久盈混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算弘毅远方久盈混合、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督弘毅远方久盈混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以</p>

	<p>应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对弘毅远方久盈混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致弘毅远方久盈混合不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	周祎 刘檬轅
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2024-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：弘毅远方久盈混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	7,250,367.62	28,992,260.22
结算备付金		114,620.19	113,940.92
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	42,263,701.77	115,837,387.24
其中：股票投资		17,865,003.00	54,518,339.68
基金投资		-	-
债券投资		24,398,698.77	61,319,047.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,199,946.28	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		516.81	72,154.96
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		50,829,152.67	145,015,743.34
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,513.96	74,245.76
应付管理人报酬		25,126.97	74,558.48
应付托管费		4,187.82	12,426.42
应付销售服务费		6,588.93	19,166.57
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	7.4.7.5	110,160.00	71,823.02
负债合计		150,577.68	252,220.25
净资产：			
实收基金	7.4.7.6	52,892,978.46	147,098,358.63
未分配利润	7.4.7.7	-2,214,403.47	-2,334,835.54
净资产合计		50,678,574.99	144,763,523.09
负债和净资产总计		50,829,152.67	145,015,743.34

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额52,892,978.46份，其中弘毅远方久盈混合型证券投资基金A类基金份额的基金份额净值0.9603元，基金份额总额12,060,584.52份，基金资产净值11,582,340.59元；弘毅远方久盈混合型证券投资基金C类基金份额的基金份额净值0.9575元，基金份额总额40,832,393.94份，基金资产净值39,096,234.40元。

7.2 利润表

会计主体：弘毅远方久盈混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日 (基金合同生效日) 至2022年12月31日
一、营业总收入		767,582.58	-1,925,937.95

1.利息收入		212,912.36	231,247.97
其中：存款利息收入	7.4.7.8	18,727.86	147,746.23
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		194,184.50	83,501.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,454,558.32	2,178,564.88
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-4,194,937.65	-1,388,666.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	888,117.06	2,055,499.65
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.11	-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	852,262.27	1,511,731.84
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	3,003,441.91	-4,348,575.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	5,786.63	12,824.86
减：二、营业总支出		908,271.91	1,065,467.69
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	508,689.23	579,409.67
2.托管费	7.4.10.2.2	84,781.55	96,568.31
3.销售服务费	7.4.10.2.3	145,370.75	152,984.01
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		26,626.78	98,088.28
其中：卖出回购金融资产支		26,626.78	98,088.28

出			
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,203.60	17.42
8.其他费用	7.4.7.16	141,600.00	138,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-140,689.33	-2,991,405.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-140,689.33	-2,991,405.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-140,689.33	-2,991,405.64

7.3 净资产变动表

会计主体：弘毅远方久盈混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	147,098,358.63	-2,334,835.54	144,763,523.09
二、本期期初净资产	147,098,358.63	-2,334,835.54	144,763,523.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-94,205,380.17	120,432.07	-94,084,948.10
（一）、综合收益总额	-	-140,689.33	-140,689.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资	-94,205,380.17	261,121.40	-93,944,258.77

产减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	18,369,341.08	-347,188.69	18,022,152.39
2.基金赎回款	-112,574,721.25	608,310.09	-111,966,411.16
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	52,892,978.46	-2,214,403.47	50,678,574.99
项目	上年度可比期间		
	2022年06月07日(基金合同生效日)至2022年12月31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	200,936,174.65	-	200,936,174.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-53,837,816.02	-2,334,835.54	-56,172,651.56
(一)、综合收益总额	-	-2,991,405.64	-2,991,405.64
(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)	-53,837,816.02	656,570.10	-53,181,245.92
其中: 1.基金申购款	13,945,104.81	-476,013.93	13,469,090.88
2.基金赎回	-67,782,920.83	1,132,584.03	-66,650,336.80

款			
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	147,098,358.63	-2,334,835.54	144,763,523.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

黄薇薇

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

弘毅远方久盈混合型证券投资基金(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[2021]2947号《关于准予弘毅远方久盈混合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《弘毅远方久盈混合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200,926,568.87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(2022)第0414号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金合同》于2022年6月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,936,174.65份基金份额,其中认购资金利息折合9,605.78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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)。

根据《弘毅远方久盈混合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、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《弘毅远方久盈混合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，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、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、股指期货、股票期权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)。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为0%-40%；投资于同业存单比例不超过基金资产的20%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，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等。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人弘毅远方基金管理有限公司于2024年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2022年6月7日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

(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

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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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，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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净

资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	606,909.15	28,034,741.74

等于：本金	606,774.78	28,028,563.31
加：应计利息	134.37	6,178.43
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	6,643,458.47	957,518.48
等于：本金	6,643,291.59	957,452.28
加：应计利息	166.88	66.20
减：坏账准备	-	-
合计	7,250,367.62	28,992,260.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	19,189,772.45	-	17,865,003.00	-1,324,769.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	24,067,764.30	351,298.77	24,398,698.77	-20,364.30
	合计	24,067,764.30	351,298.77	24,398,698.77	-20,364.30
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,257,536.75	351,298.77	42,263,701.77	-1,345,133.75
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,650,880.34	-	54,518,339.68	-4,132,540.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	60,462,035.00	1,073,047.56	61,319,047.56
	合计	60,462,035.00	1,073,047.56	61,319,047.56
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	119,112,915.34	1,073,047.56	115,837,387.24	-4,348,575.66

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,199,946.28	-
银行间市场	-	-
合计	1,199,946.28	-
项目	上年度末 2022年12月31日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	160.00	11,823.02
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	160.00	11,823.02
应付利息	-	-
预提费用-审计费	60,000.00	60,000.00
预提费用-信息披露费	50,000.00	-
合计	110,160.00	71,823.02

7.4.7.6 实收基金

7.4.7.6.1 弘毅远方久盈混合A

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方久盈混合A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,002,577.24	34,002,577.24
本期申购	9,092,899.99	9,092,899.99
本期赎回（以“-”号填列）	-31,034,892.71	-31,034,892.71

本期末	12,060,584.52	12,060,584.52
-----	---------------	---------------

7.4.7.6.2 弘毅远方久盈混合C

金额单位：人民币元

项目 (弘毅远方久盈混合C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,095,781.39	113,095,781.39
本期申购	9,276,441.09	9,276,441.09
本期赎回（以“-”号填列）	-81,539,828.54	-81,539,828.54
本期末	40,832,393.94	40,832,393.94

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；

7.4.7.7 未分配利润

7.4.7.7.1 弘毅远方久盈混合A

单位：人民币元

项目 (弘毅远方久盈混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	244,983.07	-755,520.58	-510,537.51
本期期初	244,983.07	-755,520.58	-510,537.51
本期利润	-101,436.49	208,381.77	106,945.28
本期基金份额交易产生的变动数	-637,516.59	562,864.89	-74,651.70
其中：基金申购款	-393,143.27	146,821.59	-246,321.68
基金赎回款	-244,373.32	416,043.30	171,669.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-493,970.01	15,726.08	-478,243.93

7.4.7.7.2 弘毅远方久盈混合C

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
----	-------	-------	---------

(弘毅远方久盈混合C)			
上年度末	688,687.82	-2,512,985.85	-1,824,298.03
本期期初	688,687.82	-2,512,985.85	-1,824,298.03
本期利润	-3,042,694.75	2,795,060.14	-247,634.61
本期基金份额交易产生的变动数	565,954.78	-230,181.68	335,773.10
其中：基金申购款	2,871.79	-103,738.80	-100,867.01
基金赎回款	563,082.99	-126,442.88	436,640.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,788,052.15	51,892.61	-1,736,159.54

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	15,307.24	27,392.21
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	2,676.61	6,413.10
结算备付金利息收入	679.27	113,940.92
其他	64.74	-
合计	18,727.86	147,746.23

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	72,428,406.22	32,820,387.20
减：卖出股票成本总额	76,460,396.37	34,036,699.03
减：交易费用	162,947.50	172,354.78
买卖股票差价收入	-4,194,937.65	-1,388,666.61

7.4.7.10 债券投资收益**7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,340,438.32	1,284,476.93
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-452,321.26	771,022.72
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	888,117.06	2,055,499.65

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至202 3年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	178,127,341.96	483,654,667.73
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	176,004,378.02	478,710,668.68
减：应计利息总额	2,570,410.48	4,157,022.49
减：交易费用	4,874.72	15,953.84
买卖债券差价收入	-452,321.26	771,022.72

7.4.7.11 贵金属投资收益

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	852,262.27	1,511,731.84
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	852,262.27	1,511,731.84

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	3,003,441.91	-4,348,575.66
——股票投资	2,807,771.21	-4,132,540.66
——债券投资	195,670.70	-216,035.00
——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	3,003,441.91	-4,348,575.66

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	5,786.63	12,824.86
合计	5,786.63	12,824.86

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。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	50,000.00	75,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	30,000.00	3,000.00
账户开户费	800.00	400.00
上清所查询费	800.00	-
合计	141,600.00	138,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
弘毅远方基金管理有限公司（“弘毅远方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储”）	基金托管人、基金销售机构
弘毅投资(北京)有限公司(“弘毅投资”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无

7.4.10.1.4 债券回购交易

无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01 日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合 同生效日）至2022年12月3 1日
当期发生的基金应支付的管理费	508,689.23	579,409.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,303.79	18,000.20

应支付基金管理人的净管理费	496,385.44	561,409.47
---------------	------------	------------

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0.60%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×0.60% /当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年06月07日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	84,781.55	96,568.31

注：支付基金托管人中国邮储的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10% /当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C	合计
弘毅远方基金	0.00	138,008.89	138,008.89
合计	0.00	138,008.89	138,008.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年06月07日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C	合计
弘毅远方基金	0.00	139,447.07	139,447.07
中国邮储	0.00	2,841.97	2,841.97
合计	0.00	142,289.04	142,289.04

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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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.本基金A类份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

弘毅远方久盈混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年06月07日（基金 合同生效日）至2022年 12月31日
基金合同生效日（2022年06月07日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,077,570.41	-
报告期间申购/买入总份额	8,637,588.26	3,077,570.41
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,715,158.67	3,077,570.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	97.14%	9.05%

弘毅远方久盈混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月0	上年度可比期间 2022年06月07日（基金
----	-----------------	---------------------------

	1日至2023年1 2月31日	合同生效日)至2022年 12月31日
基金合同生效日(2022年06月07日)持有的基金份额	-	7,000,340.27
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	7,000,340.27
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注: 1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年06月07日(基金合同生效日)至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮储	606,909.15	15,307.24	28,034,741.74	27,392.21

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国邮储保管, 按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、股指期货、股票期权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。本基金在综合分析多方面因素的基础上，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间进行配置，同时采取股票投资和债券投资策略，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。

本基金的基金管理人建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的多层次立体风险管理体系。董事会及风险管理委员会、经营管理层及风险控制委员会、督察长、风控合规部以及各个业务部门、各岗位在各自职责范围内依法履行职责，形成高效、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人中国邮储的托管账户，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2023年12月31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资产净值的比例为8.21%(2022年12月31日：6.81%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	9,856,653.04
合计	-	9,856,653.04

7.4.13.2.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	4,160,586.74	-
AAA以下	-	-
未评级	20,238,112.03	51,462,394.52
合计	24,398,698.77	51,462,394.52

注：未评级部分为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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上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2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量(2022年12月31日：同)。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，当出现巨额赎回情形时，经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益。本基金的投资市场主要为证券交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金

融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券等），在正常情况下均具有良好的流动性。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。单一投资者及其一致行动人主动持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。综合上述各项流动性指标的监控结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有有一定比例的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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2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	7,250,367.62	-	-	-	7,250,367.62
结算备付金	114,620.19	-	-	-	114,620.19
交易性金融资产	24,398,698.77	-	-	17,865,003.00	42,263,701.77
买入返售金融资产	1,199,946.28	-	-	-	1,199,946.28

应收申购款	-	-	-	516.81	516.81
资产总计	32,963,632.86	-	-	17,865,519.81	50,829,152.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,513.96	4,513.96
应付管理人报酬	-	-	-	25,126.97	25,126.97
应付托管费	-	-	-	4,187.82	4,187.82
应付销售服务费	-	-	-	6,588.93	6,588.93
其他负债	-	-	-	110,160.00	110,160.00
负债总计	-	-	-	150,577.68	150,577.68
利率敏感度缺口	32,963,632.86	-	-	17,714,942.13	50,678,574.99
上年度末 2022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	28,992,260.22	-	-	-	28,992,260.22
结算备付金	113,940.92	-	-	-	113,940.92
交易性金融资产	19,952,737.97	41,366,309.59	-	54,518,339.68	115,837,387.24
应收申购款	-	-	-	72,154.96	72,154.96

资产总计	49,058,939.11	41,366,309.59	-	54,590,494.64	145,015,743.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	74,245.76	74,245.76
应付管理人报酬	-	-	-	74,558.48	74,558.48
应付托管费	-	-	-	12,426.42	12,426.42
应付销售服务费	-	-	-	19,166.57	19,166.57
其他负债	-	-	-	71,823.02	71,823.02
负债总计	-	-	-	252,220.25	252,220.25
利率敏感度缺口	49,058,939.11	41,366,309.59	-	54,338,274.39	144,763,523.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	26,584.54	205,252.18
	市场利率上升25个基点	-26,518.35	-203,803.43

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过全面深入的基本面分析，自下而上从全市场中精选出基本面扎实、长期发展趋势良好、盈利和估值匹配的公司进行配置，用适当的价格买入并通过长期的持有来获取公司价值创造和增长的收益。本基金的基金管理人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，紧密追踪股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产投资比例为基金资产的0%-40%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，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等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	17,865,003.00	35.25	54,518,339.68	37.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	24,398,698.77	48.14	61,319,047.56	42.36

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	42,263,701.77	83.40	115,837,387.24	80.02

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	1,568,307.60	-
	业绩比较基准下降5%	-1,568,307.60	-

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

第一层次	17,865,003.00	54,261,061.39
第二层次	24,398,698.77	61,319,047.56
第三层次	-	257,278.29
合计	42,263,701.77	115,837,387.24

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	257,278.29	257,278.29
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	331,894.55	331,894.55
当期利得或损失总额	-	74,616.26	74,616.26
其中：计入损益的利得或损失	-	74,616.26	74,616.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层	-	-	-

项目	上年度可比期间 2022年06月07日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	250,187.02	250,187.02
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	7,091.27	7,091.27
其中：计入损益的利得或损失	-	7,091.27	7,091.27
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	257,278.29	257,278.29
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	7,091.27	7,091.27

注：1、于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2、于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	上年度末公	采用的估值技术	不可观察输入值
----	-------	---------	---------

	允价值		名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	257,278.29	平均价格亚式期权模型	预期波动率	34.23%-72.46%	负相关

7.4.14.3 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（上年度末：同）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,865,003.00	35.15
	其中：股票	17,865,003.00	35.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,398,698.77	48.00
	其中：债券	24,398,698.77	48.00
	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	1,199,946.28	2.36
	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	7,364,987.81	14.49

8	其他各项资产	516.81	0.00
9	合计	50,829,152.67	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	1,604,782.00	3.17
C	制造业	8,242,534.00	16.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	811,545.00	1.60
E	建筑业	560,712.00	1.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	170,524.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	875,353.00	1.73
J	金融业	4,760,858.00	9.39
K	房地产业	198,000.00	0.39
L	租赁和商务服务业	225,963.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	414,732.00	0.82
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	17,865,003.00	35.25

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	1,800	3,106,800.00	6.13
2	601318	中国平安	30,000	1,209,000.00	2.39
3	600036	招商银行	34,500	959,790.00	1.89
4	601166	兴业银行	40,500	656,505.00	1.30
5	600900	长江电力	27,300	637,182.00	1.26
6	601899	紫金矿业	45,900	571,914.00	1.13
7	600276	恒瑞医药	12,400	560,852.00	1.11
8	600030	中信证券	27,200	554,064.00	1.09
9	600887	伊利股份	17,700	473,475.00	0.93
10	601398	工商银行	97,700	467,006.00	0.92
11	603259	药明康德	5,700	414,732.00	0.82
12	600309	万华化学	5,200	399,464.00	0.79
13	601012	隆基绿能	16,900	387,010.00	0.76
14	601288	农业银行	89,000	323,960.00	0.64
15	600809	山西汾酒	1,400	323,022.00	0.64
16	600028	中国石化	53,000	295,740.00	0.58
17	688981	中芯国际	5,500	291,610.00	0.58
18	601088	中国神华	9,200	288,420.00	0.57
19	601668	中国建筑	58,400	280,904.00	0.55
20	600406	国电南瑞	11,200	249,984.00	0.49
21	601728	中国电信	43,300	234,253.00	0.46
22	601988	中国银行	58,700	234,213.00	0.46
23	600050	中国联通	53,200	233,016.00	0.46
24	600031	三一重工	16,600	228,582.00	0.45
25	601888	中国中免	2,700	225,963.00	0.45
26	601601	中国太保	9,500	225,910.00	0.45
27	601225	陕西煤业	10,800	225,612.00	0.45

28	601857	中国石油	31,600	223,096.00	0.44
29	600690	海尔智家	10,500	220,500.00	0.44
30	603501	韦尔股份	2,000	213,420.00	0.42
31	600048	保利发展	20,000	198,000.00	0.39
32	600089	特变电工	14,070	194,166.00	0.38
33	600436	片仔癀	800	193,592.00	0.38
34	600438	通威股份	7,500	187,725.00	0.37
35	688041	海光信息	2,600	184,548.00	0.36
36	600150	中国船舶	6,200	182,528.00	0.36
37	600104	上汽集团	13,000	175,890.00	0.35
38	603986	兆易创新	1,900	175,541.00	0.35
39	603288	海天味业	4,600	174,570.00	0.34
40	600905	三峡能源	39,900	174,363.00	0.34
41	601919	中远海控	17,800	170,524.00	0.34
42	601390	中国中铁	28,600	162,448.00	0.32
43	688111	金山办公	500	158,100.00	0.31
44	600893	航发动力	3,700	138,306.00	0.27
45	600111	北方稀土	7,100	137,314.00	0.27
46	601628	中国人寿	4,600	130,410.00	0.26
47	603799	华友钴业	3,800	125,134.00	0.25
48	601669	中国电建	24,000	117,360.00	0.23
49	601633	长城汽车	3,400	85,748.00	0.17
50	688599	天合光能	2,900	82,737.00	0.16

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,292,363.00	3.66

2	601318	中国平安	5,202,340.00	3.59
3	600036	招商银行	1,963,319.00	1.36
4	601166	兴业银行	1,052,848.00	0.73
5	601899	紫金矿业	989,384.00	0.68
6	600030	中信证券	963,134.00	0.67
7	600900	长江电力	933,302.00	0.64
8	600276	恒瑞医药	867,845.00	0.60
9	601012	隆基绿能	785,612.00	0.54
10	600309	万华化学	761,608.00	0.53
11	600887	伊利股份	740,192.00	0.51
12	601398	工商银行	737,937.00	0.51
13	603259	药明康德	729,303.00	0.50
14	600406	国电南瑞	712,505.80	0.49
15	600028	中国石化	667,732.00	0.46
16	601857	中国石油	649,621.00	0.45
17	600809	山西汾酒	573,669.00	0.40
18	600050	中国联通	569,385.00	0.39
19	601728	中国电信	553,835.00	0.38
20	603501	韦尔股份	552,138.00	0.38

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,419,035.00	7.89
2	601318	中国平安	8,099,529.00	5.60
3	600036	招商银行	4,339,484.00	3.00
4	601166	兴业银行	2,409,377.00	1.66

5	600900	长江电力	2,331,407.00	1.61
6	600030	中信证券	2,154,979.05	1.49
7	601012	隆基绿能	2,003,578.60	1.38
8	601899	紫金矿业	1,928,901.00	1.33
9	600276	恒瑞医药	1,920,653.00	1.33
10	600887	伊利股份	1,758,288.00	1.21
11	600309	万华化学	1,728,540.00	1.19
12	603259	药明康德	1,623,528.00	1.12
13	601398	工商银行	1,597,383.00	1.10
14	601888	中国中免	1,389,876.00	0.96
15	600809	山西汾酒	1,233,379.00	0.85
16	601668	中国建筑	1,232,804.00	0.85
17	600406	国电南瑞	1,195,755.25	0.83
18	601288	农业银行	1,077,911.00	0.74
19	600048	保利发展	1,027,484.00	0.71
20	600031	三一重工	981,833.00	0.68

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	36,999,288.48
卖出股票收入（成交）总额	72,428,406.22

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	24,398,698.77	48.14

	其中：政策性金融债	20,238,112.03	39.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,398,698.77	48.14

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	220312	22进出12	100,000	10,152,420.77	20.03
2	220322	22进出22	100,000	10,085,691.26	19.90
3	1928002	19民生银行二级01	40,000	4,160,586.74	8.21

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	516.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	516.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
弘毅远方久盈混合A	99	121,824.09	11,715,158.67	97.14%	345,425.85	2.86%
弘毅远方久盈混合C	1,033	39,527.97	40,001,069.43	97.96%	831,324.51	2.04%
合计	1,132	46,725.25	51,716,228.10	97.78%	1,176,750.36	2.22%

9.2 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	弘毅远方久盈混合A	996.75	0.01%
	弘毅远方久盈混合C	222.86	0.00%
	合计	1,219.61	0.00%

9.3 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	弘毅远方久盈混合A	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	弘毅远方久盈混合C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	弘毅远方久盈混合A	-
	弘毅远方久盈混合C	-
	合计	-

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方久盈混合A	弘毅远方久盈混合C
基金合同生效日(2022年06月07日)基金份额总额	35,416,185.79	165,519,988.86
本报告期期初基金份额总额	34,002,577.24	113,095,781.39
本报告期基金总申购份额	9,092,899.99	9,276,441.09
减：本报告期基金总赎回份额	31,034,892.71	81,539,828.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,060,584.52	40,832,393.94

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所6万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	38,086,262.24	34.88%	37,262.82	38.78%	-
民生证券	2	8,253,776.60	7.56%	6,677.93	6.95%	-
万联证券	2	62,863,220.37	57.56%	52,136.22	54.27%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	-	-	730,326,000.00	87.87%	-	-	-	-
民生证券	-	-	4,160,000.00	0.50%	-	-	-	-
万联证券	37,568.00	100.00%	96,640,000.00	11.63%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2022年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司网站	2023-01-01
2	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2022年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-01-18
3	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2022年第四季度报告提示性公告	证券时报	2023-01-18
4	弘毅远方久盈混合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	2023-01-20
5	弘毅远方久盈混合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	2023-01-20
6	弘毅远方久盈混合型证券投资基金更新的招募说明书（2023年第1号）	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-01-20
7	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-03-28
8	弘毅远方久盈混合型证券投资	证券时报	2023-03-28

	资基金2022年年度报告提示性公告		
9	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-04-21
10	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第一季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-21
11	弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2023-06-02
12	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(A类份额)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	2023-06-05
13	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(C类份额)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	2023-06-05
14	弘毅远方久盈混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023年第2号)	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-06-05
15	弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、公司网站	2023-06-14
16	弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2023-07-12
17	弘毅远方久盈混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023年第3号)	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-07-12
18	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(A类份额)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	2023-07-12
19	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(C类份额)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	2023-07-12
20	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-07-20

21	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第二季度报告提示性公告	证券时报	2023-07-20
22	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-08-29
23	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年中期报告提示性公告	证券时报	2023-08-29
24	弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2023-09-06
25	弘毅远方久盈混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023年第4号)	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-09-07
26	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(A类份额)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	2023-09-07
27	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(C类份额)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	2023-09-07
28	弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2023-10-12
29	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-10-25
30	弘毅远方久盈混合型证券投资基金2023年第三季度报告提示性公告	证券时报	2023-10-25
31	弘毅远方久盈混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023年第5号)	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2023-11-13
32	弘毅远方久盈混合型证券投资基金(A类份额)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	2023-11-13

33	弘毅远方久盈混合型证券投资基金（C类份额）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	2023-11-13
34	弘毅远方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2023-11-23

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20231017 - 20231231	3,077,570.41	8,637,588.26	-	11,715,158.67	22.15%
	2	20230101 - 20230806	50,002,916.66	0.00	50,002,916.66	-	0.00%
	3	20230822 - 20231016	10,000,680.55	0.00	-	10,000,680.55	18.91%
	4	20230419 - 20230802	20,000,194.44	0.00	-	20,000,194.44	37.81%
	5	20230807 - 20231231	20,000,194.44	0.00	-	20,000,194.44	37.81%
	6	20230419 - 20230802	20,000,194.44	0.00	10,000,000.00	10,000,194.44	18.91%
	7	20230807 - 20231016	20,000,194.44	0.00	10,000,000.00	10,000,194.44	18.91%
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</p>							

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2023年6月14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6000万元，增资完成后，基金管理人注册资本由人民币2.5亿元增加至人民币3.1亿元。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方久盈混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方久盈混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方久盈混合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久盈混合型证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方久盈混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

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