
弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09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:苏州银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人苏州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2026年7月1日起至2026年9月30日止。
--

§2 基金产品概况

基金简称	弘毅远方北证50成份指数
基金主代码	025690
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年12月10日
报告期末基金份额总额	102,223,916.16份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	北证50成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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。		
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司		
基金托管人	苏州银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	弘毅远方北证50成份指数A	弘毅远方北证50成份指数C	弘毅远方北证50成份指数I
下属分级基金场内简称	弘毅远方北证50成份指数A	弘毅远方北证50成份指数C	弘毅远方北证50成份指数I
下属分级基金的交易代码	025690	025691	026513
报告期末下属分级基金的份额总额	21,868,832.22份	4,023,892.94份	76,331,191.00份

注：本基金自 2026 年 1 月 5 日增加 I 类份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年07月01日 - 2026年09月30日)		
	弘毅远方北证50成份指数A	弘毅远方北证50成份指数C	弘毅远方北证50成份指数I
1.本期已实现收益	-1,697,907.36	-334,887.39	-6,675,211.07
2.本期利润	-2,716,400.34	-663,775.69	-12,965,254.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1313	-0.1502	-0.1465
4.期末基金资产净值	16,208,807.97	2,975,418.98	56,540,159.44
5.期末基金份额净值	0.7412	0.7394	0.7407

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2026年1月5日增加I类份额。

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

弘毅远方北证50成份指数A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.94%	1.88%	-16.08%	1.88%	0.14%	0.00%
过去六个月	-15.61%	1.88%	-15.84%	1.90%	0.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.88%	1.76%	-24.58%	1.82%	-1.30%	-0.06%

弘毅远方北证50成份指数C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.02%	1.88%	-16.08%	1.88%	0.06%	0.00%
过去六个月	-15.74%	1.88%	-15.84%	1.90%	0.10%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-26.06%	1.76%	-24.58%	1.82%	-1.48%	-0.06%

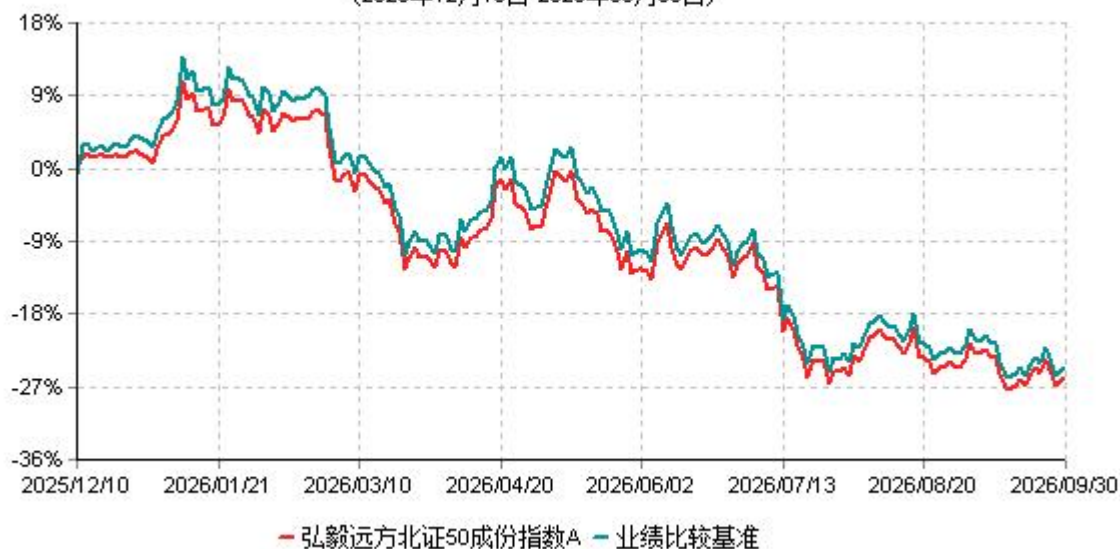
弘毅远方北证50成份指数I净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.97%	1.88%	-16.08%	1.88%	0.11%	0.00%
过去六个月	-15.65%	1.88%	-15.84%	1.90%	0.19%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-27.60%	1.83%	-26.51%	1.87%	-1.09%	-0.04%

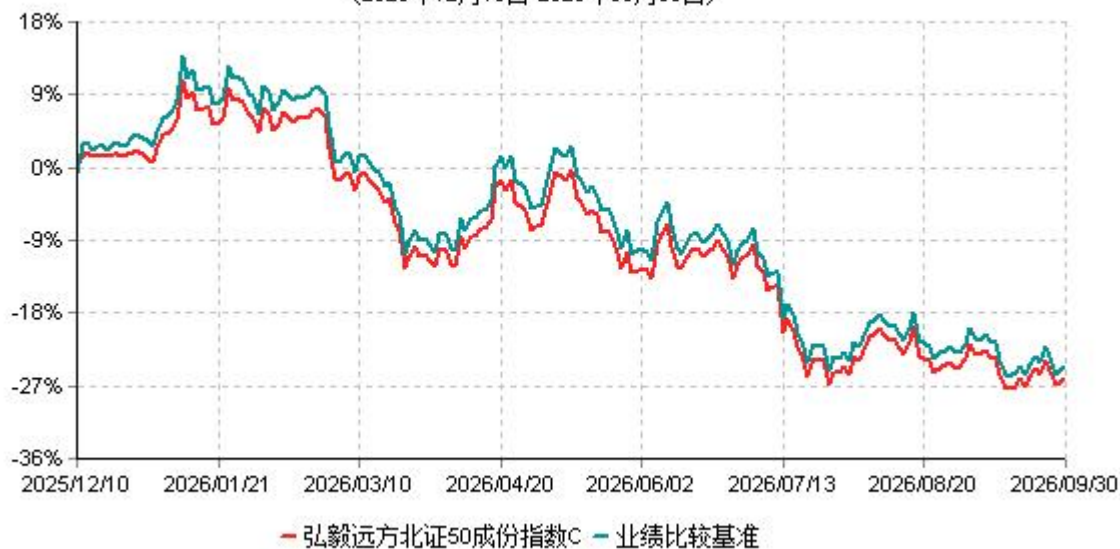
注：本基金自 2026 年 1 月 5 日增加 I 类份额。

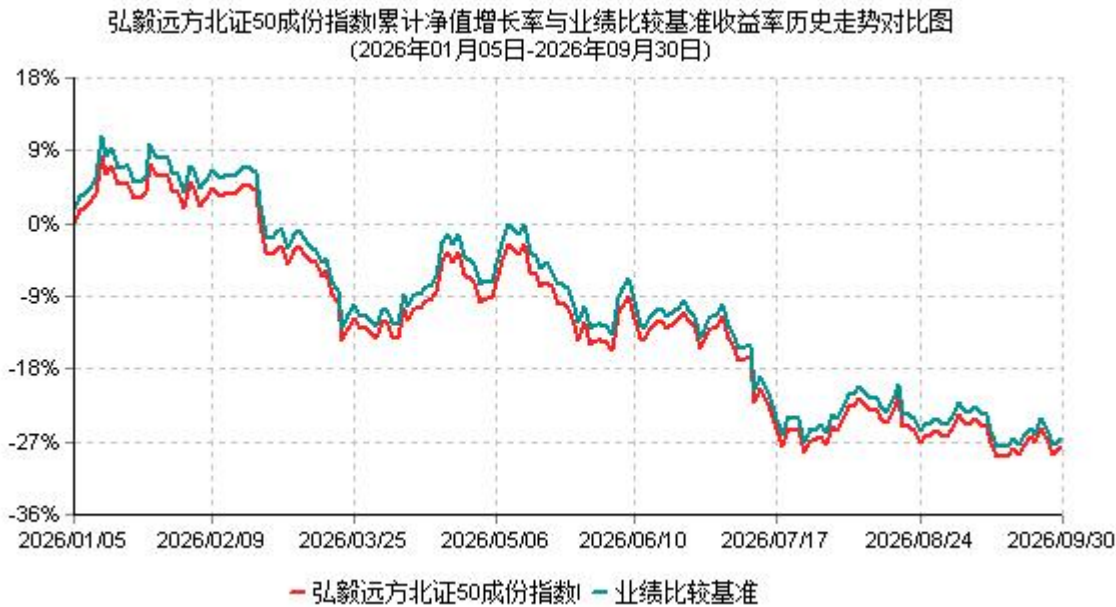
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

弘毅远方北证50成份指数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
(2025年12月10日-2026年09月30日)



弘毅远方北证50成份指数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
(2025年12月10日-2026年09月30日)





注：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 10 日。基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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 2026 年 1 月 5 日增加 I 类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
马佳	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;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;弘毅远方恒瑞混合型证券投资基金基金经理;金融工程部总经理	2025-12-10	-	16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服务部经理、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，曾任弘毅远方甄选混合型发起式证券投资基金基金经理、风控合规部负责人。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下管理的投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日总成交量5%的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪北证 50 成份指数，该指数由北京证券交易所规模大、流动性好的最具市场代表性的 50 只上市公司证券组成，以综合反映市场整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，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动进行相应调整。

指数走势上，北证 50 成份指数报告期内下跌 16.91%，同期科创 50 和创业板 50 分别下跌 30.70%和 30.23%。

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。

展望四季度，权益市场方面四季度我们的看法更为积极。宏观经济方面，出口高企、通胀回暖，消费/投资/信贷一般但 9 月已有回暖迹象。资金方面存在一些变量，市场成交量出现比较大的萎缩，但居民存款搬家、公募基金发行以及长线资金对权益配置的诉求等趋势未发生变化。海外方面，美联储连续加息概率大降、中欧贸易摩擦建立沟通渠道后风险释放，反而中东冲突和油价是地缘政治最大的风险，需要保持跟踪和应对。整体来讲，随着一系列稳增长措施落地，地产周期即将探底，从而带动国内整体的经济复苏，同时以 AI 为代表的科技产业也处于估值回归理性和产业趋势利好的双重影响，我们将以更积极的态度看待四季度的行情。

对于北证 50 成份指数，三季度大幅回撤后已回到 2024 年 10 月初的位置。从结构来看，北证 50 的指数成份股经过调整后，已纳入更多科技赛道、成长性好、专精特新隐形冠军的优质个股。北证 50 基本面自 2025 年开始显著改善，根据 Wind 分析师一致预期 2026-2027 年盈利增速 CAGR 有望超过 40%，从 2026 年 PEG 角度来看，具备了更好的配置价值。随着北交所未来 ETF 工具的推出、制度改革红利的释放，作为投资“专精特新”创新型中小企业的投资工具，建议投资者把握好时间窗口获得理想的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方北证50成份指数A基金份额净值为0.7412元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.94%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%；截至报告期末弘毅远方北证50成份指数C基金份额净值为0.7394元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.02%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%；截至报告期末弘毅远方北证50成份指数I基金份额净值为0.7407元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.97%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	71,943,871.65	93.69
	其中：股票	71,943,871.65	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,609,547.73	4.70
	其中：债券	3,609,547.73	4.70
	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	939,475.85	1.22
8	其他资产	298,669.93	0.39

9	合计	76,791,565.16	100.00
---	----	---------------	--------

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（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	-	-
B	采矿业	1,311,053.20	1.73
C	制造业	63,197,382.08	83.46
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	1,078,932.08	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,356,504.29	8.39
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	71,943,871.65	95.01

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期无积极投资股票。

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	920045	衡东光	13,600	6,976,800.00	9.21
2	920438	戈碧迦	48,977	5,407,060.80	7.14
3	920185	贝特瑞	191,625	3,957,056.25	5.23
4	920982	锦波生物	25,853	3,668,023.64	4.84
5	920599	同力股份	155,689	2,705,874.82	3.57
6	920493	并行科技	20,359	2,173,730.43	2.87
7	920077	吉林碳谷	164,912	2,173,540.16	2.87
8	920808	曙光数创	33,710	1,919,110.30	2.53
9	920809	安达科技	268,900	1,876,922.00	2.48
10	920368	连城数控	79,083	1,793,602.44	2.37

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期无积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,609,547.73	4.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	3,609,547.73	4.77
----	----	--------------	------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019846	26国债14	24,000	2,402,847.78	3.17
2	019782	25国债12	12,000	1,206,699.95	1.59

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	298,669.93

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	298,669.93

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期无积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	弘毅远方北证50成份指数A	弘毅远方北证50成份指数C	弘毅远方北证50成份指数I
报告期期初基金份额总额	10,288,850.07	5,120,882.89	99,995,918.03
报告期期间基金总申购份额	11,892,782.58	4,114,016.70	82,110,095.17
减：报告期期间基金总赎回份额	312,800.43	5,211,006.65	105,774,822.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	21,868,832.22	4,023,892.94	76,331,191.00

注：1、如果本报告期间发生转换转入、红利再投业务，则总申购份额中包含该等业务。

2、如果本报告期间发生转换转出业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、本基金自2026年1月5日起增加I类份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	弘毅远方北证 50成份指数A	弘毅远方北证 50成份指数C	弘毅远方北 证50成份指 数I
报告期期初管理人持有的本基金份 额	10,000,097.2 3	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份 额	10,000,097.2 3	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例（%）	45.73	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或转换本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固 有资金	10,000,097.23	9.78%	10,000,097.23	9.78%	3年
基金管理人高 级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人 员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股 东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,097.23	9.78%	10,000,097.23	9.78%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、关于申请募集注册弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

10.3 查阅方式

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

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