

# 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

## 2020年第4季度报告

### 2020年12月31日

基金管理人:方正证券股份有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2021年1月22日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月15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2020年10月01日起至2020年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

|             |  |          |
|-------------|--|----------|
| 基金简称        | 方正证券金立方  |          |
| 基金主代码       | 970009   |          |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |          |
| 基金合同生效日     | 2020年09月07日  |          |
| 报告期末基金份额总额  | 2,349,368,701.66份  |          |
| 投资目标        | 本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。                |          |
| 投资策略        | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略。 |          |
| 业绩比较基准      | 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%                                   |          |
| 风险收益特征      | 本集合计划为混合型集合计划，其风险收益水平低于股票型基金、集合计划，高于债券型基金、集合计划和货币市场型基金、集合计划。   |          |
| 基金管理人       | 方正证券股份有限公司   |          |
| 基金托管人       | 中信银行股份有限公司   |          |
| 下属分级基金的基金简称 | 方正证券金立方A   | 方正证券金立方C |

|                 |                |                   |
|-----------------|----------------|-------------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 970009         | 970010            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,849,148.88份 | 2,338,519,552.78份 |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### § 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<br>(2020年10月01日 - 2020年12月31日) |                  |
|-----------------|------------------------------------|------------------|
|                 | 方正证券金立方A                           | 方正证券金立方C         |
| 1. 本期已实现收益      | 64,969.70                          | 15,516,765.48    |
| 2. 本期利润         | 1,249,137.52                       | 194,276,860.89   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1111                             | 0.0870           |
| 4. 期末基金资产净值     | 15,469,524.98                      | 2,534,317,961.70 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4259                             | 1.0837           |

注：1、上表所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。

#### 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

方正证券金立方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      | 8.43%  | 0.72%     | 8.20%      | 0.60%         | 0.23% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.09%  | 0.74%     | 5.82%      | 0.63%         | 0.27% | 0.11% |

方正证券金立方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      | 8.59% | 0.72% | 8.20% | 0.60% | 0.39% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.37% | 0.66% | 6.86% | 0.60% | 1.51% | 0.06% |

注：基金合同生效日为 2020 年 09 月 07 日，方正证券金立方 C 自 2020 年 9 月 15 日起开放申购和赎回业务。

### 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

方正证券金立方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



注：1、基金合同生效日为 2020 年 09 月 07 日。截至 2020 年 12 月 31 日，本集合计划合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2020 年 09 月 07 日生效，建仓期 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定，目前本基金还在建仓期内。

方正证券金立方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



注：1、基金合同生效日为2020年09月07日，方正证券金立方C自2020年9月15日起开放申购和赎回业务。截至2020年12月31日，本集合计划合同生效不满一年。

2、本基金合同于2020年09月07日生效，建仓期6个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定，目前本基金还在建仓期内。

## § 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 |        |  |
| 王晨宇 | 本基金的基金经理 | 2020-09-07  | -    | 4年     | 中国人民大学金融学硕士，曾任职于中国人寿养老保险股份有限公司，历任行业研究员、权益投资助理，负责企业年金权益类投资工作。2016年加入方正证券股份有限公司，现任方正证券股份有限公司 |

|     |   |            |   |     |   |
|-----|---|------------|---|-----|---|
|     |   |            |   |     | 司北京证券资产管理分公司证券投资部权益投资经理。  |
| 廖帅  | 本基金的基金经理                                  | 2020-09-07 | - | 3年  | 北京大学光华管理学院经济学硕士，国立政治大学（中国台湾）资讯管理学系、经济学系双学士，曾任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部研究员、泰康资产管理有限责任公司金融工程研究高级经理。2017年加入方正证券股份有限公司，现任方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司证券投资部高级副总裁、权益量化投资经理。  |
| 李道滢 | 本基金的基金经理、方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司证券投资部权益投资总监 | 2020-09-24 | - | 12年 | 硕士，曾任国家开发银行信贷经理、联合证券研究所研究员、大公国际资信评估有限公司信用分析师。2011年3月加入益民基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、投资部基金经理。2013年9月至2017年3月期间担任益民货币市场基金、益民多利债券型证券投资基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月加入中国人保资产管理公司公募基金事业部，2017年12月至2020年6月期间担任人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基 |

|         |          |                |   |        |  |
|---------|----------|----------------|---|--------|--|
|         |          |                |   |        | 金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2020年6月加入方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司，现任证券投资部权益投资总监。              |
| 孔典<br>熠 | 本基金的基金经理 | 2020-<br>10-21 | - | 7<br>年 | 2012年7月加入华夏基金管理有限公司，历任国际投资部，投资研究部研究员（副总裁级）；2018年1月加入民生证券股份有限公司证券投资部，任投资经理；2020年3月加入方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司，任投资经理，权益研究总监。 |

注：1、本基金计划的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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，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。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在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

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有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成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度，在美国大选尘埃落定、国内外疫情反复、新冠疫苗有序推进、经济活力持续修复、企业盈利加速改善、十四五及远景规划落地等因素影响下，A 股市场总体以 N 型走势为主，震荡上行，结构上有所轮动与分化。

四季度，上证综指、上证 50、沪深 300、中证 500、中小板指、创业板指、万得全 A 的涨幅分别为 7.92%、12.63%、13.60%、2.82%、10.07%、15.21%、8.35%。风格方面，消费、周期表现领先，成长、金融居中，稳定类录得负收益。行业层面，有色金属、电力设备、细品饮料、汽车、家电表现出色，传媒、商贸零售、通信、地产、建筑表现落后。概念主题方面，酒类、新能源车产业链、光伏新能源、顺周期、上游资源小金属、机构大额买入等板块表现较好，低价股、大数据、网络游戏、互联网、5G 等主题表现相对落后。

本产品四季度采取审慎略偏向积极的操作策略，在防范阶段性市场冲击的同时，稳健有序推进建仓过程，期末仓位保持中等偏上的水平，在消费、新能源（车）、顺周期、科技、金融等板块采取相对均衡的配置结构，优先配置了业绩确定性较好、竞争优势突出的、景气度较高领域的头部公司。总体上来说，报告期内，组合回撤控制较好，收益较为理想，相对于业绩基准及核心市场指数获得了一定的超额回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券金立方 A 基金份额净值为 1.4259 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.43%，同期业绩比较基准收益率为 8.20%；截至报告期末方正证券金立方 C 基金份额净值为 1.0837 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.59%，同期业绩比较基准收益率为 8.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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)            | 占总资产的比例 (%) |
|----|------|------------------|-------------|
| 1  | 权益投资 | 2,039,289,720.59 | 77.93       |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 2,039,289,720.59 | 77.93  |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 173,726,712.60   | 6.64   |
|   | 其中：债券             | 173,726,712.60   | 6.64   |
|   | 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          | 16,200,016.20    | 0.62   |
|   | 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      | 381,064,315.97   | 14.56  |
| 8 | 其他资产              | 6,405,831.47     | 0.24   |
| 9 | 合计                | 2,616,686,596.83 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)          | 占资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -          |
| B  | 采矿业              | 21,921,240.00    | 0.86       |
| C  | 制造业              | 1,191,273,181.20 | 46.72      |
| 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           | 2,371,808.00     | 0.09       |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 64,238,625.80    | 2.52       |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,484,324.00     | 0.14       |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 185,343,945.62   | 7.27       |
| J  | 金融业              | 350,094,107.00   | 13.73      |
| K  | 房地产业             | 76,450,571.04    | 3.00       |
| L  | 租赁和商务服务业         | 45,580,698.00    | 1.79       |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,975,192.00    | 0.55       |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,198,620.00     | 0.16       |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| 0 | 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     | 80,357,407.93    | 3.15  |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 2,039,289,720.59 | 79.98 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 48,700    | 97,302,600.00 | 3.82       |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 918,000   | 79,847,640.00 | 3.13       |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 2,499,690 | 77,490,390.00 | 3.04       |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 1,303,704 | 73,163,868.48 | 2.87       |
| 5  | 601066 | 中信建投 | 1,334,496 | 56,048,832.00 | 2.20       |
| 6  | 000002 | 万科A  | 1,636,000 | 46,953,200.00 | 1.84       |
| 7  | 300760 | 迈瑞医疗 | 105,900   | 45,113,400.00 | 1.77       |
| 8  | 002624 | 完美世界 | 1,430,000 | 42,185,000.00 | 1.65       |
| 9  | 002739 | 万达电影 | 2,323,197 | 42,003,401.76 | 1.65       |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 452,800   | 41,748,160.00 | 1.64       |

### 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      | 72,866,712.60  | 2.86         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 100,860,000.00 | 3.96         |
|    | 其中：政策性金融债 | 100,860,000.00 | 3.96         |
| 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 | 173,726,712.60 | 6.81 |
|----|----|----------------|------|

### 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  | 180212 | 18国开12 | 1,000,000 | 100,860,000.00 | 3.96         |
| 2  | 019627 | 20国债01 | 728,740   | 72,866,712.60  | 2.86         |

### 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

#### 5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 802,021.97   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,807,860.27 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 2,693,620.59 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | 102,328.64   |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 6,405,831.47 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 方正证券金立方A      | 方正证券金立方C         |
|-------------------------------|---------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 13,097,596.44 | 2,017,358,346.48 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | -             | 321,161,206.30   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 2,248,447.56  | -                |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -             | -                |
| 报告期期末基金份额总额                   | 10,849,148.88 | 2,338,519,552.78 |

### § 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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020/10/21 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划增聘基金经理公告

2020/10/23 方正证券股份有限公司关于方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告

2020/11/05 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划开放定期定额投资业务公告

2020/11/10 方正证券股份有限公司关于方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划增加上海陆金所基金销售有限公司为代销机构的公告

2020/11/17 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书（更新）

2020/11/17 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要（更新）

2020/11/17 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要（更新）

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件
- 2、方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- 4、方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 9.2 存放地点

北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座9层

### 9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

方正证券股份有限公司

2021年1月22日