

方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划

2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:方正证券股份有限公司

基金托管人:华夏银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月16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2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	方正证券金港湾
基金主代码	970018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年01月18日
报告期末基金份额总额	1,538,485,363.33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、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略；5、回购策略；6、股票投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+ 沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。
基金管理人	方正证券股份有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	方正证券金港湾A	方正证券金港湾C
下属分级基金的交易代码	970018	970019
报告期末下属分级基金的份额总额	6,697,376.96份	1,531,787,986.37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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	方正证券金港湾A	方正证券金港湾C
1. 本期已实现收益	65,849.08	7,444,885.76
2. 本期利润	91,331.55	8,961,313.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0110
4. 期末基金资产净值	6,944,814.68	1,550,230,446.41
5. 期末基金份额净值	1.0369	1.0120

注：1、基金合同生效日为2021年01月18日，方正证券金港湾C自2021年2月1日起开放申购和赎回业务。

2、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。

3、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。

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

方正证券金港湾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	1.32%	0.03%	0.77%	0.10%	0.55%	-0.07%

自基金合同生效起至今	0.93%	0.03%	0.00%	0.14%	0.93%	-0.11%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

方正证券金港湾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	1.29%	0.02%	0.77%	0.10%	0.52%	-0.08%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.03%	0.25%	0.13%	0.95%	-0.10%

注：基金合同生效日为 2021 年 01 月 18 日，方正证券金港湾 C 自 2021 年 2 月 1 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

方正证券金港湾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

(2021年01月18日-2021年06月30日)



注：1、基金合同生效日为 2021 年 01 月 18 日。截至 2021 年 06 月 30 日，本基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2021 年 01 月 18 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。

方正证券金港湾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

(2021年02月02日-2021年06月30日)



注：1、基金合同生效日为 2021 年 01 月 18 日，方正证券金港湾 C 自 2021 年 02 月 01 日起开放申购和赎回业务。截至 2021 年 06 月 30 日，本基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2021 年 01 月 18 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		
宫健	本基金的基金经理	2021-01-18	-	9 年	男，经济学硕士，具有证券、基金从业资格，银行间本币市场交易员资格，2012年入职民族证券有限责任公司，曾任资产管理

					业务部固收交易员、固收投资经理。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证券投资部投资经理（投资主办人）。
李理	本基金的基金经理	2021-03-03	-	4 年	男，2012年8月加入中国工商银行总行金融市场部固定收益处任投资经理；2016年10月加入广州证券股份有限公司（现中信证券华南股份有限公司）固定收益事业部任投资经理；2020年1月加入中信证券股份有限公司固定收益部；2020年7月加入方正证券股份有限公司证券投资部，任投资经理。
孔典熠	已离任基金经理	2021-02-05	2021-05-26	7 年	男，加州大学洛杉矶分校金融工程硕士。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；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年加入方正证券股份有限公司，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权益投资经理、权益研究总监。

注：1、本基金的首任基金经理，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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
宫健	公募基金	1	1,557,175,261.09	2021-01-18
	私募资产管理计划	1	184,950,361.37	2017-06-19
	其他组合	3	10,212,833,111.00	2015-06-12
	合计	5	11,954,958,733.46	-
李理	公募基金	1	1,557,175,261.09	2021-03-03
	私募资产管理计划	2	2,054,708,515.18	2020-09-03
	其他组合	1	46,182,297.36	2021-04-16
	合计	4	3,658,066,073.63	-

注：其他组合为尚未按照《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》的要求进行变更的证券公司大集合资产管理产品。

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》、《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》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。

本基金的基金经理存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况，公司针对同一兼任基金经理管理的多个投资组合投资交易行为从严加强管理、监控和分析。本报告期内兼任的基金经理严格按照公司公平交易相关的管理规定进行投资，未见不公平交易，未在不同资管产品财产之间、资管产品财产和其他受托资产或公司自有资产之间进行利益输送的情况。

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

债券方面，二季度债券市场先涨后跌。一、二季度债券市场整体处于震荡格局，10年国债6月末收益率与年初相比仅相差4bp，多空双方的力量较为均衡，债券市场的走势较为胶着。二季度市场对于通胀的担忧依然，加之货币政策依然保持在较为中性的状态，公开市场投放量除6月末5个交易日外日投放均为100亿元，4、5、6月中5、6月MLF均等量续作，4月超额投放500亿元，整体市场对于利空的担忧仍在，但考虑半年时点因素，机构配置需求在二季度逐步释放，债券市场走出结构性行情，体现在短端好于长端，信用债好于利率债。5月下旬后，受到资金面有所收紧，加之部分长期利率债招标结果较弱，市场出现下跌。整体来看，二季度10年国开和5年AAA分别下行8bp和5bp。

股票方面，二季度A股有所上涨，上证综指收涨4.34%，深证成指收涨10.04%，沪深300收涨3.48%，创业板指收涨26.05%。股票市场在二季度走出非常明显的结构性行情，体现在不同行业、不同估值主体的走势分化较大，新能源、光伏等板块走势大幅跑赢其他板块，同时高估值板块表现也好于低估值板块，体现市场对于行业的景气度较为看重。

操作上，在债券品种选择方面，主要选择相对价值较好的3年以内AAA和AA+品种信用债，及利率债进行投资，在企业性质方面，主要选择央企、国企和城投品种进行投资，同时，根据市场走势，适时进行债券交易，增厚组合收益。股票方面，仓位在建仓初期保持较低水平，重点关注新能源、新材料、机械、化工、金融，在中盘股上将会更重点关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券金港湾A基金份额净值为1.0369元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.32%，同期业绩比较基准收益率为0.77%；截至报告期末方正证券金港湾C基金份额净值为1.0120元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.29%，同期业绩比较基准收益率为0.77%。

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)	占基金总资产的比例 (%)

1	权益投资	6,680,034.20	0.37
	其中：股票	6,680,034.20	0.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,583,125,736.10	87.02
	其中：债券	1,583,125,736.10	87.02
	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	121,915,357.87	6.70
	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	30,595,972.25	1.68
8	其他资产	76,955,898.10	4.23
9	合计	1,819,272,998.52	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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,847,510.20	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	200,844.00	0.01
J	金融业	2,553,385.00	0.16
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	78,295.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管	-	-

	理业		
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,680,034.20	0.43

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)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	11,000	596,090.00	0.04
2	000858	五粮液	1,400	417,046.00	0.03
3	601939	建设银行	62,000	412,300.00	0.03
4	600438	通威股份	8,100	350,487.00	0.02
5	601012	隆基股份	3,680	326,931.20	0.02
6	600884	杉杉股份	14,000	326,480.00	0.02
7	300750	宁德时代	600	320,880.00	0.02
8	002142	宁波银行	8,000	311,760.00	0.02
9	601658	邮储银行	60,000	301,200.00	0.02
10	002966	苏州银行	40,900	300,615.00	0.02

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	17,897,724.00	1.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	505,185,335.20	32.44
	其中：政策性金融债	124,737,135.20	8.01
4	企业债券	325,474,000.00	20.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	557,298,400.00	35.79

7	可转债（可交换债）	2,359,276.90	0.15
8	同业存单	174,911,000.00	11.23
9	其他	-	-
10	合计	1,583,125,736.10	101.67

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	1923001	19中国人寿	600,000	61,188,000.00	3.93
2	1923009	19太平财险	600,000	60,816,000.00	3.91
3	112109181	21浦发银行CD181	600,000	58,302,000.00	3.74
4	112109211	21浦发银行CD211	500,000	48,590,000.00	3.12
5	1823009	18中再寿险	400,000	41,060,000.00	2.64

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合现券市场与国债期货市场的流动性、基差水平等情况，通过国债期货进行相应套期保值操作。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
T21	10年期国债期	-35	-34,450,500.00	-67,927.47	-

09	货2109合约			
公允价值变动总额合计（元）				-67,927.47
国债期货投资本期收益（元）				-223,274.29
国债期货投资本期公允价值变动（元）				-67,927.47

注：期货投资本期收益为扣除相关税费后的金额。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金通过对国债期货的投资对投资组合进行套期保值操作，调节组合的整体久期和DV01水平，在报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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	821,527.66
2	应收证券清算款	33,301,684.09
3	应收股利	-
4	应收利息	28,564,313.57
5	应收申购款	14,185,770.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	82,602.56
8	其他	-
9	合计	76,955,898.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127005	长证转债	181,412.00	0.01
2	113011	光大转债	144,350.00	0.01
3	128136	立讯转债	132,130.90	0.01
4	110053	苏银转债	127,333.50	0.01

5	110048	福能转债	126,796.50	0.01
6	110043	无锡转债	106,960.50	0.01
7	110057	现代转债	99,466.40	0.01
8	110073	国投转债	91,519.50	0.01
9	110077	洪城转债	80,479.00	0.01
10	127025	冀东转债	80,205.00	0.01
11	113044	大秦转债	73,051.90	0.00
12	110067	华安转债	64,440.00	0.00
13	113009	广汽转债	53,718.70	0.00
14	110041	蒙电转债	52,605.00	0.00
15	110075	南航转债	49,144.00	0.00
16	113043	财通转债	45,868.10	0.00
17	113037	紫银转债	36,095.50	0.00
18	128034	江银转债	34,686.30	0.00
19	128048	张行转债	32,844.00	0.00
20	113013	国君转债	16,876.50	0.00
21	127012	招路转债	3,210.00	0.00

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

	方正证券金港湾A	方正证券金港湾C
报告期期初基金份额总额	7,510,827.41	181,017,305.63
报告期期间基金总申购份额	-	1,350,770,680.74
减：报告期期间基金总赎回份额	813,450.45	-
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	6,697,376.96	1,531,787,986.37

§ 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

	方正证券金港湾A	方正证券金港湾C
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,200,981.30	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,200,981.30	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	17.93	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§ 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

2021/4/21 方正证券股份有限公司北京办公地址变更的公告

2021/5/26 方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告

2021/5/28 方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）

2021/5/28 方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要（更新）

2021/5/28 方正证券金港湾六个月持有期债券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、中国证监会准予民族金港湾1号集合资产管理计划变更的文件
- 2、《方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照

6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内披露的各项公告

9.2 存放地点

北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18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07月21日