

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

2021年第3季度报告

2021年09月30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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月20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07月01日起至2021年09月30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	2,965,120,239.06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	7,053,994.78份	2,958,066,244.28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07月01日 - 2021年09月30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	-331,409.36	-116,643,708.21
2. 本期利润	-672,099.54	-235,673,138.22
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0930	-0.0700
4. 期末基金资产净值	9,561,319.48	3,061,186,088.50
5. 期末基金份额净值	1.3554	1.0349

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	-6.20%	1.04%	-3.50%	0.72%	-2.70%	0.32%
过去六个月	0.96%	0.96%	-1.09%	0.66%	2.05%	0.30%

过去一年	3.06%	1.05%	5.53%	0.73%	-2.47%	0.32%
自基金合同生效起至今	0.84%	1.03%	3.20%	0.73%	-2.36%	0.30%

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	-6.05%	1.04%	-3.50%	0.72%	-2.55%	0.32%
过去六个月	1.27%	0.96%	-1.09%	0.66%	2.36%	0.30%
过去一年	3.70%	1.05%	5.53%	0.73%	-1.83%	0.32%
自基金合同生效起至今	3.49%	1.03%	4.22%	0.72%	-0.73%	0.31%

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

(2020年09月07日-2021年09月30日)



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

(2020年09月16日-2021年09月30日)



§ 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	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
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	-	13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。
傅岳鹏	本基金的基金经理	2021-09-27	-	7年	2012年6月-2014年2月期间，于民族证券股份有限公司（现方正证券承销保荐有限责任公司）研究部任电子行业研究员。2014年2月-2017年5月期间，于华融证券股份有限公司市场研究部和资产管理二部任研究员。2017年7月-2018年7月期间，于天风证券股份有限公司中小企业服务中心研究支持部任研究员。2018年7月-2020年7月期间，于中化新能源投资有限公司任研究总监。2020年9月加入方正证券股份有限公司证券投资部，现任研究员、投资经理。

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

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》、《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

2021年三季度，经济复苏势头有所减弱，同时以PPI为代表的通胀水平快速高企，经济体现出局部的类滞涨特征，在供需矛盾仍然主导市场行情的基础上，随着跨周期调节政策的发力以及政策关注焦点和政策落实方式的适时适度的微调，市场体现出阶段性的风格再平衡的需求。

三季度，上证综指、上证50、沪深300、中证500、创业板指、万得全A的涨幅分别为-0.64%、-8.62%、-6.85%、4.34%、-6.69%、-1.00%。风格方面，稳定、周期板块表现领先，金融、消费板块表现落后。行业层面，煤炭、有色、钢铁、电力、化工等行业表现出色，保险、餐饮旅游、医药、食品饮料、家电等行业表现落后。概念主题方面，锂矿、磷矿、风电、稀土、氟化工等主题板块表现较好，啤酒、医美、疫苗、半导体封测、造纸等主题表现相对落后。

本产品三季度采取了相对平衡的组合管理策略，在维持适中的组合仓位的基础上，通过组合结构的局部优化及重仓个股的灵活调整等方式方法动态优化组合，较为前瞻左侧地布局了部分业绩增速稳定、估值合理、股价处于相对低位的板块与个股，同时减持了部分股价及估值较高、未来进一步超预期的可能性不大的板块与个股。

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1.3554元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.20%，同期业绩比较基准收益率为-3.50%；截至报告期末方正证券金立方C基金份额净值为1.0349元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.50%。

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	2,295,271,527.97	70.77
	其中：股票	2,295,271,527.97	70.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	164,998,870.40	5.09
	其中：债券	164,998,870.40	5.09
	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	450,000,450.00	13.87
	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	214,989,813.88	6.63
8	其他资产	118,178,059.33	3.64
9	合计	3,243,438,721.58	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	7,984,360.80	0.26
B	采矿业	41,638,856.00	1.36

C	制造业	1,551,847,278.69	50.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,778,464.00	0.55
E	建筑业	17,258,296.56	0.56
F	批发和零售业	4,206,008.22	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	16,526,351.36	0.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,987,795.18	1.37
J	金融业	282,213,456.75	9.19
K	房地产业	56,271,724.76	1.83
L	租赁和商务服务业	113,578,140.00	3.70
M	科学研究和技术服务业	80,462,983.76	2.62
N	水利、环境和公共设施管理业	22,733.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	64,495,078.00	2.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,295,271,527.97	74.75

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	600519	贵州茅台	97,906	179,167,980.00	5.83
2	000858	五粮液	667,000	146,333,130.00	4.77
3	601888	中国中免	436,839	113,578,140.00	3.70
4	000568	泸州老窖	459,673	101,854,343.34	3.32

5	300059	东方财富	2,801,184	96,276,694.08	3.14
6	603259	药明康德	347,120	53,039,936.00	1.73
7	300750	宁德时代	92,700	48,735,171.00	1.59
8	601012	隆基股份	571,460	47,134,020.80	1.53
9	600309	万华化学	438,713	46,832,612.75	1.53
10	002709	天赐材料	305,834	46,523,468.08	1.52

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	164,998,870.40	5.37
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	164,998,870.40	5.37

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	019645	20国债15	1,098,560	109,954,870.40	3.58
2	019649	21国债01	550,000	55,044,000.00	1.79

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	2,247,953.94
2	应收证券清算款	112,462,791.39
3	应收股利	-
4	应收利息	3,295,785.49
5	应收申购款	96,788.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	74,739.68
8	其他	-
9	合计	118,178,059.33

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	7,836,155.59	3,389,289,410.41
报告期期间基金总申购份额	-	11,074,796.95
减：报告期期间基金总赎回份额	782,160.81	442,297,963.08
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	7,053,994.78	2,958,066,244.28

§ 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

2021/7/7 方正证券股份有限公司关于控股股东及实际控制人拟发生变更的提示性公告

2021/9/8 方正证券股份有限公司关于获准变更主要股东的公告

2021/9/27 方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司总经理变更的公告

2021/9/27 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

2021/9/30 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)

2021/9/30 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）

2021/9/30 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10月27日