

# 方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 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:中信银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至06月30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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 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	51
7.7 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	51
7.8 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	51
7.9 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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

8.3 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	53
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
10.2 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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,314,080,993.83份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。	
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	3,962,707.55份	1,310,118,286.28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。

### 2.2 基金产品说明

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。
--	---

### 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		方正证券股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈慧蕾	姜敏
	联系电话	010-56992726	4006800000
	电子邮箱	chenhuilei@foundersc.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95571	95558
传真		010-56992708	010-85230024
注册地址		湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4,5号楼3701-3717	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100020	100020
法定代表人		施华	朱鹤新

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a>
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	方正证券金立方A	方正证券金立方C
本期已实现收益	-159,069.65	-42,099,707.51
本期利润	23,647.42	9,993,828.66
加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0070
本期加权平均净值利润率	0.69%	1.06%
本期基金份额净值增长率	0.64%	0.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-599,215.77	-458,924,108.30
期末可供分配基金份额利润	-0.1512	-0.3503
期末基金资产净值	3,363,491.78	857,956,722.04
期末基金份额净值	0.8488	0.6549
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-36.85%	-34.51%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	3.93%	1.11%	0.88%	0.52%	3.05%	0.59%
过去三个月	2.29%	1.11%	-2.53%	0.49%	4.82%	0.62%
过去六个月	0.64%	0.95%	0.50%	0.51%	0.14%	0.44%
过去一年	-22.40%	1.15%	-7.25%	0.59%	-15.15%	0.56%
自基金合同生效起至今	-36.85%	1.18%	-7.42%	0.69%	-29.43%	0.49%

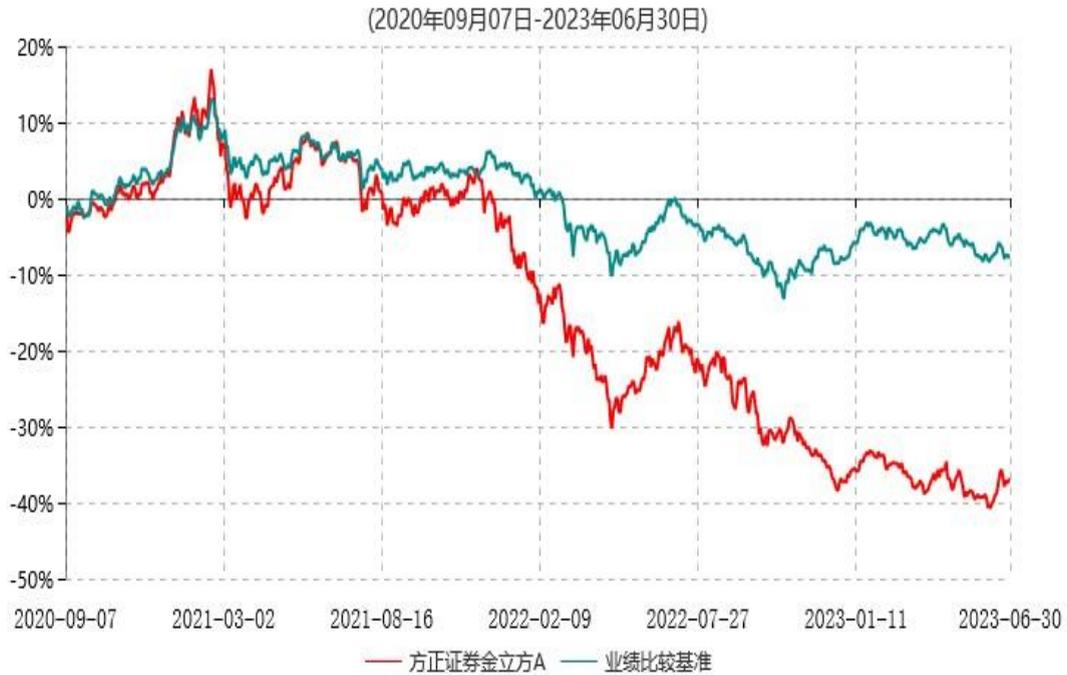
方正证券金立方C

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
过去一个月	3.99%	1.11%	0.88%	0.52%	3.11%	0.59%
过去三个月	2.44%	1.11%	-2.53%	0.49%	4.97%	0.62%
过去六个月	0.94%	0.95%	0.50%	0.51%	0.44%	0.44%
过去一年	-21.92%	1.15%	-7.25%	0.59%	-14.67%	0.56%
自基金合同生效起至今	-34.51%	1.18%	-6.50%	0.69%	-28.01%	0.49%

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

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



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：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。

## §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

方正证券股份有限公司（以下简称“方正证券”）是中国首批综合类证券公司，上海证券交易所、深圳证券交易所首批会员，于2010年改制为股份有限公司，并于2011年在上海证券交易所上市（股票代码：601901）。

通过多年积累，方正证券及其子公司业务资质齐全，范围涵盖证券经纪、期货经纪、投资银行、证券自营、资产管理、研究咨询、IB业务、QFII业务、融资融券、另类投资业务、证券投资基金业务、场外市场业务、质押式报价回购业务、代销金融产品业务、受托管理保险资金业务、新三板做市业务、收益凭证业务、私募基金管理等。

截至2023年6月30日，本基金管理人共管理了5只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划、方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划、方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划、方正证券现金港货币型集合资产管理计划、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

### 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	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王志广	本基金的基金经理	2023-01-18	-	3年	2008年7月起就职于国海证券股份有限公司投行部，任高级业务经理。2009年7月起就职于长城人寿保险股份有限公司资产管理中心，历任研究员、权益投资经理。2013年11月起就职于元龙利通（上海）股权投资管理有限公司，任投资经理。2016年7月起就职于江西铜业（北京）国际投资管理有限公司，

					任自营投资负责人。2017年4月起就职于国融证券股份有限公司资产管理部，任投资主办。2019年10月起就职于和泰人寿保险股份有限公司资产管理部，任权益投资负责人。2023年1月起就职于方正证券股份有限公司，现任资管权益投资部投资经理。
傅岳鹏	已离任基金经理	2021-09-27	2023-01-18	8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，任资管权益投资部研究员、投资经理。
乔林建	已离任基金经理	2022-08-16	2023-01-18	14年	2002年6月起就职于新华人寿保险股份有限公司，历任研究员、投资经理。2006年6月起就职于新华资产管理股份有限公司，任高级投资经理。2008年2月

					起就职于建信基金管理有限责任公司，历任专户投资经理、基金经理。2015年6月起就职于长盛基金管理有限公司，历任执行总监、基金经理。2017年11月起就职于信达证券股份有限公司，任投资管理部总经理。2021年10月加入方正证券股份有限公司，任资管权益投资部行政负责人。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.3 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

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遵规守信情况的说明

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 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，本基金未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况，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 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

上半年市场冲高回落。1月份延续上涨走势，呈现普涨行情，触及3300点后横盘震荡两个月。指数分化明显，虽然上证横盘震荡并在4、5月份两次触及3400点，但沪深300、上证50指数均在1月末见顶，此后持续回落。3月份人工智能、中特估成为市场主线，TMT集体上涨对其他板块形成显著的抽血效应。4月初电子、计算机、通信板块相继见顶回落，5月初传媒、中特估见顶，指数快速下跌，缩量交易。

4月份是宏观数据和乐观情绪的高点。1季度经济脉冲型修复后，宏观数据走弱、政策保持定力，4月末政治局会议定性“经济增长好于预期”，叠加疫情二阳、人民币贬值等因素，导致悲观情绪升温。宏观热、微观冷是市场对现状的感知，市场通过逆向思维的模式，开始博弈刺激政策的出台。在6月16日国常会及随后降息操作完成后，指数再次快速下跌。

年初我们展望2023年时认为，国内流动性中性偏松，市场估值处于中等偏下水平，市场存在上行的必要条件，大概率仍体现为结构性行情。我们判断在经济弱复苏，流动性偏松的情境下，主题投资风格占优；中特估相关板块既有政策催化，又具备低估值、顺周期属性；伴随经济重启，顺周期品种存在边际改善的机会。我们较早关注并研究了数字经济、人工智能、中特估等投资机会，并体现在投资组合中。年初产品主要配置在军工、医药、新能源等方向，基于行业和个股基本面研究，产品稳步降低了上述行业的配置权重，增加了TMT、周期、消费方向的仓位，行业和个股的集中度均有所降低。

上半年，产品持仓结构清晰，新增配置阶段性贡献了较好收益。不可否认，我们年初对经济复苏节奏的判断偏向乐观，消费、投资相关板块持续跑输市场；新能源板块调整的时间和空间也超出预期。存量资金博弈的情况下，市场缺少中长期的投资主线，对主题投资细分赛道的挖掘越来越深入，个股选择越来越发散，板块的波动幅度加大，产品净值受到拖累。因此，我们在保持组合风格特征的情况下，主动控制风险，加大自下而上个股投资机会的研究和配置。

#### 4.4.2 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0.8488元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为0.50%；截至报告期末方正证券金立方C基金份额净值为0.6549元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.94%，同期业绩比较基准收益率为0.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济保持弱复苏，经济修复动能仍待改善。6月份制造业PMI为49%，较上月小幅回升0.2个百分点，新订单、生产指数小幅回升，新出口订单、产成品库存继续下降。6月份PPI同比下降5.4%，较5月份降幅扩大0.8个百分点，前6个月累计降幅为-3.8%，较前5个月降幅扩大0.4个百分点。经济仍处于去库存阶段，市场对经济前景较为悲观。

7月初，总理召开经济形势专家座谈会，指出经济长期向好的基本面没有变，保持战略定力，注重打好政策组合拳，注重把握转型的窗口期。我们认为在全球经济下行周期，国内坚持高质量发展，在全年5%左右增长目标下，国内出台强刺激政策的概率较低。年初我们认为库存、PPI、企业盈利见底的时间窗口在2-3季度，若没有政策干预，下跌幅度和见底时间都会超出年初的预期。

在没有强刺激政策的情况下，预期下半年经济保持温和复苏，保持流动性中性偏松的判断。市场估值仍处于中等偏下水平，存在上行的必要条件。（1）上半年央行通过降准、降息操作作为经济复苏提供保障，在美联储加息接近尾声的情况下，下半年国内货币政策有望继续保持现有基调，人民币大幅贬值的概率较低。（2）沪深300指数PE、PB估值分别处于过去10年28%、16%分位左右，若下半年企业盈利能力改善，指数存在进一步上行的空间。（3）从股债收益模型看，经过2月份至今的回调，读数再次接近历史极值，下半年配置权益类资产的胜率较高。（4）申万大小盘指数市盈率比值处于2018年以来的高位，小市值股票自2022年5月份以来持续占优，下半年需要关注大小盘风格切换的可能。（5）存量资金博弈情况下，下半年大概率仍是结构性行情。TMT和中特估仍是最明确的可以有所作为的主线，不断挖掘出新的投资热点。（6）打破目前市场弱势的契机，或者是宏观政策发生显著变化，或者是中观层面可以验证到行业拐点。

未来我们将保持稳定的投资框架，将宏观经济运行、政策导向、行业景气度、个股特征变化等因素作为观测市场的锚，挖掘能够获取超额收益的优势板块。我们会加大行业和个股的研究储备，提高选择标准，控制组合的下行风险，与优秀的公司共同成长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员

会，使用可靠的估值业务系统。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 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 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金2023年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，管理人的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	91,675,163.37	163,925,275.68
结算备付金		6,377,013.94	4,098,529.12
存出保证金		367,342.78	761,220.77
交易性金融资产	6.4.7.2	722,090,030.76	825,848,465.34
其中：股票投资		722,090,030.76	754,025,710.27
基金投资		-	-
债券投资		-	71,822,755.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,010,929.71	140,000,140.01
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,083.58	54,311.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	14,903.54	54,575.12
资产总计		870,546,467.68	1,134,742,517.18
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>

<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,635,493.88	111,748,378.50
应付赎回款		2,892,424.22	947,017.75
应付管理人报酬		422,798.30	542,802.23
应付托管费		175,488.17	225,361.30
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	1,100,049.29	1,160,425.22
负债合计		9,226,253.86	114,623,985.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,314,080,993.83	1,571,057,763.26
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-452,760,780.01	-550,939,231.08
净资产合计		861,320,213.82	1,020,118,532.18
负债和净资产总计		870,546,467.68	1,134,742,517.18

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额1,314,080,993.83份，其中A类基金份额净值（暂估业绩报酬前）0.8488元，基金份额总额3,962,707.55份，资产净值（暂估业绩报酬前）3,363,491.78元，相关暂估业绩报酬0.00元，资产净值（暂估业绩报酬后）3,363,491.78元；C类基金份额净值（暂估业绩报酬前）0.6549元，基金份额总额1,310,118,286.28份，资产净值（暂估业绩报酬前）857,956,722.04元，相关暂估业绩报酬3,204.99元，资产净值（暂估业绩报酬后）857,953,517.05元。实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。

## 6.2 利润表

会计主体：方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		14,226,301.91	-356,290,022.08
1.利息收入		938,886.18	1,630,582.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	196,711.31	406,228.72
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		742,174.87	1,224,353.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-38,988,837.51	-393,884,289.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-43,228,335.13	-400,130,675.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-161,874.07	1,284,256.22
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	4,401,371.69	4,962,129.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	52,276,253.24	35,963,685.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,208,825.83	7,326,007.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,823,222.70	5,008,530.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,172,065.36	2,079,835.90
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		16,653.89	-
8. 其他费用	6.4.7.15	196,883.88	237,640.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,017,476.08	-363,616,029.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,017,476.08	-363,616,029.48
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		10,017,476.08	-363,616,029.48

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,571,057,763.26	-	-550,939,231.08	1,020,118,532.18

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,571,057,763.26	-	-550,939,231.08	1,020,118,532.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-256,976,769.43	-	98,178,451.07	-158,798,318.36
（一）、综合收益总额	-	-	10,017,476.08	10,017,476.08
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-256,976,769.43	-	88,160,974.99	-168,815,794.44
其中：1.基金申购款	4,153,573.91	-	-1,410,267.20	2,743,306.71
2.基金赎回款	-261,130,343.34	-	89,571,242.19	-171,559,101.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,314,080,993.8	-	-452,760,780.01	861,320,213.82

资产（基金净值）	3			
项目	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,217,373,077.51	-	11,447,879.58	2,228,820,957.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,217,373,077.51	-	11,447,879.58	2,228,820,957.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-426,651,097.18	-	-298,787,105.98	-725,438,203.16
（一）、综合收益总额	-	-	-363,616,029.48	-363,616,029.48
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-426,651,097.18	-	64,828,923.50	-361,822,173.68
其中：1.基金申购款	8,619,221.53	-	-1,212,246.76	7,406,974.77
2.基金赎回款	-435,270,318.71	-	66,041,170.26	-369,229,148.45
（三）、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,790,721,980.3 3	-	-287,339,226.40	1,503,382,753.9 3

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

施华

李岩

祖坤

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划(以下简称本计划或本集合计划)原为方正金泉友3号集合资产管理计划(以下简称原集合计划)。原集合计划于2011年6月21日取得《中国证监会关于核准方正证券股份有限公司设立方正金泉友3号集合资产管理计划的批复》(证监许可[2011]985号),并于2011年7月8日开始募集,2011年8月26日成立。原集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币797,356,527.58元,折合认购份额797,356,527.58份;认购资金产生的利息金额为人民币924,527.97元,折合集合计划份额924,527.97份。以上实收资金共计人民币798,281,055.55元,折合798,281,055.55份集合计划份额,上述出资业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并出具了天健验[2011]2-21号验资报告。原集合计划的管理人为方正证券股份有限公司,托管人为中信银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)于2018年11月28日发布的《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》(证监会公告【2018】39号)规定,中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自2020年9月7日起,《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》生效,原《方正金泉友3号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本

集合计划为大集合产品，系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。

本集合计划为混合型集合资产管理计划，本集合计划存续期不超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。方正证券股份有限公司是本集合计划的管理人，中信银行股份有限公司是本计划的托管人，中国证券登记结算有限责任公司是本计划的注册登记机构。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他投资品种。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划资产的50-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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6月30日的财务状况以及2023年1月1日至6月30日的经营成果和净资产（计划净值）变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

#### 1. 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自2018年1月1日起施行。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。

#### 2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 4. 企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款	91,675,163.37	
等于：本金	91,670,479.34	
加：应计利息	4,684.03	
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	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	91,675,163.37	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	764,315,403.16	-	722,090,030.76	-42,225,372.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	764,315,403.16	-	722,090,030.76	-42,225,372.40

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,010,929.71	-
银行间市场	-	-
合计	50,010,929.71	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	14,903.54
合计	14,903.54

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-	
应付交易费用	1,019,954.15	
其中：交易所市场	1,019,954.15	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	24,795.19	
其他应付	55,299.95	
合计	1,100,049.29	

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 方正证券金立方A

金额单位：人民币元

项目 (方正证券金立方A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,392,099.41	4,392,099.41
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-429,391.86	-429,391.86
本期末	3,962,707.55	3,962,707.55

##### 6.4.7.7.2 方正证券金立方C

金额单位：人民币元

项目 (方正证券金立方C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,566,665,663.85	1,566,665,663.85
本期申购	4,153,573.91	4,153,573.91
本期赎回（以“-”号填列）	-260,700,951.48	-260,700,951.48

本期末	1,310,118,286.28	1,310,118,286.28
-----	------------------	------------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 方正证券金立方A

单位：人民币元

项目 (方正证券金立方A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	536,032.93	-1,223,849.51	-687,816.58
本期利润	-159,069.65	182,717.07	23,647.42
本期基金份额交易产生的变动数	-49,602.83	114,556.22	64,953.39
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-49,602.83	114,556.22	64,953.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	327,360.45	-926,576.22	-599,215.77

#### 6.4.7.8.2 方正证券金立方C

单位：人民币元

项目 (方正证券金立方C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-504,287,272.30	-45,964,142.20	-550,251,414.50
本期利润	-42,099,707.51	52,093,536.17	9,993,828.66
本期基金份额交易产生的变动数	87,462,871.51	633,150.09	88,096,021.60
其中：基金申购款	-1,400,980.39	-9,286.81	-1,410,267.20
基金赎回款	88,863,851.90	642,436.90	89,506,288.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-458,924,108.30	6,762,544.06	-452,161,564.24

#### 6.4.7.9 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06月30日
活期存款利息收入	132,767.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	60,202.29
其他	3,741.95
合计	196,711.31

#### 6.4.7.10 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06月30日
卖出股票成交总额	1,235,570,891.43
减：卖出股票成本总额	1,275,433,954.07
减：交易费用	3,365,272.49
买卖股票差价收入	-43,228,335.13

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 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06月30日
债券投资收益——利息收入	48,604.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-210,479.00
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	-161,874.07

##### 6.4.7.11.2 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2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	71,878,400.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,610,479.00
减：应计利息总额	1,478,400.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-210,479.00

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,401,371.69
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,401,371.69

#### 6.4.7.14 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2023年06月30日
1.交易性金融资产	52,276,253.24
——股票投资	52,058,734.24
——债券投资	217,519.00
——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	52,276,253.24

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
银行汇划费	250.50
帐户维护费	18,600.00
注册登记费	109,566.61
中登电子合同费	4,000.00
合计	196,883.88

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
方正证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海天天基金销售有限公司	基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司	基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
方正证券 股份有限 公司	2,422,998,419.99	100.00%	8,664,188,528.33	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的

		比例		比例
方正证券股份有限公司	-	-	24,032,194.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
方正证券股份有限公司	6,970,000,000.00	100.00%	13,211,900,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
方正证券股份有限公司	1,945,367.00	100.00%	1,019,954.15	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比例		额的比例
方正证券股份有限公司	6,944,580.63	100.00%	3,463,091.35	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,823,222.70	5,008,530.51
其中：支付销售机构的客户维护费	5,616.62	8,229.75

注：本集合计划A类计划份额的固定管理费年费率为1.2%，C类计划份额的固定管理费年费率为0.6%。本集合计划各类计划份额的固定管理费按前一日该类计划份额资产净值对应的固定管理费年费率分别计提。固定管理费的计算方法如下：

$H = E \times I \div$  当年天数

H为各类计划份额每日应计提的固定管理费

E为该计划份额前一日的资产净值

I为该计划份额的固定管理费年费率

集合计划固定管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

在本集合计划分红确认日、赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人的期间年化收益率（R），对A类计划份额期间年化收益率超过9%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）；在赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人的期间年化收益率（R），对C类计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。

##### 6.4.10.2.2 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06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,172,065.36	2,079,835.90

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	91,675,163.37	132,767.07	113,359,210.20	229,899.45

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	8,595	48,905.55	46,498.95	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	2,643	29,337.30	45,036.72	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	349	26,803.20	37,674.55	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	2,063	24,962.30	24,900.41	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	50.00	30.71	803	40,150.00	24,660.13	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打	30.26	25.33	852	25,781.52	21,581.16	-

				新限售						
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板打新限售	26.80	22.32	891	23,878.80	19,887.12	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	87.29	53.24	365	31,859.73	19,432.60	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	212	15,900.00	19,241.12	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	创业板打新限售	32.34	31.86	562	18,175.08	17,905.32	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	162	20,392.56	14,059.98	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	609	7,722.12	13,586.79	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打新限售	26.66	31.50	360	9,597.60	11,340.00	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	73.45	46.64	243	17,848.35	11,333.52	-

688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	693	7,74 7.74	10,11 0.87	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板打新限售	71.88	92.60	89	6,39 7.32	8,24 1.40	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	296	6,11 8.32	7,74 6.32	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	创业板打新限售	58.32	45.36	167	9,73 9.44	7,57 5.12	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	289	5,54 8.80	7,37 8.17	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	创业板打新限售	41.20	42.69	172	7,08 6.40	7,34 2.68	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	创业板打新限售	50.00	48.39	134	6,70 0.00	6,48 4.26	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.79	255	7,64 7.45	6,06 6.45	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	创业板打	46.13	34.40	135	6,22 7.55	4,64 4.00	-

				新限售						
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	67	1,065.30	1,145.03	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	60	874.80	967.80	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由风险管理部、合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

##### 6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金未持有债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

#### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

#### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人定期或不定期对基金净退出比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保退出款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 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基金流动性风险管理的内部控制体系，包括严密完备的管理制度、科学规范的业务控制流程、清晰明确的组织架构与职责分工、独立严格的监督制衡与评估机制、灵活有效的应急处置计划等，同时已在内部设立专门的岗位及足够的人员配备，负责基金的流动性风险评估与监测。

本基金的基金管理人已建立以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，并针对不同类型开放式基金制定了健全有效的流动性风险指标预警监测体系。日常监控采用的流动性风险监测指标包括但不限于债券正回购杠杆比例、7个工作日可变现资产的可变现价值、流动受限资产比例、前十大份额持有人集中度、资产集中度、净流动性敞口等，投资过程中综合考虑产品投资者结构、开放申赎情况，在资产配置时对资产的集中度、期限结构、收益结构等方面做出合理安排，以确保产品资产的变现能力与投资者赎回需求匹配。

本基金所持证券除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本基金本报告期末及报告期间均无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金的管理人定期对本基金面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	91,675,163.37	-	-	-	91,675,163.37
结算备付金	6,377,013.94	-	-	-	6,377,013.94
存出保证金	367,342.78	-	-	-	367,342.78
交易性金融资产	-	-	-	722,090,030.76	722,090,030.76
买入返售金融资产	50,010,929.71	-	-	-	50,010,929.71
应收申购款	-	-	-	11,083.58	11,083.58
其他资产	-	-	-	14,903.54	14,903.54
资产总计	148,430,449.80	-	-	722,116,017.88	870,546,467.68
负债					
应付清算款	-	-	-	4,635,493.88	4,635,493.88
应付赎回款	-	-	-	2,892,424.22	2,892,424.22
应付管理人报酬	-	-	-	422,798.30	422,798.30

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划 2023 年中期报告

应付托管费	-	-	-	175,488.17	175,488.17
其他负债	-	-	-	1,100,049.29	1,100,049.29
负债总计	-	-	-	9,226,253.86	9,226,253.86
利率敏感度缺口	148,430,449.80	-	-	712,889,764.02	861,320,213.82
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					
银行存款	163,925,275.68	-	-	-	163,925,275.68
结算备付金	4,098,529.12	-	-	-	4,098,529.12
存出保证金	761,220.77	-	-	-	761,220.77
交易性金融资产	71,822,755.07	-	-	754,025,710.27	825,848,465.34
买入返售金融资产	140,000,140.01	-	-	-	140,000,140.01
应收申购款	-	-	-	54,311.14	54,311.14
其他资产	-	-	-	54,575.12	54,575.12
资产总计	380,607,920.65	-	-	754,134,596.53	1,134,742,517.18
负债					
应付清算款	-	-	-	111,748,378.50	111,748,378.50
应付赎回款	-	-	-	947,017.75	947,017.75
应付管理人报酬	-	-	-	542,802.23	542,802.23
应付托管费	-	-	-	225,361.30	225,361.30
其他负债	-	-	-	1,160,425.22	1,160,425.22

负债总计	-	-	-	114,623,985.00	114,623,985.00
利率敏感度缺口	380,607,920.65	-	-	639,510,611.53	1,020,118,532.18

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末无债券持仓，市场利率变动对本基金净值无直接的重大影响，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人通过建立多层次的风险指标体系，对其他价格风险进行持续的度量和分析，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30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	722,090,030.76	83.84	754,025,710.27	73.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	71,822,755.07	7.04

产—债券投资				
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	722,090,030.76	83.84	825,848,465.34	80.96

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票资产公允价值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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	股票投资公允价值增加5%	36,104,501.54	37,701,285.51
	股票投资公允价值减少5%	-36,104,501.54	-37,701,285.51

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	721,695,190.29	753,917,956.00
第二层次	-	71,822,755.07
第三层次	394,840.47	107,754.27
合计	722,090,030.76	825,848,465.34

**6.4.14.2.2 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证券，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，本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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.14.4 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。

**6.4.15 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。

**§7 投资组合报告****7.1 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	722,090,030.76	82.95

	其中：股票	722,090,030.76	82.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	50,010,929.71	5.74
	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	98,052,177.31	11.26
8	其他各项资产	393,329.90	0.05
9	合计	870,546,467.68	100.00

## 7.2 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	9,776,186.00	1.14
C	制造业	496,224,623.62	57.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	43,886,625.03	5.10
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	98,556,752.11	11.44
J	金融业	73,641,200.00	8.55
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	4,644.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	722,090,030.76	83.84

### 7.3 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	600150	中国船舶	1,360,983	44,789,950.53	5.20
2	002865	钧达股份	200,173	30,532,387.69	3.54
3	002475	立讯精密	930,000	30,178,500.00	3.50
4	002777	久远银海	765,900	27,166,473.00	3.15
5	688556	高测股份	491,935	26,141,425.90	3.04
6	605589	圣泉集团	1,200,000	26,088,000.00	3.03
7	300760	迈瑞医疗	84,400	25,303,120.00	2.94
8	601800	中国交建	2,300,000	25,093,000.00	2.91
9	688223	晶科能源	1,780,000	25,026,800.00	2.91
10	000768	中航西飞	920,000	24,610,000.00	2.86
11	300223	北京君正	239,961	21,190,955.91	2.46
12	688031	星环科技	157,236	20,950,124.64	2.43
13	603690	至纯科技	600,000	20,904,000.00	2.43
14	688169	石头科技	60,000	19,240,800.00	2.23
15	600602	云赛智联	1,250,000	18,825,000.00	2.19
16	000032	深桑达 A	571,200	18,792,480.00	2.18
17	688008	澜起科技	300,000	17,226,000.00	2.00
18	603986	兆易创新	159,904	16,989,800.00	1.97
19	300122	智飞生物	374,854	16,568,546.80	1.92

20	601066	中信建投	665,000	16,093,000.00	1.87
21	688515	裕太微	93,000	15,964,380.00	1.85
22	300680	隆盛科技	609,960	15,169,705.20	1.76
23	002368	太极股份	350,000	14,409,500.00	1.67
24	300059	东方财富	1,000,000	14,200,000.00	1.65
25	600036	招商银行	420,000	13,759,200.00	1.60
26	300428	立中集团	590,000	13,605,400.00	1.58
27	603919	金徽酒	570,000	13,383,600.00	1.55
28	688234	天岳先进	180,000	13,309,200.00	1.55
29	000887	中鼎股份	992,000	12,985,280.00	1.51
30	688696	极米科技	80,000	11,151,200.00	1.29
31	300580	贝斯特	444,913	10,806,936.77	1.25
32	688579	山大地纬	650,441	10,719,267.68	1.24
33	300393	中来股份	746,400	10,479,456.00	1.22
34	603348	文灿股份	231,394	10,137,371.14	1.18
35	601939	建设银行	1,600,000	10,016,000.00	1.16
36	601211	国泰君安	700,000	9,793,000.00	1.14
37	601658	邮储银行	2,000,000	9,780,000.00	1.14
38	600256	广汇能源	1,425,100	9,776,186.00	1.14
39	688599	天合光能	200,323	8,535,763.03	0.99
40	600499	科达制造	715,500	8,128,080.00	0.94
41	603589	口子窖	150,000	7,402,500.00	0.86
42	688521	芯原股份	90,000	6,472,800.00	0.75
43	688469	中芯集成	8,595	46,498.95	0.01
44	688472	阿特斯	2,643	45,036.72	0.01
45	301325	曼恩斯特	349	37,674.55	0.00
46	688352	硕中科技	2,063	24,900.41	0.00
47	301246	宏源药业	803	24,660.13	0.00
48	688570	天玛智控	852	21,581.16	0.00
49	301303	真兰仪表	891	19,887.12	0.00
50	301322	绿通科技	365	19,432.60	0.00

51	688458	美芯晟	212	19,241.12	0.00
52	301307	美利信	562	17,905.32	0.00
53	688623	双元科技	162	14,059.98	0.00
54	688562	航天软件	609	13,586.79	0.00
55	688433	华曙高科	360	11,340.00	0.00
56	301345	涛涛车业	243	11,333.52	0.00
57	688593	新相微	693	10,110.87	0.00
58	301360	荣旗科技	89	8,241.40	0.00
59	301317	鑫磊股份	296	7,746.32	0.00
60	301387	光大同创	167	7,575.12	0.00
61	688429	时创能源	289	7,378.17	0.00
62	301141	中科磁业	172	7,342.68	0.00
63	301357	北方长龙	134	6,484.26	0.00
64	301386	未来电器	255	6,066.45	0.00
65	301203	国泰环保	135	4,644.00	0.00
66	603137	恒尚节能	67	1,145.03	0.00
67	603172	万丰股份	60	967.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	688031	星环科技	56,390,490.32	5.53
2	600036	招商银行	37,199,308.02	3.65
3	000032	深桑达 A	33,032,668.78	3.24
4	002605	姚记科技	32,919,328.00	3.23
5	300776	帝尔激光	30,431,852.76	2.98
6	601800	中国交建	26,969,886.47	2.64
7	000928	中钢国际	26,964,099.64	2.64
8	600602	云赛智联	26,940,227.39	2.64

9	688556	高测股份	25,956,616.92	2.54
10	002475	立讯精密	25,099,119.85	2.46
11	002777	久远银海	24,646,753.67	2.42
12	002941	新疆交建	24,602,563.66	2.41
13	605589	圣泉集团	24,052,708.22	2.36
14	601669	中国电建	23,206,695.23	2.27
15	688223	晶科能源	22,403,501.04	2.20
16	688169	石头科技	22,212,597.33	2.18
17	603690	至纯科技	21,660,723.47	2.12
18	300223	北京君正	21,124,992.72	2.07
19	300465	高伟达	21,041,457.00	2.06
20	688008	澜起科技	20,894,772.61	2.05
21	300580	贝斯特	20,623,709.60	2.02
22	601555	东吴证券	20,580,529.00	2.02

#### 7.4.2 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	688031	星环科技	43,745,978.59	4.29
2	000661	长春高新	35,733,221.72	3.50
3	002605	姚记科技	35,302,938.48	3.46
4	000928	中钢国际	29,883,724.10	2.93
5	600765	中航重机	29,462,053.35	2.89
6	603392	万泰生物	28,785,803.80	2.82
7	603019	中科曙光	28,772,492.08	2.82
8	600276	恒瑞医药	27,786,017.06	2.72
9	300775	三角防务	25,803,735.23	2.53
10	600703	三安光电	25,678,881.12	2.52
11	002941	新疆交建	25,307,704.00	2.48
12	688295	中复神鹰	25,286,423.41	2.48

13	603393	新天然气	24,170,466.26	2.37
14	300776	帝尔激光	23,596,152.54	2.31
15	603306	华懋科技	23,594,765.00	2.31
16	002389	航天彩虹	22,411,223.00	2.20
17	300465	高伟达	22,347,368.64	2.19
18	600416	湘电股份	22,188,678.00	2.18
19	300624	万兴科技	21,595,685.71	2.12
20	600036	招商银行	21,449,430.36	2.10
21	688167	炬光科技	21,371,064.27	2.09
22	601555	东吴证券	21,050,423.66	2.06
23	688311	盟升电子	20,741,064.43	2.03

#### 7.4.3 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	1,191,439,540.32
卖出股票收入（成交）总额	1,235,570,891.43

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.11 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	367,342.78
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,083.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	14,903.54
8	其他	-
9	合计	393,329.90

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

## 58 基金份额持有人信息

### 8.1 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
方正证券金立方A	39	101,607.89	0.00	0.00%	3,962,707.55	100.00%
方正证券金立方C	29,573	44,301.16	6,711,545.61	0.51%	1,303,406,740.67	99.49%
合计	29,612	44,376.64	6,711,545.61	0.51%	1,307,369,448.22	99.49%

### 8.2 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	方正证券金立方A	0.00	0.00%
	方正证券金立方C	12,526,612.53	0.96%
	合计	12,526,612.53	0.95%

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	方正证券金立方A	0
	方正证券金立方C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基	方正证券金立方A	0

金	方正证券金立方C	0
	合计	0

## §9 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
基金合同生效日(2020年09月07日)基金份额总额	13,097,596.44	-
本报告期期初基金份额总额	4,392,099.41	1,566,665,663.85
本报告期基金总申购份额	-	4,153,573.91
减：本报告期基金总赎回份额	429,391.86	260,700,951.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,962,707.55	1,310,118,286.28

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，本基金管理人分别于2023年2月18日、2023年3月1日、2023年5月27日发布公告，李岩先生自2023年2月17日起担任方正证券股份有限公司财务负责人，陈飞先生因达到法定退休年龄于2023年2月27日辞去首席风险官职务，公司董事会聘任孙斌先生担任首席风险官，曹玉海先生自2023年5月25日起担任方正证券股份有限公司合规总监。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于2023年4月17日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于2023年4月17日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内，本基金投资策略无改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 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	
方正证券股份有限公司	2	2,422,998,419.99	100.00%	1,945,367.00	100.00%	-

**10.7.2 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

方正证券股份有限公司	-	-	6,970,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
------------	---	---	------------------	---------	---	---	---	---

## 10.8 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	方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	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）	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
3	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	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
4	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	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
5	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-18
6	方正证券股份有限公司关于高级管理人员辞职的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-01
7	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
8	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-27
9	方正证券股份有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-10

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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

### 12.3 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](http://www.foundersc.com)

方正证券股份有限公司  
二〇二三年八月三十一日