

# 方正证券现金港货币型集合资产管理计划

2023年第3季度报告

2023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:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2023年10月25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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2023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2023年7月1日起至2023年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	方正证券现金港
基金主代码	970116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年01月17日
报告期末基金份额总额	8,295,444,572.11份
投资目标	在不影响委托人正常证券交易的前提下，将集合计划资金投向各类低风险高流动性固定收益类资产，获取一定收益。
投资策略	1、利率策略；2、个券选择策略；3、银行定期存款、同业存单投资策略；4、债券回购投资策略。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、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	中国证券登记结算有限责任公司

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（2023年07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	29,623,891.58
2.本期利润	29,623,891.58
3.期末基金资产净值	8,295,444,572.11

注：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，由于按摊余成本法核算的货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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	0.2828%	0.0001%	0.3456%	0.0000%	-0.0628%	0.0001%
过去六个月	0.5886%	0.0002%	0.6886%	0.0000%	-0.1000%	0.0002%
过去一年	1.0971%	0.0004%	1.3781%	0.0000%	-0.2810%	0.0004%
自基金合同 生效起至今	2.0475%	0.0006%	2.3599%	0.0000%	-0.3124%	0.0006%

注：本集合计划每日分配收益，按月结转份额。

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

方正证券现金港币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## §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	2022-01-17	-	11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，现任资管债券投资部投资经理。

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。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度经济延续弱复苏格局，8月以来呈现触底回升的特征。经济数据方面，8月份工业增加值同比增长4.5%，高于预期值4.2%，同比改善明显，除了去年同期拉闸限电导致的低基数外，环比改善也较为明显。1-8月基建投资累计同比9%，今年以来基建整体维持偏强区间运行。制造业投资累计同比5.9%，韧性依旧。房地产开发投资累计同比-8.8%，7月底政策吹风对二线城市销售有所拉动，带动地产销售逐渐企稳，但认房不认贷等新一轮政策对一线城市地产销售的带动还有传导，资金来源和投资端现实仍待企稳。8月社会消费品零售总额同比4.6%，出行链维持韧性，在外餐饮维持两位数增速。整体来看，经济基本面呈现企稳迹象。通胀方面，CPI下行至负值后在8月份受猪肉价格环比上涨拉动触底回升，向后看随着基数效应逐步降低经济持续修复，预计CPI延续上行趋势。货币政策及流动性方面，三季度经济恢复基础还需巩固，央行超预期降息后资金面由偏宽逐步收敛。具体来看，7月份资金面偏宽松，DR007整体处于政策利率以下，当月多数时间央行缩量开展逆回购，维护流动性合理充裕。8月份央行超预期下调7天逆回购和MLF利率，上半月资金面偏宽松，下半月有所收敛。9月中旬央行采取降准操作下调存款准备金率，但9月份资金面仍然逐步收紧，临近季末资金利率走高，跨季资金

价格维持高位。整体来看三季度资金利率先下后上，但从央行的操作上来看，呵护资金面的态度没有改变。同业存单收益率也呈现先抑后扬的走势，1年期同业存单收益率收于2.44%，较二季度末上行14BP。

本基金在报告期内采取稳健的投资策略，以短期逆回购、同业存单、同业存款为主要配置资产。组合在7月份及9月份加大了中长期同业存款及同业存单的配置力度，力争提高组合收益，并在资金宽松时点保持了一定的杠杆比例，赚取息差收益。9月底因季末因素赎回量较大，组合预留了较多流动性资产并增加了一定的杠杆比例保证了产品的流动性。展望四季度，央行在三季度接连降息降准表明对于资金面呵护的态度不变，整体来看基本面对于资金面的利空有限，在信贷增长持续改善之前，预计资金面表现平稳。组合将继续优选具有良好信用资质的投资标的，根据收益率情况，调整组合平均剩余期限，并将在关键时点预留现金流，维持较好的流动性，保证产品安全稳定的运行，将继续努力为客户创造更好的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券现金港币基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.2828%，同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

#### 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	固定收益投资	3,624,148,147.60	40.92
	其中：债券	3,624,148,147.60	40.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	528,401,424.93	5.97
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,703,068,695.84	53.11
4	其他资产	41,291.31	0.00
5	合计	8,855,659,559.68	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.53
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	548,359,841.70	6.61
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	86

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产 净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产 净值的比例 (%)
1	30天以内	19.16	6.61
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	23.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.85	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	41.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.24	6.61

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	40,455,438.21	0.49
5	企业短期融资券	120,513,876.24	1.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,463,178,833.15	41.75
8	其他	-	-
9	合计	3,624,148,147.60	43.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112210313	22兴业银行C D313	1,000,000	99,869,439.24	1.20
2	112397788	23厦门国际银行CD065	1,000,000	99,820,230.42	1.20
3	112313039	23浙商银行C D039	1,000,000	99,785,583.79	1.20

4	112399475	23长沙银行C D117	1,000,000	99,662,400.78	1.20
5	112381026	23广州银行C D037	1,000,000	99,573,689.19	1.20
6	112381528	23广州银行C D044	1,000,000	99,484,210.19	1.20
7	112395367	23杭州银行C D064	1,000,000	99,420,528.89	1.20
8	112384002	23成都银行C D162	1,000,000	99,260,532.73	1.20
9	112313093	23浙商银行C D093	1,000,000	99,185,710.31	1.20
10	112313113	23浙商银行C D113	1,000,000	99,019,967.80	1.19

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0336%
报告期内偏离度的最低值	-0.0290%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0228%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用“摊余成本法”计算集合计划资产净值，为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定

价”。如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

**5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，厦门国际银行股份有限公司、长沙银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、成都银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情形。**

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期末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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,620.57
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	23,670.74
7	其他	-
8	合计	41,291.31

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	9,723,299,326.31
报告期期间基金总申购份额	45,498,967,499.83
报告期期间基金总赎回份额	46,926,822,254.03
报告期期末基金份额总额	8,295,444,572.11

## §7 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

2023/7/26 方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告

2023/8/24 方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告

2023/9/26 方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告

## §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证券现金港集合资产管理计划变更的文件
- 2、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划招募说明书》
- 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](http://www.foundersc.com)

方正证券股份有限公司

2023年10月25日