

# 方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

## 2022 年中期报告

2022 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月19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2022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	7
§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	8
§4 管理人报告	10
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	13
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	15
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 中期财务会计报告(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	20
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	70

§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	方正鑫悦一年持有债券	
基金主代码	970052	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年09月16日	
基金管理人	方正证券股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,024,915.78份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同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	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C
下属分级基金的交易代码	970052	970053
报告期末下属分级基金的份额总额	112,548,030.46份	20,476,885.32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、债券投资策略；3、股票投资策略；4、国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%

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、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。本集合计划可以投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--------	---

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈慧蕾	陆志俊
	联系电话	010-56992726	95559
	电子邮箱	chenhuilei@foundersc.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95571	95559
传真		010-56992708	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100020	200336
法定代表人		施华	任德奇

### 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	方正证券股份有限公司	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座16层

## § 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 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	方正鑫悦一年持有 债券A	方正鑫悦一年持有 债券C
本期已实现收益	1,632,580.24	252,963.68
本期利润	3,151,040.72	527,142.62
加权平均基金份额本期利润	0.0311	0.0288
本期加权平均净值利润率	3.00%	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.98%	2.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	32,199,988.14	780,482.04
期末可供分配基金份额利润	0.2861	0.0381
期末基金资产净值	118,962,853.85	21,611,648.49
期末基金份额净值	1.0570	1.0554
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.70%	5.54%

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。

4、基金合同生效日为2021年09月16日。截至2022年6月30日，本基金合同生效不满一年。

### 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

方正鑫悦一年持有债券A

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	1.44%	0.20%	0.85%	0.18%	0.59%	0.02%
过去三个月	2.27%	0.17%	0.92%	0.21%	1.35%	-0.04%
过去六个月	2.98%	0.15%	-0.76%	0.24%	3.74%	-0.09%
自基金合同生效起至今	5.70%	0.14%	-0.44%	0.20%	6.14%	-0.06%

方正鑫悦一年持有债券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	1.40%	0.20%	0.85%	0.18%	0.55%	0.02%
过去三个月	2.17%	0.18%	0.92%	0.21%	1.25%	-0.03%
过去六个月	2.78%	0.15%	-0.76%	0.24%	3.54%	-0.09%
自基金合同生效起至今	5.54%	0.14%	-0.51%	0.20%	6.05%	-0.06%

注：基金合同生效日为2021年09月16日，方正鑫悦一年持有债券C自2021年10月11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

方正鑫悦一年持有债券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09月16日-2022年06月30日)



注：1、基金合同生效日为 2021 年 09 月 16 日。截至 2022 年 6 月 30 日，本基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2021 年 09 月 16 日生效，建仓期 6 个月，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

方正鑫悦一年持有债券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10月11日-2022年06月30日)



注：1、基金合同生效日为 2021 年 09 月 16 日，方正鑫悦一年持有债券 C 自 2021 年 10 月 11 日起开放申购和赎回业务。截至 2022 年 6 月 30 日，本基金合同生效不满一年。  
2、本基金合同于 2021 年 09 月 16 日生效，建仓期 6 个月，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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 2022 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		
李理	本基金的基金经理、方正证券股份有限公司资管债券投资部行政负责人	2021-09-16	-	5 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，现任资管债券投资部行政负责人、投资经理。
李道滢	本基金的基金经理	2021-09-16	-	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，现任资管权益投资部

					权益投资经理。
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，现任资管权益投资部投资经理。

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。

#### 4.1.3 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 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 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

今年上半年，债券市场整体保持震荡。一季度，债券市场先涨后跌。1月份，在OMO、MLF利率下调，及市场对于国内基本面预期较弱的情况下，市场有所上涨，10年国债210017最低触及2.665%。春节以后，受多重因素影响，债券市场开始回调，一方面，市场预期的降准降息政策接连落空，另一方面，一月份社会融资规模增量6.17万亿元，比上年同期多9842亿元，大超市场预期，宽信用成为投资人的主要关注点，此外，1-2月份经济数据公布超市场预期，进一步强化市场对于宽信用的预期，债券在春节以后连续四周下跌，三月中旬以后，随着2月份社融数据不及预期，市场有所企稳。信用债方面，一季度违约主要在民企房地产债券，中高等级信用债不同期限出现分化，1年内品种较2021年末收益率有所下降，3-5年AAA和AA+品种收益率较2021年末平均上升15-20bp，3年期AAA信用利差展宽12bp。二季度，债券市场经历两轮上涨-下跌行情。第一轮在4月内，4月上半月，在资金面较为宽松，及疫情影响市场对于货币政策进一步发力预期下，市场小幅上涨，但月中MLF等量续作而未降息，此外央行降准幅度低于预期情况下，市场出现调整。第二轮为5-6月，5月份，市场资金面维持平稳，短期债券回暖，同时社融数据较弱，长债亦得到支撑，市场买盘力量明显增加，收益率明显下行，进入6月份，一方面，股市表现好于预期，另一方面，稳增长政策持续出台，在债券收益率绝对收益率和相对收益率均较低情况下，市场出现调整。整体来看，上半年债券市场保持震荡，10年国债210017和10年国开债210215在6月末分别较去年末上行10bp和上行4bp。

转债市场方面，1-4月份，受到股票市场表现低迷影响，可转债连续四月下跌，其中三月份中证转债指数下跌5.47%，为2017年以来最大单月跌幅，除受到股债市场下跌影响外，部分股债混合类产品的赎回也对转债市场产生一定影响。随着转债市场持续下跌，同时估值进一步压缩，部分具备弹性的较优品种绝对价格回到120元以下水平。4月27日至6月末，在权益市场上涨同时债券市场未出现大幅下跌情况下，转债市场出现上涨，制造相关的偏股型转债表现更优。整体来看，中证转债指数上半年下跌4.07%。

股票市场方面，1-4月，受到国外通胀持续超预期下货币政策收紧、俄乌冲突及4月份疫情影响，股票市场持续下跌，除中证红利指数外，宽基指数均出现较大幅度下跌，行业方面，除煤炭等少数板块外，也出现普跌，成长股跌幅更大。4月底至6月份，市场表现触底反弹行情。板块方面，成长股反弹力度更大，其中汽车、光伏、新能源等中小市值涨幅居前。

组合操作上，产品1-4月份保持较低股票和转债仓位，在4月底基于股债相对价值及部分品种的景气基本面情况，对于权益和转债资产进行了较大幅度的加仓。此外，在具体各类资产上，上半年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，及利率债进行投资，同时，根据市场走势，适时进行债券交易，增厚组合收益。可转债方面，在原有绝对价格较低，正股市值较大的金融、交运类转债外，增持了部分光伏等行业的偏股型转债，股票方面，4月末增加了成长股的配置，目前组合股票配置仍相对均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正鑫悦一年持有债券A基金份额净值为1.0570元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.98%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%；截至报告期末方正鑫悦一年持有债券C基金份额净值为1.0554元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为2022年“宽货币+宽信用”的政策组合下，债券市场大幅上涨或者下跌的概率不高，在相对震荡环境中，仍然需要重视配置型的票息收入，随着近期回购利率降至低位，需要关注后期融资利率逐步向政策利率靠拢的情况。转债方面，整体市场估值仍位于高位，相对价值并不十分突出，需要在结构性机会中精耕细作，包括行业选择和个券挖掘。A股整体配置价值有所提升，从中长期角度看，持续的成长才是创造股东价值的源泉，在长期经济增长中枢下移，经济结构转型升级的大背景下，会有较多领域出现持续的成长机会，我们希望努力去发掘这些领域中优秀企业的成长机会，在合理的估值区间进行配置，为投资人赚取企业长期成长价值。

#### 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2022年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,015,036.25	3,683,213.28
结算备付金		644,500.72	606,051.37
存出保证金		16,425.05	3,891.57
交易性金融资产	6.4.7.2	170,426,374.81	99,330,784.72
其中：股票投资		20,789,871.77	2,235,690.00
基金投资		-	-
债券投资		149,636,503.04	97,095,094.72
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	-	-
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		5,187.52	-
应收申购款		199,008.34	129,165.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	31,643.52	1,614,039.01
资产总计		174,338,176.21	105,367,145.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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		32,311,220.16	19,403,870.30
应付清算款		1,035,139.51	471,656.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		68,139.46	36,531.25
应付托管费		22,713.17	12,177.08
应付销售服务费		6,944.54	5,562.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		71,677.32	23,458.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	247,839.71	416,806.57
负债合计		33,763,673.87	20,370,062.95
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	107,239,751.03	66,743,473.02
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	33,334,751.31	18,253,609.82
净资产合计		140,574,502.34	84,997,082.84
负债和净资产总计		174,338,176.21	105,367,145.79

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额133,024,915.78份，其中A类基金份额净值1.0570元，基金份额总额112,548,030.46份；C类基金份额净值1.0554元，基金份额总额20,476,885.32份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2022年01月01日至2022年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		4,469,176.89
1. 利息收入		45,775.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	45,529.76
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		246.15
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,630,761.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-942,021.23
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	3,442,892.37
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	22,414.81
股利收益	6.4.7.13	107,475.61
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	1,792,639.42
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>		790,993.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	365,577.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	121,859.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	37,204.50
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		139,454.53
其中：卖出回购金融资产支出		139,454.53

6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		6,405.54
8. 其他费用	6.4.7.15	120,492.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,678,183.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,678,183.34
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,678,183.34

注：本基金合同变更生效日为2021年09月16日，因此无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 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）	66,743,473.0 2	-	18,253,609.8 2	84,997,082.8 4
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）	66,743,473.0 2	-	18,253,609.8 2	84,997,082.8 4
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	40,496,278.0 1	-	15,081,141.4 9	55,577,419.5 0
（一）、综合收益总额	-	-	3,678,183.34	3,678,183.34

(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)	40,496,278.01	-	11,402,958.15	51,899,236.16
其中: 1. 基金申购款	41,075,453.72	-	11,597,626.27	52,673,079.99
2. 基金赎回款	-579,175.71	-	-194,668.12	-773,843.83
(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)	107,239,751.03	-	33,334,751.31	140,574,502.34

注: 本基金合同变更生效日为2021年09月16日, 因此无上年度可比期间数据。

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

何亚刚

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

方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划由方正金泉友2号集合资产管理计划变更而来。

方正金泉友2号集合资产管理计划于2010年11月2日取得中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《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2号集合资产管理计划的批复》(证监许可[2010]1517号), 并于2010年11月18日开始募集, 于2010年12月28日成立。

根据中国证监会于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》, 本集合计划参照《中华人民共

和《证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自2021年9月16日起生效，原《方正金泉友2号集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自本资产管理合同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。方正证券股份有限公司是本集合计划的管理人，交通银行股份有限公司是本计划的托管人，方正证券股份有限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（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据））、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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：中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 85%+沪深300指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率 $\times$ 5%。

#### 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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至6月30日的经营成果和持有人权益（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

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### (一) 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：①以摊余成本计量：本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。②以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

###### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

###### (二) 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (一) 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金

融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

## (二) 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

#### （一）新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### （二）原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告

和中期报告》》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

### (1) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收申购款和其他资产-待摊费用，金额分别为3,683,213.28元、606,051.37元、3,891.57元、1,508,011.73元、129,165.84元和106,027.28元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收申购款和其他资产-待摊费用，金额分别为3,684,682.08元、606,103.62元、3,893.44元、0.00元、129,165.84元和106,027.28元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为99,330,784.72元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为100,837,273.53元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为19,403,870.30元、471,656.16元、36,531.25元、12,177.08元、5,562.90元、37,699.77元和402,565.49元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为19,405,497.58元、471,656.16元、36,531.25元、12,177.08元、5,562.90元、37,699.77元和400,938.21元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

### (2) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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
----	-----

	2022年06月30日
活期存款	3,015,036.25
等于：本金	3,014,256.29
加：应计利息	779.96
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	3,015,036.25

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,961,280.00	-	20,789,871.77	1,828,591.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	331,540.49	36,477,489.30	319,441.64
	银行间市场	1,971,293.74	113,159,013.74	-105,625.50
	合计	2,302,834.23	149,636,503.0	213,816.14

		7		4	
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	166,081,132.67	2,302,834.23	170,426,374.81	2,042,407.91	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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 2022年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	31,643.52
合计	31,643.52

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	45,565.00
其中：交易所市场	18,567.82
银行间市场	26,997.18
应付利息	-
预提费用	24,795.19
其他应付	177,479.52
合计	247,839.71

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 方正鑫悦一年持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	70,103,375.58	54,042,441.20
本期申购	43,195,960.99	33,299,600.22
本期赎回(以“-”号填列)	-751,306.11	-579,175.71
本期末	112,548,030.46	86,762,865.71

##### 6.4.7.7.2 方正鑫悦一年持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	12,701,031.82	12,701,031.82
本期申购	7,775,853.50	7,775,853.50
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	20,476,885.32	20,476,885.32

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 方正鑫悦一年持有债券A

单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	21,407,209.69	-3,495,238.92	17,911,970.77
本期利润	1,632,580.24	1,518,460.48	3,151,040.72
本期基金份额交易产生的变动数	13,387,522.59	-2,250,545.94	11,136,976.65
其中：基金申购款	13,624,026.83	-2,292,382.06	11,331,644.77
基金赎回款	-236,504.24	41,836.12	-194,668.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,427,312.52	-4,227,324.38	32,199,988.14

## 6.4.7.8.2 方正鑫悦一年持有债券C

单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	277,811.41	63,827.64	341,639.05
本期利润	252,963.68	274,178.94	527,142.62
本期基金份额交易产生的变动数	249,706.95	16,274.55	265,981.50
其中：基金申购款	249,706.95	16,274.55	265,981.50
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	780,482.04	354,281.13	1,134,763.17

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	43,944.72

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	1,504.43
其他	80.61
合计	45,529.76

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	18,158,601.05
减：卖出股票成本总额	19,049,445.61
减：交易费用	51,176.67
买卖股票差价收入	-942,021.23

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,785,253.37
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,657,639.00
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	3,442,892.37

##### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转	2,441,371,611.97

股及债券到期兑付)成交总额	
减: 卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	2,414,089,908.62
减: 应计利息总额	25,542,036.15
减: 交易费用	82,028.20
买卖债券差价收入	1,657,639.00

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资收益	22,414.81

#### 6.4.7.13 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	107,475.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	107,475.61

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,848,984.24
——股票投资	1,832,269.73
——债券投资	16,714.51
——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	56,344.82
合计	1,792,639.42

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	74,383.76
汇划手续费	2,713.40
帐户维护费	18,600.00
合计	120,492.35

#### 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
-------	---------

交通银行股份有限公司	基金托管人
方正中期期货有限公司	基金管理人子公司
方正证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
上海天天基金销售有限公司	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 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
方正证券股份有限 公司	53,845,237.01	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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
方正证券股份有限 公司	174,244,834.61	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 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
方正证券股份有限公司	47,000,000.00	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 2022年01月01日至2022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	24,024.43	100.00%	18,567.82	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 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	365,577.46
其中：支付销售机构的客户维护费	80.27

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指

令于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	121,859.17

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C	合计
方正证券股份有限公司	0.00	37,154.87	37,154.87
上海天天基金销售有限公司	0.00	49.63	49.63
合计	-	37,204.50	37,204.50

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费年费率为0.4%。

C类计划份额的销售服务费按前一日C类计划份额的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类计划份额每日应计提的销售服务费

E为C类计划份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

#### 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

方正鑫悦一年持有债券A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,044,740.13
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	1,044,740.13
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.93%

方正鑫悦一年持有债券C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,015,036.25	43,944.72

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（2022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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：张)	总额	总额	
1270 64	杭氧 转债	2022 -05- 19	2个 月	新债 未上 市	100. 00	100. 02	12	1,20 0.00	1,20 0.28	-

#### 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2022年6月30日止，本基金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32,311,220.16元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102002093	20中建四局MTN002	2022-07-04	105.73	100,000	10,573,287.67
102102330	21湖北文旅MTN003	2022-07-04	104.47	53,000	5,536,917.26
180204	18国开04	2022-07-13	103.19	100,000	10,319,493.15
132280008	22人才安居GNO01	2022-07-13	100.08	100,000	10,007,794.52
合计				353,000	36,437,492.60

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	64,859,433.37	1,133,599.35
AAA以下	29,029,218.94	671,298.07
未评级	10,447,013.70	-
合计	104,335,666.01	1,804,897.42

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、地方政府债券及央行票据等。

#### 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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	3,015,036.25	-	-	-	3,015,036.25
结算备付金	121,465.88	-	-	523,034.84	644,500.72
存出保证金	16,425.05	-	-	-	16,425.05
交易性金融资产	55,164,987.51	77,224,169.79	17,247,345.74	20,789,871.77	170,426,374.81
应收股利	-	-	-	5,187.52	5,187.52
应收申购款	-	-	-	199,008.34	199,008.34
其他资产	-	-	-	31,643.52	31,643.52
资产总计	58,317,914.69	77,224,169.79	17,247,345.74	21,548,745.99	174,338,176.21
负债					
卖出回购金融资产款	32,311,220.16	-	-	-	32,311,220.16
应付清算款	-	-	-	1,035,139.51	1,035,139.51
应付管理人报酬	-	-	-	68,139.46	68,139.46
应付托管费	-	-	-	22,713.17	22,713.17
应付销售服务费	-	-	-	6,944.54	6,944.54
应交税费	-	-	-	71,677.32	71,677.32
其他负债	-	-	-	247,839.71	247,839.71

## 方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年中期报告

负债总计	32,311,220.16	-	-	1,452,453.71	33,763,673.87
利率敏感度缺口	26,006,694.53	77,224,169.79	17,247,345.74	20,096,292.28	140,574,502.34
上年度末 2021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	3,683,213.28	-	-	-	3,683,213.28
结算备付金	606,051.37	-	-	-	606,051.37
存出保证金	3,891.57	-	-	-	3,891.57
交易性金融资产	12,748,230.38	2,103,897.35	82,242,966.99	2,235,690.00	99,330,784.72
应收利息	-	-	-	1,508,011.73	1,508,011.73
应收申购款	-	-	-	129,165.84	129,165.84
其他资产	-	-	-	106,027.28	106,027.28
资产总计	17,041,386.60	2,103,897.35	82,242,966.99	3,978,894.85	105,367,145.79
负债					
卖出回购金融资产款	19,403,870.30	-	-	-	19,403,870.30
应付证券清算款	-	-	-	471,656.16	471,656.16
应付管理人报酬	-	-	-	36,531.25	36,531.25
应付托管费	-	-	-	12,177.08	12,177.08
应付销售服务费	-	-	-	5,562.90	5,562.90
应付交易费用	-	-	-	37,699.77	37,699.77

应交税费	-	-	-	23,458.69	23,458.69
应付利息	-	-	-	1,627.28	1,627.28
其他负债	-	-	-	377,479.52	377,479.52
负债总计	19,403,870.30	-	-	966,192.65	20,370,062.95
利率敏感度缺口	-2,362,483.70	2,103,897.35	82,242,966.99	3,012,702.20	84,997,082.84

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

假设	除市场利率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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,012,812.00	1,636,388.88
	市场利率上升25个基点	-1,012,812.00	-1,636,388.88

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,021,566.70	-	3,021,566.70

应收股利	-	5,187.52	-	5,187.52
资产合计	-	3,026,754.2 2	-	3,026,754.2 2
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,026,754.2 2	-	3,026,754.2 2
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	港币对人民币升值5%	151,337.71	0.00
	港币对人民币贬值5%	-151,337.71	0.00

#### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	20,789,871.77	14.79	2,235,690.00	2.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	149,636,503.04	106.45	97,095,094.72	114.23
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	170,426,374.81	121.24	99,330,784.72	116.86

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准下降5%	4,150,346.63	275,163.93
	业绩比较基准上升5%	-4,150,346.63	-275,163.93

## 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	26,956,183.19	2,235,690.00
第二层次	143,470,191.62	97,095,094.72
第三层次	-	-
合计	170,426,374.81	99,330,784.72

##### 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	20,789,871.77	11.93
	其中：股票	20,789,871.77	11.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,636,503.04	85.83
	其中：债券	149,636,503.04	85.83
	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	-	-
	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	3,659,536.97	2.10
8	其他各项资产	252,264.43	0.14
9	合计	174,338,176.21	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为3,021,566.70元，占资产净值比例2.15%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	162,731.00	0.12
B	采矿业	622,735.00	0.44
C	制造业	13,870,266.02	9.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	689,832.00	0.49
E	建筑业	179,627.00	0.13
F	批发和零售业	116,437.75	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	270,777.00	0.19
H	住宿和餐饮业	56,250.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	985,870.50	0.70
J	金融业	389,159.00	0.28
K	房地产业	78,960.00	0.06
L	租赁和商务服务业	44,923.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	178,346.80	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	113,190.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	9,200.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	17,768,305.07	12.64

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	34,070.77	0.02
消费者非必需品	1,091,025.75	0.78
消费者常用品	100,057.23	0.07

能源	-	0.00
金融	67,346.21	0.05
医疗保健	304,498.95	0.22
工业	34,994.37	0.02
信息技术	1,209,962.15	0.86
电信服务	-	0.00
公用事业	-	0.00
房地产	179,611.27	0.13
合计	3,021,566.70	2.15

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	03690	美团-W	2,300	381,979.17	0.27
2	00700	腾讯控股	1,200	363,695.20	0.26
3	300750	宁德时代	600	320,400.00	0.23
4	01810	小米集团-W	23,400	272,956.12	0.19
5	688116	天奈科技	1,400	237,272.00	0.17
6	002594	比亚迪	700	233,443.00	0.17
7	600900	长江电力	9,900	228,888.00	0.16
8	688005	容百科技	1,700	220,048.00	0.16
9	00241	阿里健康	46,000	212,429.20	0.15
10	600519	贵州茅台	100	204,500.00	0.15
11	688390	固德威	620	194,066.20	0.14
12	600905	三峡能源	30,100	189,329.00	0.13
13	300769	德方纳米	460	187,992.80	0.13
14	688063	派能科技	600	187,320.00	0.13
15	002179	中航光电	2,840	179,828.80	0.13

16	300450	先导智能	2,400	151,632.00	0.11
17	002129	TCL中环	2,500	147,225.00	0.10
18	300850	新强联	1,600	142,448.00	0.10
19	300699	光威复材	2,300	135,401.00	0.10
20	01024	快手-W	1,800	134,538.49	0.10
21	01211	比亚迪股份	500	134,264.83	0.10
22	300674	宇信科技	8,400	131,712.00	0.09
23	688981	中芯国际	1,400	63,238.00	0.04
23	00981	中芯国际	4,000	62,189.42	0.04
24	600887	伊利股份	3,200	124,640.00	0.09
25	002192	融捷股份	800	122,960.00	0.09
26	300726	宏达电子	2,000	122,340.00	0.09
27	688598	金博股份	400	117,880.00	0.08
28	688018	乐鑫科技	1,000	112,400.00	0.08
29	605117	德业股份	400	111,956.00	0.08
30	02238	广汽集团	10,000	64,908.92	0.05
30	601238	广汽集团	2,800	42,672.00	0.03
31	300724	捷佳伟创	1,200	107,220.00	0.08
32	688396	华润微	1,800	106,326.00	0.08
33	000683	远兴能源	10,000	105,100.00	0.07
34	000988	华工科技	4,500	104,265.00	0.07
35	600096	云天化	3,300	103,884.00	0.07
36	600765	中航重机	3,220	103,619.60	0.07
37	03968	招商银行	1,500	67,346.21	0.05
37	600036	招商银行	800	33,760.00	0.02
38	002812	恩捷股份	400	100,180.00	0.07
39	00291	华润啤酒	2,000	100,057.23	0.07
40	688017	绿的谐波	840	99,960.00	0.07
41	601615	明阳智能	2,900	98,020.00	0.07
42	300498	温氏股份	4,600	97,934.00	0.07
43	300772	运达股份	3,800	96,672.00	0.07

44	601088	中国神华	2,800	93,240.00	0.07
45	00175	吉利汽车	6,000	91,539.54	0.07
46	603185	上机数控	580	90,474.20	0.06
47	06098	碧桂园服务	3,000	89,666.67	0.06
48	600004	白云机场	6,000	89,460.00	0.06
49	002475	立讯精密	2,600	87,854.00	0.06
50	02382	舜宇光学科技	800	87,503.04	0.06
51	688002	睿创微纳	2,200	87,384.00	0.06
52	002466	天齐锂业	700	87,360.00	0.06
53	688777	中控技术	1,200	87,312.00	0.06
54	09868	小鹏汽车-W	800	86,476.81	0.06
55	688388	嘉元科技	1,000	84,870.00	0.06
56	002240	盛新锂能	1,400	84,504.00	0.06
57	300200	高盟新材	10,000	84,000.00	0.06
58	688083	中望软件	400	83,768.00	0.06
59	002371	北方华创	300	83,136.00	0.06
60	02020	安踏体育	1,000	82,440.32	0.06
61	000858	五粮液	400	80,772.00	0.06
62	603267	鸿远电子	600	80,598.00	0.06
63	688111	金山办公	400	78,848.00	0.06
64	02015	理想汽车-W	600	78,455.13	0.06
65	300001	特锐德	4,500	77,895.00	0.06
66	00772	阅文集团	2,400	77,788.08	0.06
67	000983	山西焦煤	5,800	77,662.00	0.06
68	603799	华友钴业	810	77,452.20	0.06
69	600483	福能股份	5,500	77,385.00	0.06
70	605399	晨光新材	1,800	76,590.00	0.05
71	688052	纳芯微	200	75,792.00	0.05
72	601111	中国国航	3,500	40,635.00	0.03
72	00753	中国国航	6,000	34,994.37	0.02
73	300408	三环集团	2,500	75,250.00	0.05

74	300458	全志科技	2,500	75,225.00	0.05
75	300919	中伟股份	600	74,340.00	0.05
76	600219	南山铝业	20,000	73,800.00	0.05
77	688122	西部超导	800	73,760.00	0.05
78	300748	金力永磁	2,000	73,600.00	0.05
79	01347	华虹半导体	3,000	72,862.19	0.05
80	300661	圣邦股份	400	72,808.00	0.05
81	300073	当升科技	800	72,272.00	0.05
82	000792	盐湖股份	2,400	71,904.00	0.05
83	600438	通威股份	1,200	71,832.00	0.05
84	002984	森麒麟	2,300	71,553.00	0.05
85	002459	晶澳科技	900	71,010.00	0.05
86	603338	浙江鼎力	1,400	70,980.00	0.05
86	600163	中闽能源	8,400	70,980.00	0.05
88	300035	中科电气	2,500	69,875.00	0.05
89	603305	旭升股份	2,300	69,506.00	0.05
90	002507	涪陵榨菜	2,000	69,040.00	0.05
91	300244	迪安诊断	2,200	68,420.00	0.05
92	300014	亿纬锂能	700	68,250.00	0.05
93	601899	紫金矿业	7,300	68,109.00	0.05
94	688707	振华新材	900	68,103.00	0.05
95	03888	金山软件	2,600	68,038.92	0.05
96	600460	士兰微	1,300	67,600.00	0.05
97	603659	璞泰来	800	67,520.00	0.05
98	002738	中矿资源	720	66,679.20	0.05
99	300037	新宙邦	1,260	66,225.60	0.05
100	000703	恒逸石化	6,300	66,213.00	0.05
101	600875	东方电气	4,000	65,800.00	0.05
102	002236	大华股份	4,000	65,680.00	0.05
103	600809	山西汾酒	200	64,960.00	0.05
104	03800	协鑫科技	20,000	64,823.40	0.05

105	300121	阳谷华泰	6,000	64,380.00	0.05
106	300223	北京君正	600	63,750.00	0.05
107	002850	科达利	400	63,600.00	0.05
108	002206	海利得	10,000	63,200.00	0.04
109	688088	虹软科技	2,000	63,180.00	0.04
110	06618	京东健康	1,200	63,164.33	0.04
111	603806	福斯特	960	62,899.20	0.04
112	300760	迈瑞医疗	200	62,640.00	0.04
113	688036	传音控股	700	62,461.00	0.04
114	00968	信义光能	6,000	62,189.42	0.04
115	06969	思摩尔国际	3,000	62,086.79	0.04
116	000002	万科A	3,000	61,500.00	0.04
117	600702	舍得酒业	300	61,197.00	0.04
118	300390	天华超净	700	61,180.00	0.04
119	601666	平煤股份	4,500	61,155.00	0.04
120	000422	湖北宜化	3,000	60,930.00	0.04
121	002938	鹏鼎控股	2,000	60,420.00	0.04
122	300896	爱美客	100	60,001.00	0.04
123	600456	宝钛股份	1,000	59,400.00	0.04
124	603260	合盛硅业	500	58,980.00	0.04
125	300118	东方日升	2,000	58,660.00	0.04
126	688016	心脉医疗	300	58,443.00	0.04
127	688559	海目星	800	58,160.00	0.04
128	600110	诺德股份	5,000	58,100.00	0.04
129	603179	新泉股份	2,000	58,000.00	0.04
130	002415	海康威视	1,600	57,920.00	0.04
131	300777	中简科技	1,200	57,840.00	0.04
132	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.04
133	600741	华域汽车	2,500	57,500.00	0.04
134	600141	兴发集团	1,300	57,187.00	0.04
135	600150	中国船舶	3,000	56,940.00	0.04

136	002557	洽洽食品	1,000	56,930.00	0.04
137	600882	妙可蓝多	1,200	56,160.00	0.04
138	000408	藏格矿业	1,700	55,998.00	0.04
139	300613	富瀚微	660	55,968.00	0.04
140	688208	道通科技	1,700	55,964.00	0.04
141	603010	万盛股份	3,000	55,950.00	0.04
142	300610	晨化股份	3,000	55,890.00	0.04
143	002709	天赐材料	900	55,854.00	0.04
144	300655	晶瑞电材	2,876	55,506.80	0.04
145	300122	智飞生物	500	55,505.00	0.04
146	002009	天奇股份	3,000	55,500.00	0.04
147	688608	恒玄科技	400	55,040.00	0.04
148	002304	洋河股份	300	54,945.00	0.04
149	600089	特变电工	2,000	54,780.00	0.04
150	688303	大全能源	800	54,656.00	0.04
151	000733	振华科技	400	54,388.00	0.04
152	600566	济川药业	2,000	54,320.00	0.04
153	603876	鼎胜新材	1,200	54,240.00	0.04
154	002895	川恒股份	1,600	54,096.00	0.04
155	300316	晶盛机电	800	54,072.00	0.04
156	603348	文灿股份	1,000	53,600.00	0.04
157	300866	安克创新	800	53,056.00	0.04
158	300065	海兰信	4,000	52,400.00	0.04
159	688599	天合光能	800	52,200.00	0.04
160	600859	王府井	2,000	51,960.00	0.04
161	601633	长城汽车	1,400	51,856.00	0.04
162	002271	东方雨虹	1,000	51,470.00	0.04
163	603077	和邦生物	12,000	51,120.00	0.04
164	002568	百润股份	1,700	51,068.00	0.04
165	688776	国光电气	300	50,997.00	0.04
166	603730	岱美股份	3,880	50,866.80	0.04

167	603345	安井食品	300	50,361.00	0.04
168	002202	金风科技	3,400	50,320.00	0.04
169	300285	国瓷材料	1,400	50,288.00	0.04
170	601816	京沪高铁	10,000	50,200.00	0.04
171	600395	盘江股份	5,700	49,989.00	0.04
172	300745	欣锐科技	1,000	49,880.00	0.04
173	000568	泸州老窖	200	49,308.00	0.04
174	300438	鹏辉能源	800	49,160.00	0.03
175	300672	国科微	600	49,056.00	0.03
176	688029	南微医学	560	48,832.00	0.03
177	600389	江山股份	800	48,584.00	0.03
178	300775	三角防务	1,000	48,150.00	0.03
179	300033	同花顺	500	48,075.00	0.03
180	603612	索通发展	1,300	47,905.00	0.03
181	601677	明泰铝业	2,000	47,600.00	0.03
182	00960	龙湖集团	1,500	47,527.18	0.03
183	600295	鄂尔多斯	2,600	46,930.00	0.03
184	300398	飞凯材料	2,000	45,720.00	0.03
185	002756	永兴材料	300	45,663.00	0.03
186	600893	航发动力	1,000	45,510.00	0.03
187	601117	中国化学	4,800	45,168.00	0.03
188	600821	金开新能	7,000	45,080.00	0.03
189	300015	爱尔眼科	1,000	44,770.00	0.03
190	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.03
191	603906	龙蟠科技	1,200	44,328.00	0.03
192	688188	柏楚电子	200	44,008.00	0.03
193	300696	爱乐达	1,000	43,950.00	0.03
194	603982	泉峰汽车	1,800	43,902.00	0.03
195	688128	中国电研	1,800	43,830.00	0.03
196	688289	圣湘生物	1,480	43,822.80	0.03
197	000731	四川美丰	4,800	43,680.00	0.03

198	300957	贝泰妮	200	43,506.00	0.03
199	300369	绿盟科技	4,100	43,132.00	0.03
200	688696	极米科技	140	43,101.80	0.03
201	002191	劲嘉股份	4,000	42,880.00	0.03
202	688363	华熙生物	300	42,654.00	0.03
203	00688	中国海外发展	2,000	42,417.42	0.03
204	688006	杭可科技	600	42,036.00	0.03
205	600660	福耀玻璃	1,000	41,810.00	0.03
206	601009	南京银行	4,000	41,680.00	0.03
207	601187	厦门银行	6,900	41,124.00	0.03
208	600409	三友化工	5,000	40,950.00	0.03
209	688349	三一重能	1,000	40,750.00	0.03
210	688099	晶晨股份	400	40,400.00	0.03
211	002241	歌尔股份	1,200	40,320.00	0.03
212	688223	晶科能源	2,700	40,311.00	0.03
213	002126	银轮股份	3,500	40,075.00	0.03
214	002539	云图控股	2,500	39,975.00	0.03
215	002352	顺丰控股	700	39,067.00	0.03
216	002091	江苏国泰	3,601	38,710.75	0.03
217	600884	杉杉股份	1,300	38,636.00	0.03
218	003035	南网能源	6,000	38,100.00	0.03
219	300474	景嘉微	550	37,614.50	0.03
220	300894	火星人	1,000	37,390.00	0.03
221	603228	景旺电子	1,600	37,328.00	0.03
222	600016	民生银行	10,000	37,200.00	0.03
223	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.03
224	300638	广和通	1,400	37,086.00	0.03
225	002518	科士达	1,200	36,720.00	0.03
226	688008	澜起科技	600	36,348.00	0.03
227	600399	抚顺特钢	2,000	35,800.00	0.03
228	601877	正泰电器	1,000	35,780.00	0.03

229	601995	中金公司	800	35,592.00	0.03
230	000625	长安汽车	2,000	34,640.00	0.02
231	603501	韦尔股份	200	34,606.00	0.02
232	000893	亚钾国际	1,000	34,410.00	0.02
233	300347	泰格医药	300	34,335.00	0.02
234	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.02
235	603127	昭衍新药	300	34,140.00	0.02
236	02689	玖龙纸业	6,000	34,070.77	0.02
237	600745	闻泰科技	400	34,044.00	0.02
238	601058	赛轮轮胎	3,000	33,810.00	0.02
239	603360	百傲化学	2,400	33,672.00	0.02
240	002714	牧原股份	600	33,162.00	0.02
241	603997	继峰股份	3,000	32,640.00	0.02
242	300773	拉卡拉	1,700	32,402.00	0.02
243	601908	京运通	4,000	32,080.00	0.02
244	688239	航宇科技	600	31,980.00	0.02
245	688368	晶丰明源	200	31,972.00	0.02
246	002041	登海种业	1,500	31,635.00	0.02
247	600256	广汇能源	3,000	31,620.00	0.02
248	601186	中国铁建	4,000	31,600.00	0.02
249	603712	七一二	1,000	31,500.00	0.02
250	600754	锦江酒店	500	31,450.00	0.02
251	02331	李宁	500	31,086.16	0.02
252	601012	隆基绿能	460	30,649.80	0.02
253	603606	东方电缆	400	30,640.00	0.02
254	300529	健帆生物	600	30,534.00	0.02
255	603218	日月股份	1,200	30,480.00	0.02
256	600760	中航沈飞	500	30,225.00	0.02
257	688295	中复神鹰	800	29,992.00	0.02
258	002555	三七互娱	1,400	29,722.00	0.02
259	601225	陕西煤业	1,400	29,652.00	0.02

260	688665	四方光电	200	29,600.00	0.02
261	601021	春秋航空	500	29,175.00	0.02
262	01877	君实生物	800	28,905.42	0.02
263	300841	康华生物	250	28,860.00	0.02
264	603986	兆易创新	200	28,442.00	0.02
265	300685	艾德生物	880	28,160.00	0.02
266	605123	派克新材	200	28,144.00	0.02
267	600862	中航高科	1,000	28,100.00	0.02
268	300505	川金诺	900	27,864.00	0.02
269	002245	蔚蓝锂芯	1,200	27,852.00	0.02
270	601800	中国交建	3,000	27,840.00	0.02
271	300036	超图软件	1,400	27,356.00	0.02
272	002340	格林美	3,000	27,300.00	0.02
273	688202	美迪西	80	27,168.80	0.02
274	300999	金龙鱼	500	27,010.00	0.02
275	601778	晶科科技	5,000	27,000.00	0.02
276	002060	粤水电	3,100	26,939.00	0.02
277	600499	科达制造	1,300	26,832.00	0.02
278	600104	上汽集团	1,500	26,715.00	0.02
279	600031	三一重工	1,400	26,684.00	0.02
280	002056	横店东磁	1,000	26,620.00	0.02
281	688639	华恒生物	200	26,336.00	0.02
282	002497	雅化集团	800	26,120.00	0.02
283	600176	中国巨石	1,500	26,115.00	0.02
284	300496	中科创达	200	26,096.00	0.02
285	600276	恒瑞医药	700	25,963.00	0.02
286	603719	良品铺子	900	25,767.00	0.02
287	000063	中兴通讯	1,000	25,530.00	0.02
288	000707	双环科技	1,500	25,485.00	0.02
289	688800	瑞可达	200	25,262.00	0.02
290	002142	宁波银行	700	25,067.00	0.02

291	601628	中国人寿	800	24,864.00	0.02
292	600258	首旅酒店	1,000	24,800.00	0.02
293	603486	科沃斯	200	24,378.00	0.02
294	688779	长远锂科	1,200	24,000.00	0.02
295	300759	康龙化成	250	23,805.00	0.02
296	600328	中盐化工	1,000	23,550.00	0.02
297	601888	中国中免	100	23,293.00	0.02
298	600305	恒顺醋业	1,800	23,220.00	0.02
299	601128	常熟银行	3,000	22,920.00	0.02
300	688110	东芯股份	600	22,752.00	0.02
301	688636	智明达	200	22,678.00	0.02
302	603707	健友股份	800	22,560.00	0.02
303	000776	广发证券	1,200	22,440.00	0.02
304	688317	之江生物	600	22,434.00	0.02
305	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.02
306	601919	中远海控	1,600	22,240.00	0.02
307	002946	新乳业	1,700	22,083.00	0.02
308	300768	迪普科技	1,350	21,802.50	0.02
309	601618	中国中冶	6,200	21,700.00	0.02
310	002183	怡亚通	3,000	21,630.00	0.02
311	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.02
312	00285	比亚迪电子	1,000	21,165.95	0.02
313	688100	威胜信息	1,000	20,990.00	0.01
314	002487	大金重工	500	20,865.00	0.01
315	603259	药明康德	200	20,798.00	0.01
316	002384	东山精密	900	20,637.00	0.01
317	002493	荣盛石化	1,300	20,007.00	0.01
318	601166	兴业银行	1,000	19,900.00	0.01
319	300601	康泰生物	440	19,879.20	0.01
320	601138	工业富联	2,000	19,680.00	0.01
321	300820	英杰电气	300	19,365.00	0.01

322	603693	江苏新能	1,000	19,200.00	0.01
323	688408	中信博	200	18,496.00	0.01
324	603786	科博达	300	18,471.00	0.01
325	600863	内蒙华电	5,000	18,250.00	0.01
326	600508	上海能源	1,000	18,090.00	0.01
327	601001	晋控煤业	1,000	17,750.00	0.01
328	600048	保利发展	1,000	17,460.00	0.01
329	002572	索菲亚	600	16,500.00	0.01
330	600123	兰花科创	1,000	16,450.00	0.01
331	601669	中国电建	2,000	15,740.00	0.01
332	002430	杭氧股份	500	15,630.00	0.01
333	601898	中煤能源	1,500	15,570.00	0.01
334	603833	欧派家居	100	15,068.00	0.01
335	000937	冀中能源	2,000	14,920.00	0.01
336	002460	赣锋锂业	100	14,870.00	0.01
337	601377	兴业证券	2,100	14,805.00	0.01
338	603026	石大胜华	100	14,535.00	0.01
339	688037	芯源微	100	14,497.00	0.01
340	688161	威高骨科	300	14,457.00	0.01
341	601398	工商银行	3,000	14,310.00	0.01
342	300373	扬杰科技	200	14,250.00	0.01
343	688268	华特气体	200	14,052.00	0.01
344	601985	中国核电	2,000	13,720.00	0.01
345	000651	格力电器	400	13,488.00	0.01
346	300502	新易盛	500	13,100.00	0.01
347	688385	复旦微电	200	13,038.00	0.01
348	000333	美的集团	200	12,078.00	0.01
349	603517	绝味食品	200	11,564.00	0.01
350	603288	海天味业	120	10,843.20	0.01
351	601668	中国建筑	2,000	10,640.00	0.01
352	600600	青岛啤酒	100	10,392.00	0.01

353	600298	安琪酵母	200	9,750.00	0.01
354	600779	水井坊	100	9,254.00	0.01
355	600977	中国电影	800	9,200.00	0.01
356	688690	纳微科技	72	5,818.32	0.00
357	600999	招商证券	400	5,764.00	0.00
358	600547	山东黄金	300	5,568.00	0.00
359	600522	中天科技	100	2,310.00	0.00
360	601838	成都银行	100	1,658.00	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	300750	宁德时代	633,105.44	0.74
2	00700	腾讯控股	474,664.95	0.56
3	600900	长江电力	424,920.55	0.50
4	300769	德方纳米	366,500.00	0.43
5	03690	美团-W	357,241.23	0.42
6	002594	比亚迪	323,541.00	0.38
7	601088	中国神华	296,282.00	0.35
8	300674	宇信科技	280,670.00	0.33
9	688598	金博股份	269,345.70	0.32
10	601111	中国国航	267,955.00	0.32
11	01810	小米集团-W	250,324.29	0.29
12	00241	阿里健康	242,082.30	0.28
13	688116	天奈科技	237,503.20	0.28
14	600905	三峡能源	236,982.00	0.28
15	688063	派能科技	219,764.00	0.26
16	002371	北方华创	212,086.00	0.25

17	002812	恩捷股份	210,860.00	0.25
18	688390	固德威	208,786.00	0.25
19	600765	中航重机	205,776.60	0.24
20	688005	容百科技	199,978.04	0.24

#### 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	300750	宁德时代	524,992.00	0.62
2	300772	运达股份	253,720.00	0.30
3	601088	中国神华	230,469.00	0.27
4	300769	德方纳米	219,732.20	0.26
5	601111	中国国航	208,402.00	0.25
6	600900	长江电力	200,317.00	0.24
7	601878	浙商证券	191,151.00	0.22
8	300674	宇信科技	156,252.00	0.18
9	002487	大金重工	149,487.00	0.18
10	688598	金博股份	146,162.00	0.17
11	600522	中天科技	139,489.00	0.16
12	300782	卓胜微	137,385.00	0.16
13	002756	永兴材料	129,750.00	0.15
14	002709	天赐材料	128,174.00	0.15
15	002466	天齐锂业	124,531.00	0.15
16	600438	通威股份	123,484.00	0.15
17	002371	北方华创	123,110.00	0.14
18	688169	石头科技	122,856.00	0.14
19	601066	中信建投	122,167.00	0.14
20	600048	保利发展	121,890.00	0.14

#### 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	35,771,357.65
卖出股票收入（成交）总额	18,158,601.05

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,885,743.76	6.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,689,771.24	39.62
	其中：政策性金融债	35,344,908.22	25.14
4	企业债券	25,357,446.58	18.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	52,465,844.71	37.32
7	可转债(可交换债)	6,167,511.70	4.39
8	同业存单	-	-
9	其他	1,070,185.05	0.76
10	合计	149,636,503.04	106.45

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220206	22国开06	200,000	20,007,106.85	14.23
2	102002093	20中建四局MTN002	100,000	10,573,287.67	7.52
3	101901246	19湘建工MTN003	100,000	10,545,000.00	7.50
4	102102330	21湖北文旅MTN003	100,000	10,447,013.70	7.43
5	180204	18国开04	100,000	10,319,493.15	7.34

**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****7.11.1 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。

**7.11.2 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，适度调整风险敞口以降低利率波动风险对基金的影响。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

**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	16,425.05
2	应收清算款	-

3	应收股利	5,187.52
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,008.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,643.52
8	其他	-
9	合计	252,264.43

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	294,426.08	0.21
2	110079	杭银转债	200,452.82	0.14
3	127040	国泰转债	161,249.64	0.11
4	110053	苏银转债	157,471.06	0.11
5	113051	节能转债	155,717.05	0.11
6	123107	温氏转债	150,991.28	0.11
7	127017	万青转债	145,974.05	0.10
8	127032	苏行转债	136,319.61	0.10
9	127045	牧原转债	135,449.78	0.10
10	127049	希望转2	135,102.06	0.10
11	113045	环旭转债	134,072.99	0.10
12	110081	闻泰转债	123,182.60	0.09
13	128029	太阳转债	121,949.95	0.09
14	113044	大秦转债	119,968.86	0.09
15	110048	福能转债	113,581.75	0.08
16	127006	敖东转债	100,350.17	0.07
17	110056	亨通转债	97,655.87	0.07
18	113052	兴业转债	94,921.13	0.07
19	127012	招路转债	91,609.55	0.07

20	110077	洪城转债	85,081.35	0.06
21	128129	青农转债	84,000.58	0.06
22	113024	核建转债	83,835.64	0.06
23	113037	紫银转债	82,068.23	0.06
24	128034	江银转债	79,624.75	0.06
25	123048	应急转债	75,065.79	0.05
26	127038	国微转债	66,957.21	0.05
27	127030	盛虹转债	66,183.47	0.05
28	110075	南航转债	65,726.60	0.05
29	110062	烽火转债	65,302.85	0.05
30	128136	立讯转债	62,917.53	0.04
31	110064	建工转债	61,929.38	0.04
32	113616	韦尔转债	60,029.69	0.04
33	128048	张行转债	56,918.84	0.04
34	123035	利德转债	53,524.16	0.04
35	113049	长汽转债	51,266.68	0.04
36	127036	三花转债	49,579.91	0.04
37	127028	英特转债	46,056.18	0.03
38	127025	冀东转债	45,919.53	0.03
39	113516	苏农转债	45,409.43	0.03
40	110045	海澜转债	43,662.85	0.03
41	110073	国投转债	42,801.92	0.03
42	110083	苏租转债	42,366.49	0.03
43	113013	国君转债	42,032.15	0.03
44	123108	乐普转2	39,830.14	0.03
45	127039	北港转债	33,155.12	0.02
46	110067	华安转债	33,048.74	0.02
47	113011	光大转债	31,899.25	0.02
48	113021	中信转债	27,344.97	0.02
49	113017	吉视转债	22,914.88	0.02
50	110059	浦发转债	21,200.19	0.02

51	110057	现代转债	18,134.10	0.01
52	127005	长证转债	17,360.31	0.01
53	128107	交科转债	13,655.98	0.01
54	113046	金田转债	13,545.40	0.01
55	113042	上银转债	10,508.41	0.01
56	113043	财通转债	5,541.62	0.00

### 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。

## § 8 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 鑫悦 一年 持有 债券A	1,376	81,793.63	1,093,949.67	0.97%	111,454,080.79	99.03%
方正 鑫悦 一年 持有 债券C	263	77,858.88	1,286,858.61	6.28%	19,190,026.71	93.72%
合计	1,639	81,162.24	2,380,808.28	1.79%	130,644,107.50	98.21%

### 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	方正鑫悦一年持 有债券A	1,730,688.33	1.54%
	方正鑫悦一年持 有债券C	391,560.84	1.91%
	合计	2,122,249.17	1.60%

### 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	方正鑫悦一年持有 债券A	0
	方正鑫悦一年持有 债券C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	方正鑫悦一年持有 债券A	0
	方正鑫悦一年持有 债券C	10~50
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	方正鑫悦一年持有债券 A	方正鑫悦一年持有债券 C
基金合同生效日(2021年09月16 日)基金份额总额	6,533,709.38	-
本报告期期初基金份额总额	70,103,375.58	12,701,031.82
本报告期基金总申购份额	43,195,960.99	7,775,853.50
减：本报告期基金总赎回份额	751,306.11	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	112,548,030.46	20,476,885.32
-------------	----------------	---------------

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2022年4月8日发布公告，徐子兵先生自2022年4月6日起担任方正证券股份有限公司资产管理业务分管领导。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 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

本基金管理人、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	2	53,845,237.01	100.0	24,024.43	100.0	-

证券			0%		0%	
----	--	--	----	--	----	--

### 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	174,244,834.61	100.00%	47,000,000.00	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	方正证券股份有限公司资产管理业务高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-08
2	方正证券股份有限公司财务负责人变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-30

## § 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、中国证监会准予方正金泉友2号集合资产管理计划变更的文件
- 2、《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《方正证券鑫悦一年持有期债券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  
二〇二二年八月三十一日