

---

方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2022年第3季度报告

2022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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月21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2022年07月01日起至2022年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	方正证券鑫享三个月滚动债券	
基金主代码	970150	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月25日	
报告期末基金份额总额	229,745,966.78份	
投资目标	本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，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。	
基金管理人	方正证券股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	方正证券鑫享三个月滚	方正证券鑫享三个月滚

	动债券C	动债券E
下属分级基金的交易代码	970150	970151
报告期末下属分级基金的份额总额	214,745,966.78份	15,000,000.00份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年07月01日 - 2022年09月30日)	
	方正证券鑫享三个月滚动债券C	方正证券鑫享三个月滚动债券E
1. 本期已实现收益	1,190,357.95	104,469.61
2. 本期利润	919,847.99	90,849.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0061
4. 期末基金资产净值	216,556,843.63	15,090,849.32
5. 期末基金份额净值	1.0084	1.0061

注：1、基金合同生效日为2022年5月25日，方正证券鑫享三个月滚动债券E自2022年7月1日起开放申购和赎回业务。

2、上表所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

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

方正证券鑫享三个月滚动债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.68%	0.02%	0.53%	0.01%	0.15%	0.01%
自基金合同	0.84%	0.01%	0.73%	0.01%	0.11%	0.00%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

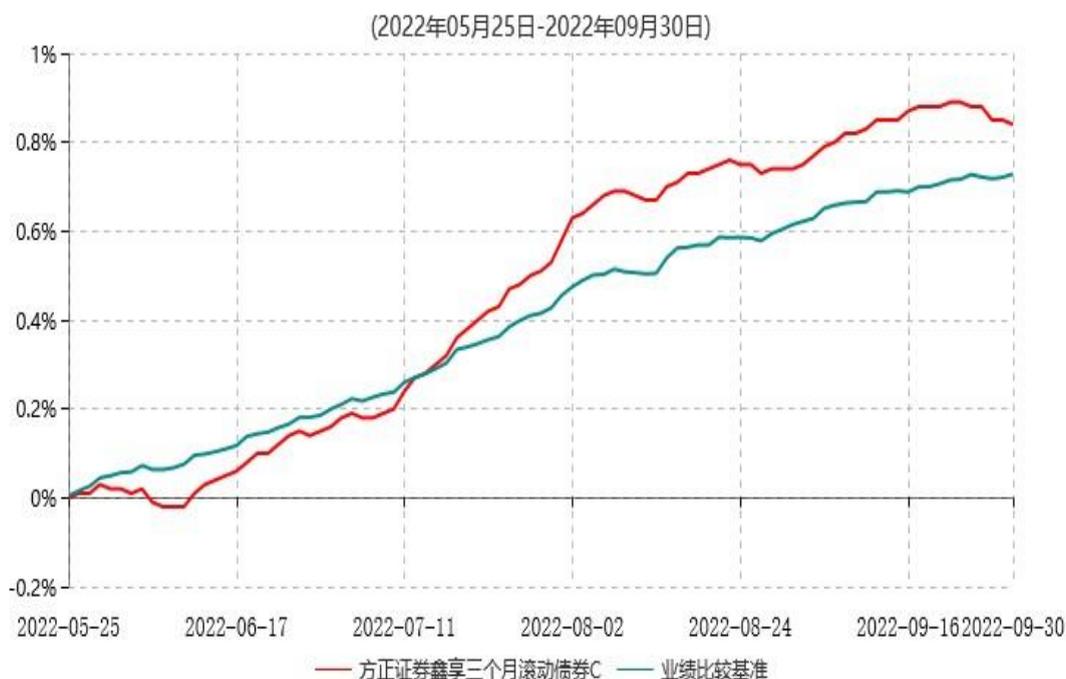
方正证券鑫享三个月滚动债券E净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.61%	0.01%	0.46%	0.01%	0.15%	0.00%

注：基金合同生效日为 2022 年 5 月 25 日，方正证券鑫享三个月滚动债券 E 自 2022 年 7 月 1 日起开放申购和赎回业务，首个投资者于 2022 年 7 月 12 日提交申购申请。

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

方正证券鑫享三个月滚动债券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



注：1、基金合同生效日为 2022 年 5 月 25 日。截至 2022 年 9 月 30 日，本基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2022 年 5 月 25 日生效，建仓期 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定，目前本基金还在建仓期内。

方正证券鑫享三个月滚动债券E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：1、基金合同生效日为 2022 年 5 月 25 日，方正证券鑫享三个月滚动债券 E 自 2022 年 7 月 1 日起开放申购和赎回业务，首个投资者于 2022 年 7 月 12 日提交申购申请。截至 2022 年 9 月 30 日，本基金合同生效不满一年。

2、本基金合同于 2022 年 5 月 25 日生效，建仓期 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定，目前本基金还在建仓期内。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨浩波	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固定收益投资总监	2022-05-25	-	18 年	男，经济学硕士，二十余年从业经验，历任宏源证券固收研究员、东方基金固收研究员、北京银行总行理财业务主管、齐鲁证券北京资产管理分公司固收业务负责人，具有丰富的大型资金运作经验，对

					宏观经济、货币政策和债券市场均有较强的分析把握能力，投资风格稳健。目前担任方正证券股份有限公司资管债券投资部固定收益投资总监，全面负责固定收益投资工作。
宫健	本基金的基金经理	2022-05-25	-	10 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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易

等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内债券市场收益率呈现大幅下行、触底回升的“V”形走势。7月份，受到市场资金面宽松、疫情发酵、房贷断供等消息的刺激，债券市场收益率持续下行。李克强总理在世界经济论坛表示“不会为过高增长目标而出台超大规模刺激措施”、政治局会议表示“保持经济运行在合理区间，力争实现最好结果”等消息，强化了市场关于政策保持克制、经济复苏缓慢的预期。进入8月份，由于主要经济指标增长力度偏弱，8月15日央行超预期下调公开市场逆回购利率和中期借贷便利利率各10BP，再次点燃了市场的做多热情，债券收益率大幅下行，并在随后几日创下今年以来的收益率低点。但是，8月24日国务院常务会议布署稳经济一揽子政策的19项接续政策措施，后续部分城市根据因城施策的原则逐渐放松地产政策，增强了市场对于稳增长政策逐渐见效的预期。在止盈盘带动下，债券收益率从8月下旬开始触底反弹。进入9月份，统计局公布的8月份我国主要经济指标总体改善，验证了前述对于稳增长政策见效的预期。同时，美联储鹰派加息、美债收益率大幅上行、人民币汇率贬值等消息对国内债券市场形成利空影响。9月下旬，受季末因素影响，市场回购利率明显攀升，进一步推动国内债券市场收益率上行。截至9月末，中国10年期国债收益率报2.76%，较上季度末下行约6BP。

投资运作方面，本产品从三季度开始进入常规化开放状态，产品规模逐渐增长，主要配置高等级、中短久期城投债。结合市场收益率波动，适当调整配置节奏，在8月15日公开市场降息后，放缓了配置节奏。为了满足流动性要求，配置一定比例的国债和逆回购资产。

展望后市，市场将在经济下行和政策托底之间进行博弈，由于经济复苏的趋势还未确立，宽松政策退出还为时尚早，未来宏观环境和政策环境总体上仍然有利于债券市场。本产品将坚持稳健的投资策略，争取为投资者实现资金的长期保值增值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券鑫享三个月滚动债券C基金份额净值为1.0084元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.68%，同期业绩比较基准收益率为0.53%；截至报告期

末方正证券鑫享三个月滚动债券E基金份额净值为1.0061元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.61%，同期业绩比较基准收益率为0.46%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	196,221,538.18	84.15
	其中：债券	196,221,538.18	84.15
	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	33,003,289.98	14.15
	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	3,378,149.33	1.45
8	其他资产	583,872.43	0.25
9	合计	233,186,849.92	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

1	国家债券	23,524,535.34	10.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	105,501,334.35	45.54
5	企业短期融资券	15,209,701.37	6.57
6	中期票据	51,985,967.12	22.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	196,221,538.18	84.71

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	101900339	19海兴MTN001	100,000	10,588,369.86	4.57
2	152714	20曲控一	100,000	10,515,917.81	4.54
3	101900402	19青岛城投MTN001	100,000	10,502,000.00	4.53
4	185377	22三投01	100,000	10,375,991.78	4.48
5	102100812	21湘高速MTN003	100,000	10,347,731.51	4.47

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,252.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	575,620.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	583,872.43

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	方正证券鑫享三个月滚动债券C	方正证券鑫享三个月滚动债券E
报告期期初基金份额总额	72,237,741.62	-
报告期期间基金总申购份额	174,266,421.31	15,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	31,758,196.15	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	214,745,966.78	15,000,000.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	方正证券鑫享三个月 滚动债券C	方正证券鑫享三个月 滚动债券E
报告期期初管理人持有的本基金份 额	4,192,732.58	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份 额	4,192,732.58	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例 (%)	1.95	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022/7/2 方正证券股份有限公司关于方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告

2022/9/19 方正证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划增加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为代销机构的公告

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予方正金泉友灵活配置集合资产管理计划变更的文件
- 2、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、方正证券鑫享三个月滚动持有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

## 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

2022年10月26日