

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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 03 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。本年度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3月17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。

本报告中财务资料已经审计。信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 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	70
8.7 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	70
8.8 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	70
8.9 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	70

8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12	投资组合报告附注.....	71
§9	基金份额持有人信息.....	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.3	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.....	72
§10	开放式基金份额变动.....	72
§11	重大事件揭示.....	73
11.1	基金份额持有人大会决议.....	73
11.2	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.....	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4	基金投资策略的改变.....	73
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	73
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8	其他重大事件.....	74
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	76
12.1	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.....	76
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§13	备查文件目录.....	76
13.1	备查文件目录.....	76
13.2	存放地点.....	76
13.3	查阅方式.....	76

§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	1,571,057,763.26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	4,392,099.41份	1,566,665,663.85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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.foundersc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座9层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任	北京市西城区太平桥大街17号

	公司	
--	----	--

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年		2021年		2020年09月07日 (基金合同生效日)-2020年12月31日	
	方正证券金立方A	方正证券金立方C	方正证券金立方A	方正证券金立方C	方正证券金立方A	方正证券金立方C
本期已实现收益	-1,895,405.86	-541,454,411.06	-480,511.22	-155,296,963.53	473,788.16	14,913,306.02
本期利润	-2,358,642.95	-679,783,487.78	-685,916.01	-288,754,516.52	868,956.42	191,119,925.92
加权平均基金份额本期利润	-0.4729	-0.3744	-0.0894	-0.0948	0.0744	0.0892
本期加权平均净值利润率	-45.63%	-46.91%	-6.43%	-8.99%	5.55%	8.71%
本期基金份额净值增长率	-35.79%	-35.40%	-7.88%	-7.32%	6.09%	8.37%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	-687,816.58	-550,251,414.50	1,687,758.04	-86,672,051.86	4,620,376.10	13,922,848.47
期末可供分配基金份额利润	-0.1566	-0.3512	0.3136	-0.0392	0.4259	0.0060
期末基金资产净值	3,704,282.83	1,016,414,249.35	7,069,922.88	2,221,751,034.21	15,469,524.98	2,534,317,961.70
期末基金份额净值	0.8434	0.6488	1.3136	1.0044	1.4259	1.0837
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值	-37.25%	-35.12%	-2.27%	0.44%	6.09%	8.37%

增长率						
-----	--	--	--	--	--	--

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
过去三个月	-8.44%	1.01%	1.31%	0.77%	-9.75%	0.24%
过去六个月	-22.89%	1.31%	-7.71%	0.66%	-15.18%	0.65%
过去一年	-35.79%	1.43%	-11.94%	0.77%	-23.85%	0.66%
自基金合同生效起至今	-37.25%	1.22%	-7.88%	0.72%	-29.37%	0.50%

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
过去三个月	-8.30%	1.01%	1.31%	0.77%	-9.61%	0.24%
过去六个月	-22.65%	1.31%	-7.71%	0.66%	-14.94%	0.65%
过去一年	-35.40%	1.43%	-11.94%	0.77%	-23.46%	0.66%
自基金合同生效起至今	-35.12%	1.22%	-6.97%	0.72%	-28.15%	0.50%

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

(2020年09月07日-2022年12月31日)



方正证券金立方C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月16日-2022年12月31日)



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效日为2020年09月07日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



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，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，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 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12月31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		
傅岳鹏	本基金的基金经理	2021-09-27	-	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	本基金的基金经理	2022-08-16	-	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。
廖帅	已离任基金经理	2020-09-07	2022-08-16	5年	北京大学光华管理学院经济学硕士，国立政治大学

					(中国台湾) 资讯管理学系、经济学系双学士，曾任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部研究员、泰康资产管理有限责任公司金融工程研究高级经理。2017年加入方正证券股份有限公司，现任资管权益投资部高级副总裁、权益量化投资经理。
高君	已离任基金经理	2021-11-23	2022-04-27	7年	2014年8月-2021年10月期间，于中信建投证券股份有限公司交易部从事投资研究工作。2021年11月加入方正证券股份有限公司资管权益投资部，任投资经理。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

2022年权益市场大体维持震荡向下走势，主要指数方面，上证综指下跌15.13%，创业板指下跌29.37%，沪深300下跌21.63%。全年分成几个阶段，年初至9月中旬前本集合计划配置较多的成长股票，与创业板指数的下跌幅度相近；9月起至11月，配置军工、能源和上游资源股票为主，净值阶段性修复。11月起市场风格发生较大幅度偏移，以食品饮料、消费服务、金融、医药等行业的股票和大盘价值股票涨幅居前，前期机构配置较多的以新能源为代表的成长股跌幅较大，本集合计划净值也跟随调整。本报告期末，本集合计划配置仍偏向以医药、科技、军工为主的成长股，因此本报告期产品净值出现一定下跌。

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0.8434元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-35.79%，同期业绩比较基准收益率为-11.94%；截至报告期末方正证券金立方C基金份额净值为0.6488元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-35.40%，同期业绩比较基准收益率为-11.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年A股经历了宽幅的震荡下跌，期间受到美元加息、地缘冲突、房地产风险、疫情管控等多重负面因素的影响。目前来看，美联储加息接近尾声，人民币贬值压力减

弱，房地产政策导向发生重要调整，社会和经济活动逐步回归正常化。国内经济弱势复苏，存在不确定性，宏观层面出口数据快速回落，消费受制于居民资产负债表收缩需要较长的修复过程，房地产投资仍在探底，基建投资能否保持高位增速存疑；微观层面上上市公司净利润季度同比增速仍在下行，可能需要到年中才能看到经济宏观、微观层面数据的确切拐点。

展望2023年，预计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。刺激消费和投资、解决科技卡脖子、保障产业链安全是提振经济的重要抓手，我们需要沿着政策刺激和产业发展的思路，在具备持续成长能力的领域内，挖掘结构转型、国产替代、自主安全、消费迭代带来的投资机会。经历年末年初的反弹，挖掘投资机会的难度增加，我们会加大行业和个股的研究深度，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人勤勉尽责、规范运作，从防范风险、保护基金份额持有人利益的角度出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，持续优化内控机制，确保各项法规和管理制度的落实。内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、内控制度体系建设

为加强公司资产管理业务的合规管理与风险管理，建立健全公司资产管理业务内部控制体系，管理人根据监管规定及内控管理需要，制定和修订了包括投资者适当性、反洗钱、投资决策、集中交易、公平交易、交易对手管理、会计核算、风险控制、合规管理、投诉处理等规范资产管理业务开展的一系列制度，涵盖了产品设计、募集、研究、投资、交易、会计核算、信息披露、清算、信息技术、投资者服务等各个环节，明确了各环节的岗位和职责，并通过考核管理、员工违规违纪行为处罚管理建立了激励和约束机制。

2、日常合规管理工作

公司合规部及资管分公司资产管理业务管理部合规团队严格根据法律法规和公司制度的相关规定，对资产管理业务开展合规咨询、合规评估、合规审查、合规检查、合规宣导、合规培训等工作，并对员工执业行为进行监督管理，促进资产管理业务合规、稳健发展。

3、日常风险管理工作

公司风险管理部及资管分公司资产管理业务管理部风控团队严格根据法律法规和公司制度规定的权限和程序，通过完善风险控制系统与机制、严格准入管理、投前尽职调查、事前审批、事中事后监控等方式，对基金的投资运作过程进行风险控制。

本基金管理人将持续加强合规管理、风险管理工作，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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2022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 托管人对本年度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2022年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	XYZH/2023BJAB1B0188

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称金立方集合计划）财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（计划净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定和财务报表附注二所述的编制基础编制，公允反映了金立方集合计划2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产（计划净值）变化情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金立方集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	金立方集合计划管理人（以下简称管理人）方正证券股份有限公司负责按照企业会计准则的规

	<p>定和财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估金立方集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算金立方集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督金立方集合计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对金立方集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计</p>

	<p>准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金立方集合计划不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	晁小燕、杜伟
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座9层
审计报告日期	2023-03-28

§7 年度财务报表

7.1 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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	163,925,275.68	110,669,370.34
结算备付金		4,098,529.12	33,733,272.05
存出保证金		761,220.77	1,705,778.40
交易性金融资产	7.4.7.2	825,848,465.34	2,022,903,880.76
其中：股票投资		754,025,710.27	1,890,538,644.06
基金投资		-	-
债券投资		71,822,755.07	132,365,236.70
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	140,000,140.01	76,000,076.00
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		-	2,686,829.66
应收股利		-	-
应收申购款		54,311.14	60,074.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	54,575.12	1,791,314.46
资产总计		1,134,742,517.18	2,249,550,596.23
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		111,748,378.50	8,226,160.94
应付赎回款		947,017.75	3,126,786.59
应付管理人报酬		542,802.23	1,171,848.64
应付托管费		225,361.30	486,738.54
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	7.4.7.6	1,160,425.22	7,718,104.43
负债合计		114,623,985.00	20,729,639.14
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,571,057,763.26	2,217,373,077.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-550,939,231.08	11,447,879.58
净资产合计		1,020,118,532.18	2,228,820,957.09
负债和净资产总计		1,134,742,517.18	2,249,550,596.23

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额1,571,057,763.26份，其中A类基金份额净值（暂估业绩报酬前）0.8434元，基金份额总额4,392,099.41份，资产净值（暂估业绩报酬前）3,704,282.83元，相关暂估业绩报酬0.00元，资产净值（暂估业绩报酬后）3,704,282.83元；C类基金份额净值（暂估业绩报酬前）0.6488元，基金份额总额1,566,665,663.85份，资产净值（暂估业绩报酬前）1,016,414,249.35元，相关暂估业绩报酬243.70元，资产净值（暂估业绩报酬后）1,016,414,005.65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。

7.2 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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-669,339,182.08	-206,681,051.76
1.利息收入		2,036,840.77	15,595,055.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	591,611.69	2,073,431.33
债券利息收入		-	5,700,824.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收		1,445,229.08	7,820,799.82

入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-532,583,709.04	-87,978,332.94
其中: 股票投资收益	7.4.7.10	-546,168,937.79	-122,876,717.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,868,788.96	-1,280,281.78
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	11,716,439.79	36,178,666.18
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)	7.4.7.14	-138,792,313.81	-134,305,905.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.15	-	8,131.32
减: 二、营业总支出		12,802,948.65	82,759,380.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,819,181.05	19,482,027.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,661,673.72	8,090,648.01
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		-	-500,138.15
8. 其他费用	7.4.7.16	322,093.88	55,686,843.48

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-682,142,130.73	-289,440,432.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-682,142,130.73	-289,440,432.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-682,142,130.73	-289,440,432.53

7.3 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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	-646,315,314.25	-	-562,387,110.66	-1,208,702,424.91
（一）、综合收益总额	-	-	-682,142,130.73	-682,142,130.73
（二）、本期基	-646,315,314.25	-	119,755,020.07	-526,560,294.18

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	14,166,604.78	-	-2,704,136.42	11,462,468.36
2.基金赎回款	-660,481,919.03	-	122,459,156.49	-538,022,762.54
(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)	1,571,057,763.26	-	-550,939,231.08	1,020,118,532.18
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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)	2,349,368,701.66	-	200,418,785.02	2,549,787,486.68
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)	2,349,368,701.66	-	200,418,785.02	2,549,787,486.68

值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-131,995,624.15	-	-188,970,905.44	-320,966,529.59
(一)、综合收益总额	-	-	-289,440,432.53	-289,440,432.53
(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)	-131,995,624.15	-	100,469,527.09	-31,526,097.06
其中：1.基金申购款	1,065,441,401.91	-	136,871,877.74	1,202,313,279.65
2.基金赎回款	-1,197,437,026.06	-	-36,402,350.65	-1,233,839,376.71
(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)	2,217,373,077.51	-	11,447,879.58	2,228,820,957.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2022年1月1日至12月31日的经营成果和净资产（计划净值）变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2022年1月1日至12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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业务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 and 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、估值原则

集合计划管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

2、估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括

停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 本集合计划投资股指期货合约、国债期货合约，一般以股指期货当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(5) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 当发生大额申购或赎回情形时，集合计划管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如集合计划管理人或集合计划托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照集合计划管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。由于参与、退出引起的实收基金的变动分别于集合计划参与确认日、退出确认日列示。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 托管费：集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.25%年费率计提，计算方法如下：

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

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，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。

(2) 固定管理费：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：

$H = E \times I \div \text{当年天数}$ ，其中：

H为各类计划份额每日应计提的固定管理费

E为该类计划份额前一日资产净值

I为该类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，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。

(3) 证券交易费用：集合计划投资运作期间所发生的证券交易和结算税费，包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其它类似性质的费用等，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由管理人向托管人发送划付指令，通知托管人从集合计划资产中支付。

(4) 集合计划注册登记费用：集合计划投资运作期间支付给注册登记机构的注册、登记费，包括但不限于中登公司服务月费等，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或

协议的具体规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由管理人向托管人发送划付指令，通知托管人从集合计划资产中支付。

(5) 管理人的业绩报酬

1) 管理人提取业绩报酬的条件和计算方法

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。

① 期间年化收益率计算：

$$\text{期间年化收益率} R = [(P_1 - P_0) / P_0^x] \times (365 \div T)$$

P_1 = 集合计划份额持有人本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P_0 = 集合计划份额持有人上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P_0^x = 集合计划份额持有人上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

T = 集合计划份额持有人上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

② 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬：

管理人根据期间年化收益率对A类计划份额收益超过9%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬；对C类计划份额收益超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下：

A类计划份额 期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬（E）计算公式
$R \leq 9\%$	0	$E=0$
$R > 9\%$	20%	$E = N \times P_0^x \times (R - 9\%) \times 20\% \times (T \div 365)$
C类计划份额 期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 6\%$	0	$E=0$
$R > 6\%$	20%	$E = N \times P_0^x \times (R - 6\%) \times 20\% \times (T \div 365)$

注：N= 集合计划份额持有人该笔申购在上一个业绩报酬计提日的份额数。

2) 业绩报酬的支付

业绩报酬由管理人负责计算。当因赎回时提取业绩报酬的，于赎回款确认日起5个工作日内托管人根据管理人的指令将赎回款以及业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。当因分红和产品终止时提取业绩报酬的，于业绩报酬计提日起5个工作日内托管人根据管理人的指令将业绩报酬划拨给管理人。

3) 暂估业绩报酬的计算方法

暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。

（6）其他费用：

1）除法律法规、中国证监会另有规定外，《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；

2）《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

3）集合计划份额持有人大会费用；

4）集合计划的银行汇划费用；

5）集合计划的相关账户开户及维护费用；

6）按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

以上费用由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由管理人向托管人发送划付指令，通知托管人从集合计划资产中支付。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为12次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的10%，若《资产管理合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。

3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。

4、本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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号一套期会计》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、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收申购款和其他资产-待摊费用，金额分别为110,669,370.34元、33,733,272.05元、1,705,778.40元、76,000,076.00元、

2,686,829.66元、1,736,739.34元、60,074.56元和54,575.12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、买入返售金融资产、应收清算款、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110,679,254.33元、33,749,969.94元、1,706,622.76元、75,973,335.67元、2,686,829.66元、0.00元、60,074.56元和54,575.12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2,022,903,880.76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2,024,639,934.19元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为8,226,160.94元、3,126,786.59元、1,171,848.64元、486,738.54元、7,532,804.48元和185,299.95元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、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8,226,160.94元、3,126,786.59元、1,171,848.64元、486,738.54元、7,532,804.48元和185,299.95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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	163,925,275.68	110,669,370.34
等于：本金	163,914,427.59	110,669,370.34
加：应计利息	10,848.09	-
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	163,925,275.68	110,669,370.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	848,309,816.91	-	754,025,710.27	-94,284,106.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	70,610,479.00	1,429,795.07	71,822,755.07	-217,519.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	70,610,479.00	1,429,795.07	71,822,755.07	-217,519.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	918,920,295.91	1,429,795.07	825,848,465.34	-94,501,625.64	
项目	上年度末 2021年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	

股票	1,846,195,143.96	-	1,890,538,644.06	44,343,500.10	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	132,418,048.63	-	132,365,236.70	-52,811.93
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	132,418,048.63	-	132,365,236.70	-52,811.93
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,978,613,192.59	-	2,022,903,880.76	44,290,688.17	

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	140,000,140.01	-
银行间市场	-	-
合计	140,000,140.01	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	76,000,076.00	-
银行间市场	-	-
合计	76,000,076.00	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	1,736,739.34
其他应收款	-	-
待摊费用	54,575.12	54,575.12
合计	54,575.12	1,791,314.46

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付交易费用	975,125.27	7,532,804.48
其中：交易所市场	975,125.27	7,532,804.48
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费用	50,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	80,000.00	80,000.00
其他应付	55,299.95	55,299.95
合计	1,160,425.22	7,718,104.43

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 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 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	5,382,164.84	5,382,164.84
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-990,065.43	-990,065.43
本期末	4,392,099.41	4,392,099.41

7.4.7.7.2 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 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,211,990,912.67	2,211,990,912.67
本期申购	14,166,604.78	14,166,604.78
本期赎回（以“-”号填列）	-659,491,853.60	-659,491,853.60
本期末	1,566,665,663.85	1,566,665,663.85

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 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	2,675,774.55	-988,016.51	1,687,758.04
本期利润	-1,895,405.86	-463,237.09	-2,358,642.95
本期基金份额交易产生的变动数	-244,335.76	227,404.09	-16,931.67
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-244,335.76	227,404.09	-16,931.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	536,032.93	-1,223,849.51	-687,816.58

7.4.7.8.2 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	-86,672,051.86	96,432,173.40	9,760,121.54
本期利润	-541,454,411.06	-138,329,076.72	-679,783,487.78
本期基金份额交易产生的变动数	123,839,190.62	-4,067,238.88	119,771,951.74
其中：基金申购款	-2,765,365.49	61,229.07	-2,704,136.42
基金赎回款	126,604,556.11	-4,128,467.95	122,476,088.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-504,287,272.30	-45,964,142.20	-550,251,414.50

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	349,893.37	1,264,189.96
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	221,501.51	778,911.63
其他	20,216.81	30,329.74
合计	591,611.69	2,073,431.33

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	7,002,639,602.61	19,908,266,166.14
减：卖出股票成本总额	7,529,842,576.48	20,031,142,883.48
减：交易费用	18,965,963.92	-
买卖股票差价收入	-546,168,937.79	-122,876,717.34

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2,149,762.74	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-280,973.78	-1,280,281.78
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	1,868,788.96	-1,280,281.78

7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	135,464,053.51	316,226,692.43
减: 卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	132,418,048.63	308,578,759.28
减: 应计利息总额	3,326,859.51	8,928,214.93
减: 交易费用	119.15	-
买卖债券差价收入	-280,973.78	-1,280,281.78

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
股票投资产生的股利收益	11,716,439.79	36,178,666.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,716,439.79	36,178,666.18

7.4.7.14 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-138,792,313.81	-139,663,803.33
——股票投资	-138,627,606.74	-139,383,173.81
——债券投资	-164,707.07	-280,629.52
——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	-	-5,357,897.81
合计	-138,792,313.81	-134,305,905.52

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	-	8,131.32
合计	-	8,131.32

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	127,753.52
银行汇划费	780.79	9,728.30
帐户维护费	37,200.00	34,200.00
注册登记费	154,113.09	33,975.63
交易费用	-	55,431,186.03
合计	322,093.88	55,686,843.48

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国北方稀土（集团）高科技股份有限公司	基金管理人的其他关联法人

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	13,529,793,231.69	100.00%	39,919,366,232.98	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
方正证券股份有限公司	94,642,673.00	100.00%	292,066,390.40	100.00%

7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	15,649,900,000.00	100.00%	83,758,200,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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12月31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	10,839,563.54	100.00%	975,125.27	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	32,019,512.58	100.00%	7,532,804.48	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,819,181.05	19,482,027.43
其中：支付销售机构的客户维护费	15,034.14	-

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：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H为各类计划份额每日应计提的固定管理费

E为该类计划份额前一日的资产净值

I为该类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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,661,673.72	8,090,648.01

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	163,925,275.68	349,893.37	110,669,370.34	1,264,189.96

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

经履行规定程序，本基金在报告期内卖出管理人其他关联法人发行的股票北方稀土。截至报告期末，本基金持仓股票中已无北方稀土。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	创业板打新限售	237.50	176.97	144	34,200.00	25,483.68	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	创业板打新限售	138.88	103.52	174	24,165.12	18,012.48	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月	创业板打新限售	18.19	14.90	620	11,277.80	9,238.00	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	创业板打新限售	78.80	76.96	115	9,062.00	8,850.40	-
301339	通行宝	2022-09-02	6个月	创业板打新限售	18.78	15.59	527	9,897.06	8,215.93	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6个月	创业板打新限售	40.13	31.90	217	8,708.21	6,922.30	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月	创业板打	52.69	51.41	133	7,007.77	6,837.53	-

				新限售						
301277	新天地	2022-11-09	6个月	创业板打新限售	27.00	25.78	245	6,615.00	6,316.10	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	创业板打新限售	38.25	29.49	111	4,245.75	3,273.39	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	创业板打新限售	40.66	22.61	143	5,814.38	3,233.23	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	创业板打新限售	25.88	21.60	148	3,830.24	3,196.80	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	创业板打新限售	39.00	24.46	130	5,070.00	3,179.80	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月	创业板打新限售	18.66	21.73	137	2,556.42	2,977.01	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	创业板打新限售	25.49	20.38	99	2,523.51	2,017.62	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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2022年12月31日止，本基金未持有除国债以外的债券投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告

本期末 2022 年 1 2 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
上年度末 2021 年 1 2 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告

日					
资产					
银行存款	110,669,370.34	-	-	-	110,669,370.34
结算备付金	33,733,272.05	-	-	-	33,733,272.05
存出保证金	1,705,778.40	-	-	-	1,705,778.40
交易性金融资产	132,365,236.70	-	-	1,890,538,644.06	2,022,903,880.76
买入返售金融资产	76,000,076.00	-	-	-	76,000,076.00
应收证券清算款	-	-	-	2,686,829.66	2,686,829.66
应收利息	-	-	-	1,736,739.34	1,736,739.34
应收申购款	-	-	-	60,074.56	60,074.56
其他资产	-	-	-	54,575.12	54,575.12
资产总计	354,473,733.49	-	-	1,895,076,862.74	2,249,550,596.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,226,160.94	8,226,160.94
应付赎回款	-	-	-	3,126,786.59	3,126,786.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,171,848.64	1,171,848.64
应付托管费	-	-	-	486,738.54	486,738.54
应付交易费用	-	-	-	7,532,804.48	7,532,804.48
其他负债	-	-	-	185,299.95	185,299.95
负债总计	-	-	-	20,729,639.14	20,729,639.14
利率敏感度缺口	354,473,733.49	-	-	1,874,347,223.60	2,228,820,957.09

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	6,392.79	160,661.30
	市场利率上升25个基点	-6,391.66	-160,661.30

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	754,025,710.27	73.92	1,890,538,644.06	84.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	71,822,755.07	7.04	132,365,236.70	5.94
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	825,848,465.34	80.96	2,022,903,880.76	90.76

7.4.13.4.3.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	股票投资公允价值增加 5%	37,701,285.51	94,526,932.20
	股票投资公允价值减少 5%	-37,701,285.51	-94,526,932.20

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	753,917,956.00	1,890,047,040.99
第二层次	71,822,755.07	132,587,604.76
第三层次	107,754.27	269,235.01
合计	825,848,465.34	2,022,903,880.76

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	269,235.01	269,235.01
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	168,575.18	168,575.18
转出第三层次	-	187,360.12	187,360.12
当期利得或损失总额	-	-142,695.80	-142,695.80

其中：计入损益的利得或损失	-	-142,695.80	-142,695.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	107,754.27	107,754.27
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-27,218.99	-27,218.99
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	98,528.99	98,528.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	286,375.94	286,375.94
转出第三层次	-	188,794.26	188,794.26
当期利得或损失总额	-	73,124.34	73,124.34
其中：计入损益的利得或损失	-	73,124.34	73,124.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	269,235.01	269,235.01
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	115,476.81	115,476.81

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
深交所限售股_创业板	107,754.27	亚式期权模型	预期波动率	0.2127-0.7817	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
深交所限售股_创业板	269,235.01	亚式期权模型	预期波动率	0.3138-2.7417	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	754,025,710.27	66.45
	其中：股票	754,025,710.27	66.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	71,822,755.07	6.33
	其中：债券	71,822,755.07	6.33

	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	140,000,140.01	12.34
	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	168,023,804.80	14.81
8	其他各项资产	870,107.03	0.08
9	合计	1,134,742,517.18	100.00

8.2 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	65,347,184.00	6.41
C	制造业	637,245,544.00	62.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,752,000.00	3.11
E	建筑业	-	-
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	14,434,172.73	1.41
J	金融业	4,990,995.00	0.49
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	230,548.80	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	23,248.12	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	2,017.62	0.00

S	综合	-	-
	合计	754,025,710.27	73.92

8.3 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	000661	长春高新	210,000	34,954,500.00	3.43
2	600765	中航重机	1,112,200	34,578,298.00	3.39
3	600150	中国船舶	1,540,983	34,333,101.24	3.37
4	000768	中航西飞	1,206,900	30,715,605.00	3.01
5	603392	万泰生物	230,000	29,141,000.00	2.86
6	300775	三角防务	760,000	28,880,000.00	2.83
7	300760	迈瑞医疗	90,000	28,437,300.00	2.79
8	688311	盟升电子	295,000	23,959,900.00	2.35
9	688295	中复神鹰	550,000	23,743,500.00	2.33
10	600276	恒瑞医药	599,920	23,114,917.60	2.27
11	688276	百克生物	330,000	22,806,300.00	2.24
12	603306	华懋科技	600,000	22,446,000.00	2.20
13	300122	智飞生物	249,903	21,948,980.49	2.15
14	603393	新天然气	1,000,000	21,770,000.00	2.13
15	600399	抚顺特钢	1,460,000	20,892,600.00	2.05
16	600416	湘电股份	1,100,000	20,680,000.00	2.03
17	600703	三安光电	1,200,000	20,592,000.00	2.02
18	002389	航天彩虹	950,000	19,541,500.00	1.92
19	600256	广汇能源	2,125,100	19,168,402.00	1.88
20	002865	钧达股份	97,400	18,028,740.00	1.77
21	600988	赤峰黄金	900,000	16,245,000.00	1.59
22	301117	佳缘科技	180,000	14,274,000.00	1.40
23	688234	天岳先进	180,000	14,040,000.00	1.38

24	300666	江丰电子	200,000	13,840,000.00	1.36
25	002371	北方华创	60,000	13,518,000.00	1.33
26	603019	中科曙光	576,100	12,754,854.00	1.25
27	601666	平煤股份	1,020,000	11,026,200.00	1.08
28	000408	藏格矿业	421,400	10,943,758.00	1.07
29	688375	国博电子	107,855	10,331,430.45	1.01
30	600499	科达制造	715,500	10,167,255.00	1.00
31	600803	新奥股份	620,000	9,982,000.00	0.98
32	002738	中矿资源	140,060	9,336,399.60	0.92
33	002466	天齐锂业	109,300	8,633,607.00	0.85
34	002240	盛新锂能	221,700	8,311,533.00	0.81
35	000568	泸州老窖	35,200	7,894,656.00	0.77
36	000858	五粮液	41,300	7,462,497.00	0.73
37	601899	紫金矿业	733,700	7,337,000.00	0.72
38	603197	保隆科技	150,000	7,095,000.00	0.70
39	600519	贵州茅台	4,100	7,080,700.00	0.69
40	600562	国睿科技	400,000	6,780,000.00	0.66
41	600338	西藏珠峰	295,100	6,763,692.00	0.66
42	603876	鼎胜新材	157,900	6,480,216.00	0.64
43	300408	三环集团	198,200	6,086,722.00	0.60
44	002850	科达利	50,000	5,940,500.00	0.58
45	300957	贝泰妮	35,100	5,238,324.00	0.51
46	301101	明月镜片	80,000	5,041,600.00	0.49
47	601939	建设银行	886,500	4,990,995.00	0.49
48	002192	融捷股份	49,100	4,806,890.00	0.47
49	688281	华秦科技	4,007	1,141,995.00	0.11
50	688293	奥浦迈	2,234	230,548.80	0.02
51	301296	新巨丰	6,197	95,402.65	0.01
52	301339	通行宝	5,261	86,658.31	0.01
53	301396	宏景科技	2,163	73,514.42	0.01
54	688132	邦彦技术	2,925	71,370.00	0.01

55	301277	新天地	2,443	69,772.36	0.01
56	301327	华宝新能	144	25,483.68	0.00
57	688480	赛恩斯	1,051	23,248.12	0.00
58	688448	磁谷科技	879	20,665.29	0.00
59	301349	信德新材	174	18,012.48	0.00
60	301328	维峰电子	115	8,850.40	0.00
61	301283	聚胶股份	133	6,837.53	0.00
62	301227	森鹰窗业	111	3,273.39	0.00
63	301276	嘉曼服饰	143	3,233.23	0.00
64	301388	欣灵电气	148	3,196.80	0.00
65	301309	万得凯	130	3,179.80	0.00
66	301161	唯万密封	137	2,977.01	0.00
67	301231	荣信文化	99	2,017.62	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002129	TCL中环	217,744,111.85	9.77
2	002756	永兴材料	142,326,271.28	6.39
3	601633	长城汽车	142,140,532.08	6.38
4	300661	圣邦股份	128,219,693.18	5.75
5	002714	牧原股份	117,636,411.77	5.28
6	000858	五粮液	111,262,199.92	4.99
7	002006	精功科技	101,999,524.89	4.58
8	600765	中航重机	99,758,393.40	4.48
9	300772	运达股份	99,488,513.95	4.46
10	002738	中矿资源	98,920,509.21	4.44
11	600256	广汇能源	88,009,175.84	3.95
12	002245	蔚蓝锂芯	82,021,687.09	3.68

13	603596	伯特利	80,653,732.24	3.62
14	000625	长安汽车	79,806,302.80	3.58
15	600884	杉杉股份	78,890,267.18	3.54
16	600338	西藏珠峰	78,529,775.47	3.52
17	300122	智飞生物	69,812,304.53	3.13
18	000408	藏格矿业	68,951,242.52	3.09
19	603613	国联股份	68,463,907.18	3.07
20	300207	欣旺达	65,311,001.96	2.93
21	002459	晶澳科技	65,176,945.38	2.92
22	002240	盛新锂能	61,185,072.33	2.75
23	002466	天齐锂业	60,268,406.44	2.70
24	600938	中国海油	60,147,177.95	2.70
25	002810	山东赫达	59,894,796.04	2.69
26	600048	保利发展	59,842,342.30	2.68
27	600522	中天科技	59,819,715.40	2.68
28	600499	科达制造	56,556,243.87	2.54
29	688508	芯朋微	55,621,308.43	2.50
30	600011	华能国际	55,381,842.00	2.48
31	002475	立讯精密	53,354,046.17	2.39
32	000422	湖北宜化	53,326,766.00	2.39
33	601666	平煤股份	53,211,868.79	2.39
34	002920	德赛西威	52,361,235.48	2.35
35	300750	宁德时代	50,439,498.96	2.26
36	002371	北方华创	50,324,620.09	2.26
37	600188	兖矿能源	49,386,683.66	2.22
38	600519	贵州茅台	48,985,418.00	2.20
39	300957	贝泰妮	48,976,521.15	2.20
40	600295	鄂尔多斯	48,823,368.20	2.19
41	688122	西部超导	47,411,169.11	2.13
42	603197	保隆科技	47,394,524.79	2.13
43	002487	大金重工	46,762,448.98	2.10

44	603267	鸿远电子	46,731,058.27	2.10
45	002176	江特电机	45,876,230.02	2.06
46	600587	新华医疗	45,674,294.00	2.05
47	603392	万泰生物	44,724,100.68	2.01

8.4.2 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	002129	TCL中环	215,990,711.37	9.69
2	300772	运达股份	189,667,340.77	8.51
3	603596	伯特利	164,431,880.79	7.38
4	002756	永兴材料	154,688,932.94	6.94
5	002245	蔚蓝锂芯	145,342,501.98	6.52
6	601633	长城汽车	140,632,395.70	6.31
7	600522	中天科技	128,972,167.40	5.79
8	300661	圣邦股份	124,275,334.94	5.58
9	002006	精功科技	117,015,513.12	5.25
10	600519	贵州茅台	116,460,267.54	5.23
11	002714	牧原股份	114,971,779.27	5.16
12	603613	国联股份	110,137,706.42	4.94
13	002009	天奇股份	106,205,096.91	4.77
14	002459	晶澳科技	104,812,934.61	4.70
15	300207	欣旺达	104,365,514.76	4.68
16	002475	立讯精密	102,517,557.21	4.60
17	600884	杉杉股份	101,725,329.65	4.56
18	000858	五粮液	95,567,162.59	4.29
19	603267	鸿远电子	89,224,516.01	4.00
20	002810	山东赫达	88,387,460.05	3.97
21	002738	中矿资源	87,105,407.75	3.91
22	002466	天齐锂业	81,450,357.33	3.65

23	000625	长安汽车	77,097,461.99	3.46
24	300059	东方财富	72,142,057.04	3.24
25	603982	泉峰汽车	61,827,503.52	2.77
26	600256	广汇能源	60,450,563.86	2.71
27	603008	喜临门	60,396,103.57	2.71
28	300750	宁德时代	57,348,525.00	2.57
29	600938	中国海油	57,337,646.90	2.57
30	600048	保利发展	57,140,962.88	2.56
31	600587	新华医疗	55,934,375.21	2.51
32	600765	中航重机	55,000,469.15	2.47
33	002487	大金重工	53,457,128.16	2.40
34	603301	振德医疗	52,749,655.66	2.37
35	002920	德赛西威	52,362,032.52	2.35
36	600338	西藏珠峰	51,952,936.18	2.33
37	688122	西部超导	51,290,699.74	2.30
38	600011	华能国际	49,354,202.26	2.21
39	000422	湖北宜化	46,790,676.39	2.10
40	300014	亿纬锂能	45,587,810.65	2.05
41	300122	智飞生物	45,459,592.59	2.04
42	688508	芯朋微	45,105,024.98	2.02
43	002304	洋河股份	44,996,081.00	2.02
44	600295	鄂尔多斯	44,831,984.83	2.01

8.4.3 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	6,531,957,249.43
卖出股票收入（成交）总额	7,002,639,602.61

8.5 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	71,822,755.07	7.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,822,755.07	7.04

8.6 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	019666	22国债01	704,000	71,822,755.07	7.04

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	761,220.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,311.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	54,575.12
8	其他	-
9	合计	870,107.03

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息**9.1 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	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	持有份额	占总份 额比例

	数 (户)			比例		
方正 证券 金立 方A	43	102,141.85	0.00	0.00%	4,392,099.41	100.0 0%
方正 证券 金立 方C	33, 948	46,148.98	9,824,610.90	0.63%	1,556,841,052.95	99.37%
合计	33, 991	46,219.82	9,824,610.90	0.63%	1,561,233,152.36	99.37%

9.2 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	16,824,758.10	1.07%
	合计	16,824,758.10	1.07%

9.3 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 金	方正证券金立方A	0
	方正证券金立方C	0
	合计	0

§10 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	5,382,164.84	2,211,990,912.67
本报告期基金总申购份额	-	14,166,604.78
减：本报告期基金总赎回份额	990,065.43	659,491,853.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,392,099.41	1,566,665,663.85

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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2022年4月8日、2022年12月14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，李正红先生自2022年12月13日起担任方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。本基金本报告期应支付给审计机构信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为5万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为3年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 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	13,529,793,231.69	100.00%	10,839,563.54	100.00%	-

11.7.2 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	94,642,673.00	100.00%	15,649,900.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	方正证券金立方一年持有期	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-26

	混合型集合资产管理计划基金经理变更公告		
3	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	2022-04-28
4	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	2022-04-28
5	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	2022-04-28
6	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
7	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	2022-08-16
8	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	2022-08-17
9	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	2022-08-17
10	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	2022-08-17
11	方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司总经理变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-14
12	方正证券股份有限公司关于	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-27

	控股股东完成股份过户登记的提示性公告		
--	--------------------	--	--

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

方正证券股份有限公司
二〇二三年三月三十一日