

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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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5月25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 | 7 |
| 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 | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 16 |
| §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 | 22 |
| 7.4 报表附注 | 24 |
| §8 投资组合报告 | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 51 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 52 |
| 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 | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |

| | |
|---|----|
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 54 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 54 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 54 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 55 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 55 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 55 |
| 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..... | 56 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 56 |
| §11 重大事件揭示..... | 57 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 57 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 57 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 57 |
| 11.8 其他重大事件..... | 58 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| §13 备查文件目录..... | 60 |
| 13.1 备查文件目录..... | 60 |
| 13.2 存放地点..... | 60 |
| 13.3 查阅方式..... | 60 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------------|----------------|
| 基金名称 | 方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 135,760,036.48份 | |
| 基金合同存续期 | 本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 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 |
| 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 | 117,760,036.48份 | 18,000,000.00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。

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、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。

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 陈慧蕾 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 010-56992726 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | chenhuilei@foundersc.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95571 | 021-60637228 |
| 传真 | | 010-56992708 | 021-60635778 |
| 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 | 北京市西城区金融大街25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 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 100020 | 100033 |
| 法定代表人 | | 施华 | 田国立 |

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 | 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、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 | 本期2022年05月25日（基金合同生效日） - 2022年12月31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 |
| 本期已实现收益 | 2,248,427.49 | 191,360.66 |
| 本期利润 | 567,987.43 | 37,771.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0039 | 0.0023 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.39% | 0.23% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.53% | -0.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022年末 | |
| 期末可供分配利润 | 623,464.10 | -72,182.12 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0053 | -0.0040 |
| 期末基金资产净值 | 118,383,500.58 | 17,927,817.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.0053 | 0.9960 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.53% | -0.40% |

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2022年5月25日。截至2022年12月31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

方正证券鑫享三个月滚动债券C

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

| | 增长率① | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|------------|--------|---------|--------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.31% | 0.04% | 0.39% | 0.02% | -0.70% | 0.02% |
| 过去六个月 | 0.37% | 0.03% | 0.92% | 0.01% | -0.55% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.53% | 0.03% | 1.12% | 0.01% | -0.59% | 0.02% |

方正证券鑫享三个月滚动债券E

| 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 | -1.00% | 0.10% | 0.39% | 0.02% | -1.39% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.40% | 0.07% | 0.85% | 0.01% | -1.25% | 0.06% |

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。

2、2022年10月13日，对E类基金份额10月12日的赎回申请按照1.0073元进行确认，赎回确认后E类基金份额为0。2022年10月17日，对E类基金份额10月14日的申购申请按照1.0000元进行确认。

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
(2022年05月25日-2022年12月31日)



注：1、基金合同生效日为2022年5月25日。截至2022年12月31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，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
(2022年07月13日-2022年12月31日)

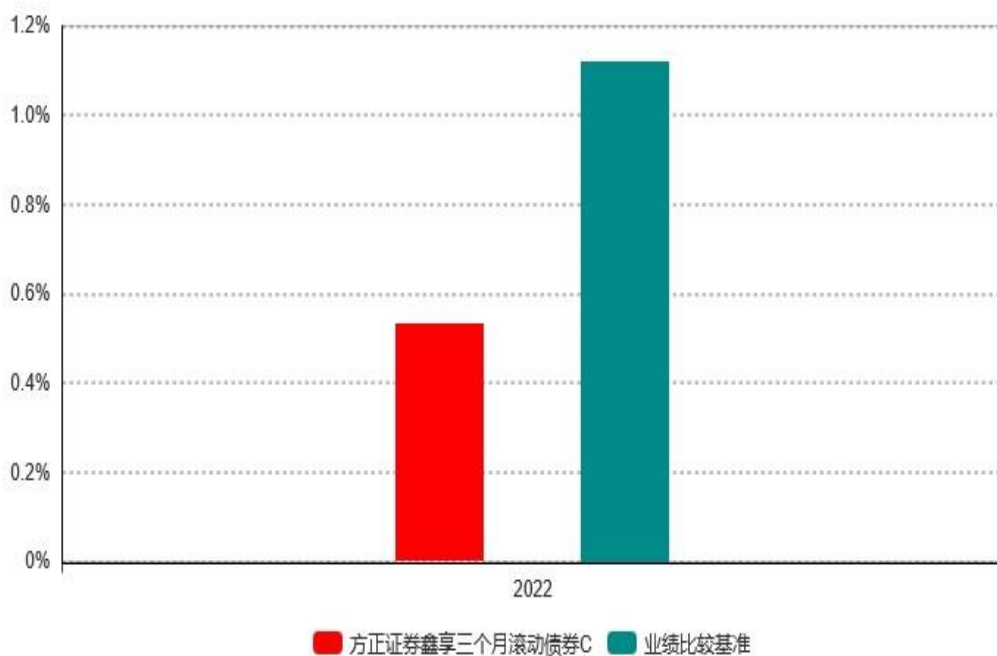


注：1、基金合同生效日为2022年5月25日，方正证券鑫享三个月滚动债券E自2022年7月1日起开放申购和赎回业务，首个投资者于2022年7月12日提交申购申请。截至2022年12月31日，本基金合同生效不满一年。

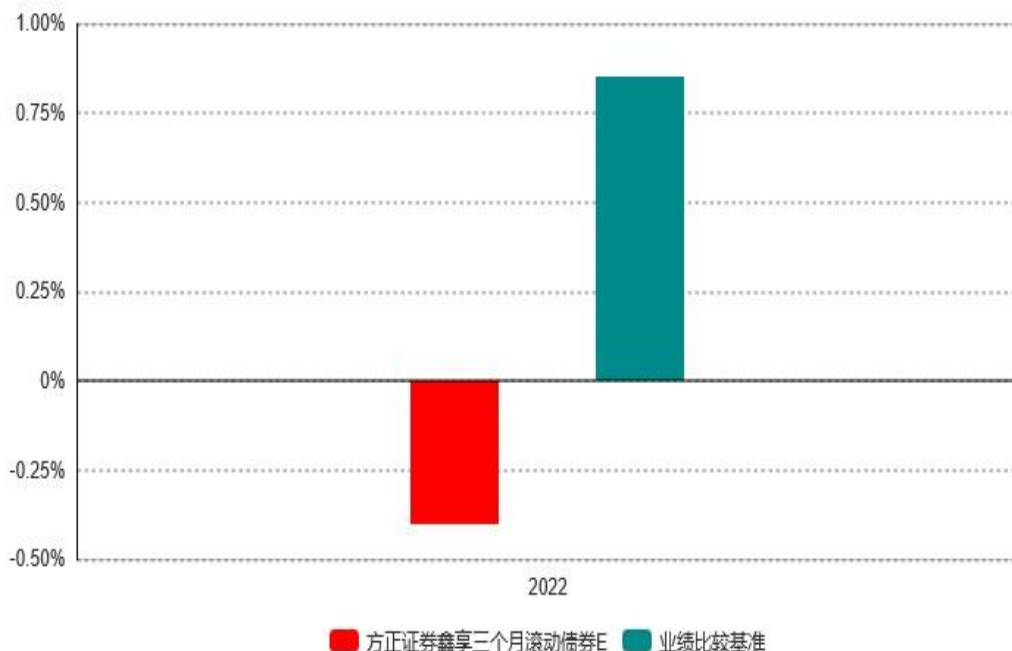
2、本基金合同于2022年5月25日生效，建仓期6个月，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3、2022年10月13日，对E类基金份额10月12日的赎回申请按照1.0073元进行确认，赎回确认后E类基金份额为0。2022年10月17日，对E类基金份额10月14日的申购申请按照1.0000元进行确认。

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2022年5月25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，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 | | |
| 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。

4.1.3 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

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

今年债券市场收益率呈现先下跌、后上升的走势。今年前10个月，受新冠疫情影响，国内经济下行压力较大，管理层先后出台多项稳增长政策，先后于1月份和8月份两次降低公开市场逆回购和中期借贷便利（MLF）利率10BP，分别于4月份和12月份下调金融机构存款准备金率0.25个百分点，同时，央行保持市场流动性合理充裕，货币市场利率保持低位，受上述宽松货币政策的支持，国内债券市场收益率前10个月总体呈现震荡下行走势。但是，11月11日国务院联防联控机制公布进一步优化疫情防控二十条措施，11月13日央行和银保监会又出台支持房地产市场发展的十六条措施，市场普遍预期疫情防控政策放松以及支持房地产政策加大力度将推动经济将快速回升，利空债券市场，所以，债券市场收益率快速回升。债券市场的调整导致债券型基金和银行理财产品净值回撤，引发个人投资者的“赎回潮”，形成赎回-抛售的负反馈，推动债券市场收益率进一步上升，相对而言，债券型资管产品重点持仓的信用债收益率上升幅度明显大于利率债。2022年末，10年期国债收益率为2.84%，较上年末上升约6BP，一年期AA+城投债收益率为3.11%，较上年末上升约22BP。

本产品坚持稳健投资策略，密切关注经济形势和政策动态，以中高等级、中短久期信用债为主要投资品种，根据市场波动灵活调整组合久期和杠杆，并保持资产组合较高的流动性，在保证流动性的前提下提升组合收益。

4.4.2 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1.0053元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.53%，同期业绩比较基准收益率为1.12%；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0.9960元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.85%。

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2023年，在疫情负面影响消退、稳增长政策持续发力的作用下，国内经济修复性回升是大趋势。随着各地度过新冠疫情感染高峰，出行和消费恢复速度将明显加快。基建投资和制造业投资将继续成为经济增长的重要拉动力，在一系列稳地产政策作用下，房地产投资的下滑趋势有望减缓。欧美经济增速放缓，导致国内出口增速下滑，可能对经济增长产生一定负面影响。总体而言，国内经济已经出现恢复趋势，但复苏的基础还不牢固，稳增长政策仍要持续发力，市场流动性仍要保持充裕。债券市场经过去年

四季度的调整之后，收益率已经大幅上升，尤其是短期债券的收益率已经上升至近几年的高位区域，在未来市场流动性充裕的市场环境中，短期债券有望带来确定性较高的收益。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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/2023BJAB1B0213 |

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 | 方正证券鑫享三个月滚动持有债券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鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称方正鑫享集合计划）财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年5月25日至12月31日的利润表、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，公允反映了方正鑫享集合计划2022年12月31日的财务状况以及2022年5月25日至12月31日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，我们独立于方正鑫享集合计划，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 | 方正鑫享集合计划管理人（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，管理人负责评估方正鑫享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方正鑫享集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督方正鑫享集合计划的财务报告过程。 |

注册会计师对财务报表审计的责任

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，就可能导致对方正鑫享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方正鑫享集合计划不能持续经营。（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。 |
| 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：方正证券鑫享三个月滚动持有债券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 |
|------------|---------|--------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 95,511.33 |
| 结算备付金 | | 1,200,445.50 |
| 存出保证金 | | 6,876.81 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 135,298,674.48 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 135,298,674.48 |
| 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 | -58.42 |
| 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 | | 500,117.04 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 70,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 137,171,566.74 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022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 | | 299,999.70 |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 191,893.38 |
| 应付管理人报酬 | | 36,485.73 |
| 应付托管费 | | 12,161.90 |
| 应付销售服务费 | | 22,042.54 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 15,994.26 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 281,670.77 |
| 负债合计 | | 860,248.28 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 135,760,036.48 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 551,281.98 |
| 净资产合计 | | 136,311,318.46 |

| | | |
|----------|--|----------------|
| 负债和净资产总计 | | 137,171,566.74 |
|----------|--|----------------|

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额总额135,760,036.48份，其中C类基金份额净值1.0053元，基金份额总额117,760,036.48份；E类基金份额净值0.9960元，基金份额总额18,000,000.00份。

2、本财务报表的实际编制期间为2022年5月25日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 1,427,414.86 |
| 1.利息收入 | | 137,259.29 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 20,380.44 |
| 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 | | 116,878.85 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,124,185.22 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 3,124,185.22 |
| 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 | | - |
| 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） | 7.4.7.13 | -1,834,029.65 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | - |
| 减：二、营业总支出 | | 821,656.36 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 290,028.68 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 96,676.13 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 181,694.88 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | 69,781.09 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 69,781.09 |
| 6. 信用减值损失 | | - |
| 7. 税金及附加 | | 11,718.40 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.14 | 171,757.18 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 605,758.50 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 605,758.50 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 605,758.50 |

注：本基金合同变更生效日为2022年5月25日，因此无上年度可比期间数据。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|-----------------|----------------------------------|--------|-------|-------|
| | 2022年05月25日（基金合同生效日）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） | - | - | - | - |
| 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） | 695,494,345.14 | - | -617,728,150.43 | 77,766,194.71 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -559,734,308.66 | - | 618,279,432.41 | 58,545,123.75 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 605,758.50 | 605,758.50 |
| （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） | -559,734,308.66 | - | 617,673,673.91 | 57,939,365.25 |
| 其中：1.基金申购款 | 299,358,431.39 | - | 1,200,086.57 | 300,558,517.96 |
| 2.基金赎回款 | -859,092,740.05 | - | 616,473,587.34 | -242,619,152.71 |
| （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） | 135,760,036.48 | - | 551,281.98 | 136,311,318.46 |

注：本基金合同变更生效日为2022年5月25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

方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划由方正金泉友灵活配置集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

方正金泉友灵活配置集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自2011年12月12日起开始募集并于2012年2月3日结束募集，于2012年2月10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》的规定，原集合计划参照《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，并将原集合计划名称变更为“方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自2022年5月25日起生效，原《方正金泉友灵活配置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，本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。方正证券股份有限公司是本集合计划的管理人，中国建设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为具有良好流动性的金融工具，包括债券（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、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)。本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，因持有可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

本集合计划的业绩比较基准为：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%

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5月25日（基金合同变更生效日）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

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2022年5月25日（基金合同变更生效日）至12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金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

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。

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

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、估值原则

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，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（包括股票等），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按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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) 首次公开发行未上市的债券，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) 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) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

(6) 本集合计划投资国债期货合约，一般以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。

(7) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(8) 当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，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。

(9) 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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(10) 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。

如管理人或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管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，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

当基金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，同时本基金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

本基金的份额面值为人民币1.00元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

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基金份额时，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）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日的资产净值

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，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给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

T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，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给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、销售服务费

本集合计划C类计划份额的年销售服务费率为0.2%,E类计划份额的年销售服务费率为0.05%。

本集合计划两类计划份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E \times M \div \text{当年天数}$$

H为各类计划份额每日应计提的销售服务费

E为该类计划份额前一日集合计划资产净值

M为该类计划份额的年销售服务费率

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给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4、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。

5、其他费用：

- (1) 集合计划的银行汇划费用、开户费用、账户维护费用；
- (2) 《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- (3) 集合计划份额持有人大会费用；
- (4) 与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等，除法律法规另行规定外，管理人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴；
- (5) 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，本集合计划可进行收益分配。
- 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。若投资者选择将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资，红利再投资取得的份额其运作期起算日和到期日与原持有集合计划份额相同。

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。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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 | |
|--------------|--------------------|-----------|
| | 活期存款 | |
| 等于：本金 | | 95,266.15 |
| 加：应计利息 | | 245.18 |
| 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 | | 95,511.33 |

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 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 102,728,719.44 | 2,540,859.96 | 104,185,879.96 | -1,083,699.44 |
| | 银行间市场 | 30,705,100.00 | 1,060,794.52 | 31,112,794.52 | -653,100.00 |
| | 合计 | 133,433,819.44 | 3,601,654.48 | 135,298,674.48 | -1,736,799.44 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |

| | | | | |
|----|----------------|--------------|----------------|---------------|
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 133,433,819.44 | 3,601,654.48 | 135,298,674.48 | -1,736,799.44 |

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 | -58.42 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | -58.42 | - |

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

本基金本报告期末无其他资产。

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 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付交易费用 | 1,795.12 |
| 其中：交易所市场 | 445.12 |
| 银行间市场 | 1,350.00 |
| 应付利息 | - |

| | |
|------|------------|
| 预提费用 | 190,822.16 |
| 其他应付 | 89,053.49 |
| 合计 | 281,670.77 |

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 方正证券鑫享三个月滚动债券C

金额单位：人民币元

| 项目 (方正证券鑫享三个月滚动债券C) | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|------------------------|--|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 77,766,194.71 | 695,494,345.14 |
| 本期申购 | 266,358,431.39 | 266,358,431.39 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -226,364,589.62 | -844,092,740.05 |
| 本期末 | 117,760,036.48 | 117,760,036.48 |

7.4.7.7.2 方正证券鑫享三个月滚动债券E

金额单位：人民币元

| 项目 (方正证券鑫享三个月滚动债券E) | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|------------------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | - | - |
| 本期申购 | 33,000,000.00 | 33,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,000,000.00 | -15,000,000.00 |
| 本期末 | 18,000,000.00 | 18,000,000.00 |

注：1、本表的实际编制期间为2022年5月25日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

2、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 方正证券鑫享三个月滚动债券C

单位：人民币元

| 项目 (方正证券鑫享三个月 滚动债券C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 基金合同生效日 | -617,841,513.06 | 113,362.63 | -617,728,150.43 |
| 本期利润 | 2,248,427.49 | -1,680,440.06 | 567,987.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 617,380,522.51 | 403,104.59 | 617,783,627.10 |
| 其中：基金申购款 | 1,267,480.30 | -67,393.73 | 1,200,086.57 |
| 基金赎回款 | 616,113,042.21 | 470,498.32 | 616,583,540.53 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,787,436.94 | -1,163,972.84 | 623,464.10 |

7.4.7.8.2 方正证券鑫享三个月滚动债券E

单位：人民币元

| 项目 (方正证券鑫享三个月 滚动债券E) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------------------|-------------|-------------|-------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 191,360.66 | -153,589.59 | 37,771.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -119,915.52 | 9,962.33 | -109,953.19 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -119,915.52 | 9,962.33 | -109,953.19 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 71,445.14 | -143,627.26 | -72,182.12 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------|--|
| 活期存款利息收入 | 7,374.42 |

| | |
|-----------|-----------|
| 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 | 12,939.12 |
| 其他 | 66.90 |
| 合计 | 20,380.44 |

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 3,622,414.46 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -498,229.24 |
| 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 | 3,124,185.22 |

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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 151,417,042.75 |
| 减：卖出债券（债 | 148,536,567.82 |

| | |
|---------------------|--------------|
| 转股及债券到期兑 付) 成本总额 | |
| 减: 应计利息总额 | 3,376,100.43 |
| 减: 交易费用 | 2,603.74 |
| 买卖债券差价收入 | -498,229.24 |

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位: 人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|---------------------------------|----------------------------------|
| | 2022年05月25日(基金合同生效日)至2022年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | -1,837,308.38 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -1,837,308.38 |
| ——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 | -3,278.73 |
| 合计 | -1,834,029.65 |

7.4.7.14 其他费用

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------------------|
| | 2022年05月25日(基金合同生效日)至2022年12月31日 |
| | |

| | |
|-------|------------|
| 审计费用 | 60,548.32 |
| 信息披露费 | 90,822.16 |
| 汇划手续费 | 1,786.70 |
| 帐户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 171,757.18 |

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 |
|----------------|---------------------|
| 中国建设银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 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 |
| 蚂蚁（杭州）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。

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-------|--|
|-------|--|

| | 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 | 205,409,874.27 | 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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31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 | 1,770,700,000.00 | 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05月25日（基金合同生效日）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 | 1,976.50 | 100.00% | 445.12 | 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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 290,028.68 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.63 |

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日的资产净值

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，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给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| | |
|----------------|--|
| | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 96,676.13 |

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

T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，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给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 方正证券鑫享三个月滚动债 | 方正证券鑫享三个月滚动债 | 合计 |

| | 券C | 券E | |
|----------------|------------|----------|------------|
| 方正证券股份有限公司 | 177,950.21 | 3,743.83 | 181,694.04 |
| 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 0.84 | 0.00 | 0.84 |
| 合计 | 177,951.05 | 3,743.83 | 181,694.88 |

注：本集合计划C类计划份额的年销售服务费率为0.2%,E类计划份额的年销售服务费率为0.05%。

本集合计划两类计划份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times M \div \text{当年天数}$

H为各类计划份额每日应计提的销售服务费

E为该计划份额前一日集合计划资产净值

M为该计划份额的年销售服务费率

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给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

方正证券鑫享三个月滚动债券C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|------------------------|--|
| 基金合同生效日（2022年05月25日）持有 | 4,192,732.58 |

| | |
|---------------------|--------------|
| 的基金份额 | |
| 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 | 4,192,732.58 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.56% |

方正证券鑫享三个月滚动债券E

份额单位：份

| 项目 | 本期 2022年05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------------------------|--|
| 基金合同生效日（2022年05月25日）持有的基金份额 | 0.00 |
| 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% |

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05月25日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|-------|--|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设 | 95,511.33 | 7,374.42 |

| | | |
|--------------|--|--|
| 银行股份 有限公司 | | |
|--------------|--|--|

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

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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
无。

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额299,999.70元，于2023年1月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA | 64,729,502.84 |
| AAA以下 | 47,376,083.83 |
| 未评级 | 15,464,686.30 |
| 合计 | 127,570,272.97 |

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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 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 | 95,511.33 | - | - | - | 95,511.33 |
| 结算备付金 | 900,445.50 | - | - | 300,000.00 | 1,200,445.50 |
| 存出保证金 | 6,876.81 | - | - | - | 6,876.81 |
| 交易性金融资产 | 31,633,012.28 | 103,665,662.20 | - | - | 135,298,674.48 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | -58.42 | -58.42 |
| 应收清算款 | - | - | - | 500,117.04 | 500,117.04 |
| 应收申购款 | - | - | - | 70,000.00 | 70,000.00 |
| 资产总计 | 32,635,845.92 | 103,665,662.20 | - | 870,058.62 | 137,171,566.74 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 299,999.70 | - | - | - | 299,999.70 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 191,893.38 | 191,893.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 36,485.73 | 36,485.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | 12,161.90 | 12,161.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 22,042.54 | 22,042.54 |

| | | | | | |
|---------|---------------|----------------|---|------------|----------------|
| 应交税费 | - | - | - | 15,994.26 | 15,994.26 |
| 其他负债 | - | - | - | 281,670.77 | 281,670.77 |
| 负债总计 | 299,999.70 | - | - | 560,248.58 | 860,248.28 |
| 利率敏感度缺口 | 32,335,846.22 | 103,665,662.20 | - | 309,810.04 | 136,311,318.46 |

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 |
| | 市场利率下降25个基点 | 246,867.53 |
| | 市场利率上升25个基点 | -245,735.14 |

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 | |
|----|--------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| | | |

| | | |
|---------------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 135,298,674.48 | 99.26 |
| 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 | 135,298,674.48 | 99.26 |

7.4.13.4.3.2 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12月31日 |
| | 业绩比较基准下降5% | -5,135,410.34 |
| | 业绩比较基准上升5% | 5,135,410.34 |

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 |
|---------------|--------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 135,298,674.48 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 135,298,674.48 |

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。

7.4.14.3 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 135,298,674.48 | 98.63 |
| | 其中：债券 | 135,298,674.48 | 98.63 |
| | 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 | -58.42 | 0.00 |
| | 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 | 1,295,956.83 | 0.94 |
| 8 | 其他各项资产 | 576,993.85 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 137,171,566.74 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内，本基金未参与股票交易业务。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内，本基金未参与股票交易业务。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内，本基金未参与股票交易业务。

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 | 7,728,401.51 | 5.67 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 96,457,478.45 | 70.76 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 31,112,794.52 | 22.82 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 135,298,674.48 | 99.26 |

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 | 101900339 | 19海兴MTN001 | 100,000 | 10,496,000.00 | 7.70 |
| 2 | 101900402 | 19青岛城投MTN001 | 100,000 | 10,460,400.00 | 7.67 |
| 3 | 163676 | 20株国04 | 100,000 | 10,218,410.96 | 7.50 |
| 4 | 185377 | 22三投01 | 100,000 | 10,215,309.59 | 7.49 |
| 5 | 185993 | 22阳安02 | 100,000 | 10,214,356.16 | 7.49 |

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

8.11.1 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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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 | 6,876.81 |
| 2 | 应收清算款 | 500,117.04 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 70,000.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 576,993.85 |

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 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------------|----------|---------------|---------------|---------|----------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 方正证券鑫享三个月滚动债券C | 1,011 | 116,478.77 | 5,285,136.36 | 4.49% | 112,474,900.12 | 95.51% |
| 方正证券鑫享三个月滚动债券E | 1 | 18,000,000.00 | 18,000,000.00 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 1,012 | 134,150.23 | 23,285,136.36 | 17.15% | 112,474,900.12 | 82.85% |

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 | 方正证券鑫享三个月 | 1,043,750.55 | 0.89% |

| | | | |
|--------|----------------|--------------|-------|
| 员持有本基金 | 滚动债券C | | |
| | 方正证券鑫享三个月滚动债券E | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 1,043,750.55 | 0.77% |

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 | 方正证券鑫享三个月滚动债券C | 0 |
| | 方正证券鑫享三个月滚动债券E | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 方正证券鑫享三个月滚动债券C | 10~50 |
| | 方正证券鑫享三个月滚动债券E | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

§10 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 |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022年05月25日)基金份额总额 | 77,766,194.71 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 266,358,431.39 | 33,000,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 226,364,589.62 | 15,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 117,760,036.48 | 18,000,000.00 |

- 注：1、基金合同生效日为2022年5月25日；
2、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，本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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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10万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为1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 | - | - | 1,976.50 | 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 | 205,409,874.27 | 100.00% | 1,770,700,000.00 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |
| 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |
| 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |
| 4 | 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资产管理合同等法律文件生效的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |

| | | | |
|----|--|--------------|------------|
| 5 | 方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |
| 6 | 方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（E类份额）基金产品资料概要 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-05-25 |
| 7 | 方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-06-28 |
| 8 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-07-02 |
| 9 | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-09-19 |
| 10 | 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 |
| 11 | 方正证券股份有限公司关于控股股东完成股份过户登记的提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022-12-27 |

§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

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