

# 方正证券现金港货币型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:方正证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2023年8月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	40
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	41
7.9 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	43
§9 开放式基金份额变动	43

§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	45
10.9 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正证券现金港货币型集合资产管理计划
基金简称	方正证券现金港
基金主代码	970116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年01月17日
基金管理人	方正证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	9,723,299,326.31份
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。

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	在不影响委托人正常证券交易的前提下，将集合计划资金投向各类低风险高流动性固定收益类资产，获取一定收益。
投资策略	1、利率策略；2、个券选择策略；3、银行定期存款、同业存单投资策略；4、债券回购投资策略。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

### 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	中国证券登记结算有限责任

			公司
信息披露 负责人	姓名	陈慧蕾	陈晨
	联系电话	010-56992726	010-50938723
	电子邮箱	chenhuilei@foundersc.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95571	4008-058-058
传真		010-56992708	-
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	北京市西城区太平桥大街17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	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		100020	100033
法定代表人		施华	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a>
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
---------------	-----

	(2023年01月01日-2023年06月30日)
本期已实现收益	62,156,452.24
本期利润	62,156,452.24
本期净值收益率	0.5807%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
期末基金资产净值	9,723,299,326.31
期末基金份额净值	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
累计净值收益率	1.7598%

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

3、本集合计划每日分配收益，按月结转份额。

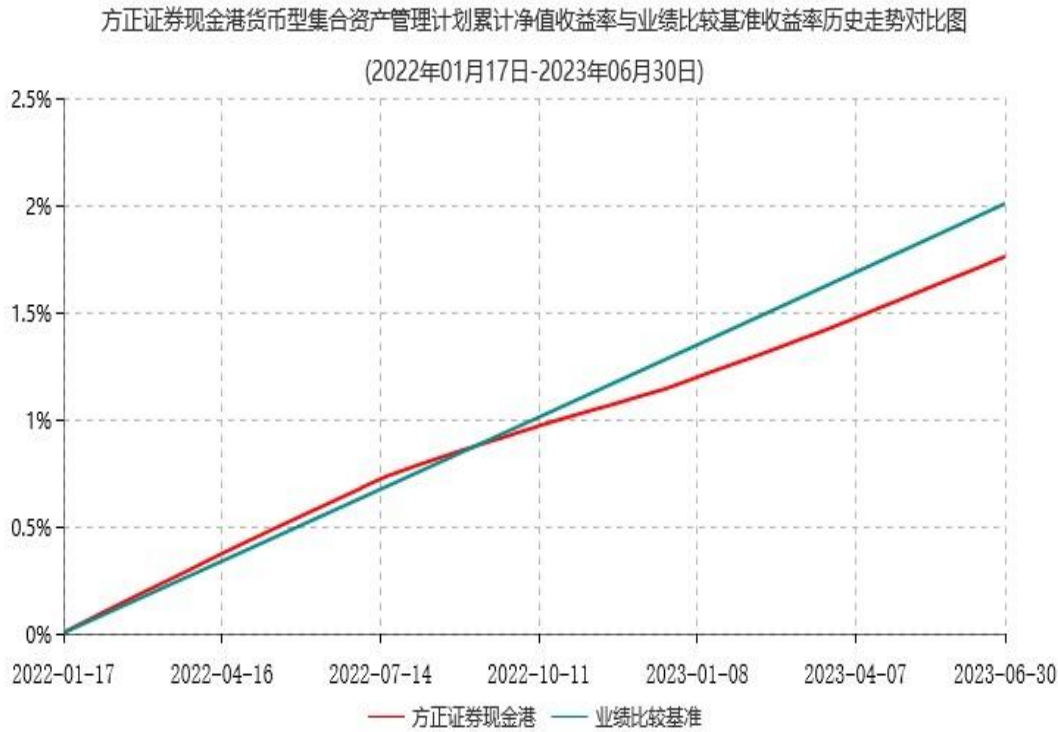
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1003%	0.0002%	0.1126%	0.0000%	-0.0123%	0.0002%
过去三个月	0.3050%	0.0001%	0.3418%	0.0000%	-0.0368%	0.0001%
过去六个月	0.5807%	0.0002%	0.6810%	0.0000%	-0.1003%	0.0002%
过去一年	1.0869%	0.0004%	1.3781%	0.0000%	-0.2912%	0.0004%
自基金合同 生效起至今	1.7598%	0.0006%	2.0073%	0.0000%	-0.2475%	0.0006%

注：本集合计划每日分配收益，按月结转份额。

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



## §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2023年6月30日，本基金管理人共管理了5只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：方正证券金立方一年持有期混合型集合资产管理计划、方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划、方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划、方正证券现金港货币型集合资产管理计划、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划。



#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫健	本基金的基金经理	2022-01-17	-	11年	男，经济学硕士，具有证券、基金从业资格，银行间本币市场交易员资格，2012年入职民族证券有限责任公司，曾任资产管理业务部固收交易员、固收投资经理。2016年加入方正证券股份有限公司，现任资管债券投资部投资经理。

注：1、本基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 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

2023年上半年，经济整体延续修复趋势，一季度需求回升较快，二季度以来需求端逐步走弱。其中地产销售疲弱、投资增速持续下行，出口中枢也较去年下行，消费持续修复，但5月以来消费也有走弱迹象。经济数据方面，1-5月份工业增加值累计同比增长3.6%，当月同比增长3.5%，低于预期值4.1%，反映出经济内生动能不足。1-5月基建投资累计同比增长9.9%，制造业投资累计同比增长6%，依然维持韧性。房地产开发投资累计同比下降7.2%，延续低基数下回落的趋势，地产投资仍呈现出一定的下行压力。社会消费品零售总额累计同比增长9.3%，但5月以来受居民收入预期下滑影响，消费增速也从高位回落。整体来看，经济基本面环比走弱。通胀方面，上半年CPI的下行主要受食品价格拖累，尤其是鲜菜和猪肉供应充足，上半年价格持续下跌，对CPI形成明显拖累。货币政策及流动性方面，一季度由于信贷投放较好、春节后现金回流略滞后以及同业存单大量发行等因素影响，资金面的波动性明显加大，同业存单收益率也在一二月份有所上行，后续随着央行加大公开市场投放量并在3月份超预期降准，资金面回归平稳，存单收益率开始下行。进入二季度国有银行、股份行和农商行等接连降低存款利率，负债端成本有所降低，短期资金价格中枢较今年一季度下行，且资金的波动性较一季度减小，同业存单收益率整体表现较好，延续下行趋势，仅在6月中下旬因季末因素有小幅回调。1年期同业存单收益率收于2.3050%，较去年年底下行11.5BP。

本基金在报告期内采取稳健的投资策略，以短期逆回购、同业存单、同业存款为主要配置资产。组合在春节前及季末、半年末等关键资金时点加大了中长期同业存款及同业存单的配置力度，力争提高组合收益，在资金宽松时期保持了一定的杠杆比例，赚取息差收益。组合将继续优选具有良好信用资质的投资标的，根据收益率情况，调整组

合平均剩余期限，并将在关键时点预留现金流，维持较好的流动性，保证产品安全稳定的运行，将继续努力为客户创造更好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券现金港基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.5807%，同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济弱复苏的格局短期内难以趋势性的改变。内需方面，房地产低迷弱化上下游产业链，企业主体融资需求不足，居民加杠杆意愿较低。外需方面，发达经济体需求减弱趋势不改，对中国出口仍会造成负面影响。通胀方面，下半年随着基数效应的减弱，以及猪价逐渐走出底部，预计CPI逐步回升，但短期内通胀压力较小，基本面仍然对于债券市场相对有利。央行的货币政策预计将继续为经济复苏保驾护航，在经济基本面没有出现明显的向好趋势之前，货币政策仍然会是稳中偏宽的基调。三季度将进入政策博弈期，预计未来一揽子政策的落地速度将会加快，但是刺激手段和方式超预期的概率不大，政策预期差将会对债券市场形成一定的扰动。综合来看，当前基本面仍然对债券市场较为有利，相对宽松的流动性对于收益率也有一定支撑，预计未来收益率曲线震荡为主，大幅调整的概率较低。本基金将继续关注基本面和货币政策的变化，在保证组合流动性安全的前提下，合理进行资产配置，继续以同业存款、同业存单以及逆回购为主要投资标的，坚持稳健的投资策略，为持有人带来稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的约定，本基金每日分配收益，按月结转份额。本报告期内，本基金分配收益62,156,452.24元，其中以再投资分红方式分配63,365,187.96元，以直接通过应付赎回款回款转出金额64,560.40元，计入应付利润科目-1,273,296.12元。不存在应分配但尚未实施分配的情况。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本托管人根据《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有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：方正证券现金港货币型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,640,665,890.40	3,337,298,995.54
结算备付金		-	24,557,604.60
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,158,649,297.97	5,305,232,494.26
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		4,158,649,297.97	5,305,232,494.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	185,081,931.55	700,154,332.38
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	43,835.30	6,574.96
资产总计		9,984,440,955.22	9,367,250,001.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		249,115,490.76	200,028,626.07
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,919,883.17	7,825,617.49
应付托管费		439,993.49	434,756.49
应付销售服务费		2,199,967.55	2,173,782.61

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		1,320,171.73	2,593,467.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	146,122.21	283,867.18
负债合计		261,141,628.91	213,340,117.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	9,723,299,326.31	9,153,909,884.05
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		9,723,299,326.31	9,153,909,884.05
负债和净资产总计		9,984,440,955.22	9,367,250,001.74

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额9,723,299,326.31份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正证券现金港货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月17日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
一、营业总收入		128,502,451.31	112,360,749.51
1.利息收入		75,299,934.32	70,249,622.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,574,867.74	66,838,858.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		6,725,066.58	3,410,763.57
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		53,202,516.99	42,111,127.18
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	53,202,516.99	42,111,127.18
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		66,345,999.07	48,104,300.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,852,134.73	39,455,166.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,658,451.89	2,191,953.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,292,259.64	3,820,643.74
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,373,074.80	2,461,585.43
其中：卖出回购金融资产 支出		2,373,074.80	2,461,585.43
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	170,078.01	174,950.79
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		62,156,452.24	64,256,449.47

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		62,156,452.24	64,256,449.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		62,156,452.24	64,256,449.47

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正证券现金港货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值)	9,153,909,884.05	-	-	9,153,909,884.05
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)	9,153,909,884.05	-	-	9,153,909,884.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	569,389,442.26	-	-	569,389,442.26
（一）、综合收益总额	-	-	62,156,452.24	62,156,452.24
（二）、本期基金份额交易产	569,389,442.26	-	-	569,389,442.26



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	100,516,135.46 1.33	-	-	100,516,135.46 1.33
2.基金赎回款	-99,946,746.01 9.07	-	-	-99,946,746.01 9.07
(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)	-	-	-62,156,452.24	-62,156,452.24
(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)	9,723,299,326.3 1	-	-	9,723,299,326.3 1
项目	上年度可比期间 2022年01月17日(基金合同生效日)至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
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)	7,820,549,804.0 0	-	-	7,820,549,804.0 0

值)				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,406,390,738.3 7	-	-	2,406,390,738.3 7
（一）、综合收益总额	-	-	64,256,449.47	64,256,449.47
（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）	2,406,390,738.3 7	-	-	2,406,390,738.3 7
其中：1.基金申购款	77,782,846,362. 27	-	-	77,782,846,362. 27
2.基金赎回款	-75,376,455,62 3.90	-	-	-75,376,455,62 3.90
（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）	-	-	-64,256,449.47	-64,256,449.47
（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）	10,226,940,542. 37	-	-	10,226,940,542. 37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

施华

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

方正证券现金港货币型集合资产管理计划由原民族证券现金港集合资产管理计划变更而来。

原民族证券现金港集合资产管理计划为现金管理产品，由原管理人中国民族证券有限责任公司发起设立，自2012年12月17日起开始募集并于2013年1月10日结束募集，于2013年1月11日成立。

根据中国证监会湖南监管局《关于核准方正证券股份有限公司在北京等地收购51家分支机构的批复》（湘证监许可字[2018]11号），中国证监会湖南监管局核准方正证券股份有限公司收购中国民族证券有限责任公司在北京等地的51家证券营业部。根据《方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司关于实施经纪业务及客户整体迁移合并的联合公告》，原集合计划的管理人由“中国民族证券有限责任公司”变更为“方正证券股份有限公司”。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“方正证券现金港货币型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自2022年1月17日起生效，原《民族证券现金港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变更生效日起存续期不得超过3年。如资产管理合同变更生效日起3年后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。方正证券股份有限公司是本集合计划的管理人，中国证券登记结算有限责任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。

本集合计划投资于以下金融工具：现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在1个月以内的债券回购；剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法律法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至6月30日的经营成果和净资产（计划净值）变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

#### 1. 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 4、企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	1,098,129,532.19
等于：本金	1,096,751,281.15
加：应计利息	1,378,251.04
减：坏账准备	-
定期存款	4,542,536,358.21
等于：本金	4,500,000,000.00
加：应计利息	42,536,358.21
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	4,542,536,358.21
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,640,665,890.40

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	30,161,104.77	30,163,520.55	2,415.78	0.0000
	银行间市场	4,128,488,193.20	4,130,438,000.00	1,949,806.80	0.0201
	合计	4,158,649,297.97	4,160,601,520.55	1,952,222.58	0.0201
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,158,649,297.97	4,160,601,520.55	1,952,222.58	0.0201

注：偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值，偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	185,081,931.55	-
合计	185,081,931.55	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末

	2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	43,835.30
合计	43,835.30

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	31,410.03
其中：交易所市场	887.88
银行间市场	30,522.15
应付利息	-
预提费用-审计费用	34,712.18
预提费用-信息披露费	80,000.00
合计	146,122.21

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,153,909,884.05	9,153,909,884.05
本期申购	100,516,135,461.33	100,516,135,461.33
本期赎回（以“-”号填列）	-99,946,746,019.07	-99,946,746,019.07
本期末	9,723,299,326.31	9,723,299,326.31

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	62,156,452.24	-	62,156,452.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-62,156,452.24	-	-62,156,452.24
本期末	-	-	-

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	26,206,548.44
定期存款利息收入	42,223,649.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	144,669.41
其他	-
合计	68,574,867.74

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.11 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	53,202,516.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	53,202,516.99

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,606,854,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,605,000,000.00
减：应计利息总额	1,854,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	42,739.66
汇划手续费	60,026.17
帐户维护费	18,600.00
中登电子合同费	14,000.00
合计	170,078.01

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
方正证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、注册登记机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
方正证券 股份有限 公司	76,987,671.24	100.00%	-	-

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	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	14,017,995,000.00	100.00%	13,820,000,000.00	100.00%

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
方正证券股份有限公司	52,990.53	100.00%	887.88	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
方正证券股份有限公司	32,980.35	100.00%	11,850.35	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,852,134.73	39,455,166.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

如果以0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，管理人将调整管理费为0.25%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提0.90%的管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,658,451.89	2,191,953.62

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

方正证券股份有限公司	13,292,259.64
合计	13,292,259.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生效日）至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
方正证券股份有限公司	3,820,643.74
合计	3,820,643.74

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划的销售服务费年费率为0.25%。本集合计划的销售服务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：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国证券登记结算有限责任公司	58,558,144.31	740,850.82	67,914,124.53	533,657.85
----------------	---------------	------------	---------------	------------

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
63,365,187.96	64,560.40	-1,273,296.12	62,156,452.24	-

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额249,115,490.76元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112209152	22浦发银行CD152	2023-07-03	99.44	880,000	87,507,655.22

112216120	22上海银行CD 120	2023-07-03	99.92	163,000	16,287,559.83
112318076	23华夏银行CD 076	2023-07-03	99.03	700,000	69,320,660.33
112380753	23广州银行CD 032	2023-07-03	99.04	428,000	42,388,244.69
112394632	23长沙银行CD 062	2023-07-03	99.47	530,000	52,717,121.46
合计				2,701,000	268,221,241.53

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由风险管理部、合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日



A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	30,161,104.77	-
合计	30,161,104.77	-

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

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

#### 6.4.13.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	4,128,488,193.20	5,305,232,494.26
合计	4,128,488,193.20	5,305,232,494.26

注: 持有发行期限在一年以内(含)的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示,持有的其他同业存单以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合,从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式: 资产变现风险和现金流风险。

##### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大,或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析,以对资产变现风险进行管理。

##### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人定期或不定期对基金净退出比例进行测算和分析,以对该风险进行跟踪和管理。此外,本基金管理人建立了现金头寸控制机制,以确保退出款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全基金流动性风险管理的内部控制体系，包括严密完备的管理制度、科学规范的业务控制流程、清晰明确的组织架构与职责分工、独立严格的监督制衡与评估机制、灵活有效的应急处置计划等，同时已在内部设立专门的岗位及足够的人员配备，负责基金的流动性风险评估与监测。

本基金的基金管理人已建立以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，并针对不同类型开放式基金制定了健全有效的流动性风险指标预警监测体系。日常监控采用的流动性风险监测指标包括但不限于债券正回购杠杆比例、7 个工作日可变现资产的可变现价值、流动受限资产比例、前十大份额持有人集中度、资产集中度、净流动性敞口等，投资过程中综合考虑产品投资者结构、开放申赎情况，在资产配置时对资产的集中度、期限结构、收益结构等方面做出合理安排，以确保产品资产的变现能力与投资者赎回需求匹配。

本基金所持证券除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本基金本报告期末及报告期间均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 0 6 月 30	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---------------------------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日						
资产						
银行存款	4,316,209,056.54	1,324,456,833.86	-	-	-	5,640,665,890.40
交易性金融资产	3,784,619,514.40	374,029,783.57	-	-	-	4,158,649,297.97
买入返售金融资产	185,081,931.55	-	-	-	-	185,081,931.55
其他资产	-	-	-	-	43,835.30	43,835.30
资产总计	8,285,910,502.49	1,698,486,617.43	-	-	43,835.30	9,984,440,955.22
负债						
卖出回购金融资产款	249,115,490.76	-	-	-	-	249,115,490.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,919,883.17	7,919,883.17
应付托管费	-	-	-	-	439,993.49	439,993.49
应付销售服务费	-	-	-	-	2,199,967.55	2,199,967.55
应付利润	-	-	-	-	1,320,171.73	1,320,171.73
其他负债	-	-	-	-	146,122.21	146,122.21
负债总计	249,115,490.76	-	-	-	12,026,138.15	261,141,628.91
利率敏感度缺口	8,036,795,011.73	1,698,486,617.43	-	-	-11,982,302.85	9,723,299,326.31
上年度末 2022年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,909,196,871.75	1,428,102,123.79	-	-	-	3,337,298,995.54
结算备付金	24,557,604.60	-	-	-	-	24,557,604.60
交易性金融资产	4,702,070,776.80	603,161,717.46	-	-	-	5,305,232,494.26
买入返售金融资产	700,154,332.38	-	-	-	-	700,154,332.38
其他资	-	-	-	-	6,574.96	6,574.96

产						
资产总计	7,335,979,585.53	2,031,263,841.25	-	-	6,574.96	9,367,250,001.74
负债						
卖出回购金融资产款	200,028,626.07	-	-	-	-	200,028,626.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,825,617.49	7,825,617.49
应付托管费	-	-	-	-	434,756.49	434,756.49
应付销售服务费	-	-	-	-	2,173,782.61	2,173,782.61
应付利润	-	-	-	-	2,593,467.85	2,593,467.85
其他负债	-	-	-	-	283,867.18	283,867.18
负债总计	200,028,626.07	-	-	-	13,311,491.62	213,340,117.69
利率敏感度缺口	7,135,950,959.46	2,031,263,841.25	-	-	-13,304,916.66	9,153,909,884.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,344,417.15	4,107,191.29
	市场利率上升25个基点	-3,336,079.23	-4,099,305.94

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，因此无重大其他价格风险。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、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。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	4,158,649,297.97	5,305,232,494.26
第三层次	-	-
合计	4,158,649,297.97	5,305,232,494.26

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,158,649,297.97	41.65
	其中：债券	4,158,649,297.97	41.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	185,081,931.55	1.85
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,640,665,890.40	56.49
4	其他各项资产	43,835.30	0.00
5	合计	9,984,440,955.22	100.00

**7.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.91	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	249,115,490.76	2.56
	其中：买断式回购融资	-	-

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.14	2.56
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.73	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	7.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	46.59	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
	合计	102.23	2.56

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,161,104.77	0.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,128,488,193.20	42.46
8	其他	-	-
9	合计	4,158,649,297.97	42.77
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	112287934	22宁波银行C D276	1,500,000	149,093,074.85	1.53
2	112214099	22江苏银行C D099	1,000,000	99,939,901.68	1.03
3	112214108	22江苏银行C D108	1,000,000	99,902,193.38	1.03



4	112284371	22厦门国际银行CD141	1,000,000	99,810,716.19	1.03
5	112284833	22杭州银行C D233	1,000,000	99,794,919.92	1.03
6	112285946	22重庆银行C D103	1,000,000	99,673,446.63	1.03
7	112209152	22浦发银行C D152	1,000,000	99,440,517.29	1.02
8	112395251	23宁波银行C D041	1,000,000	99,427,548.93	1.02
9	112395621	23杭州银行C D067	1,000,000	99,395,227.13	1.02
10	112303070	23农业银行C D070	1,000,000	99,298,086.34	1.02

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0300%
报告期内偏离度的最低值	-0.0534%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0241%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用“摊余成本法”计算集合计划资产净值，为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

**7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情形。**

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.9.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	43,835.30
7	其他	-
8	合计	43,835.30

## 58 基金份额持有人信息

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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

167,086	58,193.38	337,621,089.55	3.47%	9,385,678,236.76	96.53%
---------	-----------	----------------	-------	------------------	--------

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	78,718,239.84	0.81%
2	其他机构	44,915,810.43	0.46%
3	个人	44,384,303.27	0.46%
4	个人	43,819,538.47	0.45%
5	其他机构	37,034,400.09	0.38%
6	个人	27,053,522.90	0.28%
7	其他机构	23,300,029.79	0.24%
8	其他机构	23,260,241.09	0.24%
9	个人	21,594,686.11	0.22%
10	个人	20,812,991.58	0.21%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	16,087,742.70	0.17%

## 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年01月17日)基金份额总额	7,820,549,804.00
本报告期期初基金份额总额	9,153,909,884.05
本报告期基金总申购份额	100,516,135,461.33

减：本报告期基金总赎回份额	99,946,746,019.07
本报告期期末基金份额总额	9,723,299,326.31

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人分别于2023年2月18日、2023年3月1日、2023年5月27日发布公告，李岩先生自2023年2月17日起担任方正证券股份有限公司财务负责人，陈飞先生因达到法定退休年龄于2023年2月27日辞去首席风险官职务，公司董事会聘任孙斌先生担任首席风险官，曹玉海先生自2023年5月25日起担任方正证券股份有限公司合规总监。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	2	-	-	52,990.53	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券股份有限公司	76,987,671.24	100.00%	14,017,995,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内本基金未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 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	方正证券现金港货币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	2023-01-12
2	方正证券现金港货币型集合资产管理计划基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-12
3	方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-01
4	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-18
5	方正证券现金港货币型集合	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-24

	资产管理计划收益支付公告		
6	方正证券股份有限公司关于高级管理人员辞职的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-01
7	方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-24
8	方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-26
9	方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
10	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
11	方正证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-27
12	方正证券股份有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-10
13	方正证券现金港货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予民族证券现金港集合资产管理计划变更的文件
- 2、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《方正证券现金港货币型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照

6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内披露的各项公告

## 12.2 存放地点

北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

## 12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95571

公司网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

方正证券股份有限公司  
二〇二三年八月三十一日