

# 方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:方正证券股份有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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2024年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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 .....	14
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 .....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	方正鑫悦一年持有债券	
基金主代码	970052	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年09月16日	
基金管理人	方正证券股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,743,924.10份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C
下属分级基金的交易代码	970052	970053
报告期末下属分级基金的份额总额	7,624,592.52份	1,119,331.58份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%

风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。本集合计划可以投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正证券股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈慧蕾	方圆
	联系电话	010-56992726	95559
	电子邮箱	chenhuilei@foundersc.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		95571	95559
传真		010-56992708	021-62701216
注册地址		湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中中心4,5号楼3701-3717	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100020	200336
法定代表人		施华	任德奇

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	方正证券股份有限公司	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	方正鑫悦一年持有 债券A	方正鑫悦一年持有 债券C
本期已实现收益	-164,079.78	-49,003.67
本期利润	244,964.42	29,971.22
加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0078
本期加权平均净值利润率	1.24%	0.77%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	2,032,195.29	7,420.41
期末可供分配基金份额利润	0.2665	0.0066
期末基金资产净值	7,909,978.03	1,150,201.92
期末基金份额净值	1.0374	1.0276
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.74%	2.76%

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

方正鑫悦一年持有债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.13%	0.05%	0.12%	0.08%	0.01%	-0.03%
过去三个月	0.78%	0.06%	1.07%	0.11%	-0.29%	-0.05%
过去六个月	1.33%	0.14%	2.45%	0.14%	-1.12%	0.00%
过去一年	0.99%	0.15%	1.57%	0.14%	-0.58%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.74%	0.16%	0.25%	0.17%	3.49%	-0.01%

方正鑫悦一年持有债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.10%	0.05%	0.12%	0.08%	-0.02%	-0.03%
过去三个月	0.68%	0.06%	1.07%	0.11%	-0.39%	-0.05%
过去六个月	1.13%	0.14%	2.45%	0.14%	-1.32%	0.00%
过去一年	0.59%	0.14%	1.57%	0.14%	-0.98%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.76%	0.16%	0.18%	0.17%	2.58%	-0.01%

注：基金合同生效日为2021年09月16日，方正鑫悦一年持有债券C自2021年10月11日起开放申购和赎回业务。

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



方正鑫悦一年持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年09月16日-2024年06月30日)



方正鑫悦一年持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月11日-2024年06月30日)



## §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2024年6月30日，本基金管理人共管理了3只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划、方正证券现金港币型集合资产管理计划、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李理	本基金的基金经理、方正证券股份有限公司组合投资部行政负责人、资管债券投资部联席行政负责人	2021-09-16	-	7年	男，2012年8月加入中国工商银行总行金融市场部固定收益处任投资经理；2016年10月加入广州证券股份有限公司（现中信证券华南股份有限公司）固定收益事业部任投资经理；2020年1月加入中信证券股份有限公司固定收益部；2020年7月加入方正证券股份有限公司，现任组合投资部行政负责人、资管债券投资部联席行政负责人、投资经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现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

2024年上半年，国内经济呈现冲高回落态势，1月、2月、5月、6月的制造业PMI低于荣枯线，3月、4月在50上方，价格指数方面，CPI低位徘徊，PPI同比降幅逐步收窄，整体价格指数对于实际GDP仍构成拖累。

资产表现方面，债券市场上半年表现强劲，除了3、4月震荡外，其余月份均录得较大涨幅。其中，1-2月份市场主线行情围绕降准降息预期和风险偏好展开，在2023年12月底部分银行调降存款利率后，市场对于今年开年以来政策利率下调抱有较高期待，加之权益市场表现较弱，市场收益率快速下行，1月下旬央行降准及2月LPR超预期下调进一步激发市场做多动能，30年国债成为这一阶段市场最为关注的品种之一，在票息收益率普遍下降后，拉长久期成为市场增厚收益的又一共识。进入3月后，债券市场一方面

在止盈力量和央行有关部门负责人提示长债利率风险下有一定调整压力，另一方面，在市场资金面依然平稳及配置资金依然较多情况下，做多动能仍存，3-4月市场整体保持震荡。进入5月后，社融数据偏弱叠加特别国债发行平缓，市场收益率再次下行，尤其进入6月后，随着权益市场下跌，市场风险偏好再次下移，加之海外开启降息周期，市场对于国内货币宽松预期升温，市场收益率加速下行。

权益与转债市场方面，上半年行情可以分为三个阶段，阶段一（开年以后至2月初），指数表现低于预期，部分股票出现流动性冲击，偏防御行业、中字头、红利指数等标的表现更优，阶段二（2月初至5月初），在多方力量的共同作用下，市场逐步企稳并迎来较大幅度反弹，反弹主力从科技龙头到业绩稳定、自由现金流改善板块进行轮动，阶段三（5月初至6月底），4月份经济数据公布，需求测仍需进一步提振，叠加外部扰动因素增加，市场开始调整。整体来看，2024年上半年Wind全A和中证转债指数分别下跌8.01%和0.07%。

组合操作上，产品在上半年对权益和转债仓位进行减仓，同时在已有仓位内部进行轮动，行业和个股的配置较为分散。具体到各类资产上，债券方面，根据市场走势与判断，一定程度提高组合久期。可转债方面，组合配置较为均衡，行业分布主要以银行、公用事业为主，股票方面，组合仍然配置有一定比例的股息率较高的红利资产，整体持仓的行业较为分散，持股的集中度较低。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正鑫悦一年持有债券A基金份额净值为1.0374元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.33%，同期业绩比较基准收益率为2.45%；截至报告期末方正鑫悦一年持有债券C基金份额净值为1.0276元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.13%，同期业绩比较基准收益率为2.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从本轮经济库存周期的节奏和价格水平看，截至2024年5月份，工业企业产成品库存同比增速为3.6%，继续在低位徘徊，与之前六次库存周期的底部（2002、2006、2009、2013、2016、2019年）相比，绝对增速已接近周期底部，同时低位徘徊的时间已近一年，预计经济进一步下探的空间有限，从目前供需格局看，工业增加值仍保持较快增长而代表需求的PMI新订单则围绕50荣枯线上下波动，预计下一步的政策着力点将是更多提升需求水平。从价格水平看，GDP平减指数处于近30年来的第五个低点，从绝对水平看，已经接近前几次的低点，同时第二季度的累计同比增速出现小幅反弹，下半年来看，支撑国内价格水平上升的因素包括库存周期上升及财政扩张等，叠加基数效应，预计整体通胀水平有小幅回升。

从资产价格看，债券市场在经历了上半年的大幅上涨后，目前收益率绝对水平和相对利差都达到历史低位，考虑到经济复苏仍需要较为充裕的流动性环境，预计货币政策收紧的概率不大，但也要注意央行在今年进一步丰富了货币政策的调控框架，并加入“借券”等操作，市场收益率在下半年更可能呈现区间震荡而不是单边下行。转债方面，上半年表现好于股票，这很大程度得益于纯债市场的良好表现，但在中报公布时点前后出现持续下跌，部分转债由于正股低迷连续下挫，低价转债则出现大幅杀跌情况，这都显示转债市场的定价逻辑出现变化，“信用风险”的考量将在转债定价中得到更多权重。权益市场方面，今年整体看大盘龙头的表现要明显好于中小盘，这里面既有龙头的业绩表现和稳定性更优的原因，也有市场对于业绩确定性和投资胜率追求的影响，预计在经济没有显著复苏之前，市场的增量资金仍然有限，存量博弈的状态带来的是轮动的加速和操作难度的提升，这个时候，耐心选择估值、业绩合适的标的，并在市场时机合适的时候进行配置可能更为重要。

#### 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，本基金管理人作为准确、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

截至本报告期末，根据本基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

报告期内，本基金从2024年1月1日至2024年6月30日连续123个工作日基金资产净值低于五千万元。

## §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

本报告期间，基金托管人在方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期间，方正证券股份有限公司在方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

## 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

本报告期间，由方正证券股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	413,863.75	1,233,696.22
结算备付金		606,557.44	765,664.62
存出保证金		4,838.46	6,782.63
交易性金融资产	6.4.7.2	8,207,164.84	36,277,984.98
其中：股票投资		430,942.50	4,695,392.33
基金投资		-	-
债券投资		7,776,222.34	31,582,592.65
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	-	-
应收清算款		21,313.11	820,227.80
应收股利		1,871.02	-
应收申购款		-	29.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	17,208.38	56,611.94
资产总计		9,272,817.00	39,160,998.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	4,799,803.19
应付清算款		-	444,124.01
应付赎回款		-	218,815.36
应付管理人报酬		5,164.75	17,532.31
应付托管费		1,721.57	5,844.10
应付销售服务费		468.78	2,094.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		130.33	991.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	205,151.62	313,485.53
负债合计		212,637.05	5,802,690.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	6,997,114.32	26,485,521.79
未分配利润	6.4.7.8	2,063,065.63	6,872,786.32
净资产合计		9,060,179.95	33,358,308.11
负债和净资产总计		9,272,817.00	39,160,998.17

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额8,743,924.10份，其中A类基金份额净值1.0374元，基金份额总额7,624,592.52份；C类基金份额净值1.0276元，基金份额总额1,119,331.58份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		477,596.09	1,663,628.01
1.利息收入		7,156.86	22,073.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,047.90	22,073.48
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		1,108.96	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-17,579.86	-477,117.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-479,054.71	-1,517,039.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	453,936.53	917,806.42
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	7,538.32	122,114.76
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.13	488,019.09	2,118,672.52



以“-”号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列)		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		202,660.45	735,424.84
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	71,371.45	251,297.78
2.托管费	6.4.10.2.2	23,790.42	83,765.98
3.销售服务费	6.4.10.2.3	7,838.39	25,042.50
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		11,665.49	283,984.35
其中：卖出回购金融资产支出		11,665.49	283,984.35
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		143.88	3,937.91
8.其他费用	6.4.7.14	87,850.82	87,396.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b>		274,935.64	928,203.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>		274,935.64	928,203.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		274,935.64	928,203.17

### 6.3 净资产变动表

会计主体：方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	26,485,521.79	6,872,786.32	33,358,308.11
二、本期期初净资产	26,485,521.79	6,872,786.32	33,358,308.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,488,407.47	-4,809,720.69	-24,298,128.16
（一）、综合收益总额	-	274,935.64	274,935.64
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-19,488,407.47	-5,084,656.33	-24,573,063.80
其中：1.基金申购款	341.16	75.64	416.80
2.基金赎回款	-19,488,748.63	-5,084,731.97	-24,573,480.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	6,997,114.32	2,063,065.63	9,060,179.95
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	90,262,390.91	24,326,027.69	114,588,418.60
二、本期期初净资产	90,262,390.91	24,326,027.69	114,588,418.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,546,116.10	-11,716,574.22	-55,262,690.32

填列)			
(一)、综合收益总额	-	928,203.17	928,203.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-43,546,116.10	-12,644,777.39	-56,190,893.49
其中: 1.基金申购款	94,588.98	30,377.48	124,966.46
2.基金赎回款	-43,640,705.08	-12,675,154.87	-56,315,859.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	46,716,274.81	12,609,453.47	59,325,728.28

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

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

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

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》,本集合计划参照《中华人民共

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

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自本资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。方正证券股份有限公司是本集合计划的管理人，交通银行股份有限公司是本计划的托管人，方正证券股份有限公司是本计划的注册登记机构。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据））、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。管理层编制财务报表是为了满足中国证券监督管理委员会及其派出机构和本基金的份额持有人的要求。因此，财务报表不适用于其他用途。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照财务报表附注6.4.2所述编制基础编制。

### 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

#### 1. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定及其他相关法规，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2018年1月1日起，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；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 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。根据《财政部税务总局关于减半征收证券交易印花税的公

告》（财政部税务总局公告2023年第39号）规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

### 3.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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	413,863.75
等于：本金	413,777.91
加：应计利息	85.84
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	413,863.75

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		395,875.82	-	430,942.50	35,066.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,597,442.14	104,611.90	7,776,222.34	74,168.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,597,442.14	104,611.90	7,776,222.34	74,168.30
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,993,317.96	104,611.90	8,207,164.84	109,234.98

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应收利息	378.00
其他应收款	-
待摊费用	16,830.38
合计	17,208.38

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	2,809.08
其中：交易所市场	2,809.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,863.02
其他应付	177,479.52
合计	205,151.62

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 方正鑫悦一年持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,806,313.76	20,665,072.78
本期申购	294.89	227.34
本期赎回（以“-”号填列）	-19,182,016.13	-14,787,517.38
本期末	7,624,592.52	5,877,782.74

##### 6.4.7.7.2 方正鑫悦一年持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,820,449.01	5,820,449.01
本期申购	113.82	113.82
本期赎回（以“-”号填列）	-4,701,231.25	-4,701,231.25



本期末	1,119,331.58	1,119,331.58
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 方正鑫悦一年持有债券A

单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,073,187.15	-1,294,163.46	6,779,023.69
本期期初	8,073,187.15	-1,294,163.46	6,779,023.69
本期利润	-164,079.78	409,044.20	244,964.42
本期基金份额交易产生的变动数	-5,619,186.29	627,393.47	-4,991,792.82
其中：基金申购款	89.17	-15.71	73.46
基金赎回款	-5,619,275.46	627,409.18	-4,991,866.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,289,921.08	-257,725.79	2,032,195.29

#### 6.4.7.8.2 方正鑫悦一年持有债券C

单位：人民币元

项目 (方正鑫悦一年持有债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,408.50	38,354.13	93,762.63
本期期初	55,408.50	38,354.13	93,762.63
本期利润	-49,003.67	78,974.89	29,971.22
本期基金份额交易产生的变动数	1,015.58	-93,879.09	-92,863.51
其中：基金申购款	-0.12	2.30	2.18
基金赎回款	1,015.70	-93,881.39	-92,865.69
本期已分配利润	-	-	-

本期末	7,420.41	23,449.93	30,870.34
-----	----------	-----------	-----------

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入		4,316.92
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,681.99
其他		48.99
合计		6,047.90

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额		8,301,743.29
减：卖出股票成本总额		8,763,628.89
减：交易费用		17,169.11
买卖股票差价收入		-479,054.71

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入		240,742.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		213,193.64
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	453,936.53
----	------------

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	67,174,004.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	66,047,471.64
减：应计利息总额	912,136.64
减：交易费用	1,202.59
买卖债券差价收入	213,193.64

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	7,538.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,538.32

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	488,019.09
——股票投资	360,274.42
——债券投资	127,744.67
——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	-
合计	488,019.09

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
汇划手续费	1,506.24
信息披露费	39,781.56
审计费用	24,863.02
帐户维护费	21,700.00
合计	87,850.82

#### 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

根据《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）第五部分“第五部分集合计划的存续”的约定：“本集合计划自本资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。”

《资产管理合同》于2021年9月16日生效，本集合计划存续期将不超过2024年9月16日。存续期届满后，本集合计划应当终止，并无需召开集合计划份额持有人大会，终止后本集合计划将进入清算程序。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交通银行股份有限公司	基金托管人
方正中期期货有限公司	基金管理人子公司、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、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
北京汇成基金销售有限公司	基金销售机构
京东肯特瑞基金销售有限公司	基金销售机构
浙江同花顺基金销售有限公司	基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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	12,435,132.83	100.00%	64,924,729.39	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	95,957,162.56	100.00%	110,697,572.00	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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	136,530,000.00	100.00%	674,700,000.00	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 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比例		额的比例
方正证券股份有限公司	11,292.50	100.00%	2,809.08	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	29,060.37	100.00%	11,769.35	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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	71,371.45	251,297.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	59.10	265.88
应支付基金管理人的净管理费	71,312.35	251,031.90

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

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

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,790.42	83,765.98

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

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

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C	合计
方正证券 股份有限 公司	0.00	7,801.96	7,801.96
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	19.01	19.01
蚂蚁（杭	0.00	17.42	17.42



州)基金销售有限公司			
合计	0.00	7,838.39	7,838.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C	合计
方正证券股份有限公司	0.00	24,966.74	24,966.74
上海天天基金销售有限公司	0.00	35.19	35.19
蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	0.00	40.57	40.57
合计	0.00	25,042.50	25,042.50

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费年费率为0.4%。C类计划份额的销售服务费按前一日C类计划份额的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类计划份额每日应计提的销售服务费

E为C类计划份额前一日的集合计划资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

方正鑫悦一年持有债券A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,044,740.13	1,044,740.13
报告期间申购/买入总份额	-	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	1,044,740.13	1,044,740.13
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.70%	2.16%

方正鑫悦一年持有债券C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

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

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
交通银行股份有限公司	413,863.75	4,316.92	5,405,195.65	16,690.50

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024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2024年6月30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。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,603,735.19	15,421,352.60
AAA以下	199,803.02	1,541,449.09
未评级	-	2,083,620.77
合计	1,803,538.21	19,046,422.46

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### （1）资产变现风险

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

#### （2）现金流风险

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

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及报告期间均无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	413,863.75	-	-	-	413,863.75
结算备付金	98,751.92	-	-	507,805.52	606,557.44
存出保证金	4,838.46	-	-	-	4,838.46
交易性金融资产	1,242,034.90	6,204,439.02	329,748.42	430,942.50	8,207,164.84
应收清算款	-	-	-	21,313.11	21,313.11
应收股利	-	-	-	1,871.02	1,871.02
其他资产	-	-	-	17,208.38	17,208.38
资产总计	1,759,489.03	6,204,439.02	329,748.42	979,140.53	9,272,817.00
负债					
应付管理人报	-	-	-	5,164.75	5,164.75

酬					
应付托管费	-	-	-	1,721.57	1,721.57
应付销售服务费	-	-	-	468.78	468.78
应交税费	-	-	-	130.33	130.33
其他负债	-	-	-	205,151.62	205,151.62
负债总计	-	-	-	212,637.05	212,637.05
利率敏感度缺口	1,759,489.03	6,204,439.02	329,748.42	766,503.48	9,060,179.95
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,233,696.22	-	-	-	1,233,696.22
结算备付金	257,859.10	-	-	507,805.52	765,664.62
存出保证金	6,782.63	-	-	-	6,782.63
交易性金融资产	12,563,607.56	14,819,277.38	4,199,707.71	4,695,392.33	36,277,984.98
应收清算款	-	-	-	820,227.80	820,227.80
应收申购款	-	-	-	29.98	29.98
其他资产	-	-	-	56,611.94	56,611.94
资产总	14,061,945.51	14,819,277.38	4,199,707.71	6,080,067.57	39,160,998.17

计					
负债					
卖出回购金融资产款	4,799,803.19	-	-	-	4,799,803.19
应付清算款	-	-	-	444,124.01	444,124.01
应付赎回款	-	-	-	218,815.36	218,815.36
应付管理人报酬	-	-	-	17,532.31	17,532.31
应付托管费	-	-	-	5,844.10	5,844.10
应付销售服务费	-	-	-	2,094.07	2,094.07
应交税费	-	-	-	991.49	991.49
其他负债	-	-	-	313,485.53	313,485.53
负债总计	4,799,803.19	-	-	1,002,886.87	5,802,690.06
利率敏感度缺口	9,262,142.32	14,819,277.38	4,199,707.71	5,077,180.70	33,358,308.11

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
		市场利率下降25个基点	49,624.16



	市场利率上升25个基点	-48,954.07	-163,114.76
--	-------------	------------	-------------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	168,790.10	-	168,790.10
应收股利	-	1,871.02	-	1,871.02
资产合计	-	170,661.12	-	170,661.12
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	170,661.12	-	170,661.12
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	407,954.88	-	407,954.88
资产合计	-	407,954.88	-	407,954.88
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	407,954.88	-	407,954.88

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变
----	----------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	港币对人民币升值5%	8,533.06	20,397.74
港币对人民币贬值5%	-8,533.06	-20,397.74	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外,本基金管理人通过建立多层次的风险指标体系,对其他价格风险进行持续的度量和分析,以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	430,942.50	4.76	4,695,392.33	14.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,776,222.34	85.83	31,582,592.65	94.68
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	8,207,164.84	90.59	36,277,984.98	108.75
----	--------------	-------	---------------	--------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准下降5%	-317,441.86	-1,154,595.86
	业绩比较基准上升5%	317,441.86	1,154,595.86

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,081,226.19	8,303,930.95
第二层次	7,125,938.65	27,974,054.03
第三层次	-	-
合计	8,207,164.84	36,277,984.98

#### 6.4.14.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	430,942.50	4.65
	其中：股票	430,942.50	4.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,776,222.34	83.86
	其中：债券	7,776,222.34	83.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金	-	-

	融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,020,421.19	11.00
8	其他各项资产	45,230.97	0.49
9	合计	9,272,817.00	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为168,790.10元，占资产净值比例1.86%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	51,021.00	0.56
C	制造业	75,681.40	0.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,734.00	0.32
E	建筑业	12,476.00	0.14
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	41,161.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,880.00	0.15
J	金融业	39,199.00	0.43
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	262,152.40	2.89

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	5,978.05	0.07
消费者非必需品	-	0.00
消费者常用品	-	0.00
能源	55,322.09	0.61
金融	42,941.59	0.47
医疗保健	-	0.00
工业	-	0.00
信息技术	53,979.54	0.60
电信服务	-	0.00
公用事业	10,568.83	0.12
房地产	-	0.00
合计	168,790.10	1.86

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	100	33,988.20	0.38
2	01088	中国神华	500	16,405.42	0.18
2	601088	中国神华	300	13,311.00	0.15
3	01398	工商银行	6,000	25,409.01	0.28
4	601128	常熟银行	3,300	24,981.00	0.28
5	600900	长江电力	800	23,136.00	0.26
6	00883	中国海洋石油	1,000	20,444.03	0.23
7	00386	中国石油化工股份	4,000	18,472.64	0.20

8	300750	宁德时代	100	18,003.00	0.20
9	00902	华能国际电力股份	2,000	10,568.83	0.12
10	688568	中科星图	200	9,540.00	0.11
11	600028	中国石化	1,500	9,480.00	0.10
12	601006	大秦铁路	1,300	9,308.00	0.10
13	01810	小米集团—W	600	9,024.58	0.10
14	300274	阳光电源	140	8,684.20	0.10
15	00981	中芯国际	500	7,812.54	0.09
16	601225	陕西煤业	300	7,731.00	0.09
17	01658	邮储银行	1,000	4,180.07	0.05
17	601658	邮储银行	700	3,549.00	0.04
18	600018	上港集团	1,200	6,936.00	0.08
19	600188	兖矿能源	300	6,819.00	0.08
20	000333	美的集团	100	6,450.00	0.07
21	000429	粤高速 A	600	6,246.00	0.07
22	01818	招金矿业	500	5,978.05	0.07
23	00763	中兴通讯	200	3,154.22	0.03
23	000063	中兴通讯	100	2,797.00	0.03
24	601298	青岛港	600	5,736.00	0.06
25	600690	海尔智家	200	5,676.00	0.06
26	601668	中国建筑	1,000	5,310.00	0.06
27	00939	建设银行	1,000	5,266.16	0.06
28	600377	宁沪高速	400	5,040.00	0.06
29	600461	洪城环境	400	4,632.00	0.05
30	00998	中信银行	1,000	4,572.53	0.05
31	002142	宁波银行	200	4,412.00	0.05
32	600398	海澜之家	455	4,204.20	0.05
33	603019	中科曙光	100	4,150.00	0.05
34	000983	山西焦煤	400	4,124.00	0.05

35	002241	歌尔股份	200	3,902.00	0.04
36	300433	蓝思科技	200	3,650.00	0.04
37	600350	山东高速	400	3,540.00	0.04
38	601899	紫金矿业	200	3,514.00	0.04
39	03988	中国银行	1,000	3,513.82	0.04
40	600435	北方导航	400	3,448.00	0.04
41	601001	晋控煤业	200	3,304.00	0.04
42	601868	中国能建	1,500	3,180.00	0.04
43	600129	太极集团	100	2,892.00	0.03
44	601058	赛轮轮胎	200	2,800.00	0.03
45	600012	皖通高速	200	2,794.00	0.03
46	600547	山东黄金	100	2,738.00	0.03
47	601800	中国交建	300	2,682.00	0.03
48	600926	杭州银行	200	2,610.00	0.03
49	600066	宇通客车	100	2,580.00	0.03
50	601728	中国电信	400	2,460.00	0.03
51	600908	无锡银行	400	2,128.00	0.02
52	000703	恒逸石化	300	2,127.00	0.02
53	002465	海格通信	200	2,072.00	0.02
54	600050	中国联通	400	1,880.00	0.02
55	600026	中远海能	100	1,561.00	0.02
56	601600	中国铝业	200	1,526.00	0.02
57	601838	成都银行	100	1,519.00	0.02
58	601390	中国中铁	200	1,304.00	0.01
59	600995	南网储能	100	966.00	0.01
60	300655	晶瑞电材	100	720.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------



号				资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	167,000.00	0.50
2	300624	万兴科技	118,359.00	0.35
3	688012	中微公司	111,222.00	0.33
4	300308	中际旭创	110,832.00	0.33
5	300750	宁德时代	103,542.00	0.31
6	00700	腾讯控股	79,485.07	0.24
7	000628	高新发展	75,812.00	0.23
8	688041	海光信息	61,268.00	0.18
9	300760	迈瑞医疗	58,599.00	0.18
10	688256	寒武纪	57,338.00	0.17
11	002920	德赛西威	49,811.00	0.15
12	002371	北方华创	48,839.00	0.15
13	601138	工业富联	43,651.00	0.13
14	688111	金山办公	43,604.00	0.13
15	601088	中国神华	43,502.00	0.13
16	603220	中贝通信	42,599.00	0.13
17	600999	招商证券	41,550.00	0.12
18	688408	中信博	41,384.00	0.12
19	603019	中科曙光	41,356.00	0.12
20	601127	赛力斯	38,414.00	0.12

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	336,710.00	1.01
2	300308	中际旭创	142,045.00	0.43
3	601088	中国神华	131,516.00	0.39

4	300624	万兴科技	127,754.00	0.38
5	300750	宁德时代	114,531.00	0.34
6	600900	长江电力	108,752.00	0.33
7	00700	腾讯控股	103,816.62	0.31
8	688012	中微公司	102,598.00	0.31
9	688111	金山办公	101,208.00	0.30
10	002371	北方华创	101,066.00	0.30
11	600188	兖矿能源	91,246.00	0.27
12	000628	高新发展	91,099.00	0.27
13	688256	寒武纪	84,704.99	0.25
14	601127	赛力斯	73,956.00	0.22
15	002594	比亚迪	72,570.00	0.22
16	600028	中国石化	69,708.00	0.21
17	601881	中国银河	68,441.66	0.21
18	600350	山东高速	66,745.00	0.20
19	688041	海光信息	65,956.00	0.20
20	603019	中科曙光	64,088.00	0.19

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,138,904.64
卖出股票收入（成交）总额	8,301,743.29

#### 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	3,506,016.09	38.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,770,121.13	19.54
	其中：政策性金融债	1,770,121.13	19.54
4	企业债券	1,153,254.52	12.73

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	650,283.69	7.18
8	同业存单	-	-
9	其他	696,546.91	7.69
10	合计	7,776,222.34	85.83

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019725	23国债22	11,000	1,146,413.97	12.65
2	018063	进出2101	10,000	1,031,232.33	11.38
3	019710	23国债17	9,000	925,571.10	10.22
4	149816	22广金01	6,000	627,073.97	6.92
5	018020	国开2302	6,000	614,354.14	6.78

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,838.46
2	应收清算款	21,313.11
3	应收股利	1,871.02
4	应收利息	378.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	16,830.38
8	其他	-
9	合计	45,230.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	56,838.69	0.63
2	110059	浦发转债	33,083.61	0.37
3	113065	齐鲁转债	22,799.50	0.25
4	110079	杭银转债	21,738.61	0.24
5	113052	兴业转债	21,643.12	0.24
6	127045	牧原转债	20,120.21	0.22
7	110073	国投转债	19,484.03	0.22
8	113021	中信转债	18,904.98	0.21
9	113050	南银转债	18,812.49	0.21
10	127056	中特转债	18,587.75	0.21

11	113044	大秦转债	18,039.81	0.20
12	128048	张行转债	17,523.00	0.19
13	110093	神马转债	16,575.94	0.18
14	113055	成银转债	16,372.87	0.18
15	113056	重银转债	16,269.60	0.18
16	110089	兴发转债	15,732.82	0.17
17	127022	恒逸转债	15,330.93	0.17
18	113067	燃23转债	14,829.69	0.16
19	127018	本钢转债	14,100.10	0.16
20	113043	财通转债	13,338.62	0.15
21	113053	隆22转债	13,227.62	0.15
22	113054	绿动转债	12,676.33	0.14
23	127032	苏行转债	12,570.78	0.14
24	113068	金铜转债	11,068.92	0.12
25	113047	旗滨转债	10,964.94	0.12
26	128129	青农转债	10,643.02	0.12
27	127025	冀东转债	10,348.65	0.11
28	113516	苏农转债	9,898.71	0.11
29	123035	利德转债	9,200.27	0.10
30	128136	立讯转债	9,135.86	0.10
31	127020	中金转债	8,431.15	0.09
32	113641	华友转债	8,117.50	0.09
33	110067	华安转债	7,764.34	0.09
34	113061	拓普转债	5,934.79	0.07
35	113049	长汽转债	5,590.15	0.06
36	110064	建工转债	5,579.50	0.06
37	113024	核建转债	5,518.06	0.06
38	127049	希望转2	5,175.21	0.06
39	127027	能化转债	5,140.33	0.06
40	110083	苏租转债	5,088.22	0.06
41	123107	温氏转债	5,047.93	0.06

42	113060	浙22转债	5,004.08	0.06
43	110075	南航转债	4,959.59	0.05
44	123048	应急转债	4,823.62	0.05
45	110062	烽火转债	4,700.30	0.05
46	113066	平煤转债	4,502.65	0.05
47	110085	通22转债	4,230.79	0.05
48	127039	北港转债	3,621.85	0.04
49	113045	环旭转债	3,563.79	0.04
50	123108	乐普转2	3,187.54	0.04
51	110087	天业转债	3,035.34	0.03
52	127089	晶澳转债	2,919.02	0.03
53	127086	恒邦转债	2,483.64	0.03
54	113616	韦尔转债	2,245.37	0.02
55	127038	国微转债	2,206.85	0.02
56	110077	洪城转债	2,107.72	0.02
57	127064	杭氧转债	1,476.57	0.02
58	110068	龙净转债	1,340.94	0.01
59	113631	皖天转债	1,265.92	0.01
60	127040	国泰转债	1,135.03	0.01
61	127017	万青转债	1,107.11	0.01
62	127030	盛虹转债	1,073.07	0.01
63	127083	山路转债	1,068.02	0.01
64	118034	晶能转债	976.23	0.01

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有人户数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
方正鑫悦一年持有债券A	151	50,493.99	1,044,740.13	13.70%	6,579,852.39	86.30%
方正鑫悦一年持有债券C	45	24,874.04	0.00	0.00%	1,119,331.58	100.00%
合计	196	44,611.86	1,044,740.13	11.95%	7,699,183.97	88.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	方正鑫悦一年持有债券A	8,218.85	0.11%
	方正鑫悦一年持有债券C	165,602.24	14.79%
	合计	173,821.09	1.99%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	方正鑫悦一年持有债券A	0~10
	方正鑫悦一年持有	10~50

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	方正鑫悦一年持有债券A	方正鑫悦一年持有债券C
基金合同生效日(2021年09月16日)基金份额总额	6,533,709.38	-
本报告期期初基金份额总额	26,806,313.76	5,820,449.01
本报告期基金总申购份额	294.89	113.82
减：本报告期基金总赎回份额	19,182,016.13	4,701,231.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,624,592.52	1,119,331.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，审议《关于终止方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同有关事项的议案》，大会投票表决起止时间为自2024年5月8日起至2024年6月11日17:00止。2024年6月12日，根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具有效表决意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额未达到在权益登记日集合计划份额总数的二分之一，未达到法定的持有人会议召开条件。

### 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，本基金管理人未发生重大人事变动。



本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	12,435,132.83	100.00%	11,292.50	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	95,957,162.56	100.00%	136,530,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正证券鑫悦一年持有期债券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	2024-01-19
2	方正证券鑫悦一年持有期债券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	2024-01-19
3	方正证券鑫悦一年持有期债券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	2024-01-19
4	方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划暂停申购公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-15
5	方正证券股份有限公司关于以通讯方式召开方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-30
6	方正证券股份有限公司关于以通讯方式召开方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-06

7	方正证券股份有限公司关于以通讯方式召开方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-07
8	关于方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-13
9	方正证券鑫悦一年持有期债券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	2024-06-28
10	方正证券鑫悦一年持有期债券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	2024-06-28

## §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、中国证监会准予方正金泉友2号集合资产管理计划变更的文件
- 2、《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照

## 7、报告期内披露的各项公告

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

### 12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95571

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

方正证券股份有限公司  
二〇二四年八月三十日