
方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:方正证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至2024年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	方正证券鑫享三个月滚动债券	
基金主代码	970150	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月25日	
报告期末基金份额总额	76,410,532.99份	
投资目标	本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。	
基金管理人	方正证券股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	方正证券鑫享三个月滚	方正证券鑫享三个月滚

	动债券C	动债券E
下属分级基金的交易代码	970150	970151
报告期末下属分级基金的份额总额	76,410,532.99份	-份

注：1、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、本报告期末方正证券鑫享三个月滚动债券E类份额为0。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	方正证券鑫享三个月滚动债券C	方正证券鑫享三个月滚动债券E
1.本期已实现收益	-122,056.09	-
2.本期利润	162,401.69	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0019	-
4.期末基金资产净值	80,472,452.87	-
5.期末基金份额净值	1.0532	-

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、自2024年1月16日至本报告期末期间，方正证券鑫享三个月滚动债券E类基金份额为0。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正证券鑫享三个月滚动债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.16%	0.02%	0.43%	0.01%	-0.27%	0.01%
过去六个月	0.70%	0.02%	1.03%	0.01%	-0.33%	0.01%

过去一年	2.15%	0.02%	2.42%	0.01%	-0.27%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.32%	0.02%	5.44%	0.01%	-0.12%	0.01%

方正证券鑫享三个月滚动债券E净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
过去六个月	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
过去一年	0.92%	0.02%	0.81%	0.02%	0.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.21%	0.04%	3.50%	0.01%	-0.29%	0.03%

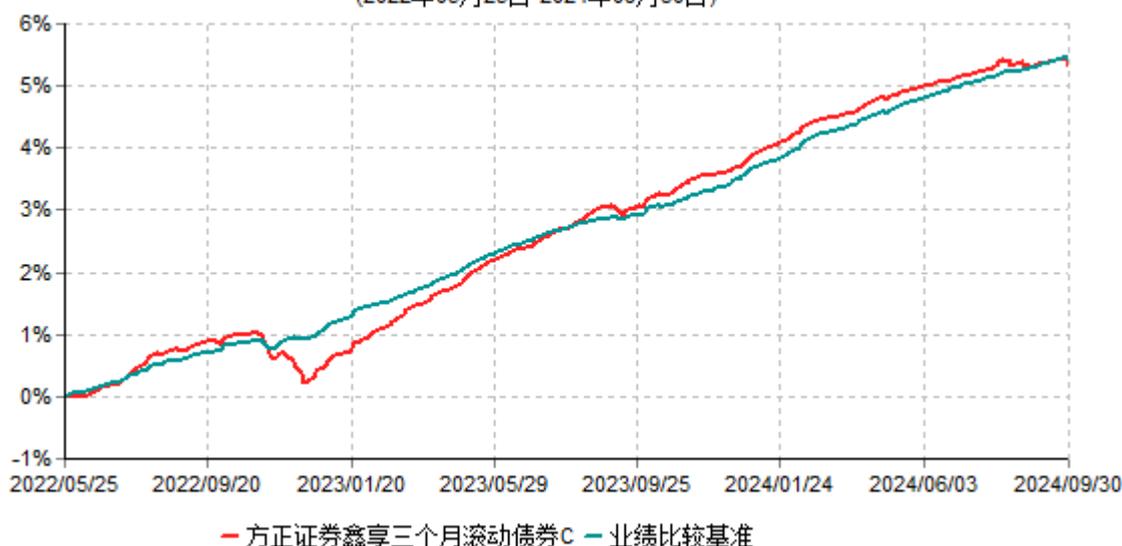
注：1、基金合同生效日为2022年5月25日，方正证券鑫享三个月滚动债券E自2022年7月1日起开放申购和赎回业务，首个投资者于2022年7月12日提交申购申请。

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。2024年1月16日，对E类基金份额1月15日的赎回申请按照1.0321元进行确认，赎回确认后E类基金份额为0。本基金E类份额自2024年1月16日至本报告期末期间无份额数据。

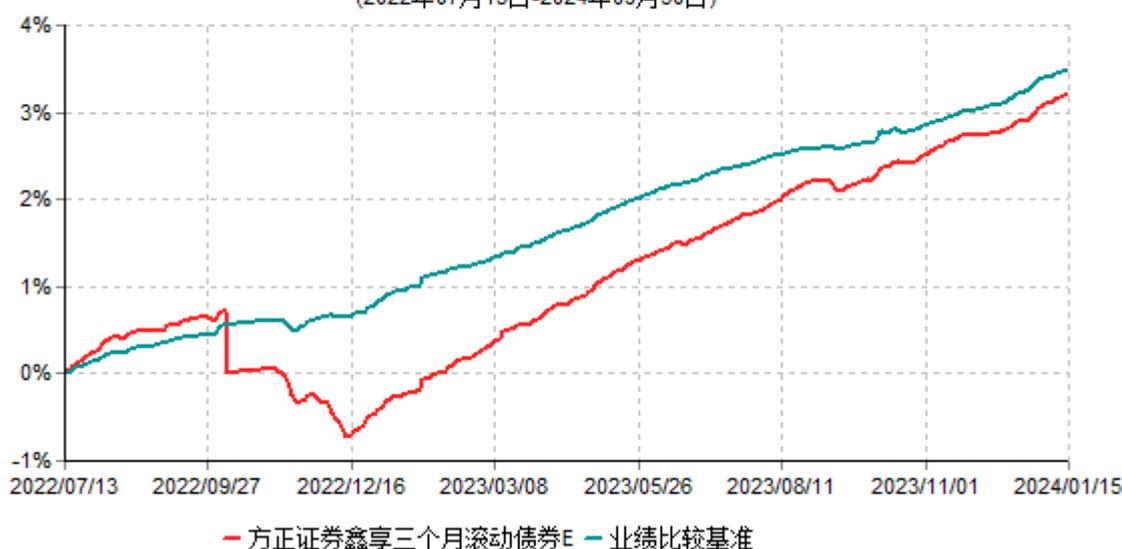
3、方正证券鑫享三个月滚动债券E无过去三个月和过去六个月的净值增长率、净值增长率标准差，过去一年的实际报告期间为2023年10月1日至2024年1月15日，自基金合同生效起至今的实际报告期间为2022年7月13日至2024年1月15日。

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

方正证券鑫享三个月滚动债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年05月25日-2024年09月30日)



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-2024年09月30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。
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。2024年1月16日，对E类基金份额1月15日的赎回申请按照1.0321元进行确认，赎回确认后E类基金份额为0。本基金E类份额自2024年1月16日至本报告期末期间无份额数据。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基	证券	说明
----	----	--------	----	----

		基金经理期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
宫健	本基金的基金经理	2022-05-25	-	12年	男，经济学硕士，具有证券、基金从业资格，银行间本币市场交易员资格，2012年入职民族证券有限责任公司，曾任资产管理业务部固收交易员、固收投资经理。2016年加入方正证券股份有限公司。现任资管债券投资部投资经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2024年三季度，经济数据延续弱势，受需求端的影响，生产也有所放缓，内需较弱的格局仍在延续。经济数据方面，8月工业增加值同比增长4.5%，低于预期值4.8%，环比弱于季节性。基建投资累计同比增长7.87%，增发国债、灾后恢复重建等项目建设加快对基建形成一定支撑，制造业投资累计同比增长9.1%，维持在较高增速水平。房地产开发投资累计同比下降10.2%，地产刺激政策对地产投资的改善效果相对有限。社会消费品零售总额同比增长2.1%，低于市场一致预期。8月出口同比增速为8.7%，仍维持一定韧性。通胀方面，8月CPI同比上涨0.6%，基数效应仍相对有利，但环比动能有待强化。

债券市场方面，三季度收益率曲线整体呈现先下后上的走势。利率债方面，7月至8月上旬受经济数据偏弱，通胀低位、政策利率下调等影响，收益曲线震荡下行，进入8月下旬随着止盈需求增加，长端风险提示等，利率低位反弹，9月底央行公布一系列政策，收益率曲线快速上行。信用债方面，7月份受配置力量带动，信用债收益率延续下行趋势，8月以来受大行卖出国债操作、央行多次提示长债风险等因素影响导致收益率上行，流动性偏弱的信用债调整时长和幅度明显高于利率债，信用利差全面走扩。截至三季度末，10年期国债收益率报2.15%，较上季度末下降5BP；1年期AA+级城投债收益率报2.25%，较上季度末上升18BP。

本基金在报告期内继续采取稳健的投资策略，组合维持短久期水平，控制回撤及波动率，以中短端高等级信用债为主要配置方向获取票息收益，并适当参与了波段交易，组合在三季度实现了净值的稳定增长。展望后市，四季度政策加码可能会对市场形成阶段性冲击，债券供给预计上升但仍有财政和货币政策的配合，经济向上动能有待观察。组合将继续保持稳健的风格特征，力争实现净值的稳步增长，为持有人获得较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末方正证券鑫享三个月滚动债券C基金份额净值为1.0532元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.16%，同期业绩比较基准收益率为0.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,562,687.98	91.24
	其中：债券	87,562,687.98	91.24
	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	8,398,040.20	8.75
8	其他资产	3,671.52	0.00
9	合计	95,964,399.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,175,588.52	31.28
	其中：政策性金融债	10,278,866.12	12.77
4	企业债券	46,754,900.01	58.10
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	15,632,199.45	19.43
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,562,687.98	108.81

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	200203	20国开03	100,000	10,278,866.12	12.77
2	2028051	20浦发银行永续债	50,000	5,341,607.92	6.64
3	2128047	21招商银行永续债	50,000	5,290,725.41	6.57
4	102103077	21淮北建投MTN003	50,000	5,281,237.70	6.56
5	102280163	22渝兴永MTN001	50,000	5,202,057.38	6.46

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,611.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,671.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	方正证券鑫享三个月滚动债券C	方正证券鑫享三个月滚动债券E
报告期期初基金份额总额	97,418,461.84	-
报告期期间基金总申购份额	2,922,443.85	-
减：报告期期间基金总赎回份额	23,930,372.70	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	76,410,532.99	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	方正证券鑫享三个月 滚动债券C	方正证券鑫享三个月 滚动债券E
报告期期初管理人持有的本基金份 额	4,192,732.58	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份 额	4,192,732.58	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例（%）	5.49	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予方正金泉友灵活配置集合资产管理计划变更的文件
- 2、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、方正证券鑫享三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

9.2 存放地点

北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

方正证券股份有限公司

2024年10月25日