

民族金扬帆1号集合资产管理计划

2021年第3季度报告

2021年09月30日



集合计划管理人:方正证券股份有限公司

集合计划托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期: 2021年10月28日

§ 1 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称“《实施细则》”）及其他有关规定制作。

中国证监会对“民族金扬帆1号集合资产管理计划”（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具了无异议函（文号：证监许可（2011）1729号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划托管人兴业银行股份有限公司对本报告中的主要财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。

本报告财务数据未经审计。

本报告中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 集合计划产品概况

集合计划简称	民族金扬帆1号
集合计划主代码	D10001
集合计划运作方式	开放式
集合计划合同生效日	2012年03月16日
报告期末集合计划份额总额	2,671,472.47份
集合计划风险特征	次高风险
投资目标	本集合计划在进行大类资产配置的基础上，重点投资于市场价值被低估、具有未来成长性的优质股票，在严格控制风险的前提下，力求获取持续的投资收益。
投资策略	1、资产类别配置 通过对国内外宏观经济环境、国家财政及货币政策的分析，预测未来宏观经济走势，判断受益资产类别；同时结合对各类宏观经济指标的分析，确定所处的经济周期，动态地调整各类资产在计划中的比例。

	2、股票投资策略 在把握宏观经济运行趋势的前提下，重点通过市盈率、市净率和托宾Q值等估值方法对市场价值被低估的优质股票进行深入挖掘，运用PEG等指标衡量所选个股的未来成长性；同时结合研究人员对行业及个股的定性分析，筛选基本面良好、具有良好成长性的个股；在以上个股的基础上，通过政策分析、行业比较分析、市场资金动向分析等选择出市场中的热点主题行业及板块、灵活把握投资机会。 3、债券投资策略 在债券投资上，稳健的投资策略是我们一贯所坚持的，即追求收益性、安全性于流动性的统一，在为客户追求稳定收益的同时，保证客户资产的安全性与流动性。
业绩比较基准	沪深300指数*70%+上证国债指数*30%
集合计划管理人	方正证券股份有限公司
集合计划托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 主要财务指标_本期

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年07月01日 - 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	447,293.26
2. 本期利润	-247,840.56
3. 期末集合计划资产净值	3,267,470.92
4. 期末集合计划份额净值	1.2231

3.1.2 主要财务指标_上期

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年04月01日 - 2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	146,379.92
2. 本期利润	837,669.21
3. 期末集合计划资产净值	6,883,013.27
4. 期末集合计划份额净值	1.2435

3.2 集合计划净值表现

3.2.1 本报告期累计单位净值走势图



§ 4 管理人报告

4.1 集合计划投资经理简介

姓名	职务	任本集合计划的 投资经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
廖帅	方正证券股份有限公司证券投资部投资经理	2018-04-16	-	国立政治大学（台湾）资讯管理学系、经济学系双学士，北京大学光华管理学院经济学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部研究员、泰康资产管理有限责任公司金融工程研究高级经理。
宫健	方正证券股份有限公司证券投资部投资经理	2019-04-02	-	金融学硕士，8年固定收益业务从业经历，具有证券从业资格、银行间本币市场交易员资格、基金从业

				资格。长期从事固定收益投资工作,对于投资交易,资产管理等有着丰富的经验。历任民族证券资产管理业务总部债券交易员,债券投资经理。2016年6月加入方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司,任证券投资部固定收益投资经理。未在其他公司兼职。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
--	--	--	--	--

4.2 报告期内集合计划的投资策略和运作分析

4.2.1 投资回顾

2021年三季度,权益市场大体维持震荡略为下行的走势。相对大盘股而言,偏中盘的股票有更好的收益表现。主要指数方面,上证综指涨幅为-0.64%,沪深300涨幅为-6.85%,中证500涨幅为4.34%。板块方面,煤炭、新能源、有色、化工相关个股表现相对较好。本报告期,本集合计划配置仍偏向较高景气行业及板块,收益较为平稳。截至报告期末,本计划单位净值1.2231,本报告期单位净值增长率-1.64%。

4.2.2 投资展望

展望后市,我们认为随着市场经历长时间的调整后,大盘越会有上行的趋势性机会。部分龙头企业的盈利在今年仍将保持上行趋势,坚守估值合理、业绩确定性高的公司,等待市场的机会来临,仍是较为稳健的选择。从行业层面来看,我们继续关注具备中长期高成长潜力的消费、新能源、医药等相关板块,个股上倾向掌握行业定价权的龙头企业。

在产品运作过程中,我们将继续保持稳健的投资风格,尤其看重个股的长期价值,寻求长期盈利表现优秀的个股进行配置,使投资组合得到更佳的风险收益比。

4.3 报告期内集合计划的业绩表现

截至报告期末民族金扬帆1号集合计划份额净值为1.2231元,本报告期内,集合计划累计单位净值增长率为-1.21%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,039,998.60	91.59
	其中:股票	3,039,998.60	91.59

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	277,615.51	8.36
8	其他资产	1,477.62	0.04
9	合计	3,319,091.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,550,430.60	78.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,648.00	2.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	156,000.00	4.77
M	科学研究和技术服务业	241,920.00	7.40
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	3,039,998.60	93.04

5.3 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	500	262,865.00	8.04
2	300037	新宙邦	1,400	217,000.00	6.64
3	601012	隆基股份	2,260	186,404.80	5.70
4	600519	贵州茅台	100	183,000.00	5.60
5	000858	五粮液	800	175,512.00	5.37
6	601888	中国中免	600	156,000.00	4.77
7	300274	阳光电源	1,000	148,380.00	4.54
8	300122	智飞生物	900	143,091.00	4.38
9	603259	药明康德	900	137,520.00	4.21
10	603267	鸿远电子	900	135,900.00	4.16

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

5.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,452.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,477.62

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 6 集合计划份额变动

单位：份

报告期期初集合计划份额总额	5,535,012.57
报告期期间集合计划总申购份额	26,180.29
减：报告期期间集合计划总赎回份额	2,889,720.39
报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末集合计划份额总额	2,671,472.47

§ 7 集合计划管理人运用自有资金投资本集合计划情况

单位：份

报告期初份额	报告期内参与	报告期内退出	报告期末份额
885,048.51	0.00	457,880.06	427,168.45

§ 8 管理人履职报告

本报告期内，本计划管理人一方正证券股份有限公司遵守《指导意见》《管理办法》、《实施细则》及有关法律法规，在管理民族金扬帆1号集合资产管理计划的期间，根据合同及说明书履行管理人义务，本计划整体合法合规，未损害计划份额持有人利益，计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及合同的规定。

§ 9 托管人履职报告

本计划托管人依据民族金扬帆1号集合资产管理计划的合同与托管协议，自计划成立日起托管“民族金扬帆1号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）的全部资产。

本报告期内，本计划托管人严格遵守有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

本报告期内，本计划托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本计划委托人利益的行为。

本计划托管人认真复核了本报告期《民族金扬帆1号集合资产管理计划2021年第3季度报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内本集合计划关联方交易情况

无。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2021年9月24日起彭小建先生代为履行方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司总经理职责，张栋先生自同日起不再担任上述职务。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准民族金扬帆1号集合资产管理计划推广的文件
- 2、民族金扬帆1号集合资产管理计划管理合同
- 3、民族金扬帆1号集合资产管理计划说明书
- 4、民族金扬帆1号集合资产管理计划风险揭示书
- 5、民族金扬帆1号集合资产管理计划托管协议
- 6、管理人业务资格批复、营业执照

11.2 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

11.3 查阅方式

www.founder.sc.com

方正证券股份有限公司

2021年10月28日

