

安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:安信证券资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。本年度报告已经全体董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2021年3月16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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经审计，信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年5月14日起至12月31日止。

1.2 目录

目录

§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
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.....	15
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.....	16
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遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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.....	17
§ 7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§ 8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49

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.....	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.....	50
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.....	50
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.....	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
8.12 投资组合报告附注.....	51
§ 9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§ 10 开放式基金份额变动.....	53
§ 11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
11.4 基金投资策略的改变.....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件.....	55
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§ 13 备查文件目录.....	56
13.1 备查文件目录.....	56
13.2 存放地点.....	56
13.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划		
基金简称	安信瑞鸿中短债		
场内简称	-		
基金主代码	970003		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 05 月 14 日		
基金管理人	安信证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	449,712,807.92 份		
基金合同存续期	3 年		
下属分级基金的基金简称	安信瑞鸿中短债 A	安信瑞鸿中短债 B	安信瑞鸿中短债 C
下属分级基金场内简称	瑞鸿中短债 A	瑞鸿中短债 B	瑞鸿中短债 C
下属分级基金的交易代码	970003	970004	970005
报告期末下属分级基金的份额总额	14,797,085.00 份	44,317,017.09 份	390,598,705.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的增值。
投资策略	本产品通过对宏观经济周期、行业前景分析和发债主体研究的综合运用，主要采用久期策略、利率债策略、信用债投资策略、杠杆策略等投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险和信用风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债新综合财富(1 年以下)指数收益率*60%+中债新综合财富(1-3 年)指数收益率*30%+一年期定期存款利率*10%。
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低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于货币市场基金。

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		安信证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李力	郭明
	联系电话	0755-88027203	010-66105799
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95517	95588
传真		0755-88258219	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4018 号安联大厦 27A02、27B02	北京市西城区复兴门内大街 5 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4018 号安联大厦 27 楼	北京市西城区复兴门内大街 5 号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		李力	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.axzqzg.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4018 号安联大厦 27 楼

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	中国证券登记结算有限责任	北京市西城区太平桥大街 17 号; 深

	公司及安信证券股份有限公司	圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4018 号安联大厦 27A02、27B02
--	---------------	---

§ 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2020年05月14日（基金合同生效日）- 2020年12月31日		
	安信瑞鸿中短债A	安信瑞鸿中短债B	安信瑞鸿中短债C
本期已实现收益	234,797.99	809,289.40	3,367,016.42
本期利润	184,203.80	660,526.18	436,651.50
加权平均基金份额本期利润	0.0090	0.0093	0.0016
本期加权平均净值利润率	0.88%	0.90%	0.15%
本期基金份额净值增长率	0.95%	0.94%	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		
期末可供分配利润	275,254.40	1,450,122.00	12,040,106.40
期末可供分配基金份额利润	0.0186	0.0327	0.0308
期末基金资产净值	15,281,037.71	45,767,139.09	402,638,812.23
期末基金份额净值	1.0327	1.0327	1.0308
3.1.3 累计期末指标	2020年末		
基金份额累计净值增长率	0.95%	0.94%	0.75%

①所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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

安信瑞鸿中短债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
过去三个月	0.40%	0.05%	0.77%	0.02%	-0.37%	0.03%
过去六个月	0.87%	0.03%	1.07%	0.02%	-0.20%	0.01%
自基金合同 生效起至今	0.95%	0.03%	0.76%	0.02%	0.19%	0.01%

安信瑞鸿中短债B

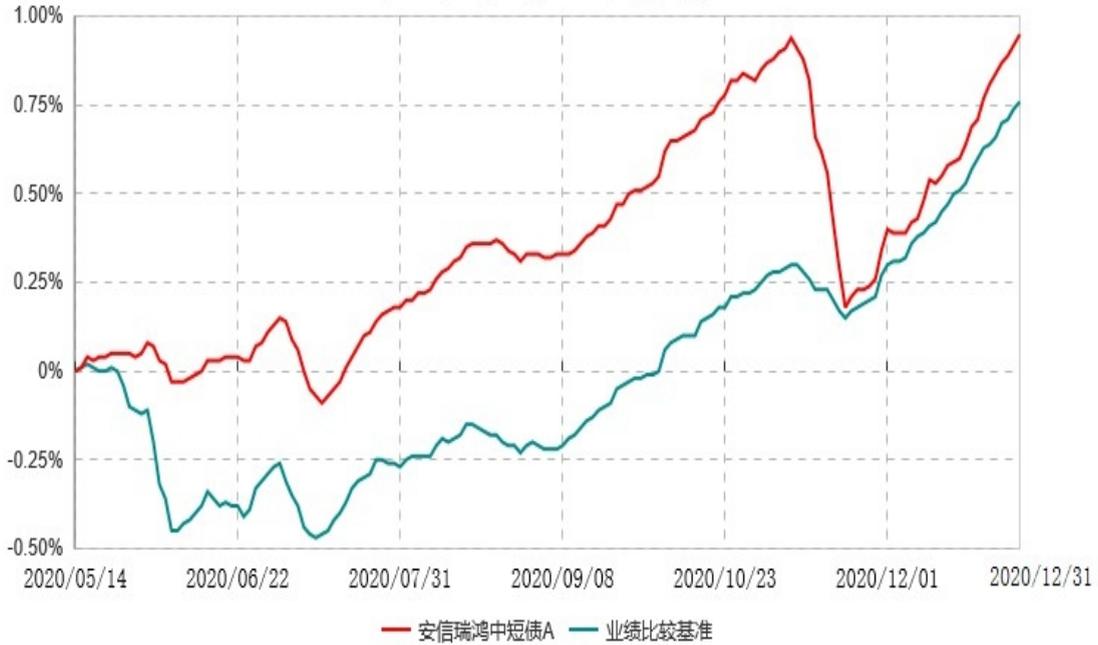
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.05%	0.77%	0.02%	-0.37%	0.03%
过去六个月	0.87%	0.04%	1.07%	0.02%	-0.20%	0.02%
自基金合同 生效起至今	0.94%	0.03%	0.76%	0.02%	0.18%	0.01%

安信瑞鸿中短债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
过去三个月	0.32%	0.05%	0.77%	0.02%	-0.45%	0.03%
过去六个月	0.71%	0.04%	1.07%	0.02%	-0.36%	0.02%
自基金合同 生效起至今	0.75%	0.03%	0.76%	0.02%	-0.01%	0.01%

3.2.2 自基金转型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

安信瑞鸿中短债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
(2020年05月14日-2020年12月31日)



安信瑞鸿中短债B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月15日-2020年12月31日)



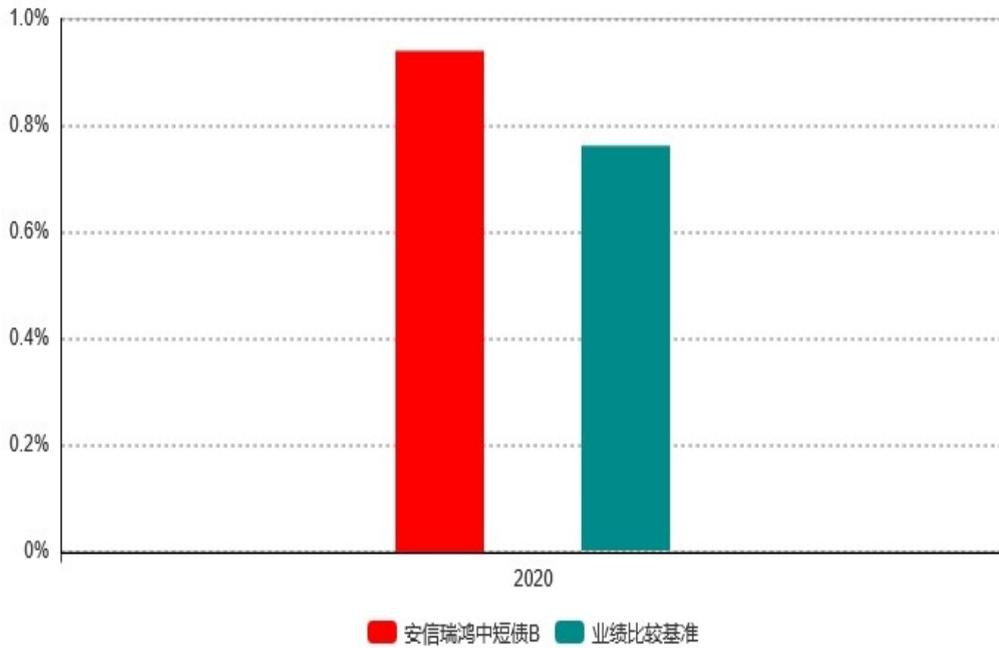
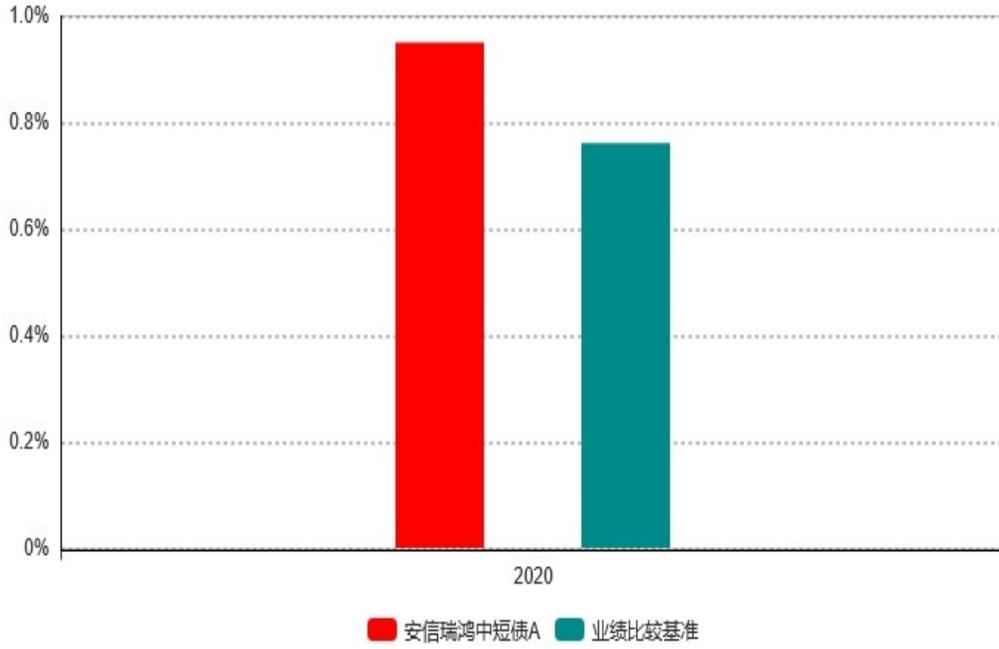
注：安信瑞鸿中短债 B（970004）5 月 14 日尚未开放申赎，无计划份额，2020 年 5 月 14 日净值不进行披露。

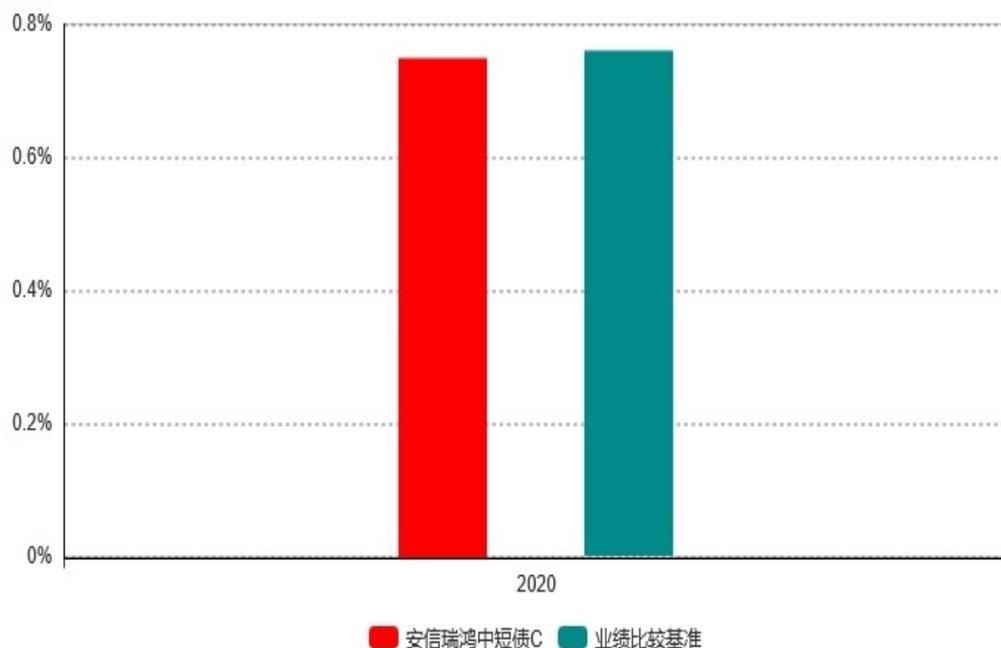
安信瑞鸿中短债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月15日-2020年12月31日)



注：安信瑞鸿中短债 C（970005）5 月 14 日尚未开放申赎，无计划份额，2020 年 5 月 14 日净值不进行披露。

3.2.3 自基金转型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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划自合同生效以来未发生利润分配，符合相关法规及集合计划合同的规定。

§ 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

安信证券资产管理有限公司（以下简称“安信资管”）是经中国证券监督管理委员会批准（《关于核准安信证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可【2019】2630号）），于2020年1月16日成立，并于同年6月取得经营证券期货业务许可；公司注册资本为10亿元，注册地址为深圳市福田区莲花街道福中社区金田路4018号安联大厦27A02、27B02，业务范围为证券资产管理。

安信资管是安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）的全资子公司，安信证券系央企国家开发投资集团有限公司旗下上市公司国投资本股份有限公司（股票代码：600061.SH）的全资子公司。安信资管前身是安信证券资产管理部，是国内资产管理规模长期领先的券商资管之一。

截至2020年12月31日，安信资管受托产品198只、管理市值合计1326.25亿元。合计管理运作76只集合计划，受托管理市值为336.49亿元；合计管理运作119只定向计划，受托管理市值为965.91亿元，其中：通道类定向计划69只，受托管理市值为751.52亿元；管理专项计划3只，受托管理市值为23.85亿元。主动管理产品129只、业务规模574.73亿元。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日颁布的《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，并经中国证监会的批准，截至2020年12月31日，安信资管目前有1只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。后续，安信资管将陆续有其他大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。

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		
杨坚丽	投资经理	2020-05-14	-	14	中国人民大学统计学硕士，2006年进入证券行业，曾供职于中国中投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司，从事固定收益投资交易。
吴慧文	投资经理	2020-11-19	-	8	武汉大学金融工程专业硕士，历任长城证券固定收益部交易员、投资助理、投资经理。擅长国债期货的策略投资、利率债的波段操作以及信用债的价值挖掘。

注：（1）集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

（2）非首任投资经理，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

姓名	产品类型	产品数量	资产净值(元)	任职时间
----	------	------	---------	------

		(只)		
杨坚丽	公募基金	1	463,686,989.03	2020-05-14
	私募资产管理计划	3	9,114,520,195.32	2018-08-03
	其他组合	-	-	-
	合计	4	9,578,207,184.35	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

本集合计划投资经理杨坚丽女士同时兼任私募资产管理计划，其薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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，本基金管理人严格按照《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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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

管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）和有关法律法规的规定，建立了公平交易相关的制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本报告期内，未发现本集合计划管理人管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，管理人为防范因投资经理兼任造成的利益冲突，对报告期内所管理的不同投资组合的整体收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合

的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口管理人管理的不同投资组合向交易价差进行了分析，未发现本集合计划投资经理所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易行为。

本报告期内，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

1. 投资策略

展望2021年，产品组合将维持一定的灵活性，采取中短久期、中高评级信用债配置策略，根据市场情况动态调整账户的持仓结构和久期，力争获取较为合理的投资回报。

2. 运作分析

疫情成为2020年市场的主线，债券市场经历了宽幅震荡格局。一季度新冠肺炎疫情在国内和海外蔓延，疫情冲击全球经济的可能性增大，国内外纷纷降息，货币宽松不断，债券作为避险资产而受益。一季度国内债市走牛，利率债曲线陡峭化下移，中高等级信用债下行幅度明显，各等级信用利差压缩至较低位置。二季度债券市场收益率整体呈现先下后上的V型走势。4月份各种宽松政策延续出台，市场资金利率和债券收益率曲线整体陡峭化下移。5月以来，随着国内疫情逐步得到控制，复工复产持续推进，公布的工业增加值数据同比转正。政策从货币政策发力转为财政政策发力，市场利率逐渐反弹，债券市场收益率均大幅上行，市场情绪较为悲观。三季度以来经济基本面持续修复，货币政策回归常态化，利率债供给放量，中短期资金价格中枢均有上移，银行同业存单价格齐升，债券收益率曲线整体呈现扁平化上行态势。国庆之后信用债一级投标热度修复，收益率略温和下行，但11月永煤违约事件打破“国企信仰”，引发市场对“逃废债”行为担忧，机构对弱资质债券恐慌性抛售，债券市场收益率整体快速上行。随后，金稳委要求打击恶意逃废债，央行加大流动性投放，永煤违约引发的市场恐慌情绪有所下降，加之利率债年度大规模供给结束，市场资金宽松，信用债市场逐步企稳。

报告期内，本产品操作相对稳健，根据债券市场情况对账户的组合久期和杠杆水平进行了相应的动态调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年12月31日，本集合计划A份额净值为1.0327元，累计单位净值为1.4841元；本集合计划B份额净值为1.0327元，累计单位净值为1.0327元；本集合计划C份额净值为1.0308元，累计单位净值为1.0308元。

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2021年，在疫苗推广接种的背景下，海外需求将逐步修复，中美关系或阶段性缓和，有利于出口持续增长。支撑经济增长的动能逐步从投资转向消费，从制造业传导向服务业，经济复苏的趋势预计能够延续至明年上半年。CPI处于低位，PPI在全球复工带动下会持续上行，通胀处于温和上行状态。中央经济工作会议要求，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持对经济恢复的必要支持力度，政策操作上要更加精准有效，不急转弯，把握好政策时度效。预计货币政策维持中性基调，并注重精准施策，根据经济形势保持政策的相机抉择性。预计市场整体流动性相对宽松，资金利率将围绕政策利率上下波动。经济增速可能在一季度达到高点，债券利率处于“磨顶”状态。目前利率债和高等级信用债配置价值较高，后期需密切关注投资增速放缓的契机。关注的风险点在于海外经济复苏强劲、通胀上行加快等。信用债投资建议以低风险为主，优选中高等级、中短期品种。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障持有人利益的原则，经营管理。管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的合规人员对公司经营、产品运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层。报告期内，公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规意识。报告期内，本集合计划的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定；管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。

本集合计划报告期内未发现存在重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损投资者利益的情形。

管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护集合资产计划资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本集合计划管理人估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资

经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本集合计划未与任何第三方签署服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本集合计划未进行利润分配，符合相关法规及合同的规定。

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，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划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，本托管人在对安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人依法对安信证券资产管理有限公司编制和披露的安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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/2021BJAB10347

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	安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划（以下简称瑞鸿中短债集合计划）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 5 月 14 日（集合计划合同变更生效日）至 12 月 31 日的利润表、持有人权益（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，公允反映了瑞鸿中短债集合计划 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 14 日（集合计划合同变更生效日）至 12 月 31 日的经营成果和持有人权益（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，我们独立于瑞鸿中短债集合计划，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	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	瑞鸿中短债集合计划管理人安信证券资产管理有限公司（以下简称管理人）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，管理人负责评估瑞鸿中短债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

	<p>用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算瑞鸿中短债集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督瑞鸿中短债集合计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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，就可能对瑞鸿中短债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瑞鸿中短债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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

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	2021-03-26	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	4,086,724.91
结算备付金		1,305,049.12
存出保证金		7,159.48
交易性金融资产	7.4.7.2	547,326,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		525,326,000.00
资产支持证券投资		22,000,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-
应收证券清算款		92,755.07
应收利息	7.4.7.4	7,949,462.09
应收股利		-
应收申购款		200,159.85
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		560,967,310.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负 债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		93,123,173.43
应付证券清算款		-
应付赎回款		3,527,498.73
应付管理人报酬		117,734.80
应付托管费		39,244.97
应付销售服务费		101,380.42
应付交易费用	7.4.7.5	30,068.87
应交税费		172,890.77
应付利息		-1,670.50
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	170,000.00
负债合计		97,280,321.49
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.7	449,712,807.92
未分配利润	7.4.7.8	13,974,181.11
所有者权益合计		463,686,989.03
负债和所有者权益总计		560,967,310.52

注：1. 本集合计划合同变更生效日为 2020 年 5 月 14 日，本报告的会计期间为 2020 年 5 月 14 日至 2020 年 12 月 31 日。截至报告期末，本集合计划变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日，集合计划份额净值 1.0311 元，集合计划份额总额 449,712,807.92 份。

7.2 利润表

会计主体：安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 1
----	-----	--

		2月31日
一、收入		3,813,345.65
1. 利息收入		8,675,220.39
其中：存款利息收入	7.4.7.9	47,307.02
债券利息收入		7,560,761.32
资产支持证券利息收入		605,107.59
买入返售金融资产收入		462,044.46
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,304,830.20
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.10	-2,304,830.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.10.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	-3,129,722.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	572,677.79
减：二、费用		2,531,964.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	718,071.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	239,357.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	538,234.20
4. 交易费用	7.4.7.13	57,523.41
5. 利息支出		739,034.00
其中：卖出回购金融资产支出		739,034.00
6. 税金及附加		25,314.97
7. 其他费用	7.4.7.14	214,429.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,281,381.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,281,381.48

注：本集合计划合同变更生效日为2020年5月14日，本报告的会计期间为2020年5月14日至2020年12月31日。截至报告期末，本集合计划变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	34,443,328.93	791,825.09	35,235,154.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,281,381.48	1,281,381.48
三、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)	415,269,478.99	11,900,974.54	427,170,453.53
其中：1. 基金申购款	2,368,325,222.74	59,826,698.60	2,428,151,921.34
2. 基金赎回款	-1,953,055,743.75	-47,925,724.06	-2,000,981,467.81
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	449,712,807.92	13,974,181.11	463,686,989.03

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：

李力 _____	向晖 _____	刘薇 _____
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

安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划（以下简称本计划或本集合计划）原为安信证券佑瑞持债券稳利集合资产管理计划（以下简称原集合计划）。原集合计划于2012年12月27日成立，于2013年1月8日在中国证券业协会《关于安信证券佑瑞持债券稳利集合资产管理计划的备案报告》（安证报[2013]7号）进行备案。原集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币504,544,408.00元，折合认购份额504,544,408.00份；认购资金产生的利息金额为人民币205,348.24元，折合集合计划份额205,348.24份；以上实收资金共计人民币504,749,756.24元，折合504,749,756.24份集合计划份额。上述出资业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了安永华明（2012）验字第60884100_H04号验资报告。原集合计划的管理人为安信证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证券监督管理委员会《关于核准安信证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2019]2630号）核准，本计划管理人安信证券股份有限公司获准设立全资资产管理子公司，即“安信证券资产管理有限公司”。从2020年6月起，本计划管理人由“安信证券股份有限公司”变更为“安信证券资产管理有限公司”。该变更仅涉及计划管理人法人主体形式上的变更，并不涉及与投资者相关的合同项下权利、义务和责任的实质性变更。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）于2018年11月30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》（证监会公告[2018]39号）规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自2020年5月14日起，《安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《安信证券佑瑞持债券稳利集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划为大集合产品，系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，存续期不超过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。安信证券资产管理有限公司是本集合计划的管理人，中国工商银行股份有限公司是本计划的托管人，安信证券股份有限公司及其他符合条件的代销机构是本计划的销售机构。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划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

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2020年12月31日的财务状况以及2020年5月14日（集合计划合同变更生效日）至12月31日的经营成果和持有人权益（计划净值）变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2020年5月14日（集合计划合同变更生效日）至12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划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

(1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。金融资产分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。

本集合计划的股票投资、债券投资和基金投资等项目于初始确认时即划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

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

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产满足下列条件之一的，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，且符合下述金融资产转移的终止确认条件。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

本集合计划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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当集合计划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，同时本集合计划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

每份计划份额面值为 1.00 元。实收基金为对外发行的计划份额总额。由于参与、退出引起的实收基金的变动分别于集合计划参与确认日、退出确认日列示。

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计划份额时，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）占计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 托管费：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.10% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(2) 管理费：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，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给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(3) 销售服务费

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等。本集合计划 A、B 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 0.3%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类计划份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类计划份额前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(4) 管理人的业绩报酬

本集合计划不提取业绩报酬。

(5)《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用,《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费、仲裁费等,集合计划份额持有人大会费用,集合计划的证券交易费用,集合计划的银行汇划费用,集合计划的开户费用、账户维护费用,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,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由托管人从集合计划财产中支付。

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,本集合计划可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准;

(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;

(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集合计划份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)由于本集合计划 A 类、B 类和 C 类计划份额的销售费用收取方式存在不同,各类别计划份额对应的可供分配收益将有所不同。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。

7.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、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。经营分部是指本集合计划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)本集合计划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)本集合计划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。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

企业税：

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，对证券投资集合计划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。

增值税：

财政部、国家税务总局于2017年6月30日下发《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号），根据该文件的规定，资管产品管理人运营资产管理产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，并于2018年1月1日实施。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。

印花税：

本集合计划管理人运用集合计划卖出股票按照1%的税率征收印花税。

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 2020年12月31日
活期存款	4,086,724.91
定期存款	-
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	-
合计	4,086,724.91

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	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	22,979,541.49	22,988,100.00
	银行间市场	505,275,740.00	502,337,900.00
	合计	528,255,281.49	525,326,000.00
资产支持证券	22,000,000.00	22,000,000.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	550,255,281.49	547,326,000.00	-2,929,281.49

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

截止本报告期末本集合计划无买入返售金融资产

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截止本报告期末本集合计划无买断式逆回购交易中取得的债券

7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	315.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	587.30

应收债券利息	7,683,251.81
应收资产支持证券利息	265,304.11
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.20
合计	7,949,462.09

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	6,093.23
银行间市场应付交易费用	23,975.64
合计	30,068.87

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	170,000.00
合计	170,000.00

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 安信瑞鸿中短债A

金额单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债A)	本期 2020 年 05 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	34,443,328.93	34,443,328.93
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-19,646,243.93	-19,646,243.93

本期末	14,797,085.00	14,797,085.00
-----	---------------	---------------

7.4.7.7.2 安信瑞鸿中短债B

金额单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债B)	本期 2020 年 05 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 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	186,501,480.29	186,501,480.29
本期赎回 (以“-”号填列)	-142,184,463.20	-142,184,463.20
本期末	44,317,017.09	44,317,017.09

7.4.7.7.3 安信瑞鸿中短债C

金额单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债C)	本期 2020 年 05 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 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	2,181,823,742.45	2,181,823,742.45
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,791,225,036.62	-1,791,225,036.62
本期末	390,598,705.83	390,598,705.83

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 安信瑞鸿中短债A

单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债A)	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	460,942.71	515,086.18	976,028.89
本期基金份额交易产生的变动数	-185,688.31	-306,387.87	-492,076.18
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-185,688.31	-306,387.87	-492,076.18

本期已分配利润	-	-	-
本期末	275,254.40	208,698.31	483,952.71

7.4.7.8.2 安信瑞鸿中短债B

单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债B)	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	809,289.40	-148,763.22	660,526.18
本期基金份额交易产生的变动数	744,095.93	45,499.89	789,595.82
其中：基金申购款	4,597,250.28	-99,610.98	4,497,639.30
基金赎回款	-3,853,154.35	145,110.87	-3,708,043.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,553,385.33	-103,263.33	1,450,122.00

7.4.7.8.3 安信瑞鸿中短债C

单位：人民币元

项目 (安信瑞鸿中短债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	-	-	-
本期利润	3,367,016.42	-2,930,364.92	436,651.50
本期基金份额交易产生的变动数	9,582,219.33	2,021,235.57	11,603,454.90
其中：基金申购款	56,173,537.71	-844,478.41	55,329,059.30
基金赎回款	-46,591,318.38	2,865,713.98	-43,725,604.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,949,235.75	-909,129.35	12,040,106.40

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	35,439.29
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	11,716.74
其他	150.99
合计	47,307.02

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,304,830.20
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	-2,304,830.20

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	917,877,193.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	911,582,279.71
减：应收利息总额	8,599,744.42
买卖债券差价收入	-2,304,830.20

7.4.7.10.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	313,054.25
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应收利息总额	313,054.25
资产支持证券投资收益	-

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,136,481.49
——股票投资	-
——债券投资	-3,136,481.49
——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	-6,759.16
合计	-3,129,722.33

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	572,677.79
合计	572,677.79

7.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	40,146.61
银行间市场交易费用	17,376.80
合计	57,523.41

7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	-
信息披露费	-
汇划手续费	23,865.33
信息披露费	150,000.00
审计费用	19,634.18
帐户维护费	18,300.00
TA 服务月费	2,329.70
其他	300.00
合计	214,429.21

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，本集合计划无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本集合计划无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
安信证券股份有限公司	计划管理人股东、原计划管理人
安信证券资产管理有限公司	计划管理人
中国工商银行股份有限公司	计划托管人

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

本集合计划本报告期未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期未发生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 2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
安信证券	200,733,140.75	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 2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

安信证券	2,058,500,000.00	100.00%
------	------------------	---------

7.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期未发生通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年05月14日（基金合同生效日）至2020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
安信证券	61,650.89	100.00%	-	-

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 2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

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			
	2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	安信瑞鸿中短债A	安信瑞鸿中短债B	安信瑞鸿中短债C	合计
安信证券资产管理 有限公司	0.00	0.00	538,234.20	538,234.20
合计	0.00	0.00	538,234.20	538,234.20

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

本报告期内，本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

安信瑞鸿中短债A

份额单位：份

项目	本期
	2020年05月14日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金合同生效日（2020年05月14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%

安信瑞鸿中短债B

份额单位：份

项目	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2020 年 05 月 14 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%

安信瑞鸿中短债C

份额单位：份

项目	本期
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2020 年 05 月 14 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	29,319,781.08
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	29,319,781.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.51%

截至 2020 年 12 月 31 日，管理人安信证券资产管理有限公司持有本集合计划份额 29,319,781.08 份。计划管理人股东安信证券股份有限公司未持有本集合计划份额。

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

报告期末除集合计划管理人之外无其他关联方投资本集合计划的情况

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	
	2020 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,086,724.91	35,439.29

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划在承销期内无参与关联方承销证券的情况

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他关联交易的事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 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

本集合计划截至 2020 年 12 月 31 日无持有因认购获配新股及债券未上市而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划截至 2020 年 12 月 31 日无持有因存在锁定期约定而流通受限的股票。

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

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
012002183	20商丘发展SCP002	2021-01-04	99.85	100,000	9,985,000.00
042000	20天津轨交CP002	2021-01-04	99.63	21,000	2,092,230.00

271					
042000 344	20烟台港CP002	2021-01-04	99.66	50,000	4,983,000.00
101476 003	14山西交投MTN001	2021-01-04	101.14	100,000	10,114,000.00
101556 009	15津城建MTN001	2021-01-04	101.16	100,000	10,116,000.00
102001 969	20孝感城投MTN002	2021-01-04	99.51	125,000	12,438,750.00
102002 095	20芜湖宜居MTN003	2021-01-04	99.43	300,000	29,829,000.00
合计				796,000	79,557,980.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 12 月 31 日,本集合计划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 22,099,779.00 元,截至 2021 年 1 月 4 日先后到期。该类交易要求本集合计划转入质押库的债券,按证券交易所的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

本计划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。本计划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。

本计划管理人建立了由风控部、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。风控部、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

信用风险是指计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致计划资产损失和收益变化的风险。本计划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。

本计划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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日
A-1	79,500,000.00
A-1 以下	-
未评级	62,926,100.00
合计	142,426,100.00

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 2020 年 12 月 31 日
AAA	30,247,000.00
AAA 以下	352,652,900.00
未评级	-
合计	382,899,900.00

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日
AAA	22,000,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	22,000,000.00

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，集合计划管理人可能无法迅速、低成本地调整计划投资组合，从而对集合计划收益造成不利影响。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集合计划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。本集合计划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

现金流风险是指计划因现金流不足导致无法应对正常计划支付义务的风险。本集合计划管理人对计划每日和每周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，本集合计划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

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与计划合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本集合计划主要投资于计划合同约定的具有良好流动性的金融工具。计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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，包括利率风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资

产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,086,724.91	-	-	-	-	-	4,086,724.91
结算备付金	1,305,049.12	-	-	-	-	-	1,305,049.12
存出保证金	7,159.48	-	-	-	-	-	7,159.48
交易性金融资产	14,998,500.00	29,961,000.00	113,587,000.00	388,779,500.00	-	-	547,326,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	92,755.07	92,755.07
应收利息	-	-	-	-	-	7,949,462.09	7,949,462.09
应收申购款	-	-	-	-	-	200,159.85	200,159.85
资产总计	20,397,433.51	29,961,000.00	113,587,000.00	388,779,500.00	-	8,242,377.01	560,967,310.52
负债							
卖出回购金融资产款	93,123,394.43	-	-	-	-	-	93,123,394.43
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,527,498.73	3,527,498.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	117,734.80	117,734.80
应付托管费	-	-	-	-	-	39,244.97	39,244.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-	101,380.42	101,380.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,068.87	30,068.87
应交税费	-	-	-	-	-	172,890.77	172,890.77
应付利息	-	-	-	-	-	-1,670.50	-1,670.50
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	93,123,394.43	-	-	-	-	4,157,148.0	97,280,542.49

计						6	
利率敏感缺口	-72,725,960.92	29,961,000.00	113,587,000.00	388,779,500.00	-	4,085,228.95	463,686,768.03

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 2020年12月31日
	利率下降 25 个基点	2,314,815.79
	利率上升 25 个基点	-2,295,867.58

7.4.13.4.2 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动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本计划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。本计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本计划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	
	2020 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	525,326,000.00	113.29
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	525,326,000.00	113.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划非指数跟踪产品，业绩比较基准的变化对本集合计划资产净值的变化无直接影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

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。

2) 各层级金融工具公允价值

于2020年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为547,326,000.00元，无属于第一、第三层级的余额。

3) 公允价值所属层级间的重大变动

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、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划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	547,326,000.00	97.57
	其中：债券	525,326,000.00	93.65
	资产支持证券	22,000,000.00	3.92
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	5,391,774.03	0.96
8	其他各项资产	8,249,536.49	1.47
9	合计	560,967,310.52	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

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

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

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

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

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

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

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	22,988,100.00	4.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,275,000.00	4.37
5	企业短期融资券	119,438,000.00	25.76
6	中期票据	362,624,900.00	78.20
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	525,326,000.00	113.29

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	102002089	20阜阳投资MTN001	400,000	39,920,000.00	8.61
2	102002090	20芜湖建设MTN005	400,000	39,700,000.00	8.56

3	102002057	20丽水城投MTN 001	300,000	29,877,000.00	6.44
4	102002095	20芜湖宜居MTN 003	300,000	29,829,000.00	6.43
5	101800408	18成都开投MTN 002	200,000	20,882,000.00	4.50

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	168543	龙控04优	100,000	10,000,000.00	2.16
2	168504	碧胜01优	100,000	10,000,000.00	2.16
3	165375	19中骏1A	20,000	2,000,000.00	0.43

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

本集合计划本报告期末进行贵金属投资交易。

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

本集合计划本报告期末进行权证投资交易。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末进行股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末持有股指期货。

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

本集合计划本报告期末持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体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 本报告期内，本集合计划未投资股票。

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	7,159.48
2	应收证券清算款	92,755.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,949,462.09
5	应收申购款	200,159.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,249,536.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
安信瑞鸿中短债 A	107	138,290.51	0.00	0.00%	14,797,085.00	100.00%
安信瑞鸿中短债 B	95	466,494.92	34,056,926.47	76.85%	10,260,090.62	23.15%
安信瑞鸿中短债 C	25,872	15,097.35	50,410,802.61	12.91%	340,187,903.22	87.09%
合计	26,074	17,247.56	84,467,729.08	18.78%	365,245,078.84	81.22%

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员持有本基金	安信瑞鸿中短债 A	-	-
	安信瑞鸿中短债 B	-	-
	安信瑞鸿中短债 C	97.71	0.0000%
	合计	97.71	0.0000%

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	安信瑞鸿中短债 A	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	安信瑞鸿中短债 B	0
	安信瑞鸿中短债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信瑞鸿中短债 A	0
	安信瑞鸿中短债 B	0
	安信瑞鸿中短债 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	安信瑞鸿中短债A	安信瑞鸿中短债B	安信瑞鸿中短债C
基金合同生效日(2020年05月14日)基金份额总额	33,534,906.97	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	186,501,480.29	2,181,823,742.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	18,737,821.97	142,184,463.20	1,791,225,036.62
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	14,797,085.00	44,317,017.09	390,598,705.83

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

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，本集合计划管理人于 2020 年 9 月 2 日聘请张南森任安信证券资产管理有限公司副总经理、本集合计划托管人的专门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，未发生涉及本集合计划、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安信证券自 2015 年起聘请立信会计师事务所为公司提供审计服务，2020 年安信资管成立后沿用立信会计师事务所为资管产品（包括公募产品）进行审计及验资，因立信会计师事务所与母公司审计服务合同到期，综合考虑我公司业务发展和未来审计需要，我公司拟聘任信永中和会计师事务所为公司 2020 年度主审会计师事务所，本报告年度的审计费用为 20,000 元。

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

本报告期内本集合计划管理人和托管人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。

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	
安信证券	2	-	-	61,650.89	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	成交金额	占当期债券回	成交	占当期权证成交总	成交	占当期基金成交总

		交总额的比例		购成交总额的比例	金额	额的比例	金额	额的比例
安信证券	200,733,140.75	100.00%	2,058,500,000.00	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	安信瑞鸿中短债基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-14
2	关于安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划修改资产管理合同、托管协议和招募说明书的公告	中国证监会指定网站	2020-07-21
3	安信证券资产管理有限公司关于安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划新增代销机构的公告	中国证监会指定网站	2020-09-01
4	安信证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-04
5	安信证券资产管理有限公司关于安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划新增代销机构的公告	中国证监会指定网站	2020-09-23
6	安信证券资产管理有限公司关于安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划新增代销机构的公告	中国证监会指定网站	2020-09-25
7	安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-20

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-06-03 至 2020-12-31	9,767,510.01	0.00	0.00	9,767,510.01	2.17%
	2	2020-05-20 至 2020-12-31	12,701,778.39	38,971,144.61	32,205,386.74	19,467,536.26	4.33%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本集合计划出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该集合计划份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本集合计划没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对集合计划份额净值造成不利影响。投资经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当集合计划出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的集合计划份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的集合计划份额持有人有可能承担短期内资产变现冲击成本对集合计划份额净值产生的不利影响。报告期内，本集合计划未发生上述相关风险事项。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 2、《安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划合同》
- 3、《安信证券瑞鸿中短债债券型集合资产管理计划托管协议》
- 4、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4018 号安联大厦 27 楼

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.axzqzg.com）查阅。

安信证券资产管理有限公司
二〇二一年三月三十一日