

安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

2021 年年度报告

2021 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2022 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农业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2022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）为本集合计划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2021年5月6日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	17
6.1 审计报告基本信息	17
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	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§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	49
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	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	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	51

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	51
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
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	53
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§10	开放式基金份额变动	54
§11	重大事件揭示	54
11.1	基金份额持有人大会决议	54
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	54
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	55
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8	其他重大事件	56
§12	影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
§13	备查文件目录	57
13.1	备查文件目录	57
13.2	存放地点	58
13.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划		
基金简称	安信资管瑞元添利		
基金主代码	970029		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年05月06日		
基金管理人	安信证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,062,595,210.50份		
基金合同存续期	3年		
下属分级基金的基金简称	安信资管瑞元添利A	安信资管瑞元添利B	安信资管瑞元添利C
下属分级基金的交易代码	970029	970030	970031
报告期末下属分级基金的份额总额	77,088,786.46份	303,693,837.43份	681,812,586.61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	本集合计划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，主要采用类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*90%+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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李力	秦一楠
	联系电话	0755-88027203	010-66060069
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95517	95599
传真		0755-88258219	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518026	100031
法定代表人		李力	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报社
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公司及安信证券资产管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号;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

§ 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2021年05月06日（基金合同生效日）- 2021年12月31日		
	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C
本期已实现收益	3,051,788.67	6,737,284.74	2,921,814.31
本期利润	5,172,696.23	9,143,218.20	3,079,749.38
加权平均基金份额本期利润	0.0510	0.0438	0.0276
本期加权平均净值利润率	4.91%	4.18%	2.62%
本期基金份额净值增长率	4.91%	4.87%	4.68%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		
期末可供分配利润	2,409,471.49	13,072,417.41	28,012,791.74
期末可供分配基金份额利润	0.0313	0.0430	0.0411
期末基金资产净值	81,867,408.47	322,444,006.10	722,568,830.04
期末基金份额净值	1.0620	1.0617	1.0598
3.1.3 累计期末指标	2021年末		
基金份额累计净值增长率	4.91%	4.87%	4.68%

(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

瑞元添利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	1.53%	0.05%	1.13%	0.04%	0.40%	0.01%
过去六个月	3.48%	0.06%	2.65%	0.05%	0.83%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.91%	0.06%	3.26%	0.04%	1.65%	0.02%

瑞元添利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	1.52%	0.05%	1.13%	0.04%	0.39%	0.01%
过去六个月	3.47%	0.06%	2.65%	0.05%	0.82%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.87%	0.06%	3.22%	0.04%	1.65%	0.02%

瑞元添利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	1.45%	0.05%	1.13%	0.04%	0.32%	0.01%
过去六个月	3.30%	0.06%	2.65%	0.05%	0.65%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.68%	0.06%	3.22%	0.04%	1.46%	0.02%

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

安信资管瑞元添利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05月06日-2021年12月31日)



安信资管瑞元添利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

(2021年05月07日-2021年12月31日)



注：安信资管瑞元添利 B（970030）5 月 6 日尚未开放申赎，无计划份额，2021 年 5 月 6 日净值不进行披露。

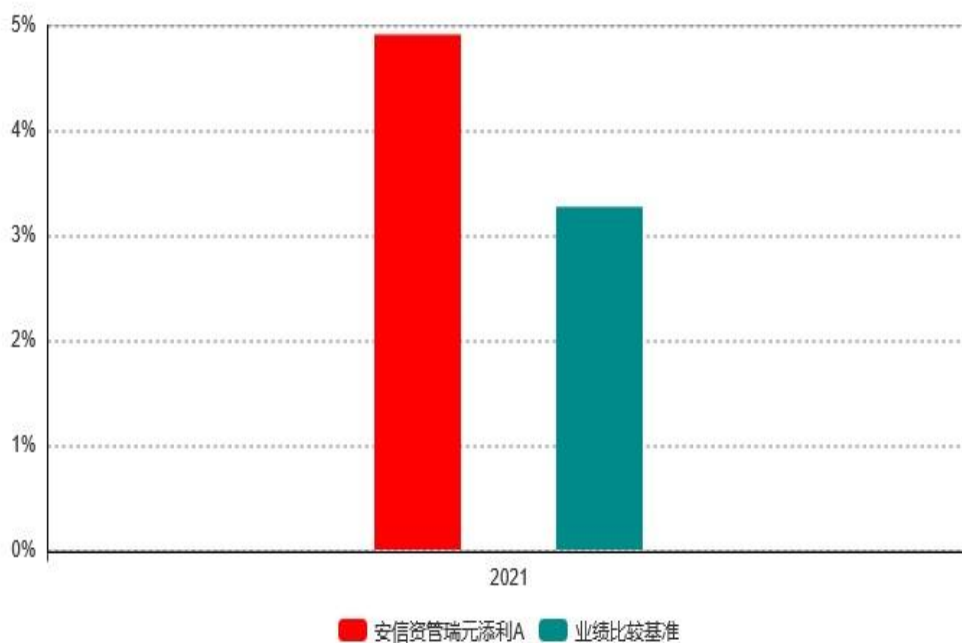
安信资管瑞元添利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

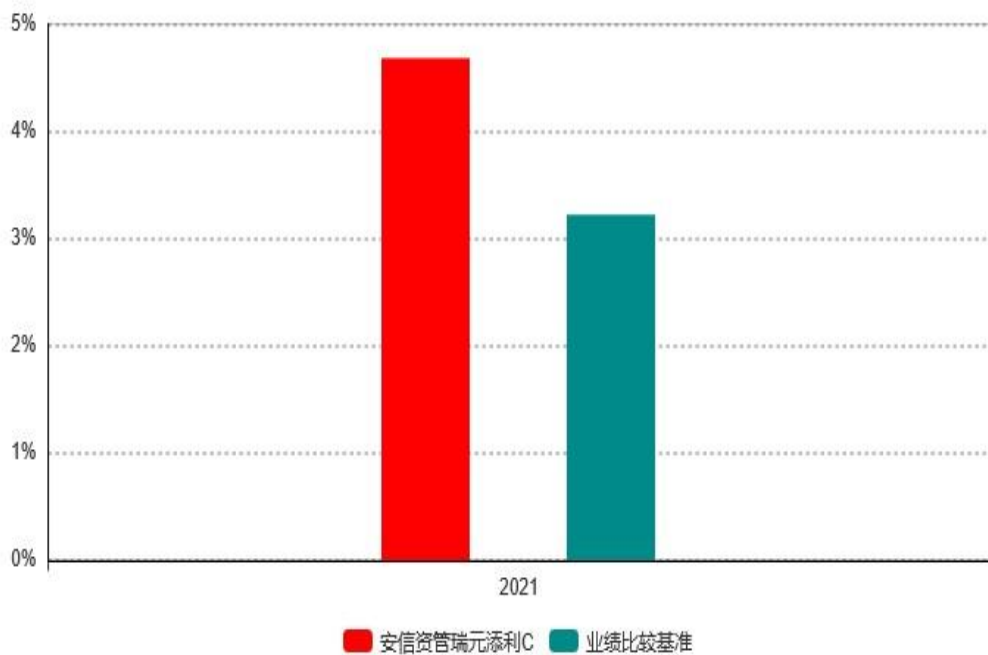
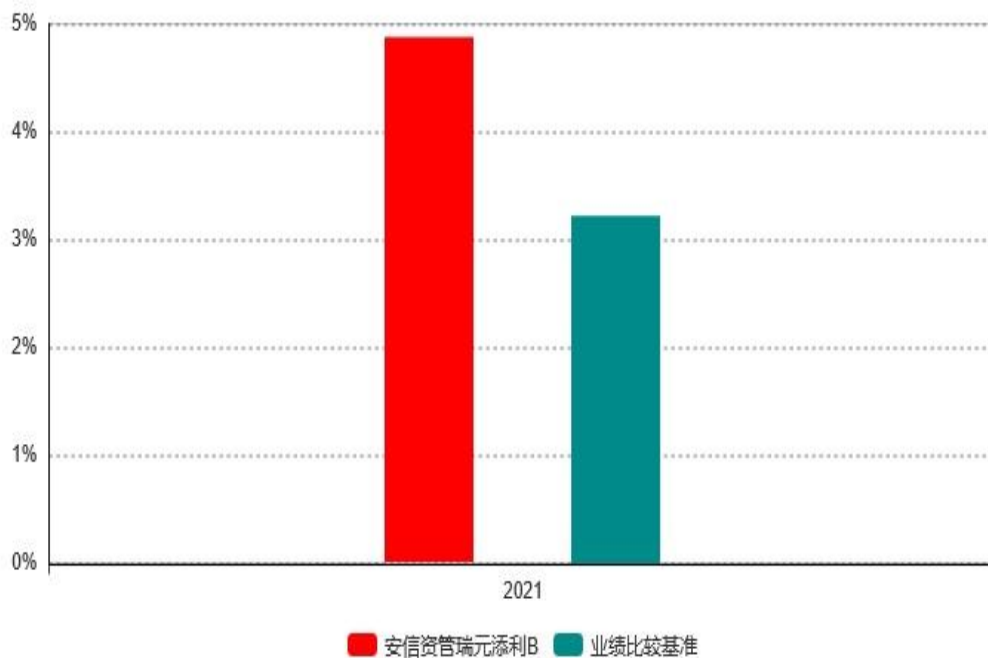
(2021年05月07日-2021年12月31日)



注：安信资管瑞元添利 C（970031）5 月 6 日尚未开放申赎，无计划份额，2021 年 5 月 6 日净值不进行披露。

3.2.3 自基金合同生效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2021年12月31日，安信资管受托产品196只、管理市值合计982.10亿元。其中公募资产管理规模23.09亿元。

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2021年12月31日，安信资管有4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		
张亚非	投资经理	2021-05-06	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士，10年以上固定收益从业经验，2005年至今先后供职于北京农村商业银行、平安银行、安信证券从事固定收益投资交易工作。于2012年10月注册证券从业资格。
吴慧文	投资经理	2021-05-06	-	9	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

本集合计划投资经理无同时兼任私募资产管理计划的情况。

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同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，共发生13起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%的情况。

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

2021 年全球疫情反复，主要国家经济在宽松政策的支撑下持续恢复，我国外需依然强势并拉动出口和受益于出口的制造业投资成为经济的主要拉动项，但内需恢复不及预期，经济修复斜率整体呈现前高后低的特征。基建投资处于低位运行、地产全线走弱，制造业投资整体疲弱，企业补库意愿较低，经济内生动力不足；通胀方面，PPI持续攀高，但下游生产和居民需求持续偏弱，通胀预期阶段性冲高，年末伴随行政控价措施的陆续出台，大宗涨价趋势有所缓解。货币政策温和宽松的态势维，两次全面降准，货币政策夸周期调节，旨在宽信用，通过释放便宜资金引导金融机构让利实体，从而降低实体融资成本。12月底银行下调1年起LPR报价，旨在让利实体，而5年LPR利率不变，提现对地产政策“房住不炒”贯穿执行。全年看债市收益率震荡下行，利率债收益率曲线扁平化下行，长债下行幅度大于短债，其中10 年期国债、国开债收益率下行29-43BP，短债收益率下行15-17BP。信用债收益率下行并伴随信用利差快速收窄，其中AA+曲线缩窄最多，整体下行59-81BP。

在投资操作方面，我们根据债市行情的节奏变化进行了合理的组合调整，对组合久期和杠杆比例都进行了灵活主动的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末瑞元添利A基金份额净值为1.0620元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.91%，同期业绩比较基准收益率为3.26%；截至报告期末瑞元添利B基金份额净值为1.0617元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.87%，同期业绩比较基

准收益率为3.22%；截至报告期末瑞元添利C基金份额净值为1.0598元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.68%，同期业绩比较基准收益率为3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来预计债券市场仍然将维持震荡行情，收益率向上及向下空间均不会太大。一方面，地产调控政策底确认，但一致预期之下，市场底还需时间，同时，外需动能不足与内需趋弱形成共振，经济下行压力进一步显现，短期内经济仍将维持弱增长状态。货币政策方面，经济下行决定了货币政策易松难紧，但美联储Tapper进程对宽松空间构成制约，货币政策预计量宽价平，更可能是针对中小企业的结构性宽货币。此外，货币政策更加强调跨周期、精细化调节，将在一定程度上熨平利率波动。整体而言，预计明年一季度，债券市场仍然维持窄幅震荡，趋势性行情概率较低。

操作上，我们将积极应对市场变化，合理调整仓位及久期。未来将优选中等期限中高资质信用债作为主要持仓品种，同时更多关注波段操作的机会。

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

在托管本集合计划的过程中，本集合计划托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及集合计划合同、托管协议的约定，对本集合计划管理人-安信证券资产管理有限公司 2021 年 5 月6日至 2021 年12月31日集合计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，安信证券资产管理有限公司在本集合计划的投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支及利润分配等问题上，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

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

本托管人认为，安信证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，集合计划管理人所编制和披露

的本集合计划年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害集合计划持有人利益的行为。

§ 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/2021BJAB10344

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	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称安信瑞元添利集合计划）财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年5月6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。</p> <p>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，公允反映了安信瑞元添利集合计划2021年12月31日的财务状况以及2021年5月6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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于安信瑞元添利集合计划，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。</p>

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>安信瑞元添利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。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估安信瑞元添利集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算安信瑞元添利集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信瑞元添利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。</p> <p>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： 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。</p>

	<p>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。</p> <p>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。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，就可能对安信瑞元添利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安信瑞元添利集合计划不能持续经营。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。</p> <p>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>
会计师事务所的名称	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）
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	2022-03-14

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
----	-----	--------------------

资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,636,900.95
结算备付金		2,822,372.01
存出保证金		306,150.38
交易性金融资产	7.4.7.2	1,091,770,538.98
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,024,161,638.98
资产支持证券投资		67,608,900.00
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	7.4.7.3	12,800,126.40
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.4	13,227,538.39
应收股利		-
应收申购款		17,088,349.99
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,140,651,977.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021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		-
应付证券清算款		12,465,335.68
应付赎回款		79,574.76
应付管理人报酬		309,937.07
应付托管费		77,471.09
应付销售服务费		126,974.22

应付交易费用	7.4.7.5	13,651.80
应交税费		552,038.53
应付利息		-3,250.66
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	150,000.00
负债合计		13,771,732.49
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.7	1,062,595,210.50
未分配利润	7.4.7.8	64,285,034.11
所有者权益合计		1,126,880,244.61
负债和所有者权益总计		1,140,651,977.10

注：1. 本集合计划合同变更生效日为2021年5月6日，本报告的会计期间为2021年5月6日至2021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2021年12月31日，安信瑞元添利A份额净值1.0620元，份额总额77,088,786.46份；安信瑞元添利B份额净值1.0617元，份额总额303,693,837.43份；安信瑞元添利C份额净值1.0598元，份额总额681,812,586.61份；合计份额净值1.0605元，总份额合计1,062,595,210.50份。

7.2 利润表

会计主体：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
一、收入		20,546,900.66
1. 利息收入		14,291,078.39
其中：存款利息收入	7.4.7.9	54,440.84
债券利息收入		12,824,154.76
资产支持证券利息收入		1,295,131.51

买入返售金融资产收入		117,351.28
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,571,046.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,563,827.10
资产支持证券投资收益	7.4.7.12.3	7,219.08
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,684,776.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、费用		3,151,236.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,152,833.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	288,208.38
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	222,574.42
4. 交易费用	7.4.7.18	11,702.57
5. 利息支出		1,237,198.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,237,198.06
6. 税金及附加		47,209.22
7. 其他费用	7.4.7.19	191,510.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,395,663.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,395,663.81

注：本集合计划合同变更生效日为2021年5月6日，本报告的会计期间为2021年5月6日至2021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：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021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)	122,089,280.44	1,461,949.33	123,551,229.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,395,663.81	17,395,663.81
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)	940,505,930.06	45,427,420.97	985,933,351.03
其中：1. 基金申购款	985,506,424.04	47,283,444.52	1,032,789,868.56
2. 基金赎回款	-45,000,493.98	-1,856,023.55	-46,856,517.53
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)	1,062,595,210.50	64,285,034.11	1,126,880,244.61

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

夏安

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

安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划由安信理财1号债券型集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。根据《证券公司客户资产管理业务管理办法》和《安信理财1号债券型集合资产管理计划说明书》约定，本集合计划认购对象为适合风险承受能力匹配且法律法规允许的个人投资者和机构投资者。本集合计划每份额面值及发行价格均为人民币1.00元。截至2009年5月20日止，本集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币1,781,416,252.58元，折合认购份额1,781,416,252.58份；认购资金产生的利息金额为人民币1,253,488.47元，折合集合计划份额1,253,488.47份。以上实收资金共计人民币1,782,669,741.05元，折合1,782,669,741.05份集合计划份额。上述出资业经中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了中审亚太验字[2009]第010330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，托管人为中国农业银行股份有限公司。

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2021年5月6日起，《安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《安信理财1号债券型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，中国农业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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 5 月 6 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

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 2021 年 5 月 6 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

金融工具是指形成集合计划的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(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应公允价值的，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）系本集合计划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；

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) 管理费

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.4%。计算方法如下：

$$G = E \times 0.4\% \div \text{当年实际天数}$$

G为每日应支付的管理费；

E为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起5个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 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。

(3) 业绩报酬

1) 管理人提取业绩报酬的原则

A. 符合业绩报酬计提条件时，在集合计划投资者赎回日和集合计划终止日计提业绩报酬。本集合计划分红日管理人不提取业绩报酬；

B. 同一投资者不同时间多次申购产品份额的，对投资者每笔参与份额（或红利再投资份额）分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

C. 在投资者赎回或集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；

D. 投资者申请赎回时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序赎回的方式确定赎回份额，计算、提取赎回份额对应的业绩报酬。

2) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资者赎回申请日或集合计划终止日。每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一业绩报酬计提日”，如该笔参与份额未发生业绩报酬计提，募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内申购的，以申购当日为上一业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率R作为计提业绩报酬的基准。

具体计算方法如下：

持有期年化收益率（R） \leq 5%，计提比例为0；

持有期年化收益率（R） $>$ 5%，计提比例为15%；

业绩报酬（H）计算方法： $H = (R - 5\%) \times 15\% \times K \times 365$

注：

H为应提取的业绩报酬

R为持有期年收益率

A=本次业绩报酬计提日集合计划份额累计净值；

B=上一业绩报酬计提日集合计划份额累计净值；

C=上一业绩报酬提取日集合计划份额净值；

N=上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数；

K=参与业绩报酬计提的份额数 \times 上一业绩报酬计提日集合计划份额净值。

3) 业绩报酬的支付

业绩报酬由管理人负责计算，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于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、公休日等，支付日期顺延。

(4) 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类、B类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.3%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的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 类份额每日应计提的销售服务费

E 为C 类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付给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(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；

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 2021年12月31日
活期存款	2,636,900.95
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	2,636,900.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021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	364,060,670.47	369,205,138.98	5,144,468.51
	银行间市场	652,289,146.00	654,956,500.00	2,667,354.00
	合计	1,016,349,816.47	1,024,161,638.98	7,811,822.51
资产支持证券		69,929,071.23	67,608,900.00	-2,320,171.23
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,086,278,887.70	1,091,770,538.98	5,491,651.28

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	12,800,126.40	-
合计	12,800,126.40	-

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 2021年12月31日
应收活期存款利息	3,214.97
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	1,270.10
应收债券利息	11,669,864.93
应收资产支持证券利息	1,552,205.48
应收买入返售证券利息	845.11
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	137.80
合计	13,227,538.39

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	13,651.80
合计	13,651.80

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	150,000.00

合计	150,000.00
----	------------

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 瑞元添利A

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利A)	本期 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	122,089,280.44	122,089,280.44
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-45,000,493.98	-45,000,493.98
本期末	77,088,786.46	77,088,786.46

7.4.7.7.2 瑞元添利B

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利B)	本期 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021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	303,693,837.43	303,693,837.43
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	303,693,837.43	303,693,837.43

7.4.7.7.3 瑞元添利C

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利C)	本期 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021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	681,812,586.61	681,812,586.61
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	681,812,586.61	681,812,586.61

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 瑞元添利A

单位：人民币元

项目 (瑞元添利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	91,221.98	1,370,727.35	1,461,949.33
本期利润	3,051,788.67	2,120,907.56	5,172,696.23
本期基金份额交易产生的变动数	-733,539.16	-1,122,484.39	-1,856,023.55
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-733,539.16	-1,122,484.39	-1,856,023.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,409,471.49	2,369,150.52	4,778,622.01

7.4.7.8.2 瑞元添利B

单位：人民币元

项目 (瑞元添利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	6,737,284.74	2,405,933.46	9,143,218.20
本期基金份额交易产生的变动数	6,335,132.67	3,271,817.80	9,606,950.47
其中：基金申购款	6,335,132.67	3,271,817.80	9,606,950.47
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,072,417.41	5,677,751.26	18,750,168.67

7.4.7.8.3 瑞元添利C

单位：人民币元

项目 (瑞元添利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	2,921,814.31	157,935.07	3,079,749.38
本期基金份额交易产生的变动数	25,090,977.43	12,585,516.62	37,676,494.05
其中：基金申购款	25,090,977.43	12,585,516.62	37,676,494.05
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,012,791.74	12,743,451.69	40,756,243.43

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	23,211.93
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	27,846.64
其他	3,382.27
合计	54,440.84

7.4.7.10 股票投资收益

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021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	1,563,827.10
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	1,563,827.10

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	158,510,087.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	154,310,839.99
减：应收利息总额	2,635,420.42
买卖债券差价收入	1,563,827.10

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	10,559,041.00
减：卖出资产支持证券成本总额	9,992,780.82

减：应收利息总额	559,041.10
资产支持证券投资收益	7,219.08

7.4.7.13 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	4,863,921.22
——股票投资	-
——债券投资	7,184,092.45
——资产支持证券投资	-2,320,171.23
——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	179,145.13
合计	4,684,776.09

7.4.7.17 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	1,902.57
银行间市场交易费用	9,800.00
合计	11,702.57

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	20,296.66
信息披露费	120,000.00
审计费用	23,835.00
帐户维护费	18,000.00
TA服务月费	8,779.24
其他	600.00
合计	191,510.90

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

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

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
中国农业银行股份有限公司	计划托管人

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

截止本报告期末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

截止本报告期末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 2021年07月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
安信证券股份有限公司	341,441,032.22	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 2021年07月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
安信证券股份有限公司	3,312,500,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 基金交易

截止本报告期末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

截止本报告期末，无应支付关联方的佣金。

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 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,152,833.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：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。本集合计划的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：每日应计提的集合计划管理费=前一日该类份额对应的集合计划资产净值×该类份额年管理费率÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	288,208.38

注：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。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：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×年托管费率÷当年天数。

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 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C	合计
安信证券股份有限公司	0.00	0.00	99,465.27	99,465.27
中国农业银行股份有限公司	0.00	0.00	792.37	792.37
合计	0.00	0.00	100,257.64	100,257.64

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、B类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.3%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：C类份额每日应计提的销售服务费=C类份额前一日集合计划资产净值×年销售服务费率÷当年天数。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付给管理人，经管理人代付给各销售机构。

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自有资金投资本基金的情况

报告期内本集合计划管理人未运用自有资金投资本集合计划。

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 2021年05月06日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,636,900.95	23,211.93

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（2021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2021年12月31日无持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券情况。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末未进行股票交易。

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

截止本报告期末无银行间市场债券正回购的情况。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末无交易所市场债券正回购的情况。

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 2021年12月31日
A-1	30,094,000.00
A-1以下	-
未评级	349,803,535.00
合计	379,897,535.00

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	57,623,900.00
合计	57,623,900.00

7.4.13.2.3 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 2021年12月31日
AAA	257,384,993.07
AAA以下	344,714,110.91
未评级	42,165,000.00
合计	644,264,103.98

7.4.13.2.4 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 2021年12月31日
AAA	9,985,000.00
AAA以下	-
未评级	-
合计	9,985,000.00

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，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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指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

市场风险是指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。

利率风险是指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。本计划的管理人定期对本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

安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年年度报告

本期末 2021年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,636,900.95	-	-	-	2,636,900.95
结算备付金	2,822,372.01	-	-	-	2,822,372.01
存出保证金	306,150.38	-	-	-	306,150.38
交易性金融资产	548,220,165.52	526,323,012.46	17,227,361.00	-	1,091,770,538.98
买入返售金融资产	12,800,126.40	-	-	-	12,800,126.40
应收利息	-	-	-	13,227,538.39	13,227,538.39
应收申购款	-	-	-	17,088,349.99	17,088,349.99
资产总计	566,785,715.26	526,323,012.46	17,227,361.00	30,315,888.38	1,140,651,977.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,465,335.68	12,465,335.68
应付赎回款	-	-	-	79,574.76	79,574.76
应付管理人报酬	-	-	-	309,937.07	309,937.07
应付托管费	-	-	-	77,471.09	77,471.09
应付销售服务费	-	-	-	126,974.22	126,974.22
应付交易费用	-	-	-	13,651.80	13,651.80
应交税费	-	-	-	552,038.53	552,038.53
应付利息	-	-	-	-3,250.66	-3,250.66
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00

负债总计	-	-	-	13,771,732.49	13,771,732.49
利率敏感度缺口	566,785,715.26	526,323,012.46	17,227,361.00	16,544,155.89	1,126,880,244.61

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2021年12月31日
	利率下降25个基点	34,119,039,095.00
	利率上升25个基点	-33,883,725,732.00

7.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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 2021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	1,024,161,638.98	90.88

资		
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	1,024,161,638.98	90.88

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2021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181,723,700.00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。

§ 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	1,091,770,538.98	95.71
	其中：债券	1,024,161,638.98	89.79
	资产支持证券	67,608,900.00	5.93
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	12,800,126.40	1.12
	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	5,459,272.96	0.48
8	其他各项资产	30,622,038.76	2.68
9	合计	1,140,651,977.10	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

截止本报告期末未进行股票交易。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

截止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

截止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

截止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

截止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

截止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	81,652,535.00	7.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	221,473,900.00	19.65
5	企业短期融资券	250,250,000.00	22.21
6	中期票据	399,185,500.00	35.42
7	可转债(可交换债)	71,599,703.98	6.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,024,161,638.98	90.88

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	019664	21国债16	500,000	50,020,000.00	4.44
2	185179	21莱钢Y2	500,000	50,000,000.00	4.44
3	149754	21山证C3	500,000	49,752,500.00	4.42
4	102103316	21珠海港MTN006	300,000	30,090,000.00	2.67
5	012105535	21如皋经贸SCP005	300,000	30,081,000.00	2.67

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	193508	信州1优	200,000	20,008,000.00	1.78
2	136797	庐陵02优	100,000	9,993,800.00	0.89
3	189761	龙控09优	100,000	9,985,000.00	0.89
4	179688	璟悦02优	100,000	9,896,000.00	0.88
5	137537	逸锃16A1	100,000	9,745,100.00	0.86
6	179460	璀璨16A	100,000	7,981,000.00	0.71

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

截止本报告期末未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

截止本报告期末未进行权证投资交易。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

截止本报告期末未进行股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

截止本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 21山证C3（代码：149754）为本集合计划前十大持仓债券。发行主体被监管部门立案调查信息详见该债券披露的《中信证券股份有限公司关于山西证券股份有限公司控股子公司涉及诉讼及收到证监会立案告知书的受托管理事务临时报告》，本集合计划投资21山证C3投资决策程序符合公司投资制度的规定。除21山证C3外，本集合计划投资的其他前十名债券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本集合计划本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出集合计划合同规定的备选股票库。

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	306,150.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,227,538.39
5	应收申购款	17,088,349.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,622,038.76

8.12.4 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	110053	苏银转债	18,991,333.60	1.69
2	113026	核能转债	10,036,271.60	0.89
3	113050	南银转债	9,614,241.00	0.85
4	123111	东财转3	6,726,120.00	0.60
5	128136	立讯转债	5,545,234.41	0.49
6	127005	长证转债	5,402,993.60	0.48
7	113013	国君转债	5,316,244.50	0.47
8	110062	烽火转债	2,888,500.00	0.26
9	113505	杭电转债	1,863,150.00	0.17
10	113043	财通转债	1,214,900.00	0.11
11	127025	冀东转债	1,042,627.95	0.09
12	113033	利群转债	744,001.50	0.07
13	127012	招路转债	714,480.82	0.06
14	127024	盈峰转债	612,605.00	0.05

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止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
安信资管瑞元添利A	638	120,828.82	447,846.25	0.58%	76,640,940.21	99.42%
安信资管瑞元添利B	1,556	195,175.99	57,810,097.67	19.04%	245,883,739.76	80.96%
安信资管瑞元添利C	2,244	303,838.05	0.00	0.00%	681,812,586.61	100.00%
合计	4,438	239,431.10	58,257,943.92	5.48%	1,004,337,266.58	94.52%

注：机构、个人投资者持有份额占总份额的比例的计算中，对下属分级集合计划，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

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	安信资管瑞元添利A	170,985.61	0.2218%
	安信资管瑞元添利B	511,714.66	0.1685%
	安信资管瑞元添利C	240.91	0.0000%
	合计	511,955.57	0.0482%

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

无本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理持有本开放式集合计划的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C
基金合同生效日(2021年05月06日)基金份额总额	122,089,280.44	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	303,693,837.43	681,812,586.61
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	45,000,493.98	-	-
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	77,088,786.46	303,693,837.43	681,812,586.61

§ 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，本集合资产管理计划管理人高级管理人员变更，2021年10月，董事长刘纯亮离任，由总经理李力兼任；2021年12月，合规总监兼首席风险官变更，由“廖笑非”变更为“陈永东”。

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁，2021年8月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

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

我公司原聘任立信会计师事务所为公司提供审计服务，于2021年改聘信永中和会计师事务所为公司2021年度主审会计师事务所，本报告年度的审计费用为30,000.00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	
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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
安信证券股份有限公司	341,441,032.22	100.00%	3,312,500,000.00	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	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划B、C类份额暂停赎回公告	中国证券报、公司网站	2021-05-07
2	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证券报、公司网站	2021-05-07
3	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 B、C类份额开通直销柜台申购、赎回业务的公告	公司网站	2021-05-10
4	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划参加天天基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021-05-11
5	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划参加京东肯特瑞销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021-05-18
6	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划新增代销机构的公告	公司网站	2021-05-18
7	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划新增代销机构的公告（上海陆金所）	公司网站	2021-06-23
8	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划新增北京汇成为销售机构的公告	公司网站	2021-07-08

9	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划2021年第二季度报告	中国证券报、公司网站	2021-07-21
10	安信证券资产管理有限公司关于投资经理吴慧文因休产假暂停履职的公告	公司网站	2021-09-13
11	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划新增蚂蚁基金为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021-09-17
12	安信证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站	2021-10-22
13	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划2021年第三季度报告	中国证券报、公司网站	2021-10-27
14	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划新增盈米基金为销售机构的公告	公司网站	2021-12-01
15	安信证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站	2021-12-14

§ 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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、《安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 2、《安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划合同》
- 3、《安信资管瑞元添利一年持有期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，投资者还可在本集合计划管理人网站（www.axzqzg.com）查阅。

安信证券资产管理有限公司
二〇二二年三月三十一日