

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:安信证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期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光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2022年8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划		
基金简称	安信资管瑞盈		
基金主代码	970058		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年07月23日		
基金管理人	安信证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	116,826,413.30份		
基金合同存续期	3年		
下属分级基金的基金简称	安信资管瑞盈3个月滚动持有A	安信资管瑞盈3个月滚动持有B	安信资管瑞盈3个月滚动持有C
下属分级基金的交易代码	970058	970059	970060
报告期末下属分级基金的份额总额	52,896,015.44份	21,898,124.01份	42,032,273.85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(1-3年)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，高于货币市场基金和货币型集合计划。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李力	石立平
	联系电话	0755-88027203	010-63639180
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95517	95595
传真		0755-88258219	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		518026	100033
法定代表人		李力	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.axzqzg.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)		
	安信资管瑞盈3 个月滚动持有A	安信资管瑞盈3 个月滚动持有B	安信资管瑞盈3 个月滚动持有C
本期已实现收益	582,782.88	117,826.02	495,871.76
本期利润	788,762.27	134,882.65	673,870.84
加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0133	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.24%	1.29%	1.08%
本期基金份额净值增长率	1.25%	1.25%	1.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)		
期末可供分配利润	1,516,515.34	599,715.26	1,030,122.88
期末可供分配基金份额利润	0.0287	0.0274	0.0245
期末基金资产净值	54,609,511.00	22,603,289.54	43,264,350.92
期末基金份额净值	1.0324	1.0322	1.0293
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	3.24%	3.19%	2.90%

注：（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

安信资管瑞盈3个月滚动持有A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.23%	0.01%	0.09%	0.02%	0.14%	-0.01%
过去三个月	0.63%	0.04%	0.92%	0.02%	-0.29%	0.02%
过去六个月	1.25%	0.06%	1.65%	0.03%	-0.40%	0.03%
自基金合同 生效起至今	3.24%	0.05%	3.00%	0.02%	0.24%	0.03%

安信资管瑞盈3个月滚动持有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
过去一个月	0.23%	0.01%	0.09%	0.02%	0.14%	-0.01%
过去三个月	0.63%	0.04%	0.92%	0.02%	-0.29%	0.02%
过去六个月	1.25%	0.06%	1.65%	0.03%	-0.40%	0.03%
自基金合同 生效起至今	3.19%	0.05%	2.95%	0.02%	0.24%	0.03%

安信资管瑞盈3个月滚动持有C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.01%	0.09%	0.02%	0.11%	-0.01%
过去三个月	0.56%	0.04%	0.92%	0.02%	-0.36%	0.02%
过去六个月	1.09%	0.06%	1.65%	0.03%	-0.56%	0.03%
自基金合同 生效起至今	2.90%	0.05%	2.95%	0.02%	-0.05%	0.03%

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

安信资管瑞盈3个月滚动持有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07月23日-2022年06月30日)



安信资管瑞盈3个月滚动持有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07月28日-2022年06月30日)



注：安信瑞盈 3 个月滚动持有债券 B（970059）2021 年 7 月 23 日尚未开放申赎，无计划份额，2021 年 7 月 23 日净值不进行披露。

安信资管瑞盈3个月滚动持有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07月28日-2022年06月30日)



注：安信瑞盈3个月滚动持有债券C（970060）2021年7月23日尚未开放申赎，无计划份额，2021年7月23日净值不进行披露。

§ 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2022年6月30日，安信资管受托产品217只，管理市值合计1065.65亿元。合计管理运作114只集合计划，受托管理市值为360.91亿元；合计管理运作99只定向计划，受托管理市值为681.89亿元。

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2022年6月30日，安信资管存续的7只大集合产品已全部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	安信证券资产管理有限公司公募部兼固定收益部负责人、基金经理	2021-05-06	-	10	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	基金经理	2021-05-06	-	10	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“离任日期”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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及其从业人员监督管理办法》的相关规定。

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，本集合计划管理人严格按照《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》

等有关法律法规及集合计划合同、招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 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，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%的交易共14起，均为量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

上半年债券市场收益率震荡下行，信用利差缩窄、期限利差放大。

一季度债券市场呈现V形走势，10年期国债收益率先下后上。年初以来央行货币宽松、宽信用的阻滞叠加市场对经济的悲观预期，债券市场收益率持续下行，春节后宽信用、美债收益率上行、经济数据公布超预期以及双降预期落空，十年国债开始回调并围绕2.8附近窄幅波动。一季度以来，国内外环境复杂性不确定性加剧，俄乌冲突爆发对能源和农产品价格的干扰，海外美国通胀加剧、美联储缩表预期加快，美债收益率陡峭上行，对债券收益率下行构成制约，与此同时，国内代表经济火车头的一线城市疫情陆续爆发和扩散，经济复苏的预期延后，对债市构成了支撑，整体债市处于多空博弈的格局。

二季度上海及长三角、北京疫情陆续爆发，而本轮上海疫情规模上看不低于2020年武汉疫情，防疫应对滞后导致持续时间较长，城市按下暂停键，长三角区域作为中国经济火车头影响较大，经济总需求孱弱，经济下行压力加大，同时央行加大逆周期调节力度，实体经济和消费者信心受创，宽信用持续不畅，资金淤积银行间市场，债市短端演绎资产荒行情，短端收益率快速走低，而长端在经济先触底后回升大背景下，受到宽信用预期、经济金融数据改善、防疫政策不断优化调整、中美利差倒挂、货币总量政策博

弈等因素影响，长端走势一波三折，市场演绎复苏预期并非一蹴而就，以10年国债为例，呈现N字形走势，维持2.70-2.85范围内窄幅震荡，债市呈现牛陡格局。

报告期内，本产品操作相对稳健，进行了适度的加仓，保持短久期配置，对组合静态收益进行优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末安信资管瑞盈3个月滚动持有A基金份额净值为1.0324元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.25%，同期业绩比较基准收益率为1.65%；截至报告期末安信资管瑞盈3个月滚动持有B基金份额净值为1.0322元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.25%，同期业绩比较基准收益率为1.65%；截至报告期末安信资管瑞盈3个月滚动持有C基金份额净值为1.0293元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.09%，同期业绩比较基准收益率为1.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段，经济最差的时候已经过去，现阶段属于疫情导致的供给约束松绑后，进入的增长修复阶段，经济逐步触底回升，经济边际上进入缓慢修复通道，但节奏缓慢。

基本上来看，随着上海北京疫后逐步修复，宽信用将有所修复，总需求缓慢回升。投资需求来看，地方政府债基本发完，基建项目集中在8月份之前落地，将会撬动基建投资增速，但宽财政刺激基建的力度仍然在年初政府报告范围内，是否新增赤字或赤字外的特别国债发行，财政缺口大概率将由增量工具补充，关注7月政治局会议的政策摆布，另外地产方面，房地产投资触底一般滞后销售6个月，当前房地产销售居然局部有所回温，但广泛的三四线城市销售仍然很差，整体上看，结构性的销售转好并不能代表整体改善，目前拿地、新开工低位徘徊，销售分化，地产复苏仍缓慢。消费需求方面，二季度央行调查问卷关键指标显示：居民对就业预期、收入信心不足，倾向于增加储蓄，减少投资，企业经营景气度下降，银行贷款需求也下降。疫情前后影响时间较长，居民对就业和收入预期的下降或成为影响消费修复的核心约束因素。出口方面，随着外围欧美的经济指标走弱，预计出口将受到外需影响增速偏弱但具有韧性，因此整体上看，经济虽然有所修复，但修复的节奏和斜率仍然缓慢。

资金面上，央行大概率要有所收敛，源于疫情和基本面好转和外围加息等因素，预计继续降息降准的总量政策宽松的可能性在降低，另外央行利润上缴结束，央行重新开启OMO投放有成本资金，也会边际上抬升整体市场资金成本。货币政策空间充裕，不透支未来，预计在经济缓慢恢复过程中信贷和总需求回升，资金淤积缓解，资金中枢水平抬升。

展望下一阶段，产品组合将维持一定的灵活性，采取短久期、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。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本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，中国光大银行股份有限公司在安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、资产管理合同、托管协议等的规定，依法安全保管了集合计划的全部资产，对本集合计划的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本集合计划运作情况报告，没有发生任何损害集合计划份额持有人利益的行为，诚实守信、勤勉尽责地履行了作为集合计划托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、资产管理合同、托管协议等的规定，对集合计划管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现集合计划管理人在投资运作、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、集合计划费用开支等方面存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据集合计划合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对集合计划管理人编制的《安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划2022年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	227,942.15	1,406,768.92
结算备付金		585,300.52	-
存出保证金		615.44	2,252.20
交易性金融资产	6.4.7.2	137,499,695.58	181,723,700.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		137,499,695.58	171,738,700.00
资产支持证券投资		-	9,985,000.00
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,921.76	332,437.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,671,943.68
资产总计		138,316,475.45	186,137,101.80
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,599,824.00	32,469,751.29
应付清算款		2,652.05	-
应付赎回款		18,908.93	53,014.00
应付管理人报酬		29,458.86	37,832.13
应付托管费		2,945.90	3,783.22
应付销售服务费		11,228.76	13,905.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		100,579.38	84,023.36
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	73,726.11	31,328.82
负债合计		17,839,323.99	32,693,638.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	116,826,413.30	150,578,492.18
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,650,738.16	2,864,971.37
净资产合计		120,477,151.46	153,443,463.55
负债和净资产总计		138,316,475.45	186,137,101.80

注：截至2022年06月30日，安信瑞盈3个月滚动持有债券A份额净值1.0324元，份额总额52,896,015.44份；安信瑞盈3个月滚动持有债券B份额净值1.0322元，份额总额21,898,124.01份；安信瑞盈3个月滚动持有债券C份额净值1.0293元，份额总额42,032,273.85份；合计份额净值1.0312元，总份额合计116,826,413.30份。

6.2 利润表

会计主体：安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022年01月01日至2022年06月30日
一、营业总收入		2,362,730.63
1. 利息收入		8,283.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,837.28
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		446.69
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,953,411.56

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,376,225.21
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-422,813.65
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	401,035.10
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	-
减：二、营业总支出		765,214.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	203,401.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,340.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	93,095.97
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		348,506.98
其中：卖出回购金融资产 支出		348,506.98
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		11,609.61
8. 其他费用	6.4.7.17	88,261.18
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,597,515.76
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,597,515.76
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,597,515.76

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	150,578,492.18	-	2,864,971.37	153,443,463.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	150,578,492.18	-	2,864,971.37	153,443,463.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,752,078.88	-	785,766.79	-32,966,312.09
（一）、综合收益总额	-	-	1,597,515.76	1,597,515.76
（二）、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）	-33,752,078.88	-	-811,748.97	-34,563,827.85
其中：1. 基金申购款	43,157,721.32	-	1,083,656.79	44,241,378.11

2. 基金赎回款	-76,909,800.20	-	-1,895,405.76	-78,805,205.96
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	116,826,413.30	-	3,650,738.16	120,477,151.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称本计划或本集合计划）由安信证券安盈宝集合资产管理计划（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《安信证券安盈宝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2013年5月22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158,716,104.26元，折合认购份额158,716,104.26份；认购资金产生的利息金额为人民币55,412.06元，折合集合计划份额55,412.06份。以上实收资金共计人民币158,771,516.32元，折合158,771,516.32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（2013）验字第60884100_H13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，托管人为中国光大银行股份有限公司。

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7月23日起，《安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理合同》生效，原《安信证券安盈宝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，中国光大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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日的经营成果和所有者权益（计划净值）变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）。

根据财政部《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（2020年12月30日下发）的规定，本集合计划首次施行上述新金融工具准则的日期为2022年1月1日，该变化构成了会计政策变更。该会计政策变更事项未对本集合计划的财务报表构成重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款主要税项列示如下：

（1）增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。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。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（2）印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	227,942.15	
等于：本金	227,636.12	
加：应计利息	306.03	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	227,942.15	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	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	26,127,487.00	664,826.06	26,929,628.16	137,315.10
	银行间市场	107,918,210.29	2,420,067.42	110,570,067.42	231,789.71
	合计	134,045,697.29	3,084,893.48	137,499,695.58	369,104.81
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		134,045,697.29	3,084,893.48	137,499,695.58	369,104.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未投资于衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截止本报告期末本集合计划无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	-
应付交易费用	7,275.58
其中：交易所市场	2,568.07

银行间市场	4,707.51
应付利息	-
预提费用	66,450.53
合计	73,726.11

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 安信资管瑞盈3个月滚动持有A

金额单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月滚动持有A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	71,610,186.84	71,610,186.84
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-18,714,171.40	-18,714,171.40
本期末	52,896,015.44	52,896,015.44

6.4.7.7.2 安信资管瑞盈3个月滚动持有B

金额单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月滚动持有B)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	12,512,009.66	12,512,009.66
本期申购	17,427,878.40	17,427,878.40
本期赎回(以“-”号填列)	-8,041,764.05	-8,041,764.05
本期末	21,898,124.01	21,898,124.01

6.4.7.7.3 安信资管瑞盈3个月滚动持有C

金额单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月滚动持有C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	66,456,295.68	66,456,295.68

本期申购	25,729,842.92	25,729,842.92
本期赎回（以“-”号填列）	-50,153,864.75	-50,153,864.75
本期末	42,032,273.85	42,032,273.85

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 安信资管瑞盈3个月滚动持有A

单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月 滚动持有A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,396,415.51	14,703.41	1,411,118.92
本期利润	582,782.88	205,979.39	788,762.27
本期基金份额交易产生的变动数	-462,683.05	-23,702.58	-486,385.63
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-462,683.05	-23,702.58	-486,385.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,516,515.34	196,980.22	1,713,495.56

6.4.7.8.2 安信资管瑞盈3个月滚动持有B

单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月 滚动持有B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	227,742.61	16,237.56	243,980.17
本期利润	117,826.02	17,056.63	134,882.65
本期基金份额交易产生的变动数	254,146.63	72,156.08	326,302.71
其中：基金申购款	435,828.98	87,209.51	523,038.49
基金赎回款	-181,682.35	-15,053.43	-196,735.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	599,715.26	105,450.27	705,165.53

6.4.7.8.3 安信资管瑞盈3个月滚动持有C

单位：人民币元

项目 (安信资管瑞盈3个月 滚动持有C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,123,748.33	86,123.95	1,209,872.28
本期利润	495,871.76	177,999.08	673,870.84
本期基金份额交易产生的变动数	-589,497.21	-62,168.84	-651,666.05
其中：基金申购款	517,061.78	43,556.52	560,618.30
基金赎回款	-1,106,558.99	-105,725.36	-1,212,284.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,030,122.88	201,954.19	1,232,077.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	5,488.29
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	2,339.29
其他	9.70
合计	7,837.28

6.4.7.10 股票投资收益

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	3,305,208.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-928,982.79
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	2,376,225.21

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	102,337,146.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,947,830.00
减：应计利息总额	3,314,003.83
减：交易费用	4,295.79
买卖债券差价收入	-928,982.79

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	75,795.89
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-498,609.54

资产支持证券投资收益—— 赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益—— 申购差价收入	-
合计	-422,813.65

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	9,542,295.89
减：卖出资产支持证券成本 总额	9,989,300.00
减：应计利息总额	51,595.89
减：交易费用	9.54
资产支持证券投资收益	-498,609.54

6.4.7.13 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生品投资收益。

6.4.7.14 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	401,035.10
——股票投资	-
——债券投资	396,735.10
——资产支持证券投资	4,300.00
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	401,035.10

6.4.7.16 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
信息披露费	59,507.37
审计费用	6,943.16
帐户维护费	17,850.00
TA月服务费	3,360.65
其他	600.00
合计	88,261.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
中国光大银行股份有限公司	计划托管人
国投安信期货有限公司	与计划管理人同一股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期末未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期末未发生通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
安信证券	21,896,191.22	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购

		成交总额的比例
安信证券	552,500,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期末未发生通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
安信证券	7,983.44	100.00%	2,568.07	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	203,401.06
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集合计划资产净值的0.3%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=前一日集合计划资产净值×年管理费率÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,340.07

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0.03%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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

安信资管瑞盈3个月滚动持有B

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
安信盛世FOF六号集合资产管理计划	16,497,639.29	14.12%	0.00	0.00%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	227,942.15	5,488.29

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他关联交易的事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划截至2022年06月30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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，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17,599,824.00元，于2022年7月1日（先后）到期。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	10,407,849.32	15,028,000.00
A-1以下	-	-
未评级	72,188,885.37	111,249,500.00
合计	82,596,734.69	126,277,500.00

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	41,606,435.95	27,781,600.00
AAA以下	13,296,524.94	11,679,000.00

未评级	-	6,000,600.00
合计	54,902,960.89	45,461,200.00

6.4.13.2.3 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	9,985,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	9,985,000.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 06月30 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	227,942.15	-	-	-	-	-	227,942.15
结算备付金	585,300.52	-	-	-	-	-	585,300.52
存出保证金	615.44	-	-	-	-	-	615.44
交易性金融资产	25,797,846.58	15,505,394.52	76,363,262.10	19,690,252.33	142,940.05	-	137,499,695.58
应收申购款	-	-	-	-	-	2,921.76	2,921.76
资产总计	26,611,704.69	15,505,394.52	76,363,262.10	19,690,252.33	142,940.05	2,921.76	138,316,475.45
负债							
卖出回购金融资产款	17,599,824.00	-	-	-	-	-	17,599,824.00
应付清算款	-	-	-	-	-	2,652.05	2,652.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,908.93	18,908.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,458.86	29,458.86
应付托管费	-	-	-	-	-	2,945.90	2,945.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,228.76	11,228.76
应交税费	-	-	-	-	-	100,579.38	100,579.38
其他负债	-	-	-	-	-	73,726.11	73,726.11
负债总计	17,599,824.00	-	-	-	-	239,499.99	17,839,323.99
利率敏感度缺口	9,011,880.69	15,505,394.52	76,363,262.10	19,690,252.33	142,940.05	-236,578.23	120,477,151.46
上年度	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

安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划2022年中期报告

末 2021年 12月31 日							
资产							
银行存款	1,406,768.92	-	-	-	-	-	1,406,768.92
存出保证金	2,252.20	-	-	-	-	-	2,252.20
交易性金融资产	20,019,000.00	15,993,600.00	119,142,100.00	26,441,000.00	128,000.00	-	181,723,700.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,671,943.68	2,671,943.68
应收申购款	-	-	-	-	-	332,437.00	332,437.00
资产总计	21,428,021.12	15,993,600.00	119,142,100.00	26,441,000.00	128,000.00	3,004,380.68	186,137,101.80
负债							
卖出回购金融资产款	32,469,751.29	-	-	-	-	-	32,469,751.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,014.00	53,014.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,832.13	37,832.13
应付托管费	-	-	-	-	-	3,783.22	3,783.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,905.43	13,905.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,361.86	8,361.86
应交税费	-	-	-	-	-	84,023.36	84,023.36
应付利息	-	-	-	-	-	8,966.96	8,966.96
其他负债	-	-	-	-	-	14,000.00	14,000.00
负债总计	32,469,751.29	-	-	-	-	223,886.96	32,693,638.25
利率敏感度缺口	-11,041,730.17	15,993,600.00	119,142,100.00	26,441,000.00	128,000.00	2,780,493.72	153,443,463.55

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	利率下降25个基点	1,690,789,215.00	2,631,298,618.00
	利率上升25个基点	-1,684,560,874.00	-2,620,986,815.00

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	137,499,695.58	114.13	171,738,700.00	111.92
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	137,499,695.58	114.13	171,738,700.00	111.92

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	142,940.05	-
第二层次	137,356,755.53	181,723,700.00
第三层次	-	-
合计	137,499,695.58	181,723,700.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本集合计划本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年01月01日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本集合计划已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本集合计划业务的性质，新金融工具准则预期不会对本集合计划的财务状况和经营成果产生重大影响。

除公允价值和执行新金融工具准则外，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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	137,499,695.58	99.41
	其中：债券	137,499,695.58	99.41
	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	813,242.67	0.59

8	其他各项资产	3,537.20	0.00
9	合计	138,316,475.45	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本集合计划本报告期末未进行股票交易。

7.4.3 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,093,690.84	5.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	28,667,415.36	23.79
5	企业短期融资券	76,503,043.85	63.50
6	中期票据	26,092,605.48	21.66

7	可转债(可交换债)	142,940.05	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	137,499,695.58	114.13

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	188877	21津投11	100,000	10,383,342.47	8.62
2	012103922	21景德镇陶SCP002	100,000	10,322,745.21	8.57
3	102103003	21鲁钢铁MTN004	100,000	10,313,917.81	8.56
4	185179	21莱钢Y2	100,000	10,309,654.80	8.56
5	042100409	21晋能装备CP004	100,000	10,286,750.68	8.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

截止本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未进行贵金属投资交易。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未进行权证投资交易。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本集合计划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。

7.12.2 本集合计划本报告期内未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	615.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,921.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,537.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	142,940.05	0.12

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的	持有人结构
------	-----	-------	-------

	户数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
安信资管瑞盈3个月滚动持有A	315	167,923.86	0.00	0.00%	52,896,015.44	100.00%
安信资管瑞盈3个月滚动持有B	62	353,195.55	16,497,639.29	75.34%	5,400,484.72	24.66%
安信资管瑞盈3个月滚动持有C	840	50,038.42	42,032,273.85	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,217	95,995.41	58,529,913.14	50.10%	58,296,500.16	49.90%

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信资管瑞盈3个月滚动持有A	0.00	0.0000%
	安信资管瑞盈3个月滚动持有B	194.69	0.0009%
	安信资管瑞盈3个月滚动持有C	118.14	0.0003%
	合计	312.83	0.0003%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金基金份额的比例展示系四舍五入结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式	安信资管瑞盈3个月滚动持有A	0

基金	安信资管瑞盈3个月滚动持有B	0
	安信资管瑞盈3个月滚动持有C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信资管瑞盈3个月滚动持有A	0
	安信资管瑞盈3个月滚动持有B	0
	安信资管瑞盈3个月滚动持有C	0
	合计	0

注：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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	安信资管瑞盈3个月滚动持有A	安信资管瑞盈3个月滚动持有B	安信资管瑞盈3个月滚动持有C
基金合同生效日(2021年07月23日)基金份额总额	273,513,497.36	-	-
本报告期期初基金份额总额	71,610,186.84	12,512,009.66	66,456,295.68
本报告期基金总申购份额	-	17,427,878.40	25,729,842.92
减：本报告期基金总赎回份额	18,714,171.40	8,041,764.05	50,153,864.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	52,896,015.44	21,898,124.01	42,032,273.85

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人、集合计划托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本集合计划审计的会计事务所为信永中和会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员在开展集合计划管理业务过程中无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员在开展集合计划托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	7,983.44	100.00%	-

注：1、本集合计划本报告期内未投资股票。

2、根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	21,896,191.22	100.00%	552,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信证券资产管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
2	关于新增北京度小满基金销售有限公司为安信资管旗下部分集合计划销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-01-05
3	关于新增和耕传承基金销售有限公司为安信资管旗下部分集合计划销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-01-07
4	安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划2021年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
5	安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划春节假期前后暂停大额申购公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-25
6	关于新增上海好买基金销售有限公司为安信资管旗下部分集合计划销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-01-25

7	安信证券资产管理有限公司关于安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划新增京东肯特瑞为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站	2022-03-09
8	安信证券资产管理有限公司关于投资经理吴慧文女士恢复履行职务的公告	中国证监会指定网站	2022-03-15
9	关于新增上海天天基金销售有限公司为安信资管旗下部分集合计划销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-03-21
10	关于新增宁波银行股份有限公司为安信资管旗下部分集合计划销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-03-28
11	安信证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划参与宁波银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站	2022-03-29
12	安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划2021年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-31
13	安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划2022年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
14	安信证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定网站	2022-05-18
15	安信证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划新增万得基金为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站	2022-06-10

16	安信证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划新增兴业银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站	2022-06-22
17	安信证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划新增鼎信汇金为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站	2022-06-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划在报告期内不存在单一投资者持有份额达到或超过集合计划总份额20%的情况。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 2、安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、安信资管瑞盈3个月滚动持有债券型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

12.2 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。

12.3 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

二〇二二年八月三十一日