

安信资管天利宝货币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:中国证券登记结算有限责任公司

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证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2022年8月24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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	41
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	44
7.9 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	45

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
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 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	47
10.9 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划
基金简称	安信资管天利宝货币
基金主代码	970105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12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	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	12,926,465,081.53份
基金合同存续期	3年

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划主要采用类属资产配置策略、期限配置策略、回购策略、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	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	李力
	联系电话	0755-88027203
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn
		陈晨
		010-50938723
		zctg@chinaclear.com.cn

客户服务电话	95517	4008-058-058
传真	0755-88258219	-
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17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	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码	518026	100033
法定代表人	李力	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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)
本期已实现收益	85,112,314.47
本期利润	85,112,314.47

本期净值收益率	0.6715%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末基金资产净值	12,926,465,081.53
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
累计净值收益率	0.7696%

注：1. 本集合计划无持有人认购或交易基金的各项费用。

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（不含公允价值变动损益）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损益，由于本集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3. 本集合计划按日结转份额，表中的“期末”均指报告一日，即06月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 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	0.0986%	0.0001%	0.1126%	0.0000%	-0.0140%	0.0001%
过去三个月	0.3209%	0.0002%	0.3418%	0.0000%	-0.0209%	0.0002%
过去六个月	0.6715%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	-0.0095%	0.0007%
自基金合同 生效起至今	0.7696%	0.0008%	0.7793%	0.0000%	-0.0097%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信资管天利宝货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月06日-2022年06月30日)



注：本集合计划的生效日为2021年12月6日。

§ 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	2021-12-06	-	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	2021-12-06	-	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，根据整体规模变动严控组合剩余期限，保持较低的杠杆，并在季末流动性波动较大的时间窗口做好备付。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末安信资管天利宝货币基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.6715%，同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

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。

下一阶段，产品组合将维持一定的灵活性，采取超短久期、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

根据本集合计划合同中“第十六部分集合计划的收益与分配”之“（二）收益分配原则”的相关规定，本集合计划收益为“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额），本集合计划在本报告期进行了6次收益集中支付并结转为基金份额，累计分配收益87,253,183.46元，利润分配金额、方式等符合相关法规和本集合计划合同的规定。

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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 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：安信资管天利宝货币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	5,363,794,358.00	4,836,282,295.22
结算备付金		2,281,899.87	454,675.88
存出保证金		80,203.71	281,703.60
交易性金融资产	6.4.7.2	7,585,725,296.37	5,653,275,911.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,585,725,296.37	5,653,275,911.28
资产支持证券投资		-	-
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	-	1,522,788,041.39
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	97,431,101.43
资产总计		12,951,881,757.95	12,110,513,728.80
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,009,474.30	7,030,556.25
应付托管费		556,081.92	1,079,659.96
应付销售服务费		2,780,409.55	1,952,932.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,636,797.88	2,153,189.46
应付利润		10,329,830.55	12,470,699.54
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	104,082.22	79,470.77
负债合计		25,416,676.42	24,766,508.25
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	12,926,465,081.53	12,085,747,220.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		12,926,465,081.53	12,085,747,220.55
负债和净资产总计		12,951,881,757.95	12,110,513,728.80

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额12,926,465,081.53份，基金份额净值1.0000元。

6.2 利润表

会计主体：安信资管天利宝货币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		162,027,647.77
1. 利息收入		69,716,540.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	60,388,036.04
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		9,328,504.24
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		92,311,107.49
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	92,311,107.49
资产支持证券投资		-
收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.12	-
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）		-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		76,915,333.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	56,776,504.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,154,250.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,771,251.39
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		839,884.35
其中：卖出回购金融资产支出		839,884.35
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		229,604.70
8. 其他费用	6.4.7.13	143,837.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,112,314.47
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,112,314.47
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		85,112,314.47

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信资管天利宝货币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)	12,085,747,220.55	-	-	12,085,747,220.55
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)	12,085,747,220.55	-	-	12,085,747,220.55
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	840,717,860.98	-	-	840,717,860.98
(一)、综合收益总额	-	-	85,112,314.47	85,112,314.47
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变	840,717,860.98	-	-	840,717,860.98

动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	173,468,377,980.24	-	-	173,468,377,980.24
2. 基金赎回款	-172,627,660,119.26	-	-	-172,627,660,119.26
（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）	-	-	-85,112,314.47	-85,112,314.47
（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）	12,926,465,081.53	-	-	12,926,465,081.53

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

原安信证券天利宝集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）为现金管理产品，由安信证券股份有限公司发起设立，自2012年11月26日起开始募集并于2012年12月7日

结束募集，于2012年12月10日成立。该计划于2012年12月21日获得中国证券业协会备案函（中证协函[2012]855号）。

根据中国证监会《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），安信证券资产管理有限公司于2020年1月16日正式成立。原集合计划的管理人由“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”。

根据《中华人民共和国基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《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》、《运作管理指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《安信资管天利宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》自2021年12月06日起生效，《安信证券天利宝集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为货币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，中国证券登记结算有限责任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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信资管天利宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据，同业存单，期限在1个月以内的债券回购，剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券，中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本集合计划的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

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01月01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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历01月01日起至06月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本集合计划在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本集合计划现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本集合计划现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本集合计划持有的债券投资和资产支持证券投资分类为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资产在资产负债表表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金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；

-该金融资产已转移，虽然本基金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，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划估值采用“摊余成本法”，并通过计算暂估收益率的方法每日确认各类金融工具的暂估收益：

1、银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；

2、回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；

3、债券以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日预提损益；

4、为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的集合计划资产净值与“摊余成本法”计算的集合计划资产净值负偏离度绝对值达到0.25%时，管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内，当正偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施，并履行信息披露义务；

5、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

6、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划每份份额享有同等分配权，本集合计划“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额），本集合计划采用1.00元固定份额净值列示，自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付，本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益。收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为集合计划份额持有人增加相应的计划份额；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为集合计划份额持有人缩减相应的计划份额，遇投资者剩余计划份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行，投资者赎回集合计划份额时，于当期月度分红日支付对应的收益。投资者解约情形下，管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款基准利率与投资者实际收益的孰低值对该投资人进行收益分配，该投资者实际投资收益与分配收益的差额部分计入集合计划资产，当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有本集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益。

6.4.4.12 分部报告

本集合计划无分部报告。

6.4.4.13 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。

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01月01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

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

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	3,372,962,720.27
等于：本金	3,370,645,665.69
加：应计利息	2,317,054.58
减：坏账准备	-
定期存款	1,990,831,637.73
等于：本金	1,970,000,000.00
加：应计利息	20,831,637.73
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	1,990,831,637.73
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,363,794,358.00

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			
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)

债券	交易所市场	450,925,558.00	451,298,447.95	372,889.95	0.0029
	银行间市场	7,134,799,738.37	7,146,498,147.97	11,698,409.60	0.0905
	合计	7,585,725,296.37	7,597,796,595.92	12,071,299.55	0.0934
资产支持证券		-	-	-	-
合计		7,585,725,296.37	7,597,796,595.92	12,071,299.55	0.0934

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

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持有衍生金融资产/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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本集合计划本报告期末未持有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	19,779.66
其中：交易所市场	-
银行间市场	19,779.66

应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	104,082.22

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	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	12,085,747,220.55	12,085,747,220.55
本期申购	173,468,377,980.24	173,468,377,980.24
本期赎回（以“-”号填列）	-172,627,660,119.26	-172,627,660,119.26
本期末	12,926,465,081.53	12,926,465,081.53

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	85,112,314.47	-	85,112,314.47
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-85,112,314.47	-	-85,112,314.47
本期末	-	-	-

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

定期存款利息收入	21,317,720.99
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	39,688.78
其他	1,153.34
合计	60,388,036.04

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	91,120,130.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,190,977.23
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	92,311,107.49

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	4,310,457,426.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,202,763,305.30
减：应计利息总额	106,503,143.85
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	1,190,977.23
----------	--------------

6.4.7.12 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.13 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	-
汇划手续费	41,235.16
信息披露费	59,507.37
审计费用	24,795.19
帐户维护费	17,700.00
其他	600.00
合计	143,837.72

6.4.7.14 分部报告

无

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、计划销售机构
安信证券资产管理有限公司	计划管理人
中国证券登记结算有限责任公司	计划托管人

注：下述关联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内及上年度可比期间未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	215,601,843.14	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	6,034,438,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 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。

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	16,646.27	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	56,776,504.96
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提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。支付基金管理人安信资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.90%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

每日应计提的集合计划管理费=前一日的集合计划资产净值×0.90%/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	3,154,250.18

注：本集合计划的托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

每日应计提的集合计划托管费=前一日的集合计划资产净值×0.05%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

本集合计划当期未发生应支付的销售服务费。

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

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间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固有资金投资本基金的情况

本报告期内本集合计划管理人未持有本集合计划份额。

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

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。

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
中国证券登记结算有限责任公司	13,602,274.65	310,419.62

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划在承销期内无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

无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
87,184,624.81	-	-2,072,310.34	85,112,314.47	-

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

本集合计划在本报告期内未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本集合计划本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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	951,266,968.50	2,191,333,892.54
A-1以下	-	-
未评级	3,717,250,842.48	869,575,176.74
合计	4,668,517,810.98	3,060,909,069.28

注：未评级债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,428,847,000.00	1,333,609,658.27
合计	2,428,847,000.00	1,333,609,658.27

6.4.13.2.4 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	500,431,784.94	1,258,757,183.73
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	500,431,784.94	1,258,757,183.73

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划的管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的10%。

一般情况下，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期再每个交易日均不得超过240天；当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过集合计划总份额的20%时，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过集合计划总份额的50%时，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；

本集合计划的管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

本集合计划所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本集合计划的管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划的管理人根据质押品的资质确定质押率水平，持续检测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本集合计划在本报告期内的流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人每日通过“影子定价”对本集合计划面临的市场风险进行监控，定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,160,805,969.14	1,202,988,388.86	-	-	-	5,363,794,358.00
结算备付金	2,281,899.87	-	-	-	-	2,281,899.87
存出保	80,203.71	-	-	-	-	80,203.71

证金						
交易性金融资产	4,967,329,989.33	2,618,395,307.04	-	-	-	7,585,725,296.37
资产总计	9,130,498,062.05	3,821,383,695.90	-	-	-	12,951,881,757.95
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,009,474.30	10,009,474.30
应付托管费	-	-	-	-	556,081.92	556,081.92
应付销售服务费	-	-	-	-	2,780,409.55	2,780,409.55
应交税费	-	-	-	-	1,636,797.88	1,636,797.88
应付利润	-	-	-	-	10,329,830.55	10,329,830.55
其他负债	-	-	-	-	104,082.22	104,082.22
负债总计	-	-	-	-	25,416,676.42	25,416,676.42
利率敏感度缺口	9,130,498,062.05	3,821,383,695.90	-	-	-25,416,676.42	12,926,465,081.53
上年度末 2021年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,066,282,295.22	770,000,000.00	-	-	-	4,836,282,295.22
结算备付金	454,675.88	-	-	-	-	454,675.88
存出保证金	281,703.60	-	-	-	-	281,703.60
交易性金融资产	3,329,169,196.18	2,324,106,715.10	-	-	-	5,653,275,911.28
买入返售金融资产	1,522,788,041.39	-	-	-	-	1,522,788,041.39
应收利息	-	-	-	-	97,431,101.43	97,431,101.43
资产总计	8,918,975,912.27	3,094,106,715.10	-	-	97,431,101.43	12,110,513,728.80
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,030,556.25	7,030,556.25

应付托管费	-	-	-	-	1,079,659.96	1,079,659.96
应付销售服务费	-	-	-	-	1,952,932.27	1,952,932.27
应付交易费用	-	-	-	-	29,470.77	29,470.77
应交税费	-	-	-	-	2,153,189.46	2,153,189.46
应付利润	-	-	-	-	12,470,699.54	12,470,699.54
其他负债	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	24,766,508.25	24,766,508.25
利率敏感度缺口	8,918,975,912.27	3,094,106,715.10	-	-	72,664,593.18	12,085,747,220.55

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	78,830,877,738.00	68,908,837,933.00
	利率上升25个基点	-78,617,791,727.00	-68,661,640,979.00

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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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	7,585,725,296.37	58.68	5,653,275,911.28	46.78
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	7,585,725,296.37	58.68	5,653,275,911.28	46.78

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	-	-
第二层次	7,585,725,296.37	5,653,275,911.28

第三层次	-	-
合计	7,585,725,296.37	5,653,275,911.28

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	固定收益投资	7,585,725,296.37	58.57

	其中：债券	7,585,725,296.37	58.57
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,366,076,257.87	41.43
4	其他各项资产	80,203.71	0.00
5	合计	12,951,881,757.95	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.64	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每个银行间交易日融资余额占集合计划资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过集合计划资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	97

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2022-01-30	121	因产品规模变动	2022-01-28至2022-01-30
2	2022-01-29	122	因产品规模变动	2022-01-28至2022-01-30
3	2022-01-28	123	因产品规模变动	2022-01-28至2022-01-30

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产 净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产 净值的比例 (%)
1	30天以内	33.91	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.42	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	41.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.55	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本集合计划本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	450,925,558.00	3.49
5	企业短期融资券	4,369,192,172.86	33.80
6	中期票据	343,100,365.39	2.65
7	同业存单	2,422,507,200.12	18.74
8	其他	-	-
9	合计	7,585,725,296.37	58.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	012281620	22中化工SCP008	3,000,000	300,886,817.61	2.33
2	112115383	21民生银行CD383	3,000,000	296,035,964.28	2.29
3	112115385	21民生银行CD385	3,000,000	296,013,334.51	2.29
4	149735	21申证D4	2,000,000	202,965,479.46	1.57
5	012280021	22华侨城SCP001	2,000,000	202,696,418.33	1.57
6	012105517	21西安高新SCP002	1,500,000	152,446,194.47	1.18
7	012105387	21济南轨交SCP005	1,500,000	152,322,754.86	1.18
8	012280045	22济南轨交SCP001	1,500,000	152,025,390.15	1.18
9	012280050	22浦东开发SCP001	1,500,000	152,018,157.33	1.18
10	012280342	22西安高新SCP001	1,500,000	151,918,982.78	1.18

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0

报告期内偏离度的最高值	0.1215%
报告期内偏离度的最低值	-0.0036%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0516%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本集合计划本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本集合计划本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 集合计划投资前十名证券的发行主体中，民生银行股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、成都洛带华侨城置地发展有限公司在本期内曾受到监管部门的处罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.9.3 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	80,203.71
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	80,203.71

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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

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
191,014	67,672.87	463,756,091.43	3.59%	12,462,708,990.10	96.41%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	券商类机构	240,426,698.00	1.86%
2	个人	68,693,743.27	0.53%
3	个人	63,764,118.21	0.49%
4	其他机构	48,746,412.17	0.38%
5	个人	43,750,477.00	0.34%
6	个人	30,057,978.85	0.23%
7	个人	28,864,143.25	0.22%
8	个人	27,336,844.42	0.21%
9	个人	22,513,920.03	0.17%
10	其他机构	20,489,819.75	0.16%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	533.58	0.0000%
------------------	--------	---------

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。

8.4 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	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基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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

基金合同生效日(2021年12月06日)基金份额总额	7,893,401,114.50
本报告期期初基金份额总额	12,085,747,220.55
本报告期基金总申购份额	173,468,377,980.24
减：本报告期基金总赎回份额	172,627,660,119.26
本报告期期末基金份额总额	12,926,465,081.53

注：报告期内集合计划总申购份额含红利再投资份额，本集合计划未开通转入/转出业
务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本集合计划本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管
业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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，集合计划管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，集合计划托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	-	-	16,646.27	100.00%	-

注：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	215,601,843.14	100.00%	6,034,438,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本集合计划在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%（含）以上的情况。

10.9 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	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-10
3	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-09
4	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-09
5	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-11
6	安信资管天利宝货币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
7	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-11
8	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-09

§ 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

本报告期内，本集合计划没有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、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划资产管理合同；

- 2、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、安信资管天利宝货币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

深圳市福田区金田路4018号安联大厦A座27楼。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95517。

公司网址：www.axzqzg.com。

安信证券资产管理有限公司
二〇二二年八月三十一日