

# 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 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

报告送出日期:2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金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2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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

<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
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.....	41
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.....	42
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
7.10 投资组合报告附注.....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
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 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
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 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 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	安信瑞盈 3 个月滚动持有债券		
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	44,775,902.32 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	26,817,745.44 份	7,962,367.87 份	9,995,789.01 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%。

### 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	0755-81681554	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		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 21 楼、22 楼	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		深圳市福田区福田街道福安社	北京市西城区太平桥大街 25 号

	区福华一路 119 号安信金融大厦 21 楼	中国光大中心
邮政编码	518026	100033
法定代表人	李力	吴利军

## 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	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 119 号安信金融大厦 21 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；深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

## § 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（2024 年 01 月 01 日-2024 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	265,813.21	45,548.71	96,963.05
本期利润	295,627.52	41,058.00	101,165.34
加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0077	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.97%	0.71%	0.79%
本期基金份额净值增长率	0.97%	0.97%	0.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）		
期末可供分配利润	2,258,168.25	670,502.30	744,732.54
期末可供分配基金份额利润	0.0842	0.0842	0.0745
期末基金资产净值	29,075,913.69	8,632,870.17	10,740,521.55
期末基金份额净值	1.0842	1.0842	1.0745
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）		
基金份额累计净值增长率	8.42%	8.39%	7.42%

### 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 净值表现

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	-0.48%	0.14%	0.34%	0.01%	-0.82%	0.13%
过去三个月	0.48%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.61%	0.08%
过去六个月	0.97%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.16%	0.08%
过去一年	1.86%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.68%	0.07%
自基金合同生效起至今	8.42%	0.07%	9.78%	0.03%	-1.36%	0.04%

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B 净值表现

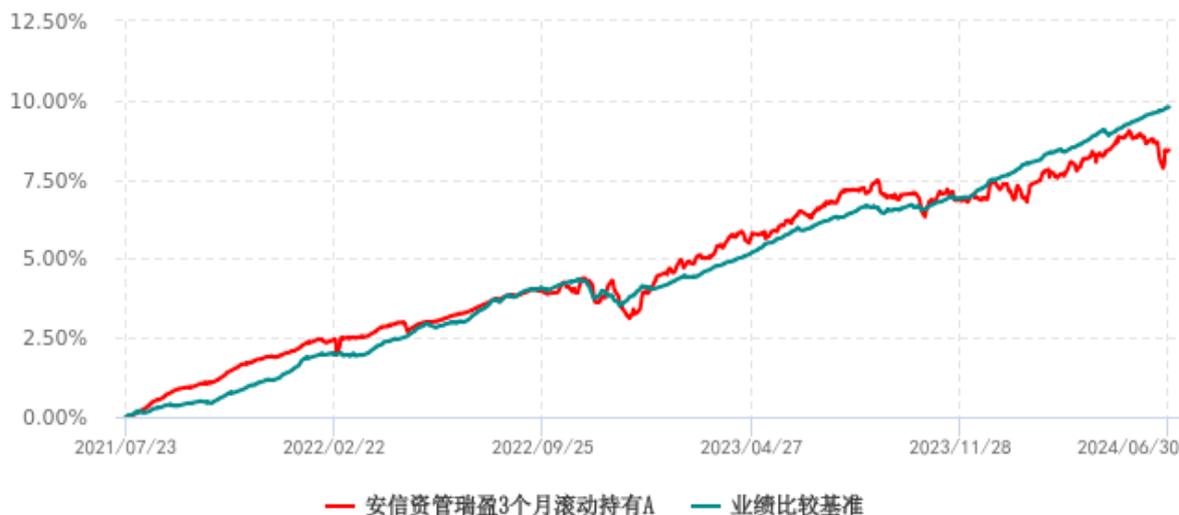
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.48%	0.14%	0.34%	0.01%	-0.82%	0.13%
过去三个月	0.48%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.61%	0.08%
过去六个月	0.97%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.16%	0.08%
过去一年	1.89%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.65%	0.07%
自基金合同生效起至今	8.39%	0.07%	9.72%	0.03%	-1.33%	0.04%

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C 净值表现

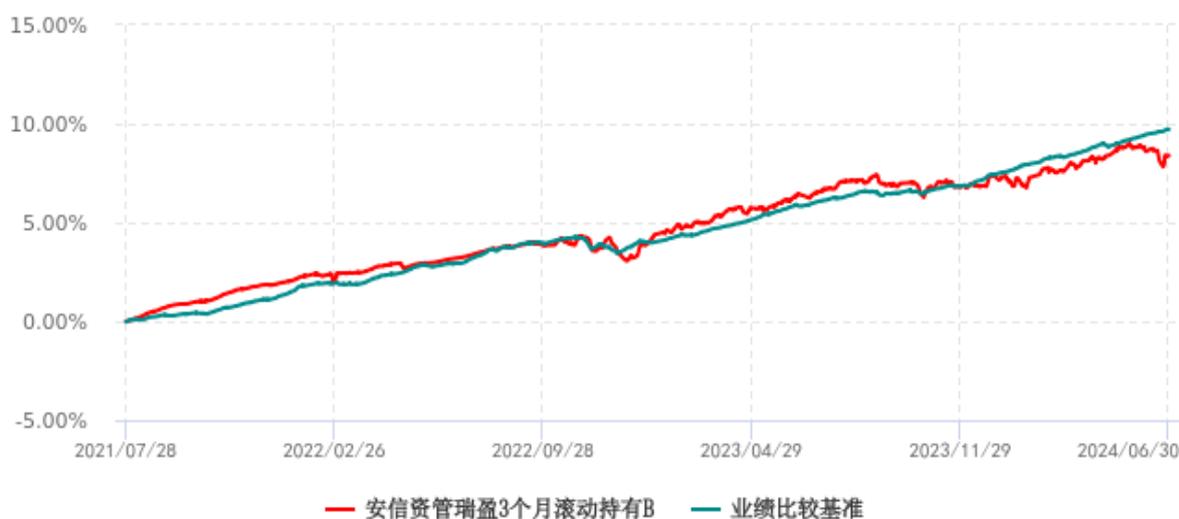
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.50%	0.14%	0.34%	0.01%	-0.84%	0.13%
过去三个月	0.41%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.68%	0.08%
过去六个月	0.82%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.31%	0.08%
过去一年	1.56%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.98%	0.07%
自基金合同生效起至今	7.42%	0.07%	9.72%	0.03%	-2.30%	0.04%

#### 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-2024年06月30日)

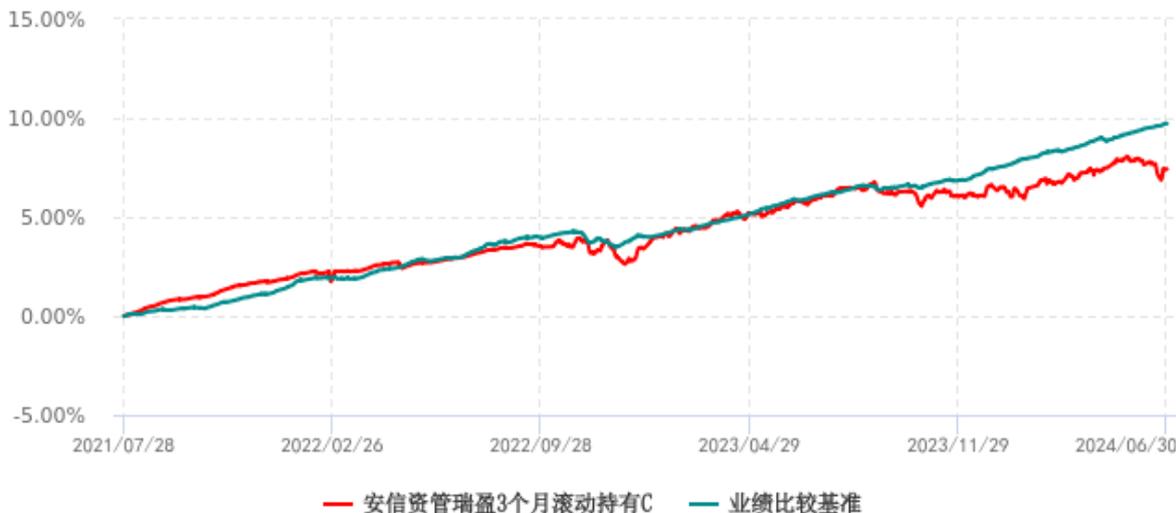


安信资管瑞盈3个月滚动持有B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月28日-2024年06月30日)



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-2024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福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼，业务范围为证券资产管理。

安信资管是国投证券股份有限公司（以下简称“国投证券”）的全资子公司，国投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。安信资管前身是国投证券资产管理部，是国内资产管理规模长期领先的券商资管之一。截至2024年6月30日，安信资管受托产品258只、管理市值合计1481.66亿元。其中公募资产管理规模131.20亿元。

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2024年6月30日，安信资管7只大集合产品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	证	说明
----	----	----------	---	----

		理（助理）期限		券从业年限	
		任职日期	离任日期		
王璇	基金经理	2022-09-08	-	3 年	男，伦敦大学女王学院金融学硕士，特许金融分析师，历任中国邮政储蓄银行信用卡研究员、中英益利资产管理有限公司投资经理助理，多年固收+产品管理经验，现任安信证券资产管理有限公司公募部投资经理。
冯思源	基金经理	2023-07-14	-	6 年	男，中山大学数学与应用数学学士，哥伦比亚大学统计学硕士，特许金融分析师，拥有多年投研工作经验。2017 年加入国投证券资产管理部，现任安信证券资产管理有限公司公募部投资经理，主要擅长可转债的投资研究。

## 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，未发生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

上半年，从全球范围来看，由于美国经济韧性仍在，叠加美股节节新高，因此美联储一再推迟降息，带动美元指数持续走高，并使得全球货币陆续贬值，其中以日元首当其冲。在此背景下，人民币汇率虽然承压，但贬值幅度并不明显，其原因在于国内虽然有出口、就业等多重压力，但决策层并未施行“大水漫灌”的财政政策，而是以“紧衣缩食”来应对内外部矛盾。

此时国内面对的矛盾主要是三重：人民币全球化与传统全球格局的矛盾、政策维持汇率稳定与对冲经济总量下行的矛盾、传统经济动能衰退与新经济孱弱的矛盾。在这三重矛盾之下，上半年政策仍然以稳健的结构性政策为主。

市场方面，整体来看，受国内资本市场信心不足影响，投资风险偏好持续压缩，在宽松的资金面、配置需求的驱动下持续走强，以 30 年国债为代表的资产持续成为投机交易的热土，债券利率保持下行趋势。转债在一季度保持了一定的抗跌属性，但伴随着“新国九条”的出台，小市值公司的退市风险加剧，弱资质转债的信用风险受到市场关注，在紧缩的市场环境下，低价转债受到冲击，大量转债跌破面值。

### 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 1.0842 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.13%；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 1.0842 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.13%；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 1.0745 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 2.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内面临的三重矛盾短期内仍然无法有效化解，因此短期内在维护汇率稳定的背景下，政策对冲经济下行的空间受限。结构方面，新经济体量相对于老经济仍然较小，但作为老经济代表的房地产放缓趋势难以改变，预计经济总量仍然修复困难。

债券市场方面，预计下半年收益率大概率将保持低位窄幅震荡。转债方面，“新国九条”的影响仍未消失，未来资金流困难的小型民营企业转债出险的频率将持续增加，短期内还需保持警惕。

账户操作方面，下半年仍将以防风险为主，转债均将控制在中等仓位以内，转债将尤其重视信用风险，并尽可能规避可能出现信用风险的转债。信用债方面，仍然以短久期、中性杠杆的防御性票息策略为主。

## 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“本基金”）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、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金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基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金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、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金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基金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基金管理人编制的《安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4509246.68	441930.73
结算备付金		60,137.36	540,905.79
存出保证金		1,312.70	3,250.48
交易性金融资产	6.4.7.2	39,435,205.79	58,467,131.57
其中：股票投资		-	0
基金投资		-	0
债券投资		39,435,205.79	58,467,131.57
资产支持证券投资		-	0
贵金属投资		-	0
其他投资		-	0
衍生金融资产	6.4.7.3	-	0
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	0
应收清算款		5,601,371.62	0
应收股利		-	0
应收申购款		100.00	0
递延所得税资产		-	0
其他资产	6.4.7.5	11,600.00	0
资产总计		49,618,974.15	59,453,218.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	0
交易性金融负债		-	0
衍生金融负债	6.4.7.3	-	0
卖出回购金融资产		-	8,356,174.82

款			
应付清算款		1,056,861.51	2,031.21
应付赎回款		2,111.04	3,074.86
应付管理人报酬		12,065.73	12,788.19
应付托管费		1,206.58	1,278.82
应付销售服务费		2,722.69	4,154.54
应付投资顾问费		-	0
应交税费		34,594.02	18,604.36
应付利润		-	0
递延所得税负债		-	0
其他负债	6.4.7.6	60,107.17	102,752.10
负债合计		1,169,668.74	8,500,858.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	44,775,902.32	47,559,962.84
未分配利润	6.4.7.8	3,673,403.09	3,392,396.83
净资产合计		48,449,305.41	50,952,359.67
负债和净资产总计		49,618,974.15	59,453,218.57

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 44,775,902.32 份。其中安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A 基金份额净值 1.0842 元，基金份额总额 26,817,745.44 份；安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B 基金份额净值 1.0842 元，基金份额总额 7,962,367.87 份；安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C 基金份额净值 1.0745 元，基金份额总额 9,995,789.01 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		725,335.79	3,834,605.13
1. 利息收入		9,122.98	11,265.27
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,572.59	10,747.51
债券利息收入		-	0
资产支持证券利息收入		-	0
买入返售金融资产收入		2,550.39	517.76
其他利息收入		-	0
2. 投资收益（损失以“-”填列）		686,686.92	2,447,944.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	0
基金投资收益	6.4.7.11	-	0
债券投资收益	6.4.7.12	686,686.92	2,376,536.30

资产支持证券投资收益		-	71,408.22
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	0
衍生工具收益	6.4.7.14	-	0
股利收益	6.4.7.15	-	0
其他投资收益		-	0
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	29,525.89	1,375,395.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	0
<b>减：二、营业总支出</b>		287,484.93	675,453.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	73,098.12	158,789.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,309.85	15,878.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,117.00	35,153.53
4. 投资顾问费		-	0
5. 利息支出		122,773.94	371,925.53
其中：卖出回购金融资产支出		122,773.94	371,925.53
6. 信用减值损失		-	0
7. 税金及附加		3,383.28	8,374.42
8. 其他费用	6.4.7.18	61,802.74	85,331.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		437,850.86	3,159,151.81
减：所得税费用		-	0
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		437,850.86	3,159,151.81
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		437,850.86	3,159,151.81

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	47,559,962.84	3,392,396.83	50,952,359.67
二、本期期初净资产	47,559,962.84	3,392,396.83	50,952,359.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,784,060.52	281,006.26	-2,503,054.26
（一）、综合收益总额	-	437,850.86	437,850.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,784,060.52	-156,844.60	-2,940,905.12

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	6,833,036.68	545,938.95	7,378,975.63
2. 基金赎回款	-9,617,097.20	-702,783.55	-10,319,880.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	44,775,902.32	3,673,403.09	48,449,305.41
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	105,145,606.22	3,346,921.34	108,492,527.56
二、本期期初净资产	105,145,606.22	3,346,921.34	108,492,527.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,908,116.74	1,934,379.97	-18,973,736.77
(一)、综合收益总额	-	3,159,151.81	3,159,151.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-20,908,116.74	-1,224,771.84	-22,132,888.58
其中：1. 基金申购款	15,328,682.21	740,477.51	16,069,159.72
2. 基金赎回款	-36,236,798.95	-1,965,249.35	-38,202,048.30
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	0	0	0
四、本期期末净资产	84,237,489.48	5,281,301.31	89,518,790.79

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。原计划设立时间为 2013 年 5 月 22 日，于 2013 年 5 月 29 日在中国证券业协会《关于安信证券安盈宝集合资产管理计划的备案报告》（安信报[2013]225 号）进行备案。原集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币 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国投证券股份有限公司（原名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。

2019 年 12 月，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，本计划原管理人国投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“国投证券股份有限公司”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 28 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，安信证券资产管理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

本集合计划财务报表以持续经营假设为基础，按照中国财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”），并参照了中国财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》、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》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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净资产（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采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本计划的业务特点和风险管理要求，本计划将所持有的金融资产在初始确认时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和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本计划管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本计划将持有的金融负债在初始确认时划分为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。本计划暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 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

本计划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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本计划对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本计划按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本计划按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本计划在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失

准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本计划在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本计划利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。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。若本计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本集合计划主要金融工具的估值方法如下：

(1) 在证券交易所市场流通的证券，按如下估值方式处理：①交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；②交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本资产管理合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。具体第三方估值机构由管理人与托管人共同确定；③交易所上市交易的可转换债券、可交换债券，以估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值（如为净价交易则以收盘价作为估值净价，下同）；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；⑤对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调

整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

(2) 首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。具体第三方估值机构由管理人与托管人共同确定。

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

(6) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(7) 当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

(8) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

(9) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于申购确认日及赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

#### 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；

（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

（1）托管费：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：

$T = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$ ，其中：

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。

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

$G = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ ，其中：

G 为每日应计提的集合计划管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

(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：

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

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。

#### 6.4.4.11 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；若投资者选择将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 B 类或 C 类份额，其运作期起始日与原持有集合计划份额相同）；

(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) 由于本集合计划各类份额的费用收取方式存在不同，各类别份额对应的可供分配收益将有所不同，管理人可对各类份额分别制定收益分配方案。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期内无外币交易。

#### 6.4.4.13 分部报告

本集合计划无分部报告。

#### 6.4.4.14 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

本集合计划本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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，对证券投资基金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。

##### (1) 增值税

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

##### (2) 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	4,509,246.68
等于：本金	4,507,694.48
加：应计利息	1,552.20
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	4509246.68

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 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	31,089,009.20	357,628.39	31,082,276.82	-364,360.77
	银行间市场	8,002,464.00	277,728.97	8,352,928.97	72,736.00
	合计	39,091,473.20	635,357.36	39,435,205.79	-291,624.77
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		39,091,473.20	635,357.36	39,435,205.79	-291,624.77

#### 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资产。

#### 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 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应收利息	11,600.00
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	11,600.00

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	8,539.49
其中：交易所市场	5,728.95
银行间市场	2,810.54
应付利息	-
预提费用	51,567.68
合计	60,107.17

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,204,846.44	29,204,846.44
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,387,101.00	-2,387,101.00
本期末	26,817,745.44	26,817,745.44

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,529,517.24	3,529,517.24
本期申购	5,091,839.83	5,091,839.83
本期赎回（以“-”号填列）	-658,989.20	-658,989.20
本期末	7,962,367.87	7,962,367.87

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,825,599.16	14,825,599.16
本期申购	1,741,196.85	1,741,196.85
本期赎回（以“-”号填列）	-6,571,007.00	-6,571,007.00
本期末	9,995,789.01	9,995,789.01

注：本年申购含红利再投、转换入份（金）额，本年赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A

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
上年度末	2,254,758.10	-98,569.23	2,156,188.8

			7
本期期初	2,254,758.10	-98,569.23	2,156,188.87
本期利润	265,813.21	29,814.31	295,627.52
本期基金份额交易产生的变动数	-200,536.88	6,888.74	-193,648.14
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-200,536.88	6,888.74	-193,648.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,320,034.43	-61,866.18	2,258,168.25

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B

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
上年度末	268,751.78	-8,236.04	260,515.74
本期期初	268,751.78	-8,236.04	260,515.74
本期利润	45,548.71	-4,490.71	41,058.00
本期基金份额交易产生的变动数	366,276.77	2,651.79	368,928.56
其中：基金申购款	418,951.10	-932.19	418,018.91
基金赎回款	-52,674.33	3,583.98	-49,090.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	680,577.26	-10,074.96	670,502.30

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C

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
上年度末	1,009,128.59	-33,436.37	975,692.22
本期期初	1,009,128.59	-33,436.37	975,692.22
本期利润	96,963.05	4,202.29	101,165.34
本期基金份额交易产生的变动数	-349,389.87	17,264.85	-332,125.02
其中：基金申购款	127,336.17	583.87	127,920.04
基金赎回款	-476,726.04	16,680.98	-460,045.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	756,701.77	-11,969.23	744,732.54

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	4,701.36
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	1,853.52

其他	17.71
合计	6,572.59

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内未进行基金投资。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	969,079.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-282,392.15
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	686,686.92

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	52,675,885.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,641,597.00
减：应计利息总额	1,305,073.76
减：交易费用	11,607.07
买卖债券差价收入	-282,392.15

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本集合计划未进行衍生工具投资。

#### 6.4.7.15 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,525.89
——股票投资	-
——债券投资	29,525.89
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	29,525.89

6.4.7.17 其他收入

本集合计划本报告期末无其他收入。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	2,486.12
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
TA 服务费	935.06
账户维护费-上清所	9,600.00
账户维护费-中债登	9,000.00
合计	61,802.74

6.4.7.19 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

关联方名称	与本基金的关系
国投证券股份有限公司	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	与计划管理人受同一股东控制

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国投证券	33,626,138.73	100.00%	47,877,548.54	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国投证券	235,960,000.00	100.00%	646,374,000.00	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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
国投证券	12,249.05	100.00%	5,728.95	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
国投证券	23,647.25	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	73,098.12	158,789.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	73,098.12	158,789.64

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,309.85	15,878.91

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
光大银行	-	-	1.82	1.82
国投证券	-	-	7,923.26	7,923.26
合计	-	-	7,925.08	7,925.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
光大银行	-	-	1.43	1.43
国投证券	-	-	17,817.07	17,817.07
合计	-	-	17,818.50	17,818.50

注：销售服务费用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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

##### 安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2023 年 01 月
----	----------------------	---------------------

	2024 年 06 月 30 日	01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 07 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,399,225.65	-
报告期内申购/买入总份额	5,082,617.13	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,481,842.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	81.41%	-

#### 6.4.10.5.2 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

安信盛世 FOF 六号资产管理计划为国投安信期货有限公司管理的产品。

#### 6.4.10.6 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	4,509,246.68	4,701.36	1,234,293.02	6,204.51

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内，本集合计划无承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内本集合计划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之外的基金

本报告期内本集合计划无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2024 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

截至本报告期末未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未持有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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截止本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本集合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。本集合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。

本集合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。本集合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。

本集合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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,032,282.05	20,651,534.21
合计	3,032,282.05	20,651,534.21

##### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	13,475,148.65	19,010,058.76

AAA 以下	9,671,763.46	10,678,880.67
未评级	13,256,011.63	8,126,657.93
合计	36,402,923.74	37,815,597.36

#### 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。

##### (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。本集合计划管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

##### (2) 现金流风险

现金流风险是指计划因现金流不足导致无法应对正常计划支付义务的风险。本集合计划管理人对计划每日和每周净退出比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本集合计划管理人建立了现金头寸控制机制，以确保退出款项的及时支付。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 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 2024 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							
货币资金	4,509,246 .68	-	-	-	-	-	4,509,246 .68
结算备付金	60,137.36	-	-	-	-	-	60,137.36
存出保证金	1,312.70	-	-	-	-	-	1,312.70
交易性金融资产	7,341,405 .35	-	6,385,671 .55	21,634,79 9.57	4,073,329 .32	-	39,435,20 5.79
应收清算款	-	-	-	-	-	5,601,371 .62	5,601,371 .62
应收申购款	-	-	-	-	-	100.00	100.00

其他资产	-	-	-	-	-	11,600.00	11,600.00
资产总计	11,912,102.09	-	6,385,671.55	21,634,799.57	4,073,329.32	5,613,071.62	49,618,974.15
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,056,861.51	1,056,861.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,111.04	2,111.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,065.73	12,065.73
应付托管费	-	-	-	-	-	1,206.58	1,206.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,722.69	2,722.69
应交税费	-	-	-	-	-	34,594.02	34,594.02
其他	-	-	-	-	-	60,107.17	60,107.17

他 负 债							
负 债 总 计	-	-	-	-	-	1,169,668 .74	1,169,668 .74
利 率 敏 感 度 缺 口	11,912,10 2.09	-	6,385,671 .55	21,634,79 9.57	4,073,329 .32	4,443,402 .88	48,449,30 5.41
上 年 度 末 202 3 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	441,930.7 3	0	0	0	0	-	441,930.7 3
结 算 备 付 金	540,905.7 9	-	-	-	-	0	540,905.7 9
存 出 保 证 金	3,250.48	-	-	-	-	0	3,250.48
交 易 性	1,427,228 .66	4,064,252 .46	31,622,35 4.73	21,353,29 5.72	0	0	58,467,13 1.57

金融资产							
资产总计	2,413,315.66	4,064,252.46	31,622,354.73	21,353,295.72	-	-	59,453,218.57
负债							
卖出回购金融资产款	8,356,174.82	0	0	0	0	-	8,356,174.82
应付清算款	-	-	-	-	-	2,031.21	2,031.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,074.86	3,074.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,788.19	12,788.19
应付托管费	-	-	-	-	-	1,278.82	1,278.82
应付销	-	-	-	-	-	4,154.54	4,154.54

售 服 务 费							
应 交 税 费	-	-	-	-	-	18,604.36	18,604.36
其 他 负 债	-	-	-	-	-	102,752.1 0	102,752.1 0
负 债 总 计	8,356,174 .82	-	-	-	-	144,684.0 8	8,500,858 .90
利 率 敏 感 度 缺 口	- 5,942,859 .16	4,064,252 .46	31,622,35 4.73	21,353,29 5.72	-	- 144,684.0 8	50,952,35 9.67

#### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	279,138.45	170,885.95
	利率上升 25 个基点	-275,024.41	-169,485.37

#### 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。本集合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。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	39,435,205.79	81.39	58,467,131.57	114.75
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	39,435,205.79	81.39	58,467,131.57	114.75

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	6,483,524.90	9,140,487.11
第二层次	32,951,680.89	49,326,644.46
第三层次	-	0
合计	39,435,205.79	58,467,131.57

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。

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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	39,435,205.79	79.48
	其中：债券	39,435,205.79	79.48
	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	4,569,384.04	9.21
8	其他各项资产	5,614,384.32	11.32
9	合计	49,618,974.15	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持有股票投资组合。

#### 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持有港股通投资股票投资组合。

### 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

截止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

截止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

截止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

截止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	12,146,634.66	25.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,452,117.26	25.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,352,928.97	17.24
7	可转债(可交换债)	6,483,524.90	13.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,435,205.79	81.39

### 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	019739	24 国债 08	50,000	5,041,023.29	10.40
2	149576	21 深投 03	40,000	4,227,626.85	8.73
3	102381678	23 豫航空港 MTN009A	40,000	4,211,269.95	8.69

4	188935	21 豫峡 02	40,000	4,204,940.27	8.68
5	102383369	23 即墨城投 MTN001	40,000	4,141,659.02	8.55

### 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

截止本报告期末未进行资产支持证券投资交易。

### 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

截止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

截止本报告期末未进行权证投资交易。

### 7.10 投资组合报告附注

#### 7.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

国城转债（代码：127019）为本集合计划前十大持仓证券。2023 年 9 月 25 日，根据中国证券监督管理委员会重庆监管局网站发布的《关于对国城矿业股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》，国城矿业涉嫌信息披露不准确，根据《上市公司信息披露管理办法》，中国证券监督管理委员会重庆监管局采取责令改正的行政监管措施，并计入证券期货市场诚信档案。

本集合计划投资国城转债投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除国城转债，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

#### 7.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

#### 7.10.3 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	1,312.70
2	应收清算款	5,601,371.62
3	应收股利	-
4	应收利息	11,600.00
5	应收申购款	100.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,614,384.32

#### 7.10.4 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	113636	甬金转债	1,021,722.07	2.11
2	127019	国城转债	914,652.55	1.89
3	110081	闻泰转债	594,610.85	1.23
4	128074	游族转债	575,755.82	1.19
5	127056	中特转债	546,698.42	1.13
6	127018	本钢转债	470,003.29	0.97
7	127026	超声转债	447,269.86	0.92
8	113627	太平转债	432,022.58	0.89
9	113643	风语转债	429,021.97	0.89
10	118038	金宏转债	334,577.55	0.69
11	128119	龙大转债	278,516.05	0.57
12	128109	楚江转债	221,654.30	0.46
13	128081	海亮转债	217,019.59	0.45

#### 7.10.5 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。

#### 7.10.6 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
安信资管瑞盈 3 个月	165	162,531.79	0.00	0%	26,817,745.44	100%

月滚动持有 A						
安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B	38	209,536.00	6,481,842.78	81%	1,480,525.09	19%
安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C	367	27,236.48	0.00	0%	9,995,789.01	100%
合计	570	78,554.21	6,481,842.78	14%	38,294,059.54	86%

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	97.62	0.0012%
	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C	29.68	0.0003%
	合计	127.30	0.0003%

注：占基金总份额比例为四舍五入后结果。

## 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

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	29,204,846.44	3,529,517.24	14,825,599.1

			6
本报告期基金总申购份额	-	5,091,839.83	1,741,196.85
减：本报告期基金总赎回份额	2,387,101.00	658,989.20	6,571,007.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,817,745.44	7,962,367.87	9,995,789.01

## § 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

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金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	
国投证券	2	-	-	12,249.05	100.00%	-

### 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
国投证券	33,626,138.73	100.00%	235,960,000.00	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	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网址	2024-01-22
2	安信证券资产管理有限公司关于更新旗下参照公募基金运作的集合资产管理计划产品风险等级划分结果的公告	中国证监会规定报刊及网址	2024-03-29
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 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网址	2024-03-29
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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网址	2024-04-22

## § 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；
- 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

深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 21 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  
二〇二四年八月三十日