

# 安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 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农业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2023年8月18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2023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遵规守信情况的说明	12
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遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	21
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
§9 开放式基金份额变动 .....	55
§10 重大事件揭示 .....	56
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
§12 备查文件目录 .....	58
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划		
基金简称	安信资管瑞元添利		
基金主代码	970029		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年05月06日		
基金管理人	安信证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	931,578,365.69份		
基金合同存续期	3年		
下属分级基金的基金简称	安信资管瑞元添利A	安信资管瑞元添利B	安信资管瑞元添利C
下属分级基金的交易代码	970029	970030	970031
报告期末下属分级基金的份额总额	54,557,235.53份	281,320,618.24份	595,700,511.92份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	集合计划在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的增值
投资策略	本集合计划通过对宏观经济周期、行业前景分析和发债主体研究的综合运用，主要采用类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*90%+一年期定期存款利率*10%。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于货币市场基金和货币型集合计划。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李力	秦一楠
	联系电话	0755-81681554	010-66060069
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95517	95599
传真		0755-88258219	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518026	100031
法定代表人		李力	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 (2023年01月01日-2023年06月30日)		
	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C
本期已实现收益	556,931.65	3,802,016.95	6,868,149.81
本期利润	2,004,444.20	13,132,191.53	29,850,227.34
加权平均基金份额本期利润	0.0351	0.0357	0.0373
本期加权平均净值利润率	3.22%	3.28%	3.45%
本期基金份额净值增长率	3.22%	3.23%	3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)		
期末可供分配利润	3,824,567.78	23,036,057.22	44,639,471.56
期末可供分配基金份额利润	0.0701	0.0819	0.0749
期末基金资产净值	60,046,254.98	309,552,990.03	651,330,893.54
期末基金份额净值	1.1006	1.1004	1.0934
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	8.72%	8.69%	8.00%

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

瑞元添利A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	0.10%	0.39%	0.04%	-0.24%	0.06%
过去三个月	0.62%	0.10%	1.54%	0.03%	-0.92%	0.07%
过去六个月	3.22%	0.10%	2.45%	0.03%	0.77%	0.07%
过去一年	1.51%	0.11%	3.86%	0.05%	-2.35%	0.06%
自基金合同 生效起至今	8.72%	0.09%	9.15%	0.05%	-0.43%	0.04%

瑞元添利B

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.10%	0.39%	0.04%	-0.23%	0.06%
过去三个月	0.62%	0.10%	1.54%	0.03%	-0.92%	0.07%
过去六个月	3.23%	0.10%	2.45%	0.03%	0.78%	0.07%
过去一年	1.51%	0.11%	3.86%	0.05%	-2.35%	0.06%
自基金合同 生效起至今	8.69%	0.09%	9.11%	0.05%	-0.42%	0.04%

瑞元添利C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.14%	0.10%	0.39%	0.04%	-0.25%	0.06%
过去三个月	0.54%	0.10%	1.54%	0.03%	-1.00%	0.07%
过去六个月	3.07%	0.10%	2.45%	0.03%	0.62%	0.07%
过去一年	1.21%	0.11%	3.86%	0.05%	-2.65%	0.06%
自基金合同 生效起至今	8.00%	0.09%	9.11%	0.05%	-1.11%	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

安信资管瑞元添利A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年05月06日-2023年06月30日)



安信资管瑞元添利B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年05月07日-2023年06月30日)



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

安信资管瑞元添利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月07日-2023年06月30日)



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

## §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2023年6月30日，安信资管受托产品206只，管理市值合计1532.58亿元。合计管理运作107只集合计划，受托管理市值为461.62亿元；合计管理运作98只单一计划，受托管理市值为1068.56亿元。

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，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	-	11	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。
冯思源	基金经理	2023-02-17	-	6	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年加入安信证券资产管理部，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。

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；(2)非首任基金经理，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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及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，国内经济虽然走出了疫情影响，但复苏的进程有所波折，总体不及年初市场的预期。具体来看，上半年PMI指数先上后下，工业增速相对平稳，固定资产投资增速逐月下滑；基建和制造业相对较强，地产投资恢复有限，竣工端相对表现较好。外需波动较大，总体有所走弱；消费持续复苏，结构有所分化。通胀总体走低，CPI、PPI均呈现震荡下行态势。货币政策上，一季度央行降准25基点，6月份OMO、SLF和MLF均下调10基点，并引导1年期、5年期LPR于6月下旬分别下调10个基点。海外方面，欧美国家的通胀于高位有所回落，但依然偏高。美国方面，一季度硅谷银行遭遇危机，美债收益率一度小幅下行；美联储3月、5月分别加息25bp；欧洲方面，欧央行3月加息50bp，5月、6月分别加息25bp。美元指数、美债今年上半年总体震荡为主。

上半年债市表现强于股市。债市方面，中债总全价指数上涨0.87%，信用债总全价指数上涨1.45%，信用债强于利率债。权益市场先涨后跌，宽幅震荡，沪深300指数下跌0.75%，上证指数上涨3.65%。春节前市场对经济全面复苏预期较强，但随后经济表现弱于预期，核心资产、蓝筹标的普遍震荡下跌，人工智能、央国企概念交替走强。可转债

市场二季度振幅较小，尽管权益表现一般，但估值和流动性的支撑明显，中证转债指数上半年依然录得3.37%的涨幅。

账户操作方面，上半纯债端继续维持中短久期运作，持仓主体以中高信用等级信用债为主，纯债仓位总体久期与评级分布保持稳定。转债端，组合继续以大市值和高等级转债为底仓，对涨幅较大的、估值偏高的标的总体进行了止盈；二季度组合的转债仓位总体小幅下降，我们主要减仓了性价比偏低、估值溢价过高的转债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末瑞元添利A基金份额净值为1.1006元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.22%，同期业绩比较基准收益率为2.45%；截至报告期末瑞元添利B基金份额净值为1.1004元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.23%，同期业绩比较基准收益率为2.45%；截至报告期末瑞元添利C基金份额净值为1.0934元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.07%，同期业绩比较基准收益率为2.45%。

#### 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，预计宏观经济复苏力度有望改善，核心是关注政策支持力度和具体的落地。政治局会议指出，当前经济运行面临新的困难挑战，主要是国内需求不足；同时也强调，加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险；要活跃资本市场，提振投资者信心。我们认为下半年或有稳增长的政策不断落地和出台，经济复苏进程有可能略有加快。结构上，预计基建和制造业投资将保持相对韧性，地产的投资、销售的改善需要关注政策的变动。消费预计仍将保持复苏，结构分化，预计必选消费强于可选消费。出口上尽管短期有所下滑，但下半年预计外需不弱，出口仍将维持一定韧性。2023年预计国内通胀大体上将保持较偏低增长，若下半年后续经济修复较快，通胀或有可能略有回升。

债券市场方面，预计下半年收益率大概率将保持窄幅震荡；目前债市收益率已经处于低位，进一步下行空间有限；或在政府债券发行加速、稳增长力度出台超预期等情况下，收益率中枢有一定的上行。我们将继续保持高等级信用债和国债为主的持仓，控制信用风险。

权益市场近期情绪有所改善，核心资产、优质蓝筹有一定反弹，但估值水平依然不高。上半年由于经济的复苏偏缓，大部分行业景气度不佳，市场的风格较为极致，TMT尤其是AI相关的行业跑赢，央国企板块也表现较强。可转债估值整体估值偏高，但估值分化明显，因此结构性机会反而更为广泛，偏股型转债性价比更优。我们仍将优选个券，在期权估值、个股估值与景气和组合波动几个角度进行平衡，争取最大化组合的风险收益比，通过转债增厚收益，为持有人带来更好的体验。

#### 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

在托管本集合计划的过程中，本集合计划托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及集合计划合同、托管协议的约定，对本集合计划管理人-安信证券资产管理有限公司2023年1月1日至2023年6月30日集合计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，安信证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，集合计划管理人所编制和披露的本集合计划年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害集合计划持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,973,562.61	54,753,793.37
结算备付金		13,031,845.82	9,657,385.29
存出保证金		313,233.57	320,278.46
交易性金融资产	6.4.7.2	1,310,808,606.12	1,864,874,092.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,310,808,606.12	1,864,874,092.75
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	-	-
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		4,684,310.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,146.30	17,376.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,334,813,705.09	1,929,622,926.35
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		309,130,494.57	165,437,108.42
应付清算款		64,232.78	45,225,783.18
应付赎回款		3,146,482.61	7,204,806.68
应付管理人报酬		358,246.25	637,170.40
应付托管费		89,561.58	159,292.62
应付销售服务费		169,963.75	347,437.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		823,741.22	1,414,453.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,843.78	170,050.00
负债合计		313,883,566.54	220,596,101.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	931,578,365.69	1,608,768,105.26
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	89,351,772.86	100,258,719.15



净资产合计		1,020,930,138.55	1,709,026,824.41
负债和净资产总计		1,334,813,705.09	1,929,622,926.35

注：本集合计划报告日账面已计提的业绩报酬未能充分反映实际应计提的业绩报酬金额。截止2023年6月30日，该集合计划在暂估业绩报酬前的计划份额净值1.0959元，集合计划份额总额931,578,365.69份，暂估业绩报酬前的基金资产净值1,020,929,317.79元。暂估业绩报酬金额820.76元，暂估业绩报酬后的基金资产净值1,020,930,138.55元。

## 6.2 利润表

会计主体：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		53,465,754.65	41,833,335.69
1.利息收入		159,282.05	117,625.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	159,282.05	87,158.61
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		-	30,466.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,546,707.94	34,644,978.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	19,546,707.94	33,534,103.48
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	1,110,874.55
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
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)	6.4.7.17	33,759,764.66	7,070,732.27
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		8,478,891.58	7,673,333.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,651,347.51	3,496,615.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	662,836.89	874,153.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,299,864.38	1,879,394.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,656,416.09	1,189,669.89
其中：卖出回购金融资产 支出		3,656,416.09	1,189,669.89
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		88,438.08	115,485.82
8. 其他费用	6.4.7.20	119,988.63	118,014.30
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		44,986,863.07	34,160,002.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		44,986,863.07	34,160,002.21
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		44,986,863.07	34,160,002.21

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	1,608,768,105.26	-	100,258,719.15	1,709,026,824.41
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）	1,608,768,105.26	-	100,258,719.15	1,709,026,824.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-677,189,739.57	-	-10,906,946.29	-688,096,685.86
（一）、综合收益总额	-	-	44,986,863.07	44,986,863.07
（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）	-677,189,739.57	-	-55,893,809.36	-733,083,548.93
其中：1.基金申购款	19,463,264.79	-	1,740,612.74	21,203,877.53
2.基金	-696,653,004.36	-	-57,634,422.10	-754,287,426.46

赎回款				
(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)	931,578,365.69	-	89,351,772.86	1,020,930,138.55
项目	上年度可比期间 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)	1,062,595,210.50	-	64,285,034.11	1,126,880,244.61
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)	1,062,595,210.50	-	64,285,034.11	1,126,880,244.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	746,153,308.53	-	82,654,825.73	828,808,134.26
(一)、综合收益总额	-	-	34,160,002.21	34,160,002.21

（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）	746,153,308.53	-	48,494,823.52	794,648,132.05
其中：1.基金申购款	855,718,571.23	-	56,533,268.46	912,251,839.69
2.基金赎回款	-109,565,262.70	-	-8,038,444.94	-117,603,707.64
（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）	1,808,748,519.03	-	146,939,859.84	1,955,688,378.87

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

安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称本集合计划或本计划）由安信理财1号债券型集合资产管理计划（以下简称原集合计划）变更而来。原集合计划设立时间为2009年5月22日。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1,781,416,252.58元，折合认购份额1,781,416,252.58份；认购资金产生的利息金

额为人民币1,253,488.47元，折合集合计划份额1,253,488.47份。以上实收资金共计人民币1,782,669,741.05元，折合1,782,669,741.05份集合计划份额。上述出资业经中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具了中审亚太验字[2009]第010330号验资报告。原集合计划的管理人为安信证券股份有限公司，托管人为中国农业银行股份有限公司。

经中国证券监督管理委员会《关于核准安信证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2019]2630号）核准，本计划原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《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和《安信资管安财富非对称指数增强1号集合资产管理计划资产管理合同》“第25部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定，经与托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，管理人安信证券资产管理有限公司于2021年5月6日将产品名称修改为“安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称本集合计划或本计划）”。

中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）根据于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，已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自2021年5月6日起，《安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《安信理财1号债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划为大集合产品，系管理人依据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，存续期不超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。安信证券资产管理有限公司是本集合计划的管理人，中国农业银行股份有限公司是本计划的托管人，安信证券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

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 2023年6月30日的财务状况以及2023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

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2023年1月1日至2023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) 金融资产分类

根据本集合计划的业务特点和风险管理要求，本集合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，且本集合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，则本集合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) 金融负债分类

本集合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。本集合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

本集合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。

本集合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，本集合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，本集合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，本集合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。

本集合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，本集合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。

本集合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。若本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，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。本基金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原则如下：

(1)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反应公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

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

$T = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ ，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

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销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(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0.40%年费率计提，计算方法如下：

$G = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ ，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

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销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### (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0.30%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划

财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### (4)管理人的业绩报酬

##### 1)管理人提取业绩报酬的原则

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

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

C.在投资者赎回或集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；

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

##### 2)业绩报酬计提方法

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

具体计算方法如下：

持有期年化收益率 $R \leq 5\%$  计提比例为0 业绩报酬（H）计算方法 $H=0$

持有期年化收益率 $R > 5\%$  计提比例为15% 业绩报酬（H）计算方法 $H = (R - 5\%) \times 15\% \times K \times 365$

注：

H为应提取的业绩报酬

R为持有期年收益率

K=参与业绩报酬计提的份额数×上一业绩报酬计提日集合计划份额净值。

##### 3)业绩报酬的支付

业绩报酬由管理人负责计算，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### (7)其他费用：

1)因集合计划资金划付支付给银行的划拨费用；

2)集合计划存续期间和清算期间发生的会计师费、律师费、信息披露费、询证费、电子合同服务等；

3)与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等，除法律法规另行规定外，管理人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴；

4)资产管理计划合同约定、法律法规规定可以在集合计划资产中列支的其它费用。

以上费用由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由管理人向托管人发送划付指令，通知托管人从集合计划资产中支付。

#### **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；

(3)集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)由于本集合计划 A 类、B 类和 C 类计划份额的销售费用收取方式存在不同，各类别计划份额对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **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**

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### **6.4.5.2 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**

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	5,973,562.61
等于：本金	5,972,895.12
加：应计利息	667.49
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	5,973,562.61

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	417,661,947.41	4,057,363.99	403,769,792.94	-17,949,518.46
	银行间市场	879,902,890.00	19,554,913.18	907,038,813.18	7,581,010.00
	合计	1,297,564,837.41	23,612,277.17	1,310,808,606.12	-10,368,508.46
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,297,564,837.41	23,612,277.17	1,310,808,606.12	-10,368,508.46	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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 2023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	12,200.62
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,200.62
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	100,843.78

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 瑞元添利A

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,724,786.69	60,724,786.69
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,167,551.16	-6,167,551.16
本期末	54,557,235.53	54,557,235.53

##### 6.4.7.7.2 瑞元添利B

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利B)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	396,933,414.48	396,933,414.48
本期申购	10,447,325.44	10,447,325.44
本期赎回（以“-”号填列）	-126,060,121.68	-126,060,121.68



本期末	281,320,618.24	281,320,618.24
-----	----------------	----------------

### 6.4.7.7.3 瑞元添利C

金额单位：人民币元

项目 (瑞元添利C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,151,109,904.09	1,151,109,904.09
本期申购	9,015,939.35	9,015,939.35
本期赎回（以“-”号填列）	-564,425,331.52	-564,425,331.52
本期末	595,700,511.92	595,700,511.92

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 瑞元添利A

单位：人民币元

项目 (瑞元添利A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,671,527.32	352,995.55	4,024,522.87
本期利润	556,931.65	1,447,512.55	2,004,444.20
本期基金份额交易产生的变动数	-403,891.19	-136,056.43	-539,947.62
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-403,891.19	-136,056.43	-539,947.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,824,567.78	1,664,451.67	5,489,019.45

#### 6.4.7.8.2 瑞元添利B

单位：人民币元

项目 (瑞元添利B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	28,675,665.96	-2,468,579.42	26,207,086.54
本期利润	3,802,016.95	9,330,174.58	13,132,191.53

本期基金份额交易产生的变动数	-9,441,625.69	-1,665,280.59	-11,106,906.28
其中：基金申购款	816,521.28	155,658.30	972,179.58
基金赎回款	-10,258,146.97	-1,820,938.89	-12,079,085.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,036,057.22	5,196,314.57	28,232,371.79

#### 6.4.7.8.3 瑞元添利C

单位：人民币元

项目 (瑞元添利C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	77,062,632.12	-7,035,522.38	70,027,109.74
本期利润	6,868,149.81	22,982,077.53	29,850,227.34
本期基金份额交易产生的变动数	-39,291,310.37	-4,955,645.09	-44,246,955.46
其中：基金申购款	651,445.61	116,987.55	768,433.16
基金赎回款	-39,942,755.98	-5,072,632.64	-45,015,388.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,639,471.56	10,990,910.06	55,630,381.62

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	38,133.00
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	118,608.24
其他	2,540.81
合计	159,282.05

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划在本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划在本报告期内无基金投资收益。

#### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	26,222,205.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,675,497.19
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	19,546,707.94

##### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	768,585,084.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	760,837,655.02
减：应计利息总额	14,411,845.85
减：交易费用	11,081.07
买卖债券差价收入	-6,675,497.19

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划在本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划在本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划在本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本集合计划在本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	33,759,764.66
——股票投资	-
——债券投资	33,759,764.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	33,759,764.66

#### 6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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	20,074.94
信息披露费	59,507.37
审计费用	19,835.79
TA服务月费	1,970.53
账户维护费_中债登	9,000.00
账户维护费_上清所	9,600.00
合计	119,988.63

#### 6.4.7.21 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
安信证券资产管理有限公司	计划管理人
中国农业银行股份有限公司	计划托管人
国投安信期货有限公司	与计划管理人同一股东

#### 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

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间均没有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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
安信证券	345,454,898.03	100.00%	488,935,495.35	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券回购成交总额的

				比例
安信证券	16,170,054,000.00	100.00%	14,673,800,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间均没有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

本报告期内通过关联方交易单元发生的债券交易的佣金费率为0，无需支付关联方佣金。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 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	2,651,347.51	3,496,615.05
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。本集合计划的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：每日应计提的集合计划管理费=前一日该类份额对应的集合计划资产净值×该类份额年管理费率÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 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	662,836.89	874,153.79

注：集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.10%年费率计提，计算方

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

### 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 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			
	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C	合计
农业银行	0.00	0.00	1,201.43	1,201.43
安信证券	0.00	0.00	157,962.32	157,962.32
安信资管	0.00	0.00	153.16	153.16
合计	0.00	0.00	159,316.91	159,316.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C	合计
农业银行	0.00	0.00	452.95	452.95
安信证券	0.00	0.00	70,971.40	70,971.40
安信资管	0.00	0.00	101.05	101.05
合计	0.00	0.00	71,525.40	71,525.40

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类、B类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.3%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：C类份额每日应计提的销售服务费=C类份额前一日集合计划资产净值×年销售服务费率÷当年天数。集合计划销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。

### 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

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间均没有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

本集合计划在本报告期内及上年度可比期间均没有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

报告期内本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

##### 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

份额单位：份

瑞元添利B

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	28,039,550.95	9.97%	28,039,550.95	7.06%

注：国投安信期货有限公司与管理人为同一股东，属于关联方，“安信盛世FOF六号集合资产管理计划”是国投安信期货有限公司管理的产品，故“安信盛世FOF六号集合资产管理计划”参与本集合计划属于关联方资管资金参与。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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

中国农业 银行股份 有限公司	5,973,562.61	38,133.00	1,977,474.38	17,824.59
----------------------	--------------	-----------	--------------	-----------

#### 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（2023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2023年6月30日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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012283988	22鲁钢铁SCP009	2023-07-04	102.11	200,000	20,421,150.68
042280411	22港兴港投CP003	2023-07-07	101.94	240,000	24,466,027.40
102100442	21华发集团MTN004	2023-07-04	101.88	100,000	10,187,877.05
102101257	21平安租赁MTN004	2023-07-04	103.71	100,000	10,370,769.86
102101552	21渝惠通MTN002	2023-07-13	104.97	100,000	10,497,287.67
102101951	21晋能煤业MTN001	2023-07-04	104.69	200,000	20,937,150.68
102280125	22华发集团MTN001	2023-07-04	103.01	69,000	7,107,731.59

102280203	22滁州同创MTN001	2023-07-06	103.06	106,000	10,924,409.37
102280375	22涪陵新城MTN001	2023-07-07	103.72	300,000	31,115,457.53
102280413	22南部新城MTN001	2023-07-13	101.75	185,000	18,824,326.23
102281709	22晋能煤业MTN018 (科创票据)	2023-07-04	103.65	300,000	31,094,301.37
102281737	22绵阳投资MTN001	2023-07-07	102.24	159,000	16,256,791.64
合计				2,059,000	212,203,281.07

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日，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120,000,000.00元，于2023年7月3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。

#### 6.4.12.4 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	50,403,013.70
A-1以下	-	-
未评级	121,159,841.50	204,099,008.95
合计	121,159,841.50	254,502,022.65

注：未评级债券为利率债、短期融资券、超短期融资券。

**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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	441,911,428.11	604,594,842.33
AAA以下	500,907,075.08	672,895,143.39
未评级	246,830,261.43	332,882,084.38
合计	1,189,648,764.62	1,610,372,070.10

注：未评级债券为利率债、公司债、超短期融资券。

**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。本集合计划持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产及金融负债不计息。本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率风险敞口进行监控，以对该风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,973,562.61	-	-	-	5,973,562.61
结算备付金	13,031,845.82	-	-	-	13,031,845.82
存出保证金	313,233.57	-	-	-	313,233.57

安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告

交易性金融资产	315,718,160.38	986,122,373.21	8,968,072.53	-	1,310,808,606.12
应收清算款	-	-	-	4,684,310.67	4,684,310.67
应收申购款	-	-	-	2,146.30	2,146.30
资产总计	335,036,802.38	986,122,373.21	8,968,072.53	4,686,456.97	1,334,813,705.09
负债					
卖出回购金融资产款	309,130,494.57	-	-	-	309,130,494.57
应付清算款	-	-	-	64,232.78	64,232.78
应付赎回款	-	-	-	3,146,482.61	3,146,482.61
应付管理人报酬	-	-	-	358,246.25	358,246.25
应付托管费	-	-	-	89,561.58	89,561.58
应付销售服务费	-	-	-	169,963.75	169,963.75
应交税费	-	-	-	823,741.22	823,741.22
其他负债	-	-	-	100,843.78	100,843.78
负债总计	309,130,494.57	-	-	4,753,071.97	313,883,566.54
利率敏感度缺口	25,906,307.81	986,122,373.21	8,968,072.53	-66,615.00	1,020,930,138.55
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,753,793.37	-	-	-	54,753,793.37
结算备付金	9,657,385.29	-	-	-	9,657,385.29
存出保	320,278.46	-	-	-	320,278.46

证金					
交易性金融资产	434,604,015.25	1,334,096,146.01	96,173,931.49	-	1,864,874,092.75
应收申购款	-	-	-	17,376.48	17,376.48
资产总计	499,335,472.37	1,334,096,146.01	96,173,931.49	17,376.48	1,929,622,926.35
负债					
卖出回购金融资产款	165,437,108.42	-	-	-	165,437,108.42
应付清算款	-	-	-	45,225,783.18	45,225,783.18
应付赎回款	-	-	-	7,204,806.68	7,204,806.68
应付管理人报酬	-	-	-	637,170.40	637,170.40
应付托管费	-	-	-	159,292.62	159,292.62
应付销售服务费	-	-	-	347,437.13	347,437.13
应交税费	-	-	-	1,414,453.51	1,414,453.51
其他负债	-	-	-	170,050.00	170,050.00
负债总计	165,437,108.42	-	-	55,158,993.52	220,596,101.94
利率敏感度缺口	333,898,363.95	1,334,096,146.01	96,173,931.49	-55,141,617.04	1,709,026,824.41

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	利率下降25个基点	5,887,464.66	9,528,313.84
	利率上升25个基点	-5,834,066.01	-9,436,163.81

#### 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 2023年06月30日		上年度末 2022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	1,310,808,606.12	128.39	1,864,874,092.75	109.12
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,310,808,606.12	128.39	1,864,874,092.75	109.12

##### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	252,905,745.21	385,519,793.93
第二层次	1,057,902,860.91	1,479,354,298.82
第三层次	-	-
合计	1,310,808,606.12	1,864,874,092.75

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

### 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

除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## §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	1,310,808,606.12	98.20
	其中：债券	1,310,808,606.12	98.20
	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	19,005,408.43	1.42
8	其他各项资产	4,999,690.54	0.37
9	合计	1,334,813,705.09	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境内股票投资组合。

#### 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	59,802,523.84	5.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	91,061,523.89	8.92
5	企业短期融资券	64,939,481.36	6.36
6	中期票据	842,099,331.82	82.48
7	可转债(可交换债)	252,905,745.21	24.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,310,808,606.12	128.39

#### 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	102103316	21珠海港MTN006	300,000	31,486,931.51	3.08
2	102280163	22渝兴永MTN001	300,000	31,127,178.08	3.05
3	102280375	22涪陵新城MTN001	300,000	31,115,457.53	3.05
4	102281709	22晋能煤业MTN018 (科创票据)	300,000	31,094,301.37	3.05

5	102280203	22滁州同创MTN001	300,000	30,918,139.73	3.03
---	-----------	--------------	---------	---------------	------

**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 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 21山证C3（代码：149754）**为本集合计划前十大持仓证券。2022年6月16日，山西证券控股子公司中德证券收到中国证监会《行政处罚决定书》（【2022】30号），责令改正，给予警告并处以罚款。

**21申证D3（代码：149681）**为本集合计划前十大持仓证券。2022年4月24日，上海证监局决定对申万宏源证券采取监督管理措施。

本集合计划投资**21山证C3、21申证D3**投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除**21山证C3、21申证D3**外，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。

**7.12.2** 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	313,233.57

2	应收清算款	4,684,310.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,146.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,999,690.54

#### 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	110081	闻泰转债	19,764,188.85	1.94
2	113060	浙22转债	18,989,562.93	1.86
3	113052	兴业转债	18,853,952.23	1.85
4	113616	韦尔转债	18,705,497.61	1.83
5	113641	华友转债	14,820,184.04	1.45
6	113623	凤21转债	14,290,862.30	1.40
7	113050	南银转债	12,418,311.35	1.22
8	113057	中银转债	12,253,834.54	1.20
9	113024	核建转债	12,131,277.22	1.19
10	128136	立讯转债	11,599,667.08	1.14
11	113053	隆22转债	11,209,377.07	1.10
12	113049	长汽转债	9,773,746.07	0.96
13	110082	宏发转债	8,921,177.52	0.87
14	113047	旗滨转债	6,636,597.89	0.65
15	127056	中特转债	6,369,564.75	0.62
16	123107	温氏转债	6,305,096.62	0.62
17	127044	蒙娜转债	6,278,121.60	0.61
18	127073	天赐转债	5,308,108.75	0.52

19	127022	恒逸转债	5,057,898.80	0.50
20	113655	欧22转债	4,726,497.08	0.46
21	111010	立昂转债	4,241,575.45	0.42
22	127030	盛虹转债	3,798,000.82	0.37
23	123146	中环转2	3,084,327.82	0.30
24	127036	三花转债	2,720,805.99	0.27
25	127024	盈峰转债	2,665,970.89	0.26
26	123108	乐普转2	2,242,904.93	0.22
27	113505	杭电转债	1,834,921.44	0.18
28	127061	美锦转债	1,481,364.85	0.15
29	127032	苏行转债	1,190,001.78	0.12
30	110076	华海转债	1,102,232.74	0.11
31	113059	福莱转债	1,079,275.81	0.11
32	113602	景20转债	1,016,208.44	0.10
33	127025	冀东转债	930,331.15	0.09
34	113033	利群转债	703,628.05	0.07
35	127047	帝欧转债	400,670.75	0.04

### 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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

安信资管瑞元添利A	469	116,326.73	0.00	0.00%	54,557,235.53	100.00%
安信资管瑞元添利B	12,796	21,985.04	83,229,259.06	29.59%	198,091,359.18	70.41%
安信资管瑞元添利C	8,909	66,865.03	0.00	0.00%	595,700,511.92	100.00%
合计	22,174	42,012.19	83,229,259.06	8.93%	848,349,106.63	91.07%

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	安信资管瑞元添利A	170,985.61	0.3134%
	安信资管瑞元添利B	149,340.17	0.0531%
	安信资管瑞元添利C	872.26	0.0001%
	合计	321,198.04	0.0345%

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

	瑞元添利A	瑞元添利B	瑞元添利C
基金合同生效日(2021年05月06日)基金份额总额	122,089,280.44	-	-
本报告期期初基金份额总额	60,724,786.69	396,933,414.48	1,151,109,904.09
本报告期基金总申购份额	-	10,447,325.44	9,015,939.35
减：本报告期基金总赎回份额	6,167,551.16	126,060,121.68	564,425,331.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,557,235.53	281,320,618.24	595,700,511.92

## §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，本集合计划管理人于2023年3月7日增聘首席信息官。

本报告期内，本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

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，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。

### 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，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	-	-	-	-	-

注：本集合计划未租用证券公司交易单元进行的债券投资交易佣金费率为0，无需支付交易佣金。

### 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	345,454,898.03	100.00%	16,170,054,000.00	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	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20
2	安信证券资产管理有限公司关于调整旗下部分集合计划单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-03

3	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-17
4	安信证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-07
5	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	中国证监会指定网站	2023-03-29
6	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-31
7	安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21

## §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、安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 2、安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、安信资管瑞元添利一年持有期债券型集合资产管理计划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](http://www.axzqzg.com)。

安信证券资产管理有限公司

二〇二三年八月三十一日