

安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

|             |                                                                                                              |                   |                   |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金简称        | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券                                                                                              |                   |                   |
| 基金主代码       | 970090                                                                                                       |                   |                   |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                       |                   |                   |
| 基金合同生效日     | 2022 年 02 月 28 日                                                                                             |                   |                   |
| 报告期末基金份额总额  | 52,899,622.98 份                                                                                              |                   |                   |
| 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        | 本集合计划的投资策略包括资产配置策略、固定收益投资策略和股票投资策略。其中固定收益投资策略包括久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、利率债投资策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略。 |                   |                   |
| 业绩比较基准      | 中债综合财富（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×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。                                      |                   |                   |
| 基金管理人       | 安信证券资产管理有限公司                                                                                                 |                   |                   |
| 基金托管人       | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                 |                   |                   |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 A                                                                                            | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 B | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 C |
| 下属分级基金的交易   | 970090                                                                                                       | 970091            | 970092            |

|                 |                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 代码              |                 |                 |                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 31,507,513.73 份 | 18,720,144.46 份 | 2,671,964.79 份 |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《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》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。根据本集合计划《资产管理合同》和《招募说明书》的约定，“安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划” A 类份额（以下简称“A 类份额”），自 2022 年 2 月 28 日起每个工作日只开放赎回，不开放申购。“安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划” B 类份额和 C 类份额，每份份额设定最短持有期，最短持有期为 6 个月。每份份额的最短持有期到期日即进入开放持有期，在开放持有期期间投资者可以办理赎回业务。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 07 月 01 日-2024 年 09 月 30 日） |                   |                   |
|-----------------|----------------------------------------|-------------------|-------------------|
|                 | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 A                      | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 B | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 C |
| 1. 本期已实现收益      | -268,870.47                            | -95,170.61        | -24,126.45        |
| 2. 本期利润         | 596,188.30                             | 504,947.59        | 49,419.77         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185                                 | 0.0328            | 0.0188            |
| 4. 期末基金资产净值     | 32,051,889.27                          | 19,042,303.56     | 2,689,890.63      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0173                                 | 1.0172            | 1.0067            |

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，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。

#### 3.2 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

###### 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 A 净值表现

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.95%  | 0.41%     | 2.35%      | 0.13%         | -0.40% | 0.28% |
| 过去六个月 | 2.09%  | 0.32%     | 3.78%      | 0.10%         | -1.69% | 0.22% |
| 过去一年  | -0.13% | 0.33%     | 6.56%      | 0.10%         | -6.69% | 0.23% |

|            |        |       |        |       |         |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.19% | 0.32% | 10.16% | 0.11% | -10.35% | 0.21% |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|

安信资管瑞丰6个月持有债券B净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.95%  | 0.40%     | 2.35%      | 0.13%         | -0.40%  | 0.27% |
| 过去六个月      | 2.08%  | 0.32%     | 3.78%      | 0.10%         | -1.70%  | 0.22% |
| 过去一年       | -0.13% | 0.33%     | 6.56%      | 0.10%         | -6.69%  | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.23% | 0.33%     | 10.25%     | 0.11%         | -10.48% | 0.22% |

安信资管瑞丰6个月持有债券C净值表现

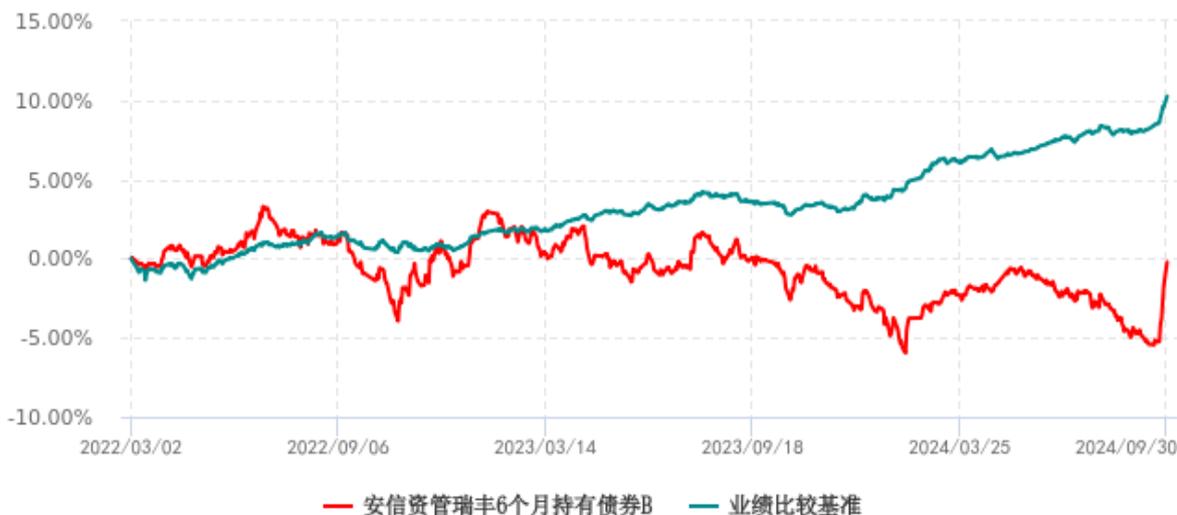
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.85%  | 0.40%     | 2.35%      | 0.13%         | -0.50%  | 0.27% |
| 过去六个月      | 1.88%  | 0.32%     | 3.78%      | 0.10%         | -1.90%  | 0.22% |
| 过去一年       | -0.52% | 0.33%     | 6.56%      | 0.10%         | -7.08%  | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.26% | 0.33%     | 10.25%     | 0.11%         | -11.51% | 0.22% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

安信资管瑞丰6个月持有债券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  
(2022年02月28日-2024年09月30日)



安信资管瑞丰6个月持有债券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  
(2022年03月02日-2024年09月30日)



注: 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 B (970091) 2 月 28 日尚未开放申赎, 无计划份额, 2022 年 2 月 28 日净值不进行披露。

安信资管瑞丰6个月持有债券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  
(2022年03月02日-2024年09月30日)



注: 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 C (970092) 2 月 28 日尚未开放申赎, 无计划份额, 2022 年 2 月 28 日净值不进行披露。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                   |
|-----|------|-------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                      |
| 王璇  | 基金经理 | 2022-03-29  | -    | 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 | 2023-02-27  | -    | 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。 |

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“离任日期”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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

#### 一、市场回顾

三季度，国内经济保持平稳态势，但需求不足的挑战仍存。具体来看，7-9 月份制造业 PMI 指数分别为 49.4、49.1 和 49.8，均位于荣枯线下运行，反映出经济信心相对偏弱，供过于求的趋势未有改善。因此，三季度价格指标继续走低，工业生产者出厂价格指数（PPI）7-9 月同比增速录得 -0.8%、-1.8%、-2.8%，月环比也录得持续下滑。尽管夏季极端气候影响导致部分农产涨价，但 CPI 增速保持相对稳定。固定资产投资方面，制造业投资持续保持相对的高增速，基建投资增速略有下滑，地产投资则并无改善，依然是投资项的拖累。三季度房地产竣工和施工面积增速均进一步走弱，新开工由于基数效应，跌幅略有企稳，但依然未见改善。同时，地产销量增速继续保持接近 -20% 的下滑速度。与地产销量不佳的同步的是居民的信贷数据：三季度居民户贷款持续同比少增，借贷意愿低迷；企业部门信贷数据略强于金融部门，但票据融资占比高，也反映出了企业信心相对有限。总体来看，三季度整体融资需求下滑，8 月 M1 增速同比下滑至 -7.3%，M2 增速也仅保持在 6.3%。内需不足在消费数据上也有所体现，7-8 月社消同比仅为 2.7%、2.1%，限额以上消费增速则转负。外需相对持续偏强，出口增速依然保持在偏高水平。

三季度末，国内政策明显发力。9 月 24 日，中国人民银行、中国证监会、金融监管总局联合发布一系列增量政策，包括降低存款准备金率、降低贷款利率、降低存量房贷利率、降低二套房首付比例、创设新的货币政策工具支持股票市场稳定发展、制定推动中长期资金入市的指导意见等。9 月 26 日，中央政治局召开会议，分析研究当前经济形势，强调加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出，发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，降低存款准备金率，实施有

力度的降息，促进房地产市场“止跌回稳”。在国际方面，随着美国经济略有放缓，通胀压力缓解，美联储亦开始降息，下调联邦基金目标利率 50 个基点至 4.75%-5.00% 区间。

金融市场方面，三季度债市震荡加剧，信用债市场相对调整幅度更大；三季度中债总全价指数上涨 0.44%，中债信用债总全价指数下跌 0.32%。权益资产在持续下跌后，9 月末因政策，有明显改善，呈现快速上涨，沪深 300 指数三季度上涨 16.07%；转债资产受到个别信用事件的冲击，一度在 7、8 月份快速调整，最终伴随权益资产上涨，三季度合计上涨 0.58%。

三季度账户总体杠杆率有所下降；纯债端以高等级信用债和利率债为主，同时利用中长久期的利率债进行适度的波段交易，账户久期略有拉长。转债持仓相对注重风险收益比，提升了一定的组合弹性，总体仓位上变化不大。权益端保持中等偏高的仓位，但在三季度末市场快速上涨后，账户权益仓位有一定的下降。风格上，总体依然偏好大盘价值风格，优选竞争力强的优质龙头，同时继续保持一定的黄金股配置。

## 二、展望与投资策略

三季度末四季度初，政策面发生了明显的边际变化，股票与债券市场波动也均明显加剧。政策面稳增长的决心已经可见，财政政策更进一步指明了几个发力方向，包括化解地方政府债务风险，加大特别国债补充大行资本金，发行专项债支持地产“止跌回稳”等，同时表态财政政策还有进一步的还有发力空间。展望四季度甚至明年初，我们认为债券利率中枢可能维持目前水平，但利率的波动可能有所加剧。转债方面，由于个别券种信用事件的冲击，市场一度呈现了非常情绪化的调整，随后市场逐渐修复。经过近期大幅的波动后，我们认为目前转债的性价比反而更为突出，向上有弹性，向下有保护的标的占比增多。在政策出现较大转变后，权益资产走出显著低估中枢是合理的，但近期估值抬升的速度和幅度较快，后续还需要基本面和盈利的跟上。在资产配置思路上，我们继续保持估值定仓，紧跟变化，及时做好组合的再平衡，争取为持有人创造价值。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末安信资管瑞丰 6 个月持有债券 A 基金份额净值为 1.0173 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%；截至报告期末安信资管瑞丰 6 个月持有债券 B 基金份额净值为 1.0172 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%；截至报告期末安信资管瑞丰 6 个月持有债券 C 基金份额净值为 1.0067 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 8 月 28 日连续四十三个交易日资产净值低于五千万元，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的情形。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                    | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-----------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资                  | 8,242,745.00  | 14.11        |
|    | 其中：股票                 | 8,242,745.00  | 14.11        |
| 2  | 基金投资                  | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资                | 48,545,357.60 | 83.11        |
|    | 其中：债券                 | 48,545,357.60 | 83.11        |
|    | 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<br>买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 980,240.95    | 1.68         |
| 8  | 其他资产                  | 639,647.71    | 1.10         |
| 9  | 合计                    | 58,407,991.26 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别                 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业             | -            | -            |
| B  | 采矿业                  | 828,720.00   | 1.54         |
| C  | 制造业                  | 6,133,415.00 | 11.40        |
| D  | 电力、热力、燃气及<br>水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业                  | -            | -            |
| F  | 批发和零售业               | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮<br>政业      | 884,460.00   | 1.64         |
| H  | 住宿和餐饮业               | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信<br>息技术服务业  | 164,550.00   | 0.31         |
| J  | 金融业                  | -            | -            |
| K  | 房地产业                 | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业             | 231,600.00   | 0.43         |
| M  | 科学研究和技术服务<br>业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设<br>施管理业    | -            | -            |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -     |
| P | 教育            | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -            | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -            | -     |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 8,242,745.00 | 15.33 |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 603288 | 海天味业 | 16,000 | 770,720.00 | 1.43         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 2,500  | 629,725.00 | 1.17         |
| 3  | 002216 | 三全食品 | 45,000 | 551,250.00 | 1.02         |
| 4  | 000895 | 双汇发展 | 18,000 | 487,620.00 | 0.91         |
| 5  | 000975 | 山金国际 | 22,000 | 409,420.00 | 0.76         |
| 6  | 603501 | 韦尔股份 | 3,500  | 375,200.00 | 0.70         |
| 7  | 601021 | 春秋航空 | 6,000  | 370,860.00 | 0.69         |
| 8  | 000039 | 中集集团 | 40,000 | 359,600.00 | 0.67         |
| 9  | 000582 | 北部湾港 | 40,000 | 328,800.00 | 0.61         |
| 10 | 000858 | 五粮液  | 2,000  | 325,020.00 | 0.60         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 16,510,211.80 | 30.70        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 8,107,436.32  | 15.07        |
| 5  | 企业短期融资券   | 4,082,793.44  | 7.59         |
| 6  | 中期票据      | 11,176,188.49 | 20.78        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 8,668,727.55  | 16.12        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 48,545,357.60 | 90.26        |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
|----|------|------|-------|---------|--------|

|   |           |                             |        |              | 值比例(%) |
|---|-----------|-----------------------------|--------|--------------|--------|
| 1 | 102281775 | 22 晋能装备<br>MTN007(科创<br>票据) | 40,000 | 4,101,353.42 | 7.63   |
| 2 | 012480045 | 24 长兴建投<br>SCP001           | 40,000 | 4,082,793.44 | 7.59   |
| 3 | 132480056 | 24 河钢集<br>GN005             | 40,000 | 4,004,146.85 | 7.44   |
| 4 | 102481320 | 24 水发集团<br>MTN004           | 30,000 | 3,070,688.22 | 5.71   |
| 5 | 149576    | 21 深投 03                    | 28,000 | 2,871,221.26 | 5.34   |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本集合计划本报告期末无股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末无国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

24 河钢集 GN005（代码：132480056）为本集合计划前十大持仓证券。2024 年 8 月 23 日，根据中国证券监督管理委员会河北监管局网站发布的《河北证监局关于对河钢集团有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》，指出公司作为河钢资源控股股东的相关承诺履行存在问题，包括保证上市公司独立性及避免同业竞争的承诺履行不到位。

22 广金 01（代码：149816）为本集合计划前十大持仓证券，根据中国证券监督管理委员会广东监管局网站发布的《关于对广州金控期货有限公司采取出具警示函监管措施的决定》，指出公司未能

建立健全并持续完善覆盖子公司及其业务的合规管理、风险管理和内部控制体系，未能健全并有效执行自有资金投资运作制度和流程。

本集合计划投资24河钢集GN005及22广金01投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除24河钢集GN005及22广金01，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。

### 5.11.2 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

本集合计划投资的前十名股票，均为基金合同规定的备选股票库之内的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 11,142.10  |
| 2  | 应收证券清算款 | 620,505.61 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 8,000.00   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 639,647.71 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|--------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债  | 875,653.15 | 1.63         |
| 2  | 110085 | 通22转债 | 669,370.00 | 1.24         |
| 3  | 113021 | 中信转债  | 659,413.31 | 1.23         |
| 4  | 113641 | 华友转债  | 624,762.00 | 1.16         |
| 5  | 110068 | 龙净转债  | 537,847.67 | 1.00         |
| 6  | 127039 | 北港转债  | 484,401.21 | 0.90         |
| 7  | 123035 | 利德转债  | 480,700.05 | 0.89         |
| 8  | 123216 | 科顺转债  | 392,801.81 | 0.73         |
| 9  | 110081 | 闻泰转债  | 378,856.49 | 0.70         |
| 10 | 113033 | 利群转债  | 336,862.40 | 0.63         |
| 11 | 113623 | 凤21转债 | 307,168.98 | 0.57         |
| 12 | 127089 | 晶澳转债  | 267,300.58 | 0.50         |
| 13 | 113044 | 大秦转债  | 237,516.14 | 0.44         |
| 14 | 123076 | 强力转债  | 232,759.26 | 0.43         |
| 15 | 110064 | 建工转债  | 220,237.26 | 0.41         |
| 16 | 127024 | 盈峰转债  | 214,578.55 | 0.40         |
| 17 | 113066 | 平煤转债  | 211,095.12 | 0.39         |
| 18 | 113664 | 大元转债  | 205,367.06 | 0.38         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 19 | 123119 | 康泰转 2   | 196,689.23 | 0.37 |
| 20 | 127032 | 苏行转债    | 187,894.27 | 0.35 |
| 21 | 123107 | 温氏转债    | 184,635.58 | 0.34 |
| 22 | 113669 | 景 23 转债 | 129,516.58 | 0.24 |
| 23 | 128081 | 海亮转债    | 111,897.49 | 0.21 |
| 24 | 110089 | 兴发转债    | 110,916.66 | 0.21 |
| 25 | 123113 | 仙乐转债    | 108,552.08 | 0.20 |
| 26 | 127056 | 中特转债    | 107,269.53 | 0.20 |
| 27 | 123217 | 富仕转债    | 77,418.02  | 0.14 |
| 28 | 128128 | 齐翔转 2   | 59,496.82  | 0.11 |
| 29 | 113045 | 环旭转债    | 57,750.25  | 0.11 |

#### 5.11.5 报告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前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   | 安信资管瑞丰 6 个月<br>持有债券 A | 安信资管瑞丰 6 个月<br>持有债券 B | 安信资管瑞丰 6 个月<br>持有债券 C |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额<br>总额                   | 32,985,270.08         | 13,898,414.90         | 2,592,440.23          |
| 报告期期间基金总申<br>购份额                  | -                     | 5,190,188.59          | 79,742.42             |
| 减：报告期期间基金<br>总赎回份额                | 1,477,756.35          | 368,459.03            | 217.86                |
| 报告期期间基金拆分<br>变动份额（份额减少<br>以“-”填列） | -                     | -                     | -                     |
| 报告期期末基金份额<br>总额                   | 31,507,513.73         | 18,720,144.46         | 2,671,964.79          |

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 A | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 B | 安信资管瑞丰 6 个月持有债券 C |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | -                 | -                 | -                 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -                 | 5,161,023.95      | -                 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -                 | -                 | -                 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | -                 | 5,161,023.95      | -                 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例 (%) | -                 | 27.57             | -                 |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额 (份)     | 交易金额 (元)     | 适用费率 |
|----|------|------------|--------------|--------------|------|
| 1  | 申购   | 2024-08-29 | 5,161,023.95 | 5,000,000.00 | -    |
| 合计 |      |            | 5,161,023.95 | 5,000,000.00 |      |

注：本集合计划 B 类份额申购金额大于等于 500 万元时，申购费按 1000 元/笔收取。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 2、安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管瑞丰 6 个月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、安信资管瑞丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

## 9.2 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。

## 9.3 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

二〇二四年十月二十五日