

# 安信资管天利宝货币型集合资产管理计划

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:安信证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2024 年 03 月 29 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。本年度报告已经全体董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2024年3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。

本报告中财务资料经审计，信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
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	11
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 债券回购融资情况	47
8.3 基金投资组合平均剩余期限	48
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	49
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	50
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	50

8.9 投资组合报告附注 .....	50
§9 基金份额持有人信息 .....	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
§10 开放式基金份额变动 .....	52
§11 重大事件揭示 .....	53
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	54
11.9 其他重大事件 .....	54
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
12.1 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 .....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§13 备查文件目录 .....	57
13.1 备查文件目录 .....	57
13.2 存放地点 .....	57
13.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划
基金简称	安信资管天利宝货币
基金主代码	970105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月06日
基金管理人	安信证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	9,324,118,721.79份
基金合同存续期	3年

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划主要采用类属资产配置策略、期限配置策略、回购策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	李力
	联系电话	0755-81681561
	电子邮箱	axzg@essence.com.cn
客户服务电话	95517	4008-058-058
传真	0755-88258219	-
注册地址	深圳市福田区福田街道福安	北京市西城区太平桥大街17

	社区福华一路19号安信金融大厦21楼、22楼	号
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路19号安信金融大厦21楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码	518026	100033
法定代表人	李力	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.axzqzg.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路19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
会计师事务所	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座9层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023年	2022年	2021年12月06日 (基金合同生效日)-2021年12月31日
本期已实现收益	138,625,572.24	154,658,468.25	10,768,321.38

本期利润	138,625,572.24	154,658,468.25	10,768,321.38
本期净值收益率	1.1083%	1.2175%	0.0974%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023年末	2022年末	2021年末
期末基金资产净值	9,324,118,721.79	10,653,953,835.63	12,085,747,220.55
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末	2022年末	2021年末
累计净值收益率	2.4389%	1.3161%	0.0974%

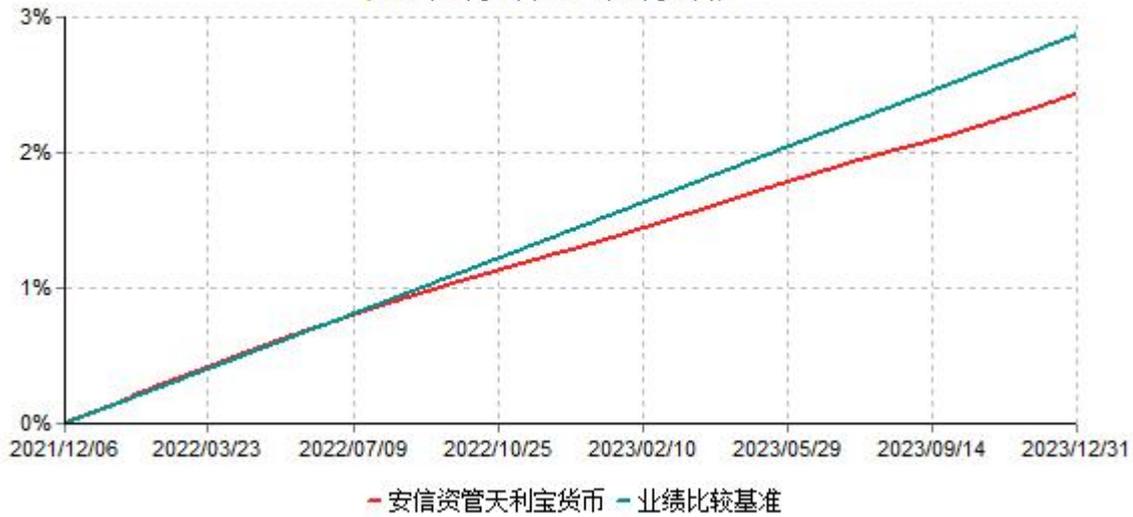
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2976%	0.0004%	0.3456%	0.0000%	-0.0480%	0.0004%
过去六个月	0.5507%	0.0004%	0.6924%	0.0000%	-0.1417%	0.0004%
过去一年	1.1083%	0.0003%	1.3781%	0.0000%	-0.2698%	0.0003%
自基金合同生效起至今	2.4389%	0.0006%	2.8755%	0.0000%	-0.4366%	0.0006%

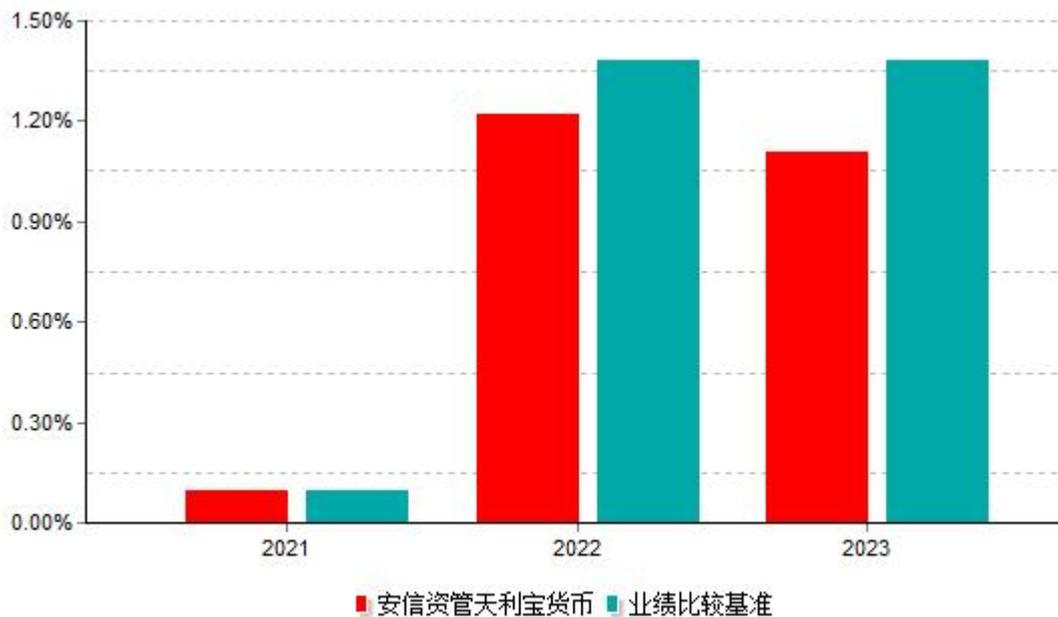
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信资管天利宝货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年12月06日-2023年12月31日)



注：本集合计划的生效日为2021年12月6日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资	直接通过应	应付利润本	年度利润分	备注

	形式转实收 基金	付赎回款转 出金额	年变动	配合计	
2023年	137,789,392. 32	-	836,179.92	138,625,572. 24	-
2022年	158,842,220. 09	-	-4,183,751.8 4	154,658,468. 25	-
2021年	-	-	10,768,321.3 8	10,768,321.3 8	-
合计	296,631,612. 41	-	7,420,749.46	304,052,361. 87	-

## §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2023年12月31日，安信资管受托产品259只、管理市值合计1516.94亿元。其中公募资产管理规模109.99亿元。

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2023年12月31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 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职	离任		

		日期	日期		
杨坚丽	基金经理	2023-07-10	-	17	女，中国人民大学统计学硕士，多年证券从业经历，曾任职于中国中投证券研究所研究员、资产管理部投资主办、国信证券资产管理部投资主办。2016年9月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投资经理。擅长组合构建与大类资产配置，主要秉承以宏观基本面研判为基础，投资风格稳健。
张亚非	原安信证券资产管理有限公司公募部兼固定收益部负责人、基金经理	2021-12-06	2023-07-10	11	女，对外经济贸易大学金融学硕士，多年固定收益从业经验。曾任职于北京农村商业银行、平安银行担任债券投资经理。2012年9月加入国投证券资产管理部，任职期间担任安信证券资产管理有限公司固定收益部和公募部总经理。
吴慧文	基金经理	2021-12-06	2023-07-10	11	女，武汉大学金融工程硕士，多年债券投资经验。历任长城证券固定收益部投资经理。2016年8月加入国投证券资产管理部，任职期间担任安信证券资产管理有限公司投资经理。

#### 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

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 公平交易制度和控制方法

管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）和有关法律法规的规定，建立了公平交易相关的制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2023年疫情消退和经济恢复中，货币政策回归中性偏宽松基调，资金利率围绕政策利率波动，节奏上全年资金利率一波三折，呈现先上后下再上的N型走势。年初受新增贷款高增的背景下，资金面边际收紧，资金利率上行。二季度随着信贷季节性效应褪去以及央行降息落地，R007和DR007均有所下行，资金利率震荡下行。8月15日央行下调OMO和MLF利率，债市做多热情高企，十年国债一度下行至年内低点。但8月中旬开始资金利率边际收紧，资金利率中枢缓幅上行。随着多项稳增长政策陆续落实，市场预期经济修复趋势有望延续，资金利率缓慢上行。国庆后资金面整体偏紧，经济数据超预期并叠加债券供给预期扰动下，存单利率以及中高等级信用债收益率震荡上行。11月以来，万亿国债发行落地、房地产政策宽松预期等影响因素共同作用下，资金面持续紧平衡，基本面内生动能偏弱对债市利好程度有限，债市表现偏弱，存单和债券短端收益率曲线震荡上行。12月在年末跨年资金无忧以及银行大额存单利率下调带动政策利率降息预期

发酵，债市震荡走强，存单利率快速下行，债券市场收益率整体下行。整体来说全年资金利率中枢较去年有所上行。

报告期内，本产品操作相对稳健，根据本产品规模变化规律严控组合剩余期限，并通过对货币市场利率走势的判断，择机在高评级短期债券、同业存单、逆回购、定期存款和活期存款等资产中做出投资安排，在季末流动性波动较大的时间窗口做好备付，以保持产品平稳运行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末安信资管天利宝货币基金份额净值为1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为1.1083%，同期业绩比较基准收益率为1.3781%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 一、展望

宏观层面来看，2024年债券市场仍然处于牛市环境，供需矛盾下债券资产荒演绎下，整体将会推动债券收益率继续震荡下行。短期来看，元旦前机构配债抢跑，推动债券收益率继续下行，短期内可能存在机构止盈行为，债券收益率呈现窄幅震荡走势。2024年预计财政政策稳健扩张，并率先发力以带动经济平稳增长，“地方平台控债务”的背景下，预计中央财政加杠杆。货币政策保持适度宽松，并配合宽财政政策以支撑经济稳步增长，我们认为年内仍有降息降准的可能性。

##### 二、投资策略

下一阶段，产品组合将优化流动性结构，适度对存款、现券进行调仓，维持较好的流动性，根据市场情况动态调整账户的持仓结构、组合久期，力争获取较为稳健的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障持有人利益的原则，经营管理。管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的合规人员对公司经营、产品运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层。报告期内，公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规意识。报告期内，本集合计划的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定；管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。

本集合计划报告期内未发现存在重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损投资者利益的情形。

管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护集合资产计划资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划合同中“第十六部分集合计划的收益与分配”之“（二）收益分配原则”的相关规定，本集合计划收益为“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额），本集合计划在本报告期进行了12次收益集中支付并结转为基金份额，累计分配收益137,789,392.32元，利润分配金额、方式等符合相关法规和本集合计划合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	XYZH/2024BJAB1B0151

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了安信资管天利宝货币型集合资产管理计划（以下简称天利宝集合计划）财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产（计划净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定和财务报表附注二所述的编制基础编制，公允反映了天利宝集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产（计划净值）变动情况。

<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天利宝集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>天利宝集合计划管理人安信证券资产管理有限公司（以下简称集合计划管理人）管理层负责按照企业会计准则的规定和财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估天利宝集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非集合计划管理人管理层计划清算天利宝集合计划、终止运营或别无其他现实的选择。集合计划管理人治理层负责监督天利宝集合计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以</p>

	<p>下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价集合计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天利宝集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天利宝集合计划不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	晁小燕	杜伟
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座9层	
审计报告日期	-	

§7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：安信资管天利宝货币型集合资产管理计划

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	5,523,308,004.01	4,515,898,656.76
结算备付金		136,431.18	-
存出保证金		42,736.63	35,877.26
交易性金融资产	7.4.7.2	3,821,284,071.70	6,160,674,082.38
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,821,284,071.70	6,160,674,082.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		9,344,771,243.52	10,676,608,616.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,335,799.54	9,721,673.37
应付托管费		463,099.97	540,093.02
应付销售服务费		2,315,499.87	2,700,464.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		381,635.52	1,315,827.44
应付利润		8,960,836.19	8,186,865.33
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	195,650.64	189,856.78
负债合计		20,652,521.73	22,654,780.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	9,324,118,721.79	10,653,953,835.63
未分配利润	7.4.7.7	-	-
净资产合计		9,324,118,721.79	10,653,953,835.63
负债和净资产总计		9,344,771,243.52	10,676,608,616.40

注：报告截止日2023年12月31日，计划份额净值1.0000元，计划份额总额9,324,118,721.79份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信资管天利宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		290,411,829.76	314,545,653.27
1.利息收入		197,168,460.66	119,611,275.09

其中：存款利息收入	7.4.7.8	184,131,823.59	109,932,201.75
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		13,036,637.07	9,679,073.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		93,243,236.52	194,934,378.18
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-	-
基金投资收益	7.4.7.10	-	-
债券投资收益	7.4.7.11	93,243,236.52	194,934,378.18
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	132.58	-
<b>减：二、营业总支出</b>		151,786,257.52	159,887,185.02
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	113,467,401.98	114,960,801.94
2.托管费	7.4.10.2.2	6,303,744.63	6,386,711.21
3.销售服务费	7.4.10.2.3	31,518,722.69	31,933,556.06
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		36,854.27	5,895,987.82
其中：卖出回购金融资产支		36,854.27	5,895,987.82

出			
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		152,024.04	407,999.16
8.其他费用	7.4.7.17	307,509.91	302,128.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		138,625,572.24	154,658,468.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		138,625,572.24	154,658,468.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		138,625,572.24	154,658,468.25

### 7.3 净资产变动表

会计主体：安信资管天利宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,653,953,835.63	-	10,653,953,835.63
二、本期期初净资产	10,653,953,835.63	-	10,653,953,835.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,329,835,113.84	-	-1,329,835,113.84
（一）、综合收益总额	-	138,625,572.24	138,625,572.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资	-1,329,835,113.84	-	-1,329,835,113.84

产减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	327,597,776,592.16	-	327,597,776,592.16
2.基金赎回款	-328,927,611,706.00	-	-328,927,611,706.00
(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)	-	-138,625,572.24	-138,625,572.24
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	9,324,118,721.79	-	9,324,118,721.79
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,085,747,220.55	-	12,085,747,220.55
二、本期期初净资产	12,085,747,220.55	-	12,085,747,220.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,431,793,384.92	-	-1,431,793,384.92
(一)、综合收益总额	-	154,658,468.25	154,658,468.25
(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)	-1,431,793,384.92	-	-1,431,793,384.92
其中: 1.基金申购款	331,385,369,203.21	-	331,385,369,203.21

2.基金赎回款	-332,817,162,588.13	-	-332,817,162,588.13
(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)	-	-154,658,468.25	-154,658,468.25
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	10,653,953,835.63	-	10,653,953,835.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信资管天利宝货币型集合资产管理计划(以下简称本计划或本集合计划),由安信证券天利宝集合资产管理计划(以下简称原集合计划)变更而来。原集合计划于2012年12月10日设立,于2012年12月14日在中国证券业协会《关于安信证券天利宝集合资产管理计划的备案报告》(安证报[2012]415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1,503,056,153.00元,折合认购份额1,503,056,153.00份。以上实收资金共计人民币1,503,056,153.00元,折合1,503,056,153.00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(2012)验字第60884100\_H02号验资报告。原集合计划的管理人为国投证券资产管理有限公司(原名安信证券股份有限公司),托管人为中国证券登记结算有限责任公司是本集合计划。

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。

根据中国证券监督委员（以下简称中国证监会）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操作指引》（证监会公告[2018]39号）的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

自2021年12月6日起，《安信资管天利宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《安信证券天利宝集合管理合同》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。

本集合计划为货币型集合资产管理计划，自资产管理合同变更生效日起按照中国证监会有关规定执行。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。安信证券资产管理有限公司是本集合计划的管理人，中国证券登记结算有限责任公司是本计划的托管人，安信证券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。

#### **7.4.2 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。

#### **7.4.3 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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产（计划净值）变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 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。

##### **7.4.4.2 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。

##### **7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

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

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

（2）回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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0.05%年费率计提，计算方法如下：

$T = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ ，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0.90%年费率计提，计算方法如下：

$G = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$ ，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。

当以0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提0.90%的管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

(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。本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ ；

H为每日应计提的销售服务费；

E为前一日集合计划资产净值。

(4) 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、电子合同服务费等；

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划每份份额享有同等分配权；

(2) 本集合计划“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）；

(3) 本集合计划采用1.00元固定份额净值列示，自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付；

(4) 本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为集合计划份额持有人增加相应的计划份额；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为集合计划份额

持有人缩减相应的计划份额，遇投资者剩余计划份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行；

(6) 投资者赎回集合计划份额时，于当期月度分红日支付对应的收益；

(7) 投资者解约情形下，管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款基准利率与投资者实际收益的孰低值对该投资人进行收益分配，该投资者实际投资收益与分配收益的差额部分计入集合计划资产；

(8) 当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有本集合计划的收益分配权益，当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益；

(9) 在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人可调整计划收益的分配原则和支付方式，不需召开集合计划份额持有人大会；

(10) 如需召开集合计划份额持有人大会，集合计划份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；

(11) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.12 外币交易**

本集合计划本报告期内无外币交易。

#### **7.4.4.13 分部报告**

本集合计划无分部报告。

#### **7.4.4.14 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。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,779,559,195.77	2,174,505,572.56
等于：本金	1,777,963,912.16	2,172,393,251.71
加：应计利息	1,595,283.61	2,112,320.85
减：坏账准备	-	-
定期存款	3,743,748,808.24	2,341,393,084.20
等于：本金	3,690,000,000.00	2,320,000,000.00
加：应计利息	53,748,808.24	21,393,084.20
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	100,306,666.82
存款期限3个月以上	3,743,748,808.24	2,241,086,417.38
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	5,523,308,004.01	4,515,898,656.76

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	102,267,609.09	102,304,536.99	36,927.90	0.0004
	银行间市场	3,719,016,462.61	3,719,517,862.67	501,400.06	0.0054
	合计	3,821,284,071.70	3,821,822,399.66	538,327.96	0.0058
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,821,284,071.70	3,821,822,399.66	538,327.96	0.0058
项目		上年度末 2022年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	183,882,500.27	183,701,487.68	-181,012.59	-0.0017
	银行间市场	5,976,791,582.11	5,969,987,798.90	-6,803,783.21	-0.0639
	合计	6,160,674,082.38	6,153,689,286.58	-6,984,795.80	-0.0656
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,160,674,082.38	6,153,689,286.58	-6,984,795.80	-0.0656

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31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	6,350.64	10,556.78
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	6,350.64	10,556.78
应付利息	-	-
预提费用-审计费	60,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提费用-账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	195,650.64	189,856.78

#### 7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,653,953,835.63	10,653,953,835.63
本期申购	327,597,776,592.16	327,597,776,592.16

本期赎回（以“-”号填列）	-328,927,611,706.00	-328,927,611,706.00
本期末	9,324,118,721.79	9,324,118,721.79

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。

#### 7.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	138,625,572.24	-	138,625,572.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-138,625,572.24	-	-138,625,572.24
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.8 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	76,754,489.38	67,253,934.31
定期存款利息收入	107,064,307.38	42,604,667.46
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	312,840.62	72,034.85
其他	186.21	1,565.13
合计	184,131,823.59	109,932,201.75

#### 7.4.7.9 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。

### 7.4.7.10 基金投资收益

本集合计划本报告期内未进行基金投资。

### 7.4.7.11 债券投资收益

#### 7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	92,924,088.27	193,945,284.33
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	319,148.25	989,093.85
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	93,243,236.52	194,934,378.18

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	11,139,110,544.71	10,610,120,817.43
减: 卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	11,016,424,179.60	10,422,068,109.34
减: 应计利息总额	122,367,216.86	187,063,614.24
减: 交易费用	-	-

买卖债券差价收入	319,148.25	989,093.85
----------	------------	------------

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.4.7.13 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。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本集合计划未进行衍生工具投资。

#### 7.4.7.15 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	132.58	-
合计	132.58	-

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	-	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	90,309.91	85,928.83
信息披露费	120,000.00	120,000.00

审计费用	60,000.00	50,000.00
账户维护费_中债登	18,000.00	9,000.00
账户维护费_上清所	19,200.00	9,600.00
帐户维护费	-	26,700.00
其他	-	900.00
合计	307,509.91	302,128.83

#### 7.4.7.18 分部报告

无

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 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
中国证券登记结算有限责任公司	计划托管人

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	163,677,429.31	100.00%	258,254,688.76	100.00%

#### 7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	45,536,444,000.00	100.00%	10,255,238,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.1.6 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	113,467,401.98	114,960,801.94

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	113,467,401.98	114,960,801.94

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

每日应计提的集合计划管理费=前一日的集合计划资产净值×0.90%/当年天数

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,303,744.63	6,386,711.21

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

每日应计提的集合计划托管费=前一日的集合计划资产净值×0.05%/当年天数

#### 7.4.10.2.3 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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国投证券	31,518,722.69
合计	31,518,722.69
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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

国投证券	31,933,556.06
合计	31,933,556.06

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

计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

本集合计划当期未发生应支付的销售服务费。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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。

##### 7.4.10.5.2 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

报告期末国投证券股份有限公司为集合计划管理人提供2.7亿元资金满足日常快取功能产生的份额。

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券	11,110,457.17	1,156,806.25	13,233,461.52	606,861.78

登记结算 有限责任 公司				
--------------------	--	--	--	--

**7.4.10.7 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。

**7.4.10.8 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。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金**

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
137,789,392.32	-	836,179.92	138,625,572.24	-

**7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 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12月31日未持有因认购获配新股及债券未上市而流通受限制的证券。

**7.4.12.2 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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 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。

**7.4.12.3.2 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。

**7.4.12.4 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。

**7.4.13 金融工具风险及管理**

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	398,238,203.93
A-1以下	-	-
未评级	2,981,282,511.11	3,714,252,880.02
合计	2,981,282,511.11	4,112,491,083.95

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	593,985,445.39	1,519,427,991.84

合计	593,985,445.39	1,519,427,991.84
----	----------------	------------------

#### 7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	205,607,424.74	528,755,006.59
AAA以下	-	-
未评级	40,408,690.46	-
合计	246,016,115.20	528,755,006.59

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12 月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	4,114,898,003.34	1,408,410,000.67	-	-	-	5,523,308,004.01
结算备付金	136,431.18	-	-	-	-	136,431.18
存出保证金	42,736.63	-	-	-	-	42,736.63
交易性金融资产	3,089,278,476.03	732,005,595.67	-	-	-	3,821,284,071.70
资产总计	7,204,355,647.18	2,140,415,596.34	-	-	-	9,344,771,243.52
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,335,799.54	8,335,799.54
应付托管费	-	-	-	-	463,099.97	463,099.97
应付销售服务费	-	-	-	-	2,315,499.87	2,315,499.87

安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2023年年度报告

应交税费	-	-	-	-	381,635.52	381,635.52
应付利润	-	-	-	-	8,960,836.19	8,960,836.19
其他负债	-	-	-	-	195,650.64	195,650.64
负债总计	-	-	-	-	20,652,521.73	20,652,521.73
利率敏感度缺口	7,204,355,647.18	2,140,415,596.34	-	-	-20,652,521.73	9,324,118,721.79
上年度末 2022年12 月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,693,204,545.75	822,694,111.01	-	-	-	4,515,898,656.76
存出保证金	35,877.26	-	-	-	-	35,877.26
交易性金融资产	5,431,141,217.60	729,532,864.78	-	-	-	6,160,674,082.38
资产总计	9,124,381,640.61	1,552,226,975.79	-	-	-	10,676,608,616.40
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	9,721,673.37	9,721,673.37
应付托管费	-	-	-	-	540,093.02	540,093.02
应付销售服务费	-	-	-	-	2,700,464.83	2,700,464.83
应交税费	-	-	-	-	1,315,827.44	1,315,827.44
应付利润	-	-	-	-	8,186,865.33	8,186,865.33
其他负债	-	-	-	-	189,856.78	189,856.78
负债总计	-	-	-	-	22,654,780.77	22,654,780.77
利率敏感度缺口	9,124,381,640.61	1,552,226,975.79	-	-	-22,654,780.77	10,653,953,835.63

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
	利率下降25个基点	2,936,723.02	4,309,102.80
	利率上升25个基点	-2,926,235.19	-4,294,602.46

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	3,821,284,071.70	40.98	6,160,674,082.38	57.83
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	3,821,284,071.70	40.98	6,160,674,082.38	57.83

##### 7.4.13.4.3.2 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	3,821,284,071.70	6,160,674,082.38
第三层次	-	-
合计	3,821,284,071.70	6,160,674,082.38

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.3 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。

###### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,821,284,071.70	40.89
	其中：债券	3,821,284,071.70	40.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,523,444,435.19	59.11
4	其他各项资产	42,736.63	0.00
5	合计	9,344,771,243.52	100.00

#### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.01	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内集合计划债券正回购的资金余额未发生超过集合计划资产净值20%的情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过120天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	37.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	11.85	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.57	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	30.08	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.32	-

注：各期限资产包括成本折溢价和应计利息。

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	102,267,609.09	1.10
5	企业短期融资券	2,981,282,511.11	31.97
6	中期票据	143,748,506.11	1.54
7	同业存单	593,985,445.39	6.37
8	其他	-	-
9	合计	3,821,284,071.70	40.98
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注：摊余成本包括成本折溢价和应计利息。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	072310215	23平安证券CP01 2	2,000,000	201,031,147.5 4	2.16
2	072310212	23银河证券CP00 4	1,600,000	160,848,262.3 0	1.73
3	012382926	23青岛国信SCP0 06	1,200,000	121,229,283.4 0	1.30
4	072310192	23国金证券CP01	1,200,000	120,920,655.7	1.30

		5		4	
5	072310201	23银河证券CP003	1,100,000	110,757,196.72	1.19
6	102100420	21国联MTN001	1,000,000	103,339,815.65	1.11
7	072310075	23平安证券CP004	1,000,000	101,991,803.28	1.09
8	012382843	23山东金融SCP003	1,000,000	101,115,330.86	1.08
9	012382447	23光大集团SCP009	1,000,000	101,084,279.66	1.08
10	012382854	23光大集团SCP010	1,000,000	100,886,590.98	1.08

注：摊余成本包括成本折溢价和应计利息。

### 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0080%
报告期内偏离度的最低值	-0.0494%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0175%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本集合计划未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

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

本报告期末本集合计划未持有资产支持证券。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用“摊余成本法”计算集合计划资产净值，为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用“影子定价”。如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

**8.9.2 23平安证券CP012（代码：072310215）及23平安证券CP004（代码：072310075）**为本集合计划前十大持仓证券。2023年10月9日，中国证监会深圳监管局网站发布对平安证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定（行政监管措施决定书【2023】166号）。

本集合计划投资23平安证券CP012及23平安证券CP004投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除23平安证券CP012及23平安证券CP004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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	42,736.63
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	42,736.63

### 8.9.4 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
197,569	47,194.24	441,667,962.69	4.74%	8,882,450,759.10	95.26%

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	券商类机构	210,154,116.00	2.25%
2	个人	60,010,994.35	0.64%
3	个人	43,096,216.70	0.46%
4	个人	40,586,950.36	0.44%
5	个人	29,651,188.75	0.32%
6	其他机构	22,632,994.09	0.24%
7	券商类机构	20,799,990.00	0.22%
8	基金类机构	20,153,778.00	0.22%
9	个人	19,729,425.21	0.21%
10	个人	16,966,551.84	0.18%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	424,235.62	0.0045%

注：占基金总份额比例为四舍五入后结果。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年12月06日)基金份额总额	7,893,401,114.50
本报告期期初基金份额总额	10,653,953,835.63
本报告期基金总申购份额	327,597,776,592.16
减：本报告期基金总赎回份额	328,927,611,706.00
本报告期期末基金份额总额	9,324,118,721.79

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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2023年3月，安信资管决定许彦冰任首席信息官。2023年8月，安信资管决定文庆能任副总经理。2023年8月，安信资管决定李露任合规总监，陈永东不再兼任合规总监，仍任公司首席风险官。2023年12月，安信资管杨成省不再任副总经理。

本报告期内，本集合计划托管人未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

我公司聘任信永中和会计师事务所为公司2023年度主审会计师事务所，本报告年度的审计费用为60,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本集合计划管理人及高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本集合计划托管人及高级管理人员在开展集合计划托管业务过程中未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	-	-	-	-	-

#### 11.7.2 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	163,677,429.31	100.00%	45,536,444.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本集合计划在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%（含）以上的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-11
2	关于安信资管天利宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20

3	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2022年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
4	安信证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	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	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-29
6	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2022年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-31
7	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-11
8	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2023年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
9	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-10
10	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-09
11	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-07-10
12	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-07-11
13	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2023年第2季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-07-21
14	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-08-09
15	安信证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-08-29

16	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2023年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-08-31
17	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-09-11
18	安信证券资产管理有限公司2023年行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-09-29
19	关于安信资管天利宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-10-10
20	关于安信资管天利宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-10-11
21	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-10-11
22	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划2023年第3季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-10-25
23	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-11-09
24	安信资管天利宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-12-11
25	安信证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-12-15

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- 2、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、安信资管天利宝货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二四年三月二十九日