

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划
2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:安信证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 07 月 19 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光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年7月12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04月01日起至06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信瑞盈 3 个月滚动持有债券		
基金主代码	970058		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 07 月 23 日		
报告期末基金份额总额	44,775,902.32 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	本集合计划通过对宏观经济周期、行业前景分析和发债主体研究的综合运用，主要采用类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。		
业绩比较基准	中债综合财富(1-3 年)指数收益率*90%+一年期定期存款利率*10%。		
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	中国光大银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C
下属分级基金的交易代码	970058	970059	970060

报告期末下属分级基金的份额总额	26,817,745.44 份	7,962,367.87 份	9,995,789.01 份
-----------------	-----------------	----------------	----------------

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，“安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划”A 类份额（以下简称“A 类份额”），自 2021 年 7 月 23 日起每个工作日只开放赎回，不开放申购。“安信资管瑞盈 3 个月滚动持有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 3 个月。每份份额的最短持有期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该计划份额进入下一个运作期。

§ 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 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）		
	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C
1. 本期已实现收益	116,463.93	28,630.96	38,046.54
2. 本期利润	149,021.91	26,721.93	51,480.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0054	0.0036	0.0048
4. 期末基金资产净值	29,075,913.69	8,632,870.17	10,740,521.55
5. 期末基金份额净值	1.0842	1.0842	1.0745

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

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 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	0.48%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.61%	0.08%
过去六个月	0.97%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.16%	0.08%
过去一年	1.86%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.68%	0.07%
自基金合同	8.42%	0.07%	9.78%	0.03%	-1.36%	0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 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	0.48%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.61%	0.08%
过去六个月	0.97%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.16%	0.08%
过去一年	1.89%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.65%	0.07%
自基金合同 生效起至今	8.39%	0.07%	9.72%	0.03%	-1.33%	0.04%

安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C 净值表现

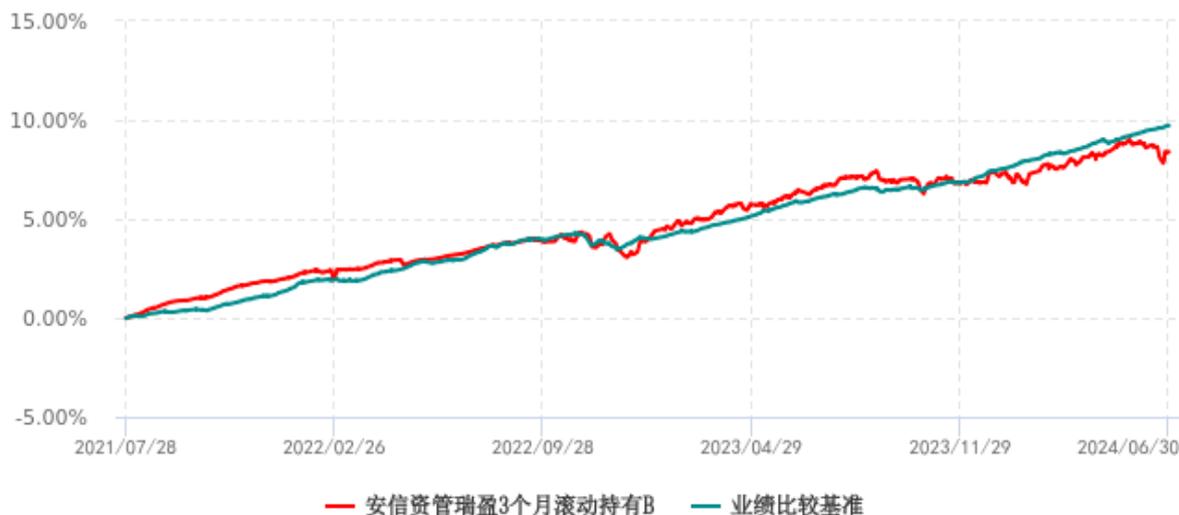
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.41%	0.11%	1.09%	0.03%	-0.68%	0.08%
过去六个月	0.82%	0.10%	2.13%	0.02%	-1.31%	0.08%
过去一年	1.56%	0.09%	3.54%	0.02%	-1.98%	0.07%
自基金合同 生效起至今	7.42%	0.07%	9.72%	0.03%	-2.30%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信资管瑞盈3个月滚动持有A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年07月23日-2024年06月30日)

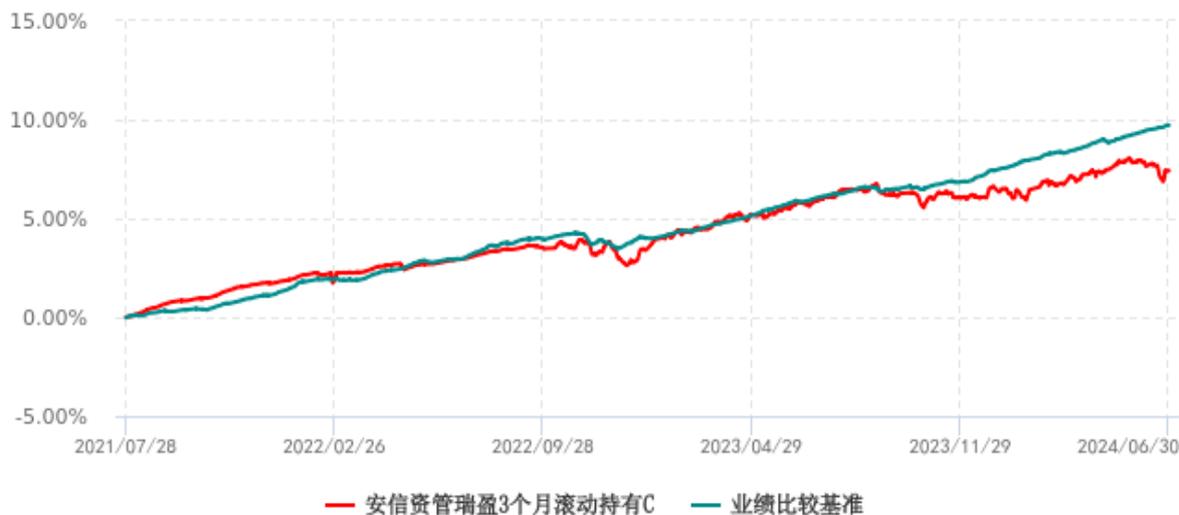


安信资管瑞盈3个月滚动持有B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年07月28日-2024年06月30日)



注: 安信瑞盈 3 个月滚动持有债券 B (970059) 2021 年 7 月 23 日尚未开放申赎, 无计划份额, 2021 年 7 月 23 日净值不进行披露。

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



注: 安信瑞盈 3 个月滚动持有债券 C (970060) 2021 年 7 月 23 日尚未开放申赎, 无计划份额, 2021 年 7 月 23 日净值不进行披露。

§ 4 管理人报告

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

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

二季度，从全球范围来看，由于美国经济韧性仍在，叠加美股节节新高，因此美联储一再推迟降息，带动美元指数持续走高，并使得全球货币陆续贬值，其中以日元首当其冲。在此背景下，人民币汇率虽然承压，但贬值幅度并不明显，其原因在于国内虽然有出口、就业等多重压力，但决策层并未施行“大水漫灌”的财政政策，而是以“紧衣缩食”来应对内外部矛盾。

此时国内面对的矛盾主要是三重：人民币全球化与传统全球格局的矛盾、政策维持汇率稳定与对冲经济总量下行的矛盾、传统经济动能衰退与新经济孱弱的矛盾。在这三重矛盾之下，二季度政策仍然以稳健的结构性政策为主，部分地区放松地产限购政策但并未有效带动房地产销售。

市场方面，二季度的地产持续出台在季度初提高了市场预期，股票继续延续一季度的修复态势持续走高，债券则出现了一定程度的调整。但由于现实不及预期，转债继续恢复疲软的下跌趋势，与此同时，债券利率则重新开始下行。整体来看，二季度债券和转债均表现为震荡走势，值得注意的是二季度转债的信用风险有一定程度的暴露。

二、市场展望与操作

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

债券市场方面，预计下半年收益率大概率将保持低位窄幅震荡。转债方面，未来资金流困难的小型民营企业转债出险的频率将持续增加。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A 基金份额净值为 1.0842 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%；截至报告期末安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B 基金份额净值为 1.0842 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%；截至报告期末安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C 基金份额净值为 1.0745 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%。

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 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,435,205.79	79.48
	其中：债券	39,435,205.79	79.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	4,569,384.04	9.21
8	其他资产	5,614,384.32	11.32
9	合计	49,618,974.15	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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

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	019739	24 国债 08	50,000	5,041,023.29	10.40
2	149576	21 深投 03	40,000	4,227,626.85	8.73
3	102381678	23 豫航空港 MTN009A	40,000	4,211,269.95	8.69
4	188935	21 豫峡 02	40,000	4,204,940.27	8.68
5	102383369	23 即墨城投 MTN001	40,000	4,141,659.02	8.55

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

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

本集合计划投资国城转债投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,312.70
2	应收证券清算款	5,601,371.62
3	应收股利	-
4	应收利息	11,600.00
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,614,384.32

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

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未持有股票。

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

	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 A	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 B	安信资管瑞盈 3 个月滚动持有 C
报告期期初基金份额总额	27,996,519.44	3,028,599.58	11,303,266.44
报告期期间基金总申购份额	-	5,082,626.33	1,117,471.53
减：报告期期间基金总赎回份额	1,178,774.00	148,858.04	2,424,948.96
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	26,817,745.44	7,962,367.87	9,995,789.01

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

	安信资管瑞盈 3 个月 滚动持有 A	安信资管瑞盈 3 个月 滚动持有 B	安信资管瑞盈 3 个月 滚动持有 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	1,399,225.65	-
报告期期间买入/申购总份额	-	5,082,617.13	-
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	-	6,481,842.78	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	81.41	-

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	2024-04-11	5,082,617.13	5,500,000.00	-
合计			5,082,617.13	5,500,000.00	

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、安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 2、安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议；
- 3、安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、安信资管瑞盈 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

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。

安信证券资产管理有限公司

二〇二四年七月十九日