

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信永利信用债券	
基金主代码	000310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 8 日	
报告期末基金份额总额	46,635,276.57 份	
投资目标	在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	封闭期内，在久期配置上，预测利率和收益率的变动，合理匹配投资组合久期和封闭期；在品种配置上，基于宏观基本面研究，分析多种因素，合理配置不同债券的构成比例；在信用投资上，依据内外评级结果，建立信用债券的投资库，并进行动态调整和维护；在可转债投资上，合理估值，投资价值低估的可转债；在资产支持证券的投资上，重点关注基础资产的类型、发行条款、提前偿还率和市场流动性等因素，综合评估。开放期内，主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的流动性，减小净值的波动。	
业绩比较基准	1.5×1 年期银行定期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信永利信用债券 A	安信永利信用债券 C
下属分级基金的交易代码	000310	000335
报告期末下属分级基金的份额总额	38,759,393.49 份	7,875,883.08 份

§ 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	安信永利信用债券 A	安信永利信用债券 C
1. 本期已实现收益	1,316,124.89	254,788.95
2. 本期利润	1,039,510.59	199,198.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0268	0.0253
4. 期末基金资产净值	49,127,496.49	9,874,879.00
5. 期末基金份额净值	1.267	1.254

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所示数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、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

安信永利信用债券 A

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	2.10%	0.09%	0.57%	0.01%	1.53%	0.08%
过去六个月	4.28%	0.09%	1.13%	0.01%	3.15%	0.08%
过去一年	9.51%	0.11%	2.25%	0.01%	7.26%	0.10%
过去三年	21.48%	0.10%	6.76%	0.01%	14.72%	0.09%
过去五年	29.88%	0.10%	11.26%	0.01%	18.62%	0.09%
自基金合同生效起至今	74.62%	0.14%	21.24%	0.01%	53.38%	0.13%

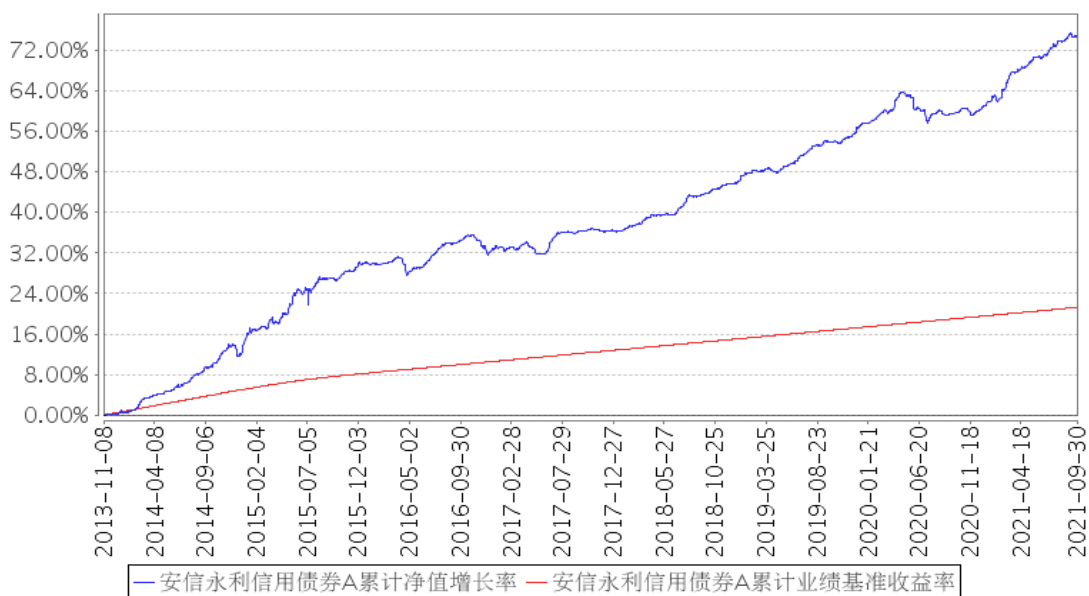
安信永利信用债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

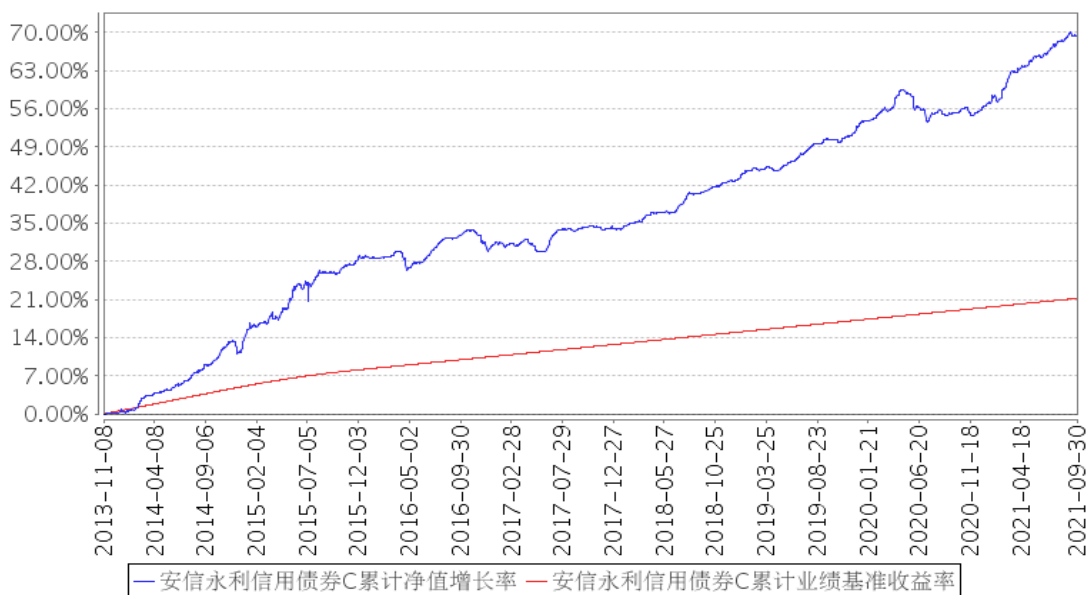
				④		
过去三个月	2.03%	0.09%	0.57%	0.01%	1.46%	0.08%
过去六个月	4.15%	0.09%	1.13%	0.01%	3.02%	0.08%
过去一年	9.14%	0.11%	2.25%	0.01%	6.89%	0.10%
过去三年	20.19%	0.10%	6.76%	0.01%	13.43%	0.09%
过去五年	27.46%	0.10%	11.26%	0.01%	16.20%	0.09%
自基金合同生效起至今	69.40%	0.14%	21.24%	0.01%	48.16%	0.13%

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

安信永利信用债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信永利信用债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、本基金合同生效日为 2013 年 11 月 8 日。
- 2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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		
李君	本基金的基金经理，混合资产投资部副总经理	2017年12月26日	-	16年	李君先生，管理学硕士。历任光大证券研究所研究部行业分析师，国信证券研究所研究部高级行业分析师，上海泽熙投资管理有限公司投资研究部投资研究员，太和先机资产管理有限公司投资研究部研究总监，东方睿德（上海）投资管理有限公司股权投资部投资总监，上海东证橡睿投资管理有限公司投资部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部副总经理。曾任安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信目标收益债券型证券投资基金、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信中短利率债券型证券投资基金（LOF）、安信尊享纯债债券型证券投资基金的基金经理；现任安信永利信用定期开

					放债券型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
黄琬舒	本基金的基金经理	2021 年 4 月 2 日	-	6 年	黄琬舒女士，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司集中交易部债券交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部基金经理。现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理，安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度，央行进行“降准”操作，而经济基本面数据回落情况略超市场预期，消费受疫情反复影响表现低迷，投资受基建和地产拖累增速放缓，仅出口方面维持较高景气度。期间，央行公开市场操作方面维持稳健，债券市场整体先有所上涨，后维持震荡状态。报告期内，基于对信用风险的谨慎，本基金纯债部分进一步向高评级优质国企信用债集中。另一方面，可转债市场估值中枢继续上移，我们认为，这一估值中枢的变化，与同期股票市场的走势联动，也与市场参与者的乐观情绪相关。部分股票本身没有明显上涨的情况下，我们也时而观察到其所对应转债定价的上升，这意味着隐含风险收益比的下降。本基金从可转债标的的定价出发，对投资组合进行调整，季度内，总体转债持仓比例略有下降，并根据定价状况，对个券的持仓比例进行调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.267 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.10%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.254 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.03%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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	85,665,586.50	95.36
	其中：债券	85,665,586.50	95.36
	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	2,869,438.36	3.19
8	其他资产	1,298,487.17	1.45
9	合计	89,833,512.03	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

本基金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

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,257,000.00	102.13
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,247,694.00	2.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,864,096.40	40.45
8	同业存单	-	-

9	地方政府债	296,796.10	0.50
10	其他	-	-
11	合计	85,665,586.50	145.19

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	175122	20 中金 07	50,000	5,073,000.00	8.60
2	163756	20 国君 G4	50,000	5,049,000.00	8.56
3	175534	20 华泰 G8	50,000	5,044,500.00	8.55
4	149173	20 申证 06	50,000	5,042,500.00	8.55
5	149326	20 国信 04	50,000	5,038,500.00	8.54
5	155830	19 海通 02	50,000	5,038,500.00	8.54

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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券除 20 信投 G1（证券代码：163222 SH）、21 银河 G5（证券代码：188399 SH）、20 中金 07（证券代码：175122 SH）、21 招证 G1（证券代码：175637 SH）、20 申证 06（证券代码：149173 SZ）、20 华泰 G8（证券代码：175534 SH）、19 海通 02（证券代码：155830 SH）、20 国信 04（证券代码：149326 SZ）、20 国君 G4（证券代码：163756 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 11 月 30 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证监局责令改正【北京证监局（2020）176 号】。

2020 年 12 月 31 日，中信建投证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证监会责令改正。

2021 年 4 月 6 日，中信建投证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证监会监管（约见）谈话。

2021 年 8 月 5 日，中国银河证券股份有限公司因未经著作权人许可，通过信息网络向公众传播其文章《自贸港负面清单彰显推进高水平开放决心》被北京市文化和旅游局警告、罚款人民币贰仟 2000 元【（京）文执罚（2021）第 500023 号】。

2021 年 12 月 31 日，中国国际金融股份有限公司因内部制度不完善被中国证监会通知整改。

2021 年 1 月 20 日，中国国际金融股份有限公司因未依法履行职责被中国证监会警示。

2021 年 7 月 19 日，中国国际金融股份有限公司因违反反洗钱法被人行中国人民银行营管部罚款 185.80 万元【银管罚（2021）19 号】。

2021 年 6 月 4 日，招商证券股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行深圳市中心支行罚款 173 万元【深人银罚（2021）10 号】。

2020 年 11 月 20 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所债券业务中心警示【上证债监[2020]45 号】。

2020 年 11 月 25 日，申万宏源证券有限公司因未依法履行职责被上海证监局通知整改【沪证监决[2020]168 号】。

2021 年 4 月，申万宏源证券有限公司因内部制度不完善、未依法履行职责被重庆证监局警示【中国证券监督管理委员会重庆监管局行政监督管理措施决定书（2021）12 号】。

2020 年 11 月 24 日，华泰证券股份有限公司因未依法履行职责被江苏证监局警示【江苏证监局[2020]112 号】。

2020 年 12 月 30 日，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证监会警示。

2021 年 1 月 8 日，海通证券股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则、内控管

理不到位被中国银行间市场交易商协会警告,通知整改。

2021 年 9 月 9 日,海通证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证监会立案调查【证监立案字 0152021022 号、证监调查字 0152021061 号】。

2021 年 9 月 29 日,海通证券股份有限公司因未履行职责被重庆证监局没收违法所得,整改通知,罚款 400 万元【重庆证监局处罚字[2021]5 号】。

2021 年,海通证券股份有限公司因未依法履行职责、内部制度不完善被上海证监局诫勉谈话、警示、暂停或取消相关资格【沪证监决[2021]40 号、沪证监决[2021]41 号】。

2021 年 7 月 5 日,国信证券股份有限公司因违规经营,短线交易被中国银行间市场交易商协会诫勉谈话,通知整改。

2020 年 11 月 25 日,国泰君安证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证监局警示【沪证监决[2020]173 号】。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库,本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,909.18
2	应收证券清算款	500,402.19
3	应收股利	-
4	应收利息	795,175.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,298,487.17

5.10.4 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	132008	17 山高 EB	3,156,600.00	5.35
2	132007	16 凤凰 EB	3,145,500.00	5.33
3	113042	上银转债	2,959,155.00	5.02
4	110059	浦发转债	2,930,262.00	4.97
5	132011	17 浙报 EB	2,032,030.00	3.44
6	113037	紫银转债	1,865,974.00	3.16

7	132004	15 国盛 EB	1,551,900.00	2.63
8	113021	中信转债	512,832.00	0.87
9	128118	瀛通转债	358,802.00	0.61
10	113530	大丰转债	327,270.00	0.55
11	113567	君禾转债	285,922.00	0.48
12	113044	大秦转债	274,352.00	0.46
13	128049	华源转债	257,862.50	0.44
14	113599	嘉友转债	251,856.00	0.43
15	123077	汉得转债	204,212.00	0.35
16	113561	正裕转债	197,724.40	0.34
17	113594	淳中转债	196,668.00	0.33
18	128069	华森转债	191,754.00	0.32
19	128132	交建转债	173,247.00	0.29
20	128063	未来转债	172,500.00	0.29
21	123062	三超转债	172,335.00	0.29
22	128129	青农转债	162,135.00	0.27
23	113524	奇精转债	130,320.00	0.22
24	123072	乐歌转债	118,620.00	0.20
25	123045	雷迪转债	114,590.00	0.19
26	128139	祥鑫转债	112,240.00	0.19
27	128070	智能转债	110,050.00	0.19
28	123088	威唐转债	108,830.00	0.18
29	113566	翔港转债	108,612.90	0.18
30	128117	道恩转债	105,820.00	0.18
31	110064	建工转债	105,510.00	0.18
32	113604	多伦转债	104,990.00	0.18
33	127016	鲁泰转债	104,403.70	0.18
34	123076	强力转债	104,120.00	0.18
35	128125	华阳转债	103,640.00	0.18
36	123065	宝莱转债	98,955.00	0.17
37	113565	宏辉转债	98,802.00	0.17
38	123056	雪榕转债	95,240.60	0.16
39	113591	胜达转债	93,024.00	0.16
40	113608	威派转债	92,488.00	0.16
41	123039	开润转债	88,184.00	0.15
42	113597	佳力转债	76,734.00	0.13
43	123059	银信转债	66,750.00	0.11
44	128123	国光转债	63,750.00	0.11
45	113519	长久转债	62,280.40	0.11
46	113619	世运转债	33,352.90	0.06
47	113574	华体转债	32,454.00	0.06
48	128143	锋龙转债	23,622.00	0.04

49	113546	迪贝转债	22,540.00	0.04
----	--------	------	-----------	------

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信永利信用债券 A	安信永利信用债券 C
报告期期初基金份额总额	38,759,393.49	7,875,883.08
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	38,759,393.49	7,875,883.08

§ 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

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永利信用定期开放债券型证券投资基金募集的文件；

- 2、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2021 年 10 月 26 日