

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 1 月 19 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2024年1月18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2023年10月1日起至12月31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	166,664,845.05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。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
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	160,905,568.66 份	5,759,276.39 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 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	1,044,902.95	28,938.41
2. 本期利润	992,894.14	27,098.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0047
4. 期末基金资产净值	219,633,921.80	7,706,005.36
5. 期末基金份额净值	1.3650	1.3380

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列数字；

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

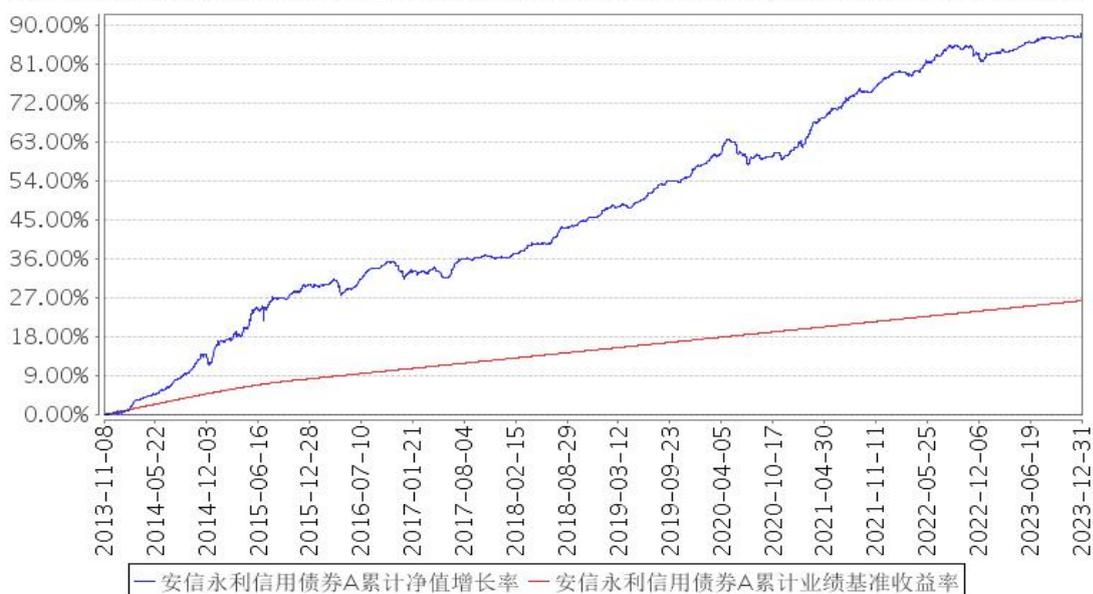
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.44%	0.05%	0.57%	0.01%	-0.13%	0.04%
过去六个月	1.19%	0.05%	1.13%	0.01%	0.06%	0.04%
过去一年	3.02%	0.06%	2.25%	0.01%	0.77%	0.05%
过去三年	16.77%	0.09%	6.75%	0.01%	10.02%	0.08%
过去五年	28.86%	0.09%	11.26%	0.01%	17.60%	0.08%
自基金合同生效起至今	88.13%	0.13%	26.31%	0.01%	61.82%	0.12%

安信永利信用债券 C

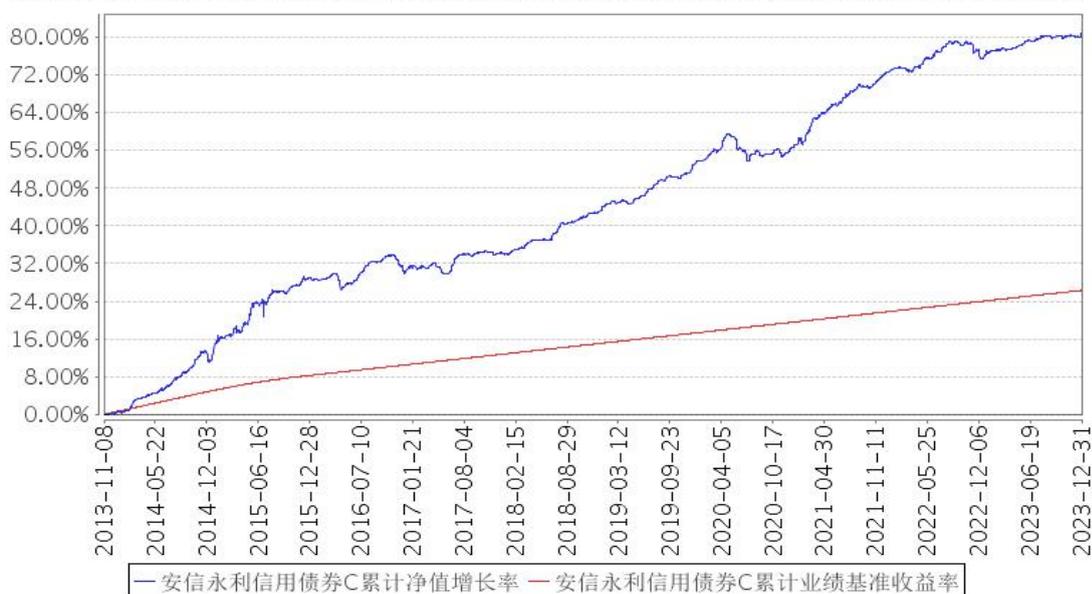
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.38%	0.05%	0.57%	0.01%	-0.19%	0.04%
过去六个月	0.98%	0.05%	1.13%	0.01%	-0.15%	0.04%
过去一年	2.61%	0.06%	2.25%	0.01%	0.36%	0.05%
过去三年	15.44%	0.09%	6.75%	0.01%	8.69%	0.08%
过去五年	26.45%	0.09%	11.26%	0.01%	15.19%	0.08%
自基金合同生效起至今	80.75%	0.13%	26.31%	0.01%	54.44%	0.12%

### 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，混合资产投资部总经理	2017年12月26日	-	18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、混合资产投资部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部总经理。现任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、安信稳健聚申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、安信稳健汇利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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、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）、安信稳健增益 6 个月持有期混合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

四季度，在经济基本面表现不及预期以及“地方政府化债”的政策背景下，宽财政力度有所加强，地方政府债券发行提速，市场流动性的波动性有所加大。受经济基本面及债券市场供需关系的影响，债券市场收益率整体以下行为主，短端收益率先上后下，信用债表现优于利率债。

期间，本基金的纯债部分主要投资于高等级金融债以及国股行同业存单，并适时提高了组合杠杆。转债估值显著下降后，逐步进入“双重保护”阶段。一重保护是，部分转债对应的正股本身估值处于低位，显示出性价比，二重保护是，转债本身 YTM 也显著提升。这样的双重保护下，我们择机提升了可转债持仓比例。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信永利信用债券 A 基金份额净值为 1.3650 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.44%；安信永利信用债券 C 基金份额净值为 1.3380 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.38%；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	348,982,254.61	98.67
	其中：债券	348,982,254.61	98.67
	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	4,664,718.21	1.32
8	其他资产	29,602.93	0.01
9	合计	353,676,575.75	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。

### 5.4 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	182,825,612.06	80.42
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	39,194.46	0.02
5	企业短期融资券	40,510,118.03	17.82
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	85,778,213.01	37.73
8	同业存单	39,829,117.05	17.52
9	其他	-	-
10	合计	348,982,254.61	153.51

### 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	185316	22 上证 01	200,000	20,518,254.25	9.03
2	185285	22 海通 01	200,000	20,482,746.30	9.01
3	188035	21 中财 G3	200,000	20,457,265.75	9.00
4	072310113	23 华宝证券 CP004	200,000	20,341,626.23	8.95
5	188418	21 兴业 03	200,000	20,293,644.93	8.93

### 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 22 海通 01（代码：185285 SH）、23 华宝证券 CP004（代码：072310113 CY）、21 兴业 03（代码：188418 SH）、21 中银 01（代码：188804 SH）、23 平安证券 CP009（代码：072310166 CY）、22 宁证 02（代码：137701 SH）、23 招 S17（代码：240293 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。

#### 1. 海通证券股份有限公司

2023 年 5 月 31 日，海通证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会上海监管局警示。

2023 年 6 月 16 日，海通证券股份有限公司因内部制度不完善被上海证券交易所警示。

2023 年 11 月 9 日，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会出具警示函。

2023 年 11 月 17 日，海通证券股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被中国证券监督管理委员会湖北监管局出具警示函。

2023 年 11 月 21 日，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所警示。

#### 2. 华宝证券股份有限公司

2023 年 2 月 16 日，华宝证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券业协会要求提交书面承诺。

2023 年 7 月 17 日，华宝证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函。

2023 年 12 月 11 日，华宝证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会上海监管局责令改正、限制从事相关经营活动。

2023 年 12 月 15 日，华宝证券股份有限公司因内部制度不完善、开展业务不规范被中国证券监督管理委员会上海监管局责令改正、限制从事相关经营活动。

### 3. 兴业银行股份有限公司

2023 年 1 月 18 日，兴业银行股份有限公司因违反银行间债券市场相关自律管理规则被中国银行间市场交易商协会警告。

2023 年 5 月 8 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会福建监管局责令改正。

2023 年 10 月 31 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

### 4. 中银国际证券股份有限公司

2023 年 2 月 6 日，中银国际证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管警示。

### 5. 平安证券股份有限公司

2023 年 10 月 9 日，平安证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

### 6. 南京证券股份有限公司

2023 年 10 月 24 日，南京证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市长宁区税务局第十三税务所责令改正。

### 7. 招商证券股份有限公司

2023 年 6 月 8 日，招商证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2023 年 9 月 11 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

## 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	29,602.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,602.93

#### 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	128035	大族转债	16,921,593.30	7.44
2	113052	兴业转债	16,899,894.31	7.43
3	110043	无锡转债	9,989,105.66	4.39
4	128129	青农转债	5,206,362.04	2.29
5	113037	紫银转债	5,186,806.36	2.28
6	113516	苏农转债	4,546,756.70	2.00
7	118020	芳源转债	472,113.30	0.21
8	118000	嘉元转债	434,580.53	0.19
9	113624	正川转债	421,334.75	0.19
10	127075	百川转 2	404,356.21	0.18
11	123198	金埔转债	353,735.27	0.16
12	123128	首华转债	352,616.69	0.16
13	127060	湘佳转债	350,283.55	0.15
14	113600	新星转债	348,996.33	0.15
15	123168	惠云转债	348,488.35	0.15
16	123190	道氏转 02	341,912.66	0.15
17	113608	威派转债	340,392.34	0.15
18	118029	富淼转债	340,317.61	0.15
19	113665	汇通转债	338,746.68	0.15
20	123146	中环转 2	337,198.59	0.15
21	113649	丰山转债	335,544.00	0.15
22	113640	苏利转债	334,914.37	0.15
23	123144	裕兴转债	334,109.36	0.15
24	118023	广大转债	325,302.76	0.14
25	123151	康医转债	297,006.21	0.13
26	118005	天奈转债	291,303.08	0.13
27	113048	晶科转债	280,578.52	0.12
28	113653	永 22 转债	274,192.29	0.12
29	110092	三房转债	249,054.04	0.11
30	127087	星帅转 2	237,623.36	0.10

31	127043	川恒转债	236,934.59	0.10
32	113627	太平转债	236,258.32	0.10
33	113654	永 02 转债	235,319.47	0.10
34	127066	科利转债	234,794.66	0.10
35	113632	鹤 21 转债	233,889.58	0.10
36	123106	正丹转债	233,653.56	0.10
37	123133	佩蒂转债	232,596.93	0.10
38	111010	立昂转债	232,350.07	0.10
39	127081	中旗转债	232,231.78	0.10
40	111001	山玻转债	231,652.16	0.10
41	127051	博杰转债	231,625.95	0.10
42	123165	回天转债	231,338.98	0.10
43	113647	禾丰转债	231,246.28	0.10
44	110085	通 22 转债	230,940.26	0.10
45	123183	海顺转债	230,853.41	0.10
46	127031	洋丰转债	230,780.33	0.10
47	128144	利民转债	230,341.75	0.10
48	123093	金陵转债	230,269.89	0.10
49	113046	金田转债	229,801.81	0.10
50	113059	福莱转债	229,559.77	0.10
51	123159	崧盛转债	229,457.36	0.10
52	113659	莱克转债	229,436.31	0.10
53	118006	阿拉转债	228,864.24	0.10
54	123115	捷捷转债	228,689.60	0.10
55	127017	万青转债	228,674.39	0.10
56	127074	麦米转 2	228,515.34	0.10
57	127042	嘉美转债	228,475.71	0.10
58	127024	盈峰转债	228,446.47	0.10
59	110089	兴发转债	228,245.47	0.10
60	113644	艾迪转债	228,209.34	0.10
61	113668	鹿山转债	227,985.93	0.10
62	118031	天 23 转债	227,901.47	0.10
63	110086	精工转债	227,648.47	0.10
64	113054	绿动转债	227,595.88	0.10
65	123166	蒙泰转债	227,465.92	0.10
66	110087	天业转债	227,235.49	0.10
67	123193	海能转债	226,772.38	0.10
68	113657	再 22 转债	226,743.33	0.10
69	113655	欧 22 转债	226,359.07	0.10
70	123156	博汇转债	226,354.78	0.10
71	127068	顺博转债	226,351.26	0.10
72	118032	建龙转债	226,324.00	0.10

73	123155	中陆转债	225,998.42	0.10
74	123185	能辉转债	225,959.55	0.10
75	113670	金 23 转债	225,951.62	0.10
76	118026	利元转债	225,556.23	0.10
77	127044	蒙娜转债	225,553.50	0.10
78	118034	晶能转债	225,465.36	0.10
79	123161	强联转债	225,250.04	0.10
80	111009	盛泰转债	225,053.18	0.10
81	123132	回盛转债	224,810.90	0.10
82	123091	长海转债	224,786.35	0.10
83	128117	道恩转债	224,713.45	0.10
84	123179	立高转债	224,694.25	0.10
85	123186	志特转债	224,402.91	0.10
86	127083	山路转债	224,210.72	0.10
87	113636	甬金转债	223,786.16	0.10
88	127062	垒知转债	221,914.74	0.10
89	123180	浙矿转债	221,852.29	0.10
90	118013	道通转债	221,810.13	0.10
91	113666	爱玛转债	221,592.56	0.10
92	123169	正海转债	217,956.34	0.10
93	113650	博 22 转债	217,850.20	0.10
94	123149	通裕转债	215,830.95	0.09
95	118033	华特转债	214,939.72	0.09
96	123071	天能转债	201,528.14	0.09
97	111014	李子转债	145,768.34	0.06
98	128125	华阳转债	139,861.27	0.06
99	123126	瑞丰转债	136,264.73	0.06
100	123154	火星转债	134,379.11	0.06
101	113065	齐鲁转债	130,440.61	0.06
102	123039	开润转债	123,077.07	0.05
103	118008	海优转债	122,697.99	0.05
104	118010	洁特转债	111,141.78	0.05
105	113593	沪工转债	103,673.96	0.05
106	127059	永东转 2	68,338.69	0.03
107	123056	雪榕转债	67,894.93	0.03
108	128116	瑞达转债	62,971.59	0.03
109	113606	荣泰转债	60,729.42	0.03
110	123184	天阳转债	53,935.53	0.02
111	113625	江山转债	9,951.04	0.00
112	123104	卫宁转债	6,831.47	0.00
113	113056	重银转债	1,022.99	0.00

### 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	160,905,568.66	5,759,276.39
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	160,905,568.66	5,759,276.39

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20231001-20231231	43,400,480.45	-	-	43,400,480.45	26.04
	2	20231001-20231231	74,793,567.69	-	-	74,793,567.69	44.88

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：（1）基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受

基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 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

2024 年 1 月 19 日