

安信永利信用定期开放债券型证券投资基  
金  
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 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：2024 年 7 月 18 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 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 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	48,462,197.13 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	27,405,800.23 份	21,056,396.90 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 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	380,866.82	258,081.08
2. 本期利润	455,292.61	314,167.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0166	0.0150
4. 期末基金资产净值	38,021,465.45	28,578,127.12
5. 期末基金份额净值	1.3874	1.3572

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

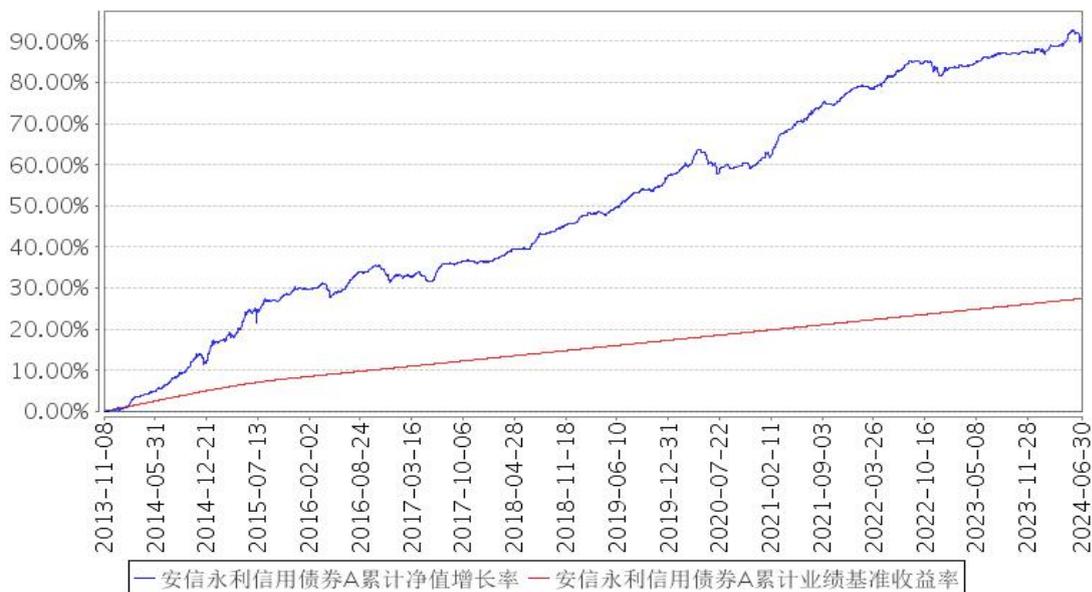
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.22%	0.16%	0.56%	0.01%	0.66%	0.15%
过去六个月	1.64%	0.13%	1.12%	0.01%	0.52%	0.12%
过去一年	2.85%	0.10%	2.26%	0.01%	0.59%	0.09%
过去三年	11.80%	0.09%	6.76%	0.01%	5.04%	0.08%
过去五年	26.94%	0.10%	11.26%	0.01%	15.68%	0.09%
自基金合同生效起至今	91.21%	0.13%	27.43%	0.01%	63.78%	0.12%

安信永利信用债券 C

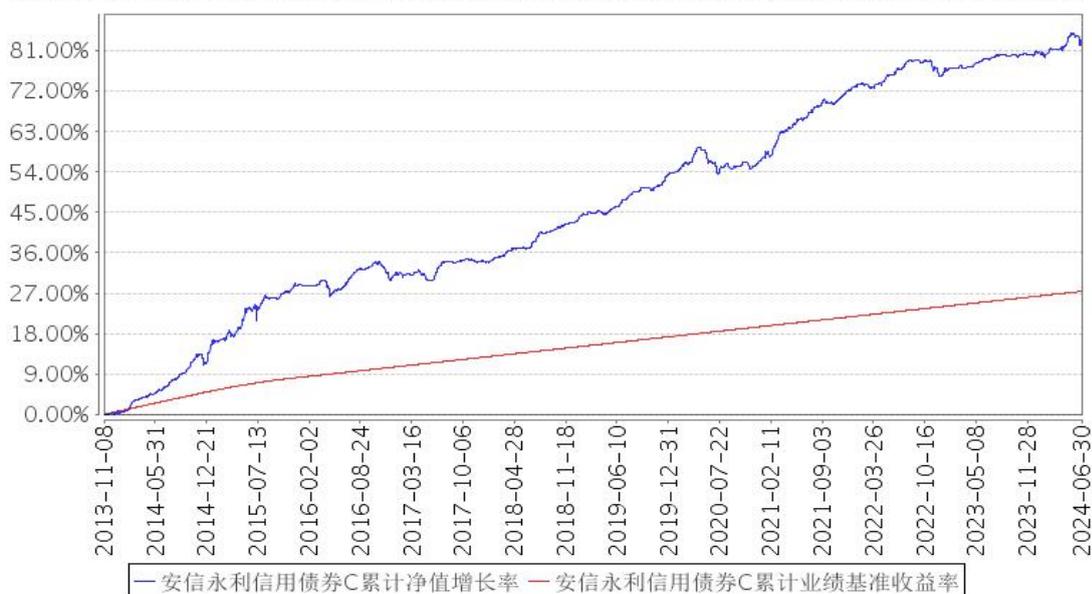
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.11%	0.16%	0.56%	0.01%	0.55%	0.15%
过去六个月	1.43%	0.13%	1.12%	0.01%	0.31%	0.12%
过去一年	2.43%	0.10%	2.26%	0.01%	0.17%	0.09%
过去三年	10.43%	0.09%	6.76%	0.01%	3.67%	0.08%
过去五年	24.63%	0.10%	11.26%	0.01%	13.37%	0.09%
自基金合同生效起至今	83.35%	0.13%	27.43%	0.01%	55.92%	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		
黄琬舒	本基金的基金经理	2024 年 4 月 11 日	-	9 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、安信民稳增长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、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信恒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、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信长鑫增强债券

					型证券投资基金的基金经理助理；安信目标收益债券型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信中短利率债券型证券投资基金（LOF）、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
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	2024年4月11日	19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、安信长鑫增强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遵规守信情况的说明

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

在纯债方面，本季度的国内经济基本面情况保持平稳，生产端表现稳中偏强而需求端表现整体仍然偏弱。地产投资方面持续磨底，地产新政的效果有待进一步观察，而制造业 PMI 显示经济回升的基础仍需加强。资本市场方面，权益市场阶段性波动较大，资金风险偏好持续降低，受供求因素影响，债券市场持续走牛，债券收益率持续下行，短端收益率下行幅度大于长端，曲线走陡。转债方面，本季度中证转债指数上涨 0.75%，但先涨后跌，振幅达到 5.52%。前半段转债市场成交量持续提升，或与增量资金的配置行为有关；6 月之后，市场逐步显现出“信用分层”的现象，信用资质好的转债走势保持平稳或持续上涨，而信用资质较差的标的整体表现不佳，也有部分标的在这个过程中或被“错杀”。期间，本基金在综合考虑之下，积极管理了可转债的仓位。纯债部分主要持有了高等级信用债，并在大多数时候维持了偏低的组合久期。总体而言，本基金本季度以较稳健的方式获得了一定的收益。

### 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 1.3874 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.22%；安信永利信用债券 C 基金份额净值为 1.3572 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%；同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

### 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	81,495,780.87	97.83
	其中：债券	81,495,780.87	97.83
	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	400,000.00	0.48
	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	1,384,660.16	1.66
8	其他资产	20,951.38	0.03
9	合计	83,301,392.41	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	37,139,434.52	55.77
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	29,175.94	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,327,170.41	66.56

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,495,780.87	122.37

### 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	110059	浦发转债	60,900	6,715,770.02	10.08
2	113042	上银转债	57,420	6,527,132.76	9.80
3	113052	兴业转债	60,150	6,509,292.92	9.77
4	175280	20 中财 G3	60,000	6,302,939.18	9.46
5	115648	23 招证 G6	60,000	6,200,067.62	9.31

### 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上银转债（代码：113042 SH）、兴业转债（代码：113052 SH）、20 中财 G3（代码：175280 SH）、23 招证 G6（代码：115648 SH）、22 平证 05（代码：137563 SH）、23 国君 G2（代码：138807 SH）、23 中银 01（代码：115094 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. 上海银行股份有限公司

2023 年 11 月 17 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款、责令改正。

2023 年 11 月 27 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局上海市分局罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 29 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局上海监管局罚款。

2024 年 6 月 7 日，上海银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局上海监管局罚款。

#### 2. 兴业银行股份有限公司

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。

2024 年 1 月 22 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。

#### 3. 中国中金财富证券有限公司

2024 年 5 月 29 日，中国中金财富证券有限公司因涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会自律调查。

#### 4. 招商证券股份有限公司

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。

2024 年 2 月 2 日，招商证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会安徽监管局出具警示函。

2024 年 2 月 9 日，招商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责令合规检查与报告。

2024 年 4 月 30 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通报批评。

#### 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。

2024 年 2 月 8 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出具警示函。

2024 年 6 月 12 日，平安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。

6. 国泰君安证券股份有限公司

2023 年 11 月 27 日，国泰君安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。

2024 年 1 月 8 日，国泰君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出具警示函。

2024 年 1 月 24 日，国泰君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安徽监管局出具警示函。

7. 中银国际证券股份有限公司

2024 年 5 月 8 日，中银国际证券股份有限公司因未依法履行职责被全国中小企业股份转让系统有限责任公司要求提交书面承诺。

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股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,951.38
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	20,951.38

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	110059	浦发转债	6,715,770.02	10.08
2	113042	上银转债	6,527,132.76	9.80

3	113052	兴业转债	6,509,292.92	9.77
4	113037	紫银转债	3,114,018.91	4.68
5	128129	青农转债	2,871,355.74	4.31
6	113053	隆 22 转债	999,188.50	1.50
7	118034	晶能转债	601,358.44	0.90
8	110085	通 22 转债	571,141.87	0.86
9	113059	福莱转债	432,588.82	0.65
10	127089	晶澳转债	273,420.16	0.41
11	110081	闻泰转债	270,549.13	0.41
12	113661	福 22 转债	266,951.84	0.40
13	113633	科沃转债	257,259.91	0.39
14	113048	晶科转债	220,200.96	0.33
15	123179	立高转债	218,711.64	0.33
16	128135	洽洽转债	213,427.13	0.32
17	123113	仙乐转债	213,400.00	0.32
18	123160	泰福转债	206,286.59	0.31
19	118042	奥维转债	202,948.73	0.30
20	113666	爱玛转债	199,727.98	0.30
21	113606	荣泰转债	199,445.72	0.30
22	123154	火星转债	182,684.03	0.27
23	113605	大参转债	180,362.27	0.27
24	113644	艾迪转债	176,560.38	0.27
25	111016	神通转债	173,735.98	0.26
26	118011	银微转债	171,281.57	0.26
27	113627	太平转债	167,414.44	0.25
28	118039	煜邦转债	161,336.78	0.24
29	123180	浙矿转债	160,637.27	0.24
30	118006	阿拉转债	160,412.36	0.24
31	123104	卫宁转债	159,546.68	0.24
32	127046	百润转债	159,058.03	0.24
33	127040	国泰转债	158,902.95	0.24
34	128125	华阳转债	158,884.00	0.24
35	123165	回天转债	158,775.05	0.24
36	123082	北陆转债	158,589.96	0.24
37	118010	洁特转债	156,604.82	0.24
38	113056	重银转债	154,012.03	0.23
39	113655	欧 22 转债	146,895.84	0.22
40	123152	润禾转债	146,753.20	0.22
41	111014	李子转债	146,462.24	0.22
42	118014	高测转债	146,401.64	0.22
43	123039	开润转债	146,142.31	0.22
44	127042	嘉美转债	143,635.75	0.22

45	123093	金陵转债	139,406.25	0.21
46	113657	再 22 转债	139,057.50	0.21
47	123149	通裕转债	137,338.39	0.21
48	123121	帝尔转债	136,203.95	0.20
49	118043	福立转债	135,498.11	0.20
50	110082	宏发转债	134,063.01	0.20
51	113542	好客转债	133,612.07	0.20
52	127024	盈峰转债	133,332.19	0.20
53	127082	亚科转债	131,984.47	0.20
54	113643	风语转债	131,923.40	0.20
55	118035	国力转债	130,171.91	0.20
56	111004	明新转债	124,328.69	0.19
57	127087	星帅转 2	123,071.42	0.18
58	118029	富淼转债	121,175.26	0.18
59	113670	金 23 转债	121,093.28	0.18
60	123122	富瀚转债	120,247.52	0.18
61	113597	佳力转债	120,103.76	0.18
62	110076	华海转债	119,462.56	0.18
63	128097	奥佳转债	119,063.95	0.18
64	118005	天奈转债	118,868.77	0.18
65	123169	正海转债	114,589.05	0.17
66	123133	佩蒂转债	114,128.62	0.17
67	118015	芯海转债	113,663.07	0.17
68	123215	铭利转债	112,840.38	0.17
69	127062	垒知转债	111,305.95	0.17
70	123144	裕兴转债	110,889.04	0.17
71	111010	立昂转债	109,564.25	0.16
72	123100	朗科转债	109,286.85	0.16
73	123233	凯盛转债	108,393.81	0.16
74	118040	宏微转债	107,608.83	0.16
75	127078	优彩转债	107,147.23	0.16
76	127051	博杰转债	107,021.24	0.16
77	123214	东宝转债	105,100.27	0.16
78	123211	阳谷转债	101,892.67	0.15
79	118032	建龙转债	99,906.03	0.15
80	123210	信服转债	99,458.79	0.15
81	113640	苏利转债	97,929.04	0.15
82	113650	博 22 转债	96,679.00	0.15
83	123115	捷捷转债	96,561.46	0.14
84	113641	华友转债	95,378.99	0.14
85	123124	晶瑞转 2	95,185.19	0.14
86	123183	海顺转债	94,161.63	0.14

87	123174	精锻转债	93,524.17	0.14
88	113584	家悦转债	93,458.27	0.14
89	111001	山玻转债	93,064.96	0.14
90	123151	康医转债	92,929.20	0.14
91	113649	丰山转债	89,324.48	0.13
92	113664	大元转债	88,854.29	0.13
93	123071	天能转债	87,845.81	0.13
94	123166	蒙泰转债	86,457.93	0.13
95	113676	荣 23 转债	82,778.16	0.12
96	118033	华特转债	82,711.12	0.12
97	123126	瑞丰转债	82,649.92	0.12
98	128131	崇达转 2	82,011.56	0.12
99	118041	星球转债	81,163.33	0.12
100	113624	正川转债	80,497.72	0.12
101	123065	宝莱转债	80,383.36	0.12
102	123120	隆华转债	80,155.04	0.12
103	127031	洋丰转债	79,876.56	0.12
104	127017	万青转债	79,713.17	0.12
105	113677	华懋转债	78,986.50	0.12
106	123109	昌红转债	76,071.04	0.11
107	113660	寿 22 转债	75,803.87	0.11
108	111009	盛泰转债	75,412.32	0.11
109	123185	能辉转债	74,016.47	0.11
110	128130	景兴转债	72,252.43	0.11
111	123187	超达转债	71,739.49	0.11
112	127041	弘亚转债	70,275.59	0.11
113	127066	科利转债	67,637.24	0.10
114	113653	永 22 转债	66,978.92	0.10
115	118024	冠宇转债	66,888.92	0.10
116	118012	微芯转债	66,684.60	0.10
117	118038	金宏转债	64,687.10	0.10
118	118036	力合转债	64,132.57	0.10
119	110093	神马转债	64,092.21	0.10
120	128117	道恩转债	62,163.76	0.09
121	123218	宏昌转债	60,134.72	0.09
122	127079	华亚转债	59,333.01	0.09
123	113656	嘉诚转债	59,145.69	0.09
124	123202	祥源转债	57,001.04	0.09
125	127059	永东转 2	56,399.48	0.08
126	123103	震安转债	54,827.72	0.08
127	123064	万孚转债	53,858.92	0.08
128	123091	长海转债	53,805.44	0.08

129	123224	宇邦转债	53,613.57	0.08
130	128144	利民转债	53,112.99	0.08
131	127085	韵达转债	52,848.49	0.08
132	127025	冀东转债	50,708.13	0.08
133	113608	威派转债	48,126.33	0.07
134	123088	威唐转债	48,113.19	0.07
135	113647	禾丰转债	47,951.98	0.07
136	113654	永 02 转债	47,930.69	0.07
137	113636	甬金转债	47,838.29	0.07
138	127044	蒙娜转债	45,130.22	0.07
139	123076	强力转债	43,718.58	0.07
140	127093	章鼓转债	40,845.90	0.06
141	113047	旗滨转债	40,571.21	0.06
142	113663	新化转债	39,852.97	0.06
143	111003	聚合转债	39,743.30	0.06
144	123197	光力转债	39,484.54	0.06
145	113679	芯能转债	39,302.54	0.06
146	118028	会通转债	39,194.13	0.06
147	123208	孩王转债	38,989.76	0.06
148	123132	回盛转债	34,845.86	0.05
149	123193	海能转债	34,803.97	0.05
150	113618	美诺转债	33,735.15	0.05
151	113616	韦尔转债	33,680.47	0.05
152	113659	莱克转债	33,649.48	0.05
153	127088	赫达转债	33,371.74	0.05
154	123159	崧盛转债	32,551.07	0.05
155	127026	超声转债	32,426.05	0.05
156	113675	新 23 转债	31,301.92	0.05
157	111005	富春转债	27,790.76	0.04
158	113046	金田转债	27,074.33	0.04
159	123195	蓝晓转 02	22,294.34	0.03
160	123067	斯莱转债	20,502.64	0.03
161	127060	湘佳转债	20,476.44	0.03
162	123145	药石转债	20,375.61	0.03
163	111013	新港转债	20,208.92	0.03
164	123108	乐普转 2	20,186.69	0.03
165	128116	瑞达转债	20,027.58	0.03
166	118013	道通转债	19,414.40	0.03
167	110094	众和转债	13,558.88	0.02
168	110089	兴发转债	13,485.48	0.02
169	118044	赛特转债	13,292.21	0.02
170	123235	亿田转债	13,066.49	0.02

171	113638	台 21 转债	6,725.60	0.01
172	113579	健友转债	4,326.09	0.01
173	113671	武进转债	3,660.12	0.01

### 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	28,108,256.52	17,800,768.83
报告期期间基金总申购份额	5,840.06	3,255,848.60
减：报告期期间基金总赎回份额	708,296.35	220.53
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	27,405,800.23	21,056,396.90

## § 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

2024年7月18日