

安信永利信用定期开放债券型证券投资基
金
2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 年 10 月 24 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 10 月 23 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 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	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 7 月 1 日-2024 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	131,578.48	70,566.49
2. 本期利润	734,870.14	523,082.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0268	0.0248
4. 期末基金资产净值	38,756,335.59	29,101,209.46
5. 期末基金份额净值	1.4142	1.3821

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

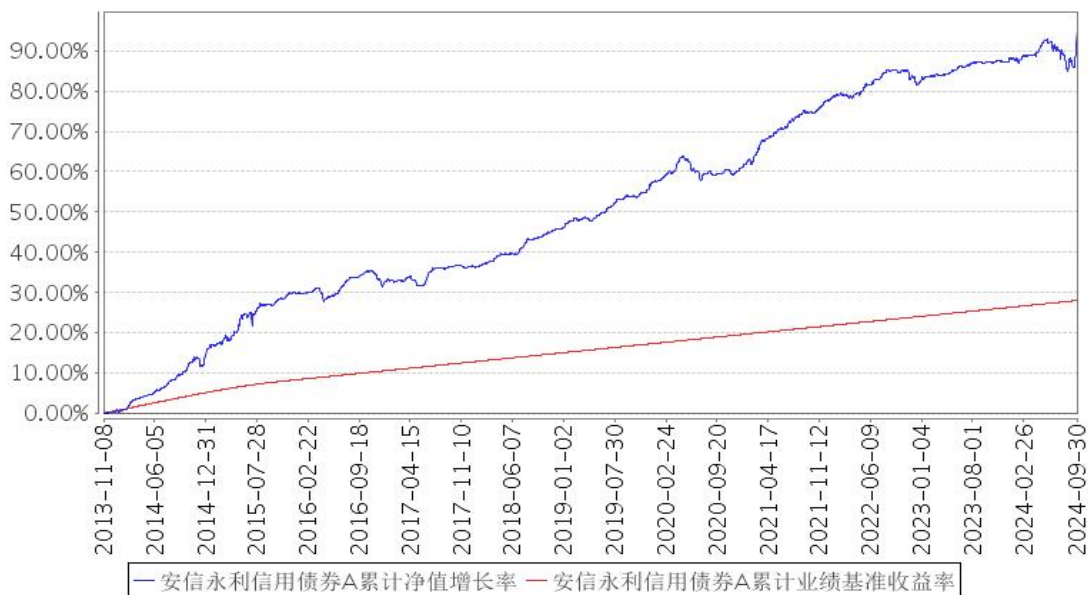
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.93%	0.40%	0.57%	0.01%	1.36%	0.39%
过去六个月	3.17%	0.31%	1.13%	0.01%	2.04%	0.30%
过去一年	4.06%	0.23%	2.26%	0.01%	1.80%	0.22%
过去三年	11.62%	0.15%	6.76%	0.01%	4.86%	0.14%
过去五年	26.61%	0.13%	11.26%	0.01%	15.35%	0.12%
自基金合同生效起至今	94.91%	0.14%	28.00%	0.01%	66.91%	0.13%

安信永利信用债券 C

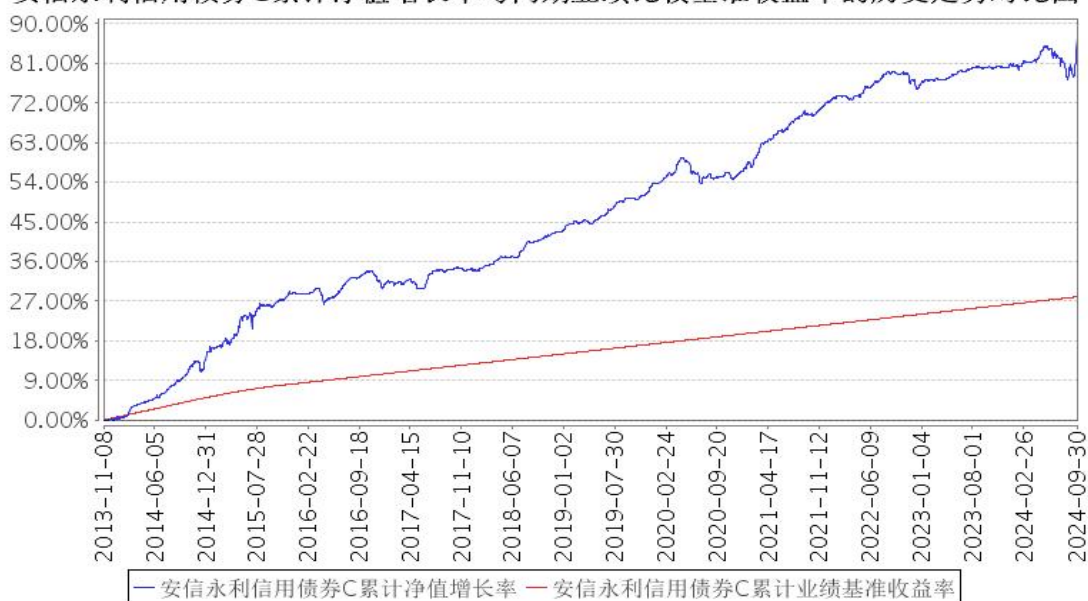
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.83%	0.40%	0.57%	0.01%	1.26%	0.39%
过去六个月	2.97%	0.31%	1.13%	0.01%	1.84%	0.30%
过去一年	3.68%	0.23%	2.26%	0.01%	1.42%	0.22%
过去三年	10.22%	0.14%	6.76%	0.01%	3.46%	0.13%
过去五年	24.18%	0.13%	11.26%	0.01%	12.92%	0.12%
自基金合同生效起至今	86.71%	0.14%	28.00%	0.01%	58.71%	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		
黄琬舒	本基金的基金经理，混合资产投资部总经理助理	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资助理、固定收益部投资经理、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总经理助理。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。
--	--	--	--	--	---

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，经济基本面数据、信贷增速等表现持续弱势，市场风险偏好进一步回落，债券市场收益率整体震荡下行。资金持续涌入固定收益类市场，债市做多氛围浓厚，投资者对各类纯债资产的挖掘几近极致，各期限、各品种债券收益率进一步挑战前低。尽管长端债券定价明显偏低，

但 10 年国债收益率仍最低下行至 2% 左右水平。与此同时，权益市场表现低迷，再加上个别转债标的发生违约，投资者对转债信用风险的担忧情绪迅速扩散，中证转债指数一度创三年以来新低。9 月 24 日之后，央行、金监局、证监会等陆续释放稳增长信号，政策涉及货币市场、地产、金融等多个领域，市场预期快速扭转，资金的风险偏好迅速抬升，纯债市场随之上演“V 型”反转行情，在此后的约一周时间内快速回吐本季度的绝大部分涨幅。而另一方面，权益市场资产价格迅速重估，转债也随着正股的上涨快速反弹，所有行业几乎全面走高，中证转债指数 9 月份上涨约 5.8%。期间，本基金随着市场行情演绎，显著降低了纯债仓位，同时逆向提高了可转债的仓位水平，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 1.4142 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.93%；安信永利信用债券 C 基金份额净值为 1.3821 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.83%；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	86,111,363.23	97.30
	其中：债券	86,111,363.23	97.30
	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	2,375,197.52	2.68
8	其他资产	12,444.61	0.01
9	合计	88,499,005.36	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	18,266,422.68	26.92
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,667.52	0.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	67,824,273.03	99.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	86,111,363.23	126.90

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	113052	兴业转债	60,150	6,583,977.80	9.70
2	110059	浦发转债	59,330	6,574,394.69	9.69
3	113042	上银转债	57,420	6,515,913.05	9.60
4	115105	23 海通 06	60,000	6,154,280.55	9.07
5	115781	23 中证 16	60,000	6,066,969.53	8.94

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兴业转债（代码：113052 SH）、上银转债（代码：113042 SH）、23 海通 06（代码：115105 SH）、23 中证 16（代码：115781 SH）、青农转债（代码：128129 SZ）、重银转债（代码：113056 SH）、苏行转债（代码：127032 SZ）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. 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。

2024 年 7 月 25 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局福建监管局罚款。

2. 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。

3. 海通证券股份有限公司

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。

2024 年 1 月 5 日，海通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 22 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责令改正。

2024 年 1 月 29 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监管谈话。

2024 年 2 月 1 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责令改正。

2024 年 4 月 13 日，海通证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2024 年 4 月 19 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警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2024 年 4 月 29 日，海通证券股份有限公司因内部制度不完善、违规经营被中国证券监督管理委员会上海监管局责令改正。

2024 年 4 月 30 日，海通证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件、内部制度不完善、未依法履行职责被中国证券监督管理委员会罚款、没收违法所得，被中国证券监督管理委员会广东监管局责令改正。

2024 年 5 月 8 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通报批评。

2024 年 6 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书面警示。

2024 年 9 月 4 日，海通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。

4. 中信证券股份有限公司

2024 年 1 月 12 日，中信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。

2024 年 4 月 13 日，中信证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2024 年 4 月 19 日，中信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警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2024 年 4 月 30 日，中信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罚款、没收违法所得。

2024 年 4 月 30 日，中信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 5 月 10 日，中信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广东监管局出具警示函。

2024 年 8 月 7 日，中信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贵州监管局出具警示函。

2024 年 8 月 26 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证券交易所出具警示函。

2024 年 8 月 29 日，中信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。

5. 青岛农村商业银行股份有限公司

2024 年 1 月 5 日，青岛农村商业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青岛监管局罚款。

2024 年 8 月 20 日，青岛农村商业银行股份有限公司因未按期缴纳税款被国家金融监督管理总局青岛监管局责令改正。

6. 重庆银行股份有限公司

2024 年 6 月 28 日，重庆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重庆监管局罚款。

7. 苏州银行股份有限公司

2024 年 8 月 2 日，苏州银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局江苏监管局罚款。

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	12,444.61
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	12,444.61

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	113052	兴业转债	6,583,977.80	9.70
2	110059	浦发转债	6,574,394.69	9.69
3	113042	上银转债	6,515,913.05	9.60
4	113037	紫银转债	3,059,671.05	4.51
5	128129	青农转债	2,829,385.95	4.17
6	113056	重银转债	2,262,869.29	3.33
7	127032	苏行转债	1,701,105.21	2.51
8	113050	南银转债	1,225,614.53	1.81
9	113053	隆 22 转债	1,052,939.48	1.55
10	113044	大秦转债	744,613.00	1.10
11	110085	通 22 转债	708,488.64	1.04
12	127040	国泰转债	592,484.30	0.87
13	113059	福莱转债	565,952.48	0.83
14	110079	杭银转债	548,457.52	0.81
15	127085	韵达转债	444,210.77	0.65
16	127046	百润转债	424,891.38	0.63
17	113616	韦尔转债	415,670.94	0.61
18	127027	能化转债	414,328.32	0.61
19	128135	洽洽转债	387,162.99	0.57
20	113666	爱玛转债	376,050.45	0.55
21	110082	宏发转债	375,987.69	0.55
22	127089	晶澳转债	373,311.21	0.55
23	113633	科沃转债	366,912.57	0.54
24	123179	立高转债	362,108.36	0.53

25	113661	福 22 转债	351,555.61	0.52
26	118034	晶能转债	330,763.23	0.49
27	123119	康泰转 2	317,008.24	0.47
28	123210	信服转债	304,961.78	0.45
29	123169	正海转债	299,153.66	0.44
30	113682	益丰转债	295,138.44	0.43
31	113660	寿 22 转债	293,753.44	0.43
32	127066	科利转债	290,605.27	0.43
33	110090	爱迪转债	282,992.33	0.42
34	110093	神马转债	281,828.59	0.42
35	123108	乐普转 2	275,881.33	0.41
36	127056	中特转债	270,320.47	0.40
37	118042	奥维转债	264,283.82	0.39
38	118024	冠宇转债	255,930.32	0.38
39	123064	万孚转债	252,365.79	0.37
40	111014	李子转债	251,682.09	0.37
41	113627	太平转债	251,323.89	0.37
42	123195	蓝晓转 02	247,594.02	0.36
43	123117	健帆转债	244,525.30	0.36
44	123113	仙乐转债	243,157.52	0.36
45	110089	兴发转债	242,914.20	0.36
46	128131	崇达转 2	235,234.12	0.35
47	113605	大参转债	234,947.22	0.35
48	123104	卫宁转债	234,368.92	0.35
49	110076	华海转债	232,962.81	0.34
50	123114	三角转债	232,448.01	0.34
51	111016	神通转债	228,047.59	0.34
52	127082	亚科转债	218,418.59	0.32
53	123152	润禾转债	212,192.65	0.31
54	118036	力合转债	211,844.85	0.31
55	113047	旗滨转债	204,393.87	0.30
56	123187	超达转债	202,819.25	0.30
57	123217	富仕转债	201,287.16	0.30
58	123158	宙邦转债	199,900.64	0.29
59	113606	荣泰转债	199,826.04	0.29
60	111013	新港转债	199,161.99	0.29
61	113659	莱克转债	198,124.24	0.29
62	127038	国微转债	194,600.58	0.29
63	127031	洋丰转债	190,977.87	0.28
64	127024	盈峰转债	190,973.03	0.28
65	127041	弘亚转债	190,874.08	0.28
66	123224	宇邦转债	190,512.87	0.28

67	113677	华懋转债	190,114.71	0.28
68	118041	星球转债	187,587.23	0.28
69	113579	健友转债	186,244.95	0.27
70	113676	荣 23 转债	184,851.13	0.27
71	118039	煜邦转债	181,321.80	0.27
72	123115	捷捷转债	180,360.79	0.27
73	123160	泰福转债	179,174.72	0.26
74	113644	艾迪转债	178,891.87	0.26
75	118033	华特转债	178,204.22	0.26
76	127090	兴瑞转债	178,188.76	0.26
77	123231	信测转债	177,707.61	0.26
78	111003	聚合转债	175,614.55	0.26
79	123100	朗科转债	175,178.96	0.26
80	127016	鲁泰转债	174,600.35	0.26
81	123180	浙矿转债	173,444.77	0.26
82	128125	华阳转债	171,422.42	0.25
83	123237	佳禾转债	169,452.65	0.25
84	123082	北陆转债	169,192.10	0.25
85	113664	大元转债	169,126.33	0.25
86	123197	光力转债	168,483.12	0.25
87	113049	长汽转债	168,084.12	0.25
88	123218	宏昌转债	167,955.42	0.25
89	123121	帝尔转债	167,621.12	0.25
90	123093	金陵转债	167,035.27	0.25
91	118006	阿拉转债	166,840.42	0.25
92	111010	立昂转债	165,855.73	0.24
93	118011	银微转债	165,748.45	0.24
94	123211	阳谷转债	165,275.40	0.24
95	123159	崧盛转债	164,546.09	0.24
96	127026	超声转债	163,239.66	0.24
97	123039	开润转债	163,095.05	0.24
98	113597	佳力转债	160,755.29	0.24
99	127069	小熊转债	160,085.04	0.24
100	118043	福立转债	159,484.69	0.24
101	123133	佩蒂转债	157,920.38	0.23
102	123194	百洋转债	156,471.01	0.23
103	127042	嘉美转债	156,120.24	0.23
104	113045	环旭转债	155,926.63	0.23
105	123165	回天转债	154,836.60	0.23
106	113637	华翔转债	153,725.74	0.23
107	127073	天赐转债	151,962.68	0.22
108	113048	晶科转债	150,398.53	0.22

109	113655	欧 22 转债	146,907.81	0.22
110	123191	智尚转债	146,090.23	0.22
111	118014	高测转债	145,140.80	0.21
112	113675	新 23 转债	144,547.07	0.21
113	123112	万讯转债	144,065.45	0.21
114	118013	道通转债	143,735.89	0.21
115	123059	银信转债	141,665.22	0.21
116	123154	火星转债	139,272.66	0.21
117	123239	锋工转债	139,152.15	0.21
118	113657	再 22 转债	138,797.59	0.20
119	123149	通裕转债	138,755.02	0.20
120	123208	孩王转债	138,667.27	0.20
121	123088	威唐转债	137,560.01	0.20
122	113584	家悦转债	136,199.08	0.20
123	123235	亿田转债	135,369.79	0.20
124	113681	镇洋转债	132,868.24	0.20
125	123204	金丹转债	132,867.15	0.20
126	118035	国力转债	132,809.60	0.20
127	118025	奕瑞转债	131,893.91	0.19
128	123072	乐歌转债	131,350.43	0.19
129	118005	天奈转债	130,248.78	0.19
130	113643	风语转债	129,342.42	0.19
131	127091	科数转债	129,165.12	0.19
132	123233	凯盛转债	128,973.75	0.19
133	128097	奥佳转债	128,268.07	0.19
134	128136	立讯转债	127,733.66	0.19
135	127093	章鼓转债	125,351.42	0.18
136	123109	昌红转债	123,750.64	0.18
137	123214	东宝转债	123,549.60	0.18
138	127078	优彩转债	121,817.03	0.18
139	118040	宏微转债	121,153.37	0.18
140	123065	宝莱转债	121,025.50	0.18
141	118029	富淼转债	119,398.09	0.18
142	123145	药石转债	119,216.46	0.18
143	127017	万青转债	118,779.39	0.18
144	118015	芯海转债	116,143.29	0.17
145	113061	拓普转债	113,491.52	0.17
146	113667	春 23 转债	112,637.06	0.17
147	123144	裕兴转债	112,511.01	0.17
148	127076	中宠转 2	112,004.89	0.17
149	127081	中旗转债	111,003.92	0.16
150	123091	长海转债	110,693.61	0.16

151	113670	金 23 转债	110,444.05	0.16
152	127050	麒麟转债	110,296.11	0.16
153	123203	明电转 02	109,132.82	0.16
154	123071	天能转债	107,711.67	0.16
155	123199	山河转债	107,001.75	0.16
156	123201	纽泰转债	106,752.18	0.16
157	118044	赛特转债	106,530.66	0.16
158	123124	晶瑞转 2	106,345.29	0.16
159	123122	富瀚转债	105,549.69	0.16
160	123202	祥源转债	105,464.02	0.16
161	113663	新化转债	104,612.68	0.15
162	113624	正川转债	103,814.69	0.15
163	127087	星帅转 2	103,276.93	0.15
164	123226	中富转债	103,056.91	0.15
165	113679	芯能转债	100,194.75	0.15
166	123090	三诺转债	97,779.83	0.14
167	123236	家联转债	96,409.49	0.14
168	118032	建龙转债	96,346.85	0.14
169	113650	博 22 转债	95,101.35	0.14
170	123184	天阳转债	93,598.80	0.14
171	123183	海顺转债	93,477.07	0.14
172	118037	上声转债	93,459.01	0.14
173	113656	嘉诚转债	91,748.34	0.14
174	113640	苏利转债	89,410.48	0.13
175	127074	麦米转 2	87,940.80	0.13
176	128095	恩捷转债	87,612.23	0.13
177	123151	康医转债	86,906.80	0.13
178	123101	拓斯转债	85,113.60	0.13
179	123188	水羊转债	84,657.76	0.12
180	118004	博瑞转债	84,222.63	0.12
181	128133	奇正转债	83,670.94	0.12
182	110084	贵燃转债	83,202.71	0.12
183	123215	铭利转债	82,417.81	0.12
184	123170	南电转债	81,601.59	0.12
185	123126	瑞丰转债	81,306.06	0.12
186	111004	明新转债	81,162.66	0.12
187	111001	山玻转债	79,947.20	0.12
188	127025	冀东转债	79,724.22	0.12
189	118012	微芯转债	79,499.73	0.12
190	127072	博实转债	78,584.82	0.12
191	123174	精锻转债	77,471.90	0.11
192	113638	台 21 转债	75,478.80	0.11

193	113671	武进转债	75,228.24	0.11
194	118010	洁特转债	74,387.45	0.11
195	128109	楚江转债	73,614.48	0.11
196	111009	盛泰转债	73,603.87	0.11
197	123087	明电转债	72,562.95	0.11
198	113066	平煤转债	71,774.58	0.11
199	118038	金宏转债	71,481.84	0.11
200	123178	花园转债	71,188.64	0.10
201	111018	华康转债	71,054.55	0.10
202	127054	双箭转债	70,592.61	0.10
203	127051	博杰转债	70,004.25	0.10
204	118028	会通转债	69,717.56	0.10
205	123193	海能转债	68,997.83	0.10
206	127071	天箭转债	68,811.09	0.10
207	113542	好客转债	68,644.73	0.10
208	113641	华友转债	67,683.20	0.10
209	128130	景兴转债	67,476.03	0.10
210	123120	隆华转债	65,000.30	0.10
211	113653	永 22 转债	62,746.10	0.09
212	113618	美诺转债	62,708.03	0.09
213	128117	道恩转债	62,075.39	0.09
214	127088	赫达转债	58,547.30	0.09
215	123076	强力转债	57,025.66	0.08
216	127079	华亚转债	56,800.03	0.08
217	123230	金钟转债	56,448.08	0.08
218	128137	洁美转债	56,403.03	0.08
219	113673	岱美转债	56,282.01	0.08
220	113608	威派转债	49,087.75	0.07
221	127059	永东转 2	46,591.09	0.07
222	127044	蒙娜转债	45,384.17	0.07
223	127043	川恒转债	44,234.53	0.07
224	127104	姚记转债	31,020.82	0.05
225	110081	闻泰转债	28,414.11	0.04
226	113649	丰山转债	27,467.21	0.04
227	113021	中信转债	23,977.97	0.04
228	127105	龙星转债	21,524.18	0.03
229	128116	瑞达转债	20,330.28	0.03
230	123219	宇瞳转债	14,629.55	0.02
231	123050	聚飞转债	14,332.07	0.02
232	128128	齐翔转 2	14,279.39	0.02
233	113680	丽岛转债	13,293.84	0.02
234	127062	垒知转债	11,946.87	0.02

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	27,405,800.23	21,056,396.90
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	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 10 月 24 日