

# 安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 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：2021 年 7 月 20 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 7 月 19 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 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	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 4 月 1 日-2021 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	616,762.54	114,573.50
2. 本期利润	999,975.69	191,751.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0243
4. 期末基金资产净值	48,087,985.90	9,675,680.06
5. 期末基金份额净值	1.241	1.229

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	2.14%	0.08%	0.56%	0.01%	1.58%	0.07%
过去六个月	6.16%	0.14%	1.12%	0.01%	5.04%	0.13%
过去一年	6.89%	0.12%	2.25%	0.01%	4.64%	0.11%
过去三年	22.38%	0.10%	6.76%	0.01%	15.62%	0.09%
过去五年	30.97%	0.10%	11.25%	0.01%	19.72%	0.09%
自基金合同生效起至今	71.04%	0.14%	20.67%	0.01%	50.37%	0.13%

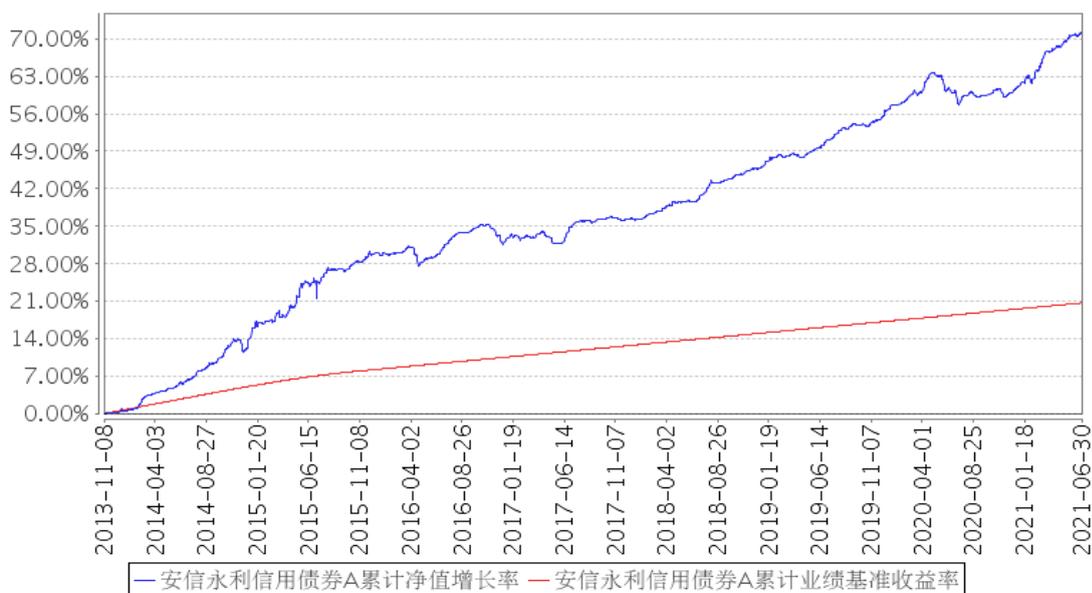
安信永利信用债券 C

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

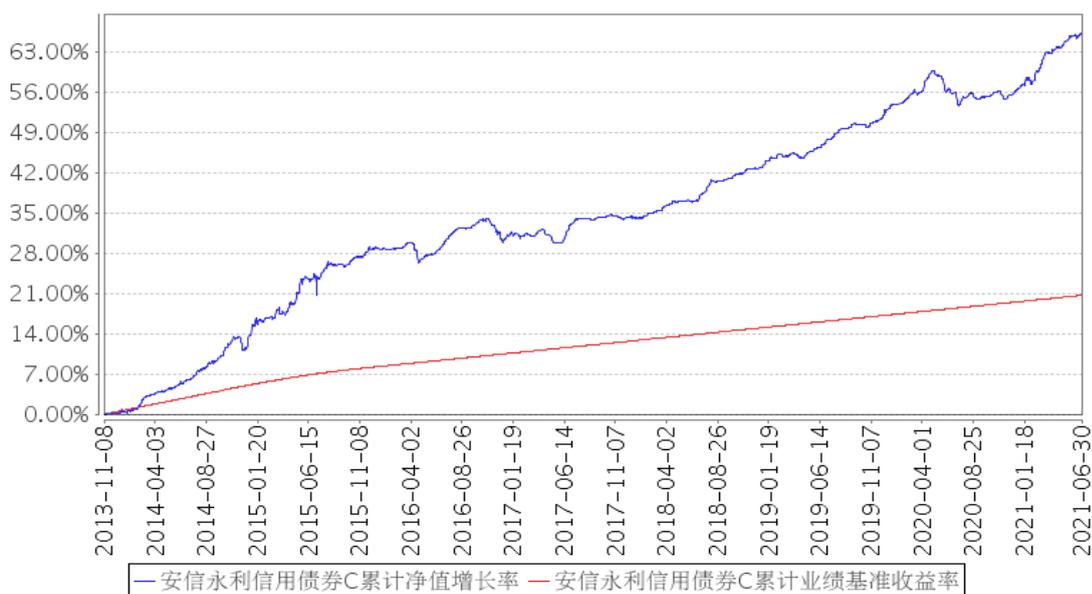
				④		
过去三个月	2.08%	0.08%	0.56%	0.01%	1.52%	0.07%
过去六个月	6.04%	0.14%	1.12%	0.01%	4.92%	0.13%
过去一年	6.59%	0.12%	2.25%	0.01%	4.34%	0.11%
过去三年	21.12%	0.10%	6.76%	0.01%	14.36%	0.09%
过去五年	28.54%	0.10%	11.25%	0.01%	17.29%	0.09%
自基金合同生效起至今	66.03%	0.14%	20.67%	0.01%	45.36%	0.13%

### 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	2017 年 12 月 26 日	-	16.0 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。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。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的基金经理。
黄琬舒	本基金的基金经理	2021 年 4 月 2 日	-	6.0 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

报告期内，债券市场小幅震荡，有所上涨。基于对信用风险的谨慎，本基金纯债部分的配置以优质 AAA 国企信用债为主，同时维持了中等水平的杠杆。本季度，中高等级可转债仍然是我们的重要配置。期间可转债显著上涨，我们从价值判断出发，适当减持了部分标的。

#### 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 1.241 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.14%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.229 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.08%，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	81,234,379.50	97.42
	其中：债券	81,234,379.50	97.42
	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	1,218,911.60	1.46
8	其他资产	930,049.93	1.12
9	合计	83,383,341.03	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	45,256,991.60	78.35
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,373,134.32	4.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	33,145,505.88	57.38
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	458,747.70	0.79
10	其他	-	-
11	合计	81,234,379.50	140.63

## 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	132015	18 中油 EB	50,000	5,112,500.00	8.85
2	175122	20 中金 07	50,000	5,062,000.00	8.76
3	175534	20 华泰 G8	50,000	5,038,500.00	8.72
4	163756	20 国君 G4	50,000	5,037,000.00	8.72
5	149326	20 国信 04	50,000	5,036,000.00	8.72

## 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 中证 G6（证券代码：163340 SH）、20 信投 G1（证券代码：163222 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 2 月 10 日，中信证券股份有限公司因内部制度不完善被证监局责令整改【深圳证监局(2021)5 号】。

2020 年，中信证券股份有限公司因内部制度不完善、未依法履行职责、违反自律规则被证监

会警示、责令改正，被中国证券业协会勒令自查违规。

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证监局监管（约见）谈话。

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

2020 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，中国国际金融股份有限公司因违规经营、未及时披露公司重大事件、未依法履行职责被中国证券业协会警示【北京证监局[2020]63 号、中国证券业协会[2017]36 号、中国证券业协会[2019]19 号、上交所[2019]1 号、上交所[2019]17 号、中国证券业协会[2019]19 号、深证函[2018]474 号】。

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，招商证券股份有限公司因违反反洗钱法被央行深圳市中心支行罚款【深人罚（2021）10 号】。

2020 年，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告、被证监会出具警示函【上证债监（2020）45 号】。

2021 年，申万宏源证券有限公司因未依法履行职责被证监局警告，因内部制度不完善、违反《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》被证监局出具警示函【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 25 日，申万宏源证券有限公司因未依法履行职责被证监局责令改正【沪证监决(2020)168 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出具警示函【江苏证监局(2020)112 号】。

2021 年，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被证监会出具警示函、监管（约见）谈话。2021 年 3 月 31 日，海通证券股份有限公司因内部制度不完善被上海证监局责令增加合规检查次数、责令暂停部分业务【沪证监决[2021]40 号、沪证监决[2021]41 号】。

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规定被中国银行间市场交易商协会警告，责令改正。

2020 年，海通证券股份有限公司因未依法履行职责被证监会出具警示函、因违反自律规则被中国证券业协会勒令自查违规。

2020 年 11 月 25 号，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	29,799.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	900,250.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	930,049.93

### 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	132015	18 中油 EB	5,112,500.00	8.85
2	132008	17 山高 EB	3,138,600.00	5.43
3	132007	16 凤凰 EB	3,130,200.00	5.42
4	113037	紫银转债	2,785,590.00	4.82
5	110059	浦发转债	2,581,236.00	4.47
6	132004	15 国盛 EB	2,046,000.00	3.54
7	132011	17 浙报 EB	2,012,010.00	3.48
8	132016	19 东创 EB	1,478,855.00	2.56
9	113567	君禾转债	431,360.00	0.75
10	113546	迪贝转债	419,920.00	0.73
11	113524	奇精转债	416,440.00	0.72
12	113591	胜达转债	416,240.00	0.72
13	113530	大丰转债	409,920.00	0.71
14	128049	华源转债	409,240.00	0.71
15	128116	瑞达转债	405,200.00	0.70
16	128139	祥鑫转债	400,440.00	0.69
17	113600	新星转债	395,560.00	0.68
18	127027	靖远转债	380,152.00	0.66
19	113610	灵康转债	377,545.00	0.65
20	113599	嘉友转债	375,795.00	0.65
21	128042	凯中转债	375,655.00	0.65
22	113608	威派转债	354,016.00	0.61

23	128118	瀛通转债	346,528.00	0.60
24	113525	台华转债	286,728.00	0.50
25	113594	淳中转债	224,060.00	0.39
26	113561	正裕转债	217,240.00	0.38
27	128069	华森转债	211,160.00	0.37
28	113044	大秦转债	205,820.00	0.36
29	123084	高澜转债	196,344.00	0.34
30	123059	银信转债	189,414.00	0.33
31	128063	未来转债	179,707.00	0.31
32	128081	海亮转债	170,565.00	0.30
33	123087	明电转债	160,020.90	0.28
34	113568	新春转债	159,432.00	0.28
35	110070	凌钢转债	111,043.20	0.19

### 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 7 月 20 日