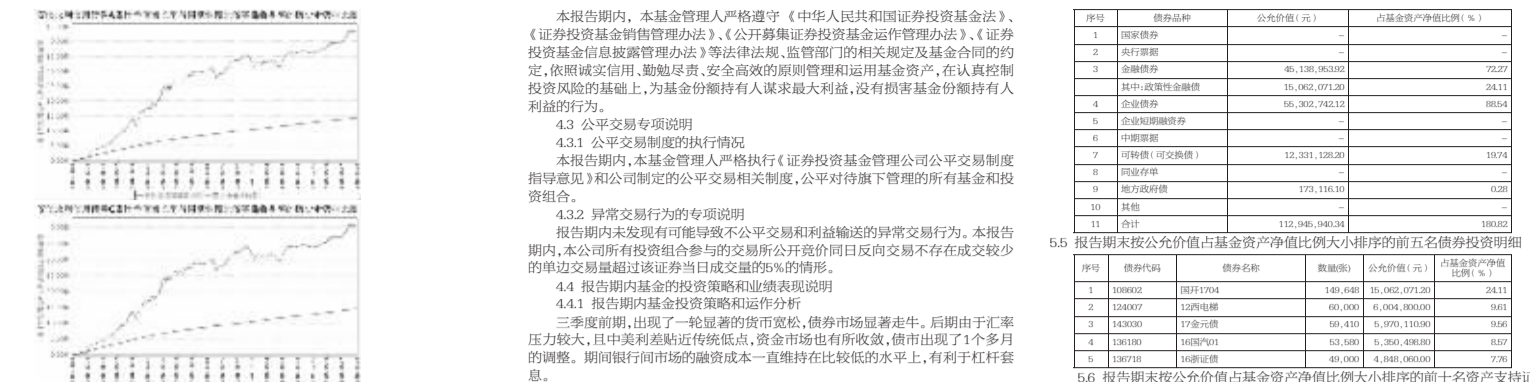


安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告



注：1、本基金合同生效日为2016年10月28日。
2、本基金合同约定，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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标和基金净值表现			
单位：人民币元			
主要财务指标	报告期自2018年07月01日至2018年09月30日	安信永利信用债C	安信永利信用债B
1.本期已实现收益	1,434,489.77	285,409.77	285,409.77
2.本期公允价值变动收益	1,586,016.77	247,779.88	247,779.88
3.本期计提的公允价值变动损失	-	-	-
4.本期公允价值变动净损益	1,586,016.77	247,779.88	247,779.88
5.本期投资收益	60,294,396.32	11,821,915.00	11,821,915.00

注：1、上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 本报告期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			
期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②
过去三个月	2.81%	0.07%	2.74%
过去六个月	2.62%	0.07%	2.55%

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的有关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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管理制度指导意见》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业绩表现说明

截至本报告期末本基金A类基金份额净值为1.038元，本报告期基金份额净值增长率为2.85%；截至本报告期末本基金B类基金份额净值为1.068元，本报告期基金份额净值增长率为2.82%；同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	应收股利	-	-
4	其他资产	-	-
5	合计	120,619,307.84	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投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末持有债券。

5.4.1 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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,179,280.00	11.04
4	企业债券	-	-
5	中期票据	-	-
6	可转债(可交换债)	20,141,406.87	19.89
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	31,320,686.87	30.93

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	100002	国开1704	149,468	16,062,073.20	24.11
2	120007	12国债(7)	69,000	6,000,400.00	9.45
3	130001	13国债(1)	60,410	5,099,110.00	7.60
4	130003	13国债(3)	63,520	5,200,400.00	8.52
5	130718	国债逆回购	49,000	4,348,000.00	7.76

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股指期货交易情况说明

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 报告期内基金投资的前十名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、处罚的情况。

5.10.2 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股票必须先买入再买入。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	7,608.61
2	应收证券清算款	390,589.66
3	应收股利	-
4	其他应收款	2,128,628.60
5	其他	-
6	待摊费用	-
7	其他	2,636,620.67
8	合计	5,163,447.54

5.10.4 报告期末未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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.5 报告期末前十名股票中存在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、处罚的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.10.7 开放式基金资产变动

项目	安信永利信用债A	安信永利信用债B
报告期末基金份额总额	49,274,396.22	49,621,914.09
报告期基金份额净增加额	-	-
报告期基金份额净减少额	-	-
基金份额减少原因(“赎回”、“申购”、“转换”、“转托管”等)	-	-
报告期末基金份额总额	49,274,396.22	49,621,914.09

5.10.8 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	120006	东方转债	4,613,300.00	4.26
2	120011	长城转债	3,387,400.00	3.10
3	110002	二债转债	2,987,000.00	2.76
4	110008	浙报转债	1,980,170.00	1.83
5	110023	海通转债	727,110.00	0.72
6	130020	太湖转债	441,300.00	0.44
7	120017	12国债(7)	303,640.00	0.10

5.10.9 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.10 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.11 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.12 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.13 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.14 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.15 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.16 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.17 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)	303,640.00	0.04

5.10.18 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	100002	国开1704	16,062,073.20	4.26
2	120007	12国债(7)	6,000,400.00	1.53
3	130001	13国债(1)	5,099,110.00	1.29
4	130003	13国债(3)	5,200,400.00	1.33
5	130718	国债逆回购	4,348,000.00	1.11
6	120017	12国债(7)</		