

# 安信目标收益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	安信目标收益债券
基金主代码	750002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 9 月 25 日
报告期末基金份额总额	3,209,021,393.36 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，以 3 个月期上海银行间同业拆放利率（Shibor3M）为收益跟踪目标，并力争实现超越目标基准的投资回报。
投资策略	基于货币政策研究、利率研究等宏观基本面研究，根据风险收益特征对普通债券、浮动利息债券、可转换债券和资产支持证券等大类资产进行配置比例。通过研究基准利率类型、利差水平、发行主体等因素，并结合市场预期分析和对市场基准利率走势的判断，制定浮息债的投资策略。密切跟踪债券发行市场的供应状况，深入研究利差变动，在重点研究发行人特征及其信用水平、债券类型、担保情况、发行利率和承销商构成的基础上积极参与债券一级市场投资。可转债的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法，利用期权定价模型等数量化方法对可转债的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。同时，持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，对普通的和创新性的资产支持证券品种进行深入分析，制定周密资产支持证券投资策略。普通债券投资策略包括品种配置策略、收益率曲线配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购策略等。

业绩比较基准	3 个月期上海银行间同业拆放利率（Shibor3M）	
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于中低风险和收益水平的投资品种。</p> <p>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。</p>	
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	安信目标收益债券 A	安信目标收益债券 C
下属分级基金的交易代码	750002	750003
报告期末下属分级基金的份额总额	2,406,928,654.96 份	802,092,738.40 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）	
	安信目标收益债券 A	安信目标收益债券 C
1. 本期已实现收益	17,675,879.65	4,543,466.71
2. 本期利润	3,487,597.88	10,911,034.86
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0011	0.0135
4. 期末基金资产净值	3,273,370,715.65	1,059,988,193.70
5. 期末基金份额净值	1.3600	1.3215

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

安信目标收益债券 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	1.49%	0.47%	0.48%	0.00%	1.01%	0.47%
过去六个月	3.47%	0.37%	0.98%	0.01%	2.49%	0.36%

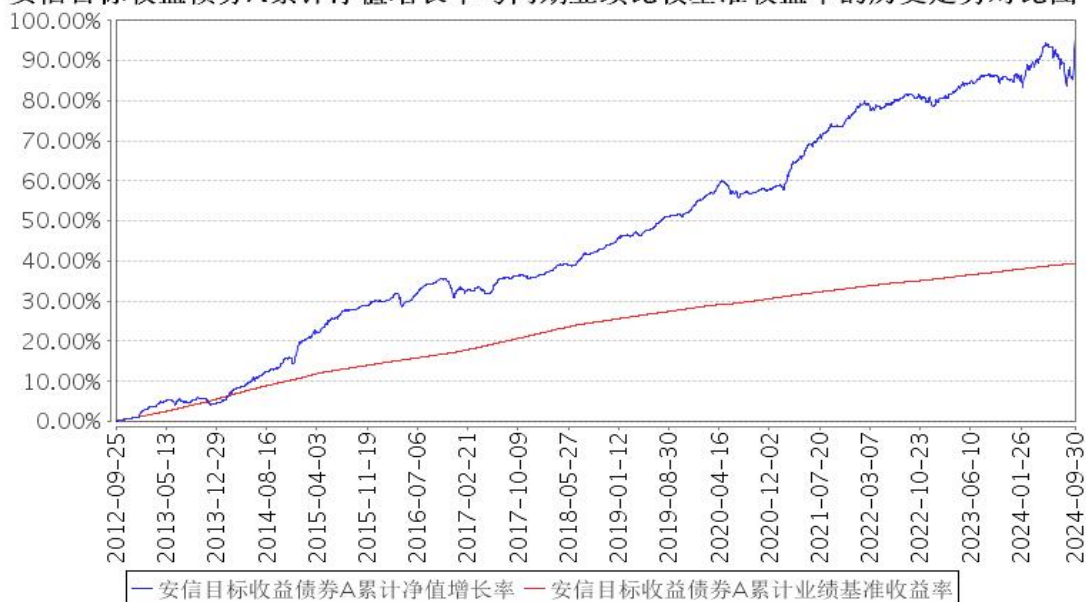
过去一年	4.86%	0.30%	2.19%	0.01%	2.67%	0.29%
过去三年	12.49%	0.19%	6.64%	0.01%	5.85%	0.18%
过去五年	29.00%	0.16%	11.76%	0.01%	17.24%	0.15%
自基金合同生效起至今	95.39%	0.13%	39.39%	0.01%	56.00%	0.12%

安信目标收益债券 C

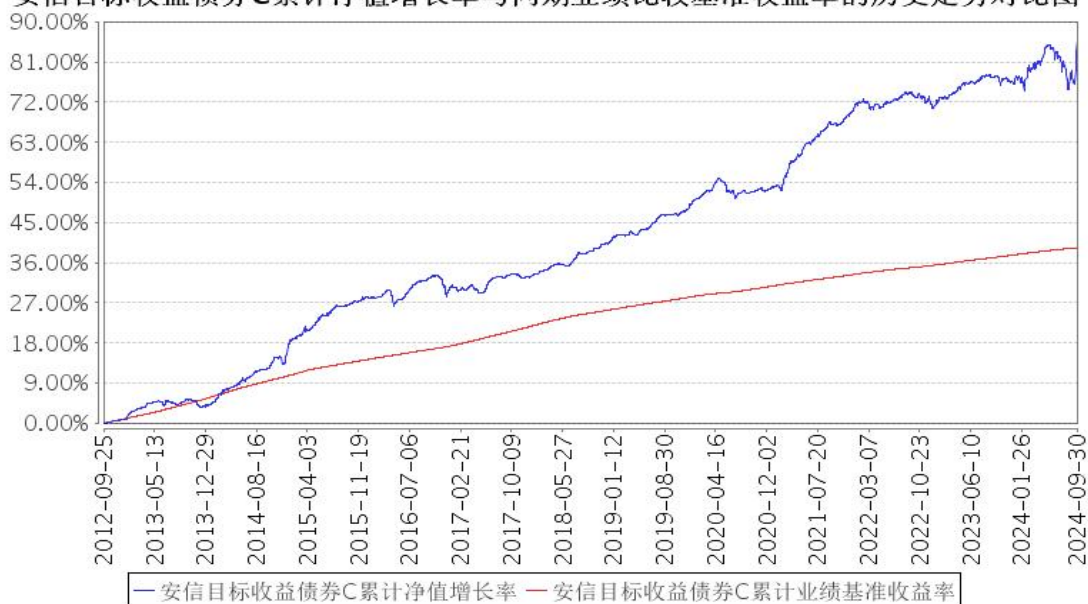
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.38%	0.47%	0.48%	0.00%	0.90%	0.47%
过去六个月	3.26%	0.37%	0.98%	0.01%	2.28%	0.36%
过去一年	4.47%	0.30%	2.19%	0.01%	2.28%	0.29%
过去三年	11.14%	0.19%	6.64%	0.01%	4.50%	0.18%
过去五年	26.42%	0.16%	11.76%	0.01%	14.66%	0.15%
自基金合同生效起至今	85.73%	0.13%	39.39%	0.01%	46.34%	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

安信目标收益债券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



安信目标收益债券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 2012 年 9 月 25 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规定。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		
张翼飞	本基金的基金经理，公司首席投资官（CIO）	2016年3月14日	-	14年	张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部财务主管，上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理、混合资产投资部总经理、公司总经理助理、公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司首席投资官（混合资产 CIO）。现任安信永鑫增强债券型证券投资基金的基金经理助理；安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、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、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信恒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，混合资产投资部总经理助理	2023 年 12 月 21 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、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

转债部分，本季度转债市场一度大幅调整，在纯债收益率屡创历史新低的情况下，转债市场的加权平均到期收益率几乎达到历史极值，并显著高于纯债收益率。我们认为，考虑到转债内涵的期权价值不可能为负，诸多转债的价格应该是被显著低估了，转债市场具有罕见的投资价值。期间，除了权益资产之外的仓位，我们较多的持有了经过认真筛选的转债资产。

纯债部分，本季度债券市场一度持续走强，各关键期限收益率几乎都大幅刷新了历史新低。长期来说，我们仍然倾向于人民币会有一定幅度的温和通胀。我们认为，长债收益率对长期温和通胀的可能性定价严重不足。纯债部分，我们倾向于尽可能低的仓位、相对较短的久期、尽可能高的信用评级。

本报告期末，转债市场出现了大幅上涨。但是，从 2022 年初本轮地产政策启动至今的效果来看，大经济体的惯性不可小觑。我们认为，从政策出台到基本面见底回升也许尚需时日，短期市场行情的大幅上涨相对于尚待验证的基本面修复来说，也许走的太快了。随着价格的上涨，投资价值的突出程度有所下降。我们在季度末最后的上涨行情中，对转债持仓做了一定幅度的止盈。

事后来看，我们在报告期内对于转债、纯债的看法大致是正确的，也从中有了很好的获益，净值创出了新高。但是，报告期内，转债、纯债的走势一度大幅偏离我们对市场的判断，这种偏离也在不断提示我们，去反复检视所秉持的观点是否站得住脚。持有上述头寸的过程，实际上也是不断检视、批判底层逻辑的过程。

报告期内的遗憾在于，期间可转债市场前所未有的大跌，打破了我们组合风险预算的假设——我们之前认为，可转债是信用纯债和股票期权的综合体，由于期权价值不可能为负，所以可转债价格不太可能大面积跌破纯债价值。虽然后期发生了大幅的、非常迅速的修复，但是期间可

转债市场的大幅波动，打破了我们之前的风险预算假设，导致我们的基金净值刷新了最大回撤，虽然本季度总体收益还是不错的，但是期间的波动，还是会给信任我们的投资人带来困扰。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信目标收益债券 A 基金份额净值为 1.3600 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.49%；安信目标收益债券 C 基金份额净值为 1.3215 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.38%；同期业绩比较基准收益率为 0.48%。

#### 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	3,645,296,630.42	75.13
	其中：债券	3,645,296,630.42	75.13
	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	616,862,189.18	12.71
	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	67,370,113.39	1.39
8	其他资产	522,316,181.57	10.77
9	合计	4,851,845,114.56	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	125,361,599.98	2.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	239,215,801.93	5.52
	其中：政策性金融债	228,870,369.05	5.28
4	企业债券	1,660.42	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,280,695,769.05	75.71
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	21,799.04	0.00
10	其他	-	-
11	合计	3,645,296,630.42	84.12

### 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	3,802,300	416,197,153.69	9.60
2	113042	上银转债	2,407,940	273,248,479.21	6.31
3	110085	通 22 转债	1,251,540	128,881,086.12	2.97
4	110059	浦发转债	1,001,250	110,949,143.43	2.56
5	240421	24 农发 21	1,000,000	100,110,136.99	2.31

### 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兴业转债（代码：113052 SH）、上银转债（代码：113042 SH）、杭银转债（代码：110079 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. 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. 杭州银行股份有限公司

2024 年 1 月 15 日，杭州银行股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被国家金融监督管理总局浙江监管局罚款。

2024 年 8 月 15 日，杭州银行股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述被国家金融监督管理总局浙江监管局罚款。

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	207,761.12
2	应收证券清算款	475,591,560.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	46,516,860.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	522,316,181.57

### 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	416,197,153.69	9.60
2	113042	上银转债	273,248,479.21	6.31
3	110085	通 22 转债	128,881,086.12	2.97
4	110059	浦发转债	110,949,143.43	2.56
5	113053	隆 22 转债	98,506,867.16	2.27
6	110079	杭银转债	92,132,350.16	2.13
7	113059	福莱转债	56,654,821.89	1.31
8	113050	南银转债	56,108,004.86	1.29
9	113044	大秦转债	49,244,215.00	1.14
10	127073	天赐转债	48,226,189.17	1.11
11	127056	中特转债	46,064,646.06	1.06
12	127040	国泰转债	45,828,660.71	1.06
13	113661	福 22 转债	39,209,670.27	0.90
14	113062	常银转债	36,089,693.85	0.83
15	118024	冠宇转债	32,663,107.51	0.75
16	127089	晶澳转债	31,991,790.37	0.74

17	118034	晶能转债	31,976,299.28	0.74
18	110093	神马转债	28,802,652.33	0.66
19	110089	兴发转债	28,249,035.83	0.65
20	113655	欧 22 转债	26,192,171.35	0.60
21	113048	晶科转债	25,919,644.36	0.60
22	110082	宏发转债	24,567,856.16	0.57
23	128135	洽洽转债	23,542,007.73	0.54
24	113065	齐鲁转债	23,206,947.64	0.54
25	127032	苏行转债	22,963,166.63	0.53
26	127046	百润转债	21,332,933.20	0.49
27	123149	通裕转债	21,290,122.07	0.49
28	123113	仙乐转债	21,073,724.39	0.49
29	127024	盈峰转债	20,519,408.36	0.47
30	123179	立高转债	20,486,867.23	0.47
31	123104	卫宁转债	20,421,679.85	0.47
32	111010	立昂转债	19,920,420.78	0.46
33	113047	旗滨转债	19,656,760.08	0.45
34	110076	华海转债	19,070,443.84	0.44
35	113623	凤 21 转债	18,491,953.14	0.43
36	113633	科沃转债	18,441,850.59	0.43
37	127027	能化转债	18,412,250.63	0.42
38	123169	正海转债	17,122,740.63	0.40
39	127066	科利转债	16,896,210.44	0.39
40	113656	嘉诚转债	16,888,831.00	0.39
41	118042	奥维转债	16,476,764.50	0.38
42	123121	帝尔转债	16,267,123.64	0.38
43	113670	金 23 转债	16,149,375.12	0.37
44	127042	嘉美转债	16,111,927.64	0.37
45	128131	崇达转 2	16,069,975.31	0.37
46	113682	益丰转债	15,745,138.09	0.36
47	113627	太平转债	15,601,009.20	0.36
48	111009	盛泰转债	15,252,771.00	0.35
49	118043	福立转债	14,937,721.73	0.34
50	113666	爱玛转债	14,825,938.30	0.34
51	111018	华康转债	14,552,860.72	0.34
52	123071	天能转债	14,388,190.26	0.33
53	111004	明新转债	14,244,523.82	0.33
54	127085	韵达转债	14,136,870.60	0.33
55	113677	华懋转债	13,878,373.60	0.32
56	113644	艾迪转债	13,608,872.07	0.31
57	123115	捷捷转债	13,216,956.97	0.31
58	113659	莱克转债	13,209,766.82	0.30

59	127078	优彩转债	13,057,600.21	0.30
60	127016	鲁泰转债	12,917,645.29	0.30
61	123144	裕兴转债	12,893,105.86	0.30
62	113606	荣泰转债	12,738,630.77	0.29
63	111001	山玻转债	12,544,044.23	0.29
64	127091	科数转债	12,466,247.24	0.29
65	113679	芯能转债	12,306,394.93	0.28
66	123122	富瀚转债	12,277,278.36	0.28
67	113605	大参转债	12,201,308.75	0.28
68	123215	铭利转债	12,053,124.88	0.28
69	123174	精锻转债	11,723,005.07	0.27
70	111016	神通转债	11,694,968.70	0.27
71	123133	佩蒂转债	11,681,709.17	0.27
72	111014	李子转债	11,569,090.33	0.27
73	123210	信服转债	11,549,772.48	0.27
74	118005	天奈转债	11,449,869.75	0.26
75	113636	甬金转债	11,442,196.68	0.26
76	113616	韦尔转债	11,439,353.93	0.26
77	118033	华特转债	11,384,169.36	0.26
78	113584	家悦转债	11,268,346.08	0.26
79	123124	晶瑞转 2	11,114,703.78	0.26
80	113650	博 22 转债	10,972,064.77	0.25
81	113643	风语转债	10,928,908.64	0.25
82	113037	紫银转债	10,921,385.76	0.25
83	123154	火星转债	10,880,289.50	0.25
84	123082	北陆转债	10,751,888.78	0.25
85	118011	银微转债	10,748,472.26	0.25
86	123165	回天转债	10,571,736.38	0.24
87	113641	华友转债	10,447,162.24	0.24
88	113657	再 22 转债	10,374,870.45	0.24
89	118014	高测转债	10,310,961.49	0.24
90	118035	国力转债	10,258,055.14	0.24
91	123217	富仕转债	10,111,472.63	0.23
92	123183	海顺转债	10,104,660.75	0.23
93	113649	丰山转债	10,088,604.85	0.23
94	123064	万孚转债	9,988,572.55	0.23
95	118032	建龙转债	9,868,807.78	0.23
96	123109	昌红转债	9,694,647.32	0.22
97	127031	洋丰转债	9,597,485.56	0.22
98	118029	富淼转债	9,505,780.47	0.22
99	118010	洁特转债	9,271,024.92	0.21
100	127088	赫达转债	9,228,317.48	0.21

101	123119	康泰转 2	9,196,709.89	0.21
102	113681	镇洋转债	9,033,986.00	0.21
103	123233	凯盛转债	8,932,701.89	0.21
104	127017	万青转债	8,754,937.42	0.20
105	118040	宏微转债	8,710,340.91	0.20
106	128125	华阳转债	8,641,228.19	0.20
107	118015	芯海转债	8,611,195.67	0.20
108	113640	苏利转债	8,594,820.39	0.20
109	113624	正川转债	8,551,333.62	0.20
110	127082	亚科转债	8,457,784.93	0.20
111	123151	康医转债	8,435,116.23	0.19
112	118006	阿拉转债	8,169,728.37	0.19
113	113593	沪工转债	7,971,741.08	0.18
114	128097	奥佳转债	7,903,450.65	0.18
115	127062	垒知转债	7,882,943.87	0.18
116	113608	威派转债	7,761,999.80	0.18
117	123197	光力转债	7,593,512.62	0.18
118	118028	会通转债	7,522,749.21	0.17
119	123214	东宝转债	7,490,801.44	0.17
120	113056	重银转债	7,485,537.21	0.17
121	123211	阳谷转债	7,318,077.75	0.17
122	118038	金宏转债	7,315,359.10	0.17
123	113579	健友转债	7,264,642.38	0.17
124	113660	寿 22 转债	7,239,078.39	0.17
125	118039	煜邦转债	7,091,330.76	0.16
126	123218	宏昌转债	6,696,117.37	0.15
127	123117	健帆转债	6,617,248.60	0.15
128	118036	力合转债	6,516,390.97	0.15
129	123185	能辉转债	6,492,396.27	0.15
130	123180	浙矿转债	6,473,277.91	0.15
131	123224	宇邦转债	6,437,067.15	0.15
132	123126	瑞丰转债	6,413,964.18	0.15
133	123236	家联转债	6,344,977.40	0.15
134	127090	兴瑞转债	6,316,274.38	0.15
135	123235	亿田转债	6,315,275.84	0.15
136	123160	泰福转债	6,304,467.43	0.15
137	127026	超声转债	6,242,393.33	0.14
138	123159	崧盛转债	6,235,765.98	0.14
139	123231	信测转债	6,028,964.64	0.14
140	113618	美诺转债	5,980,645.39	0.14
141	123088	威唐转债	5,892,304.26	0.14
142	113597	佳力转债	5,753,891.05	0.13

143	113676	荣 23 转债	5,697,832.78	0.13
144	110094	众和转债	5,690,607.30	0.13
145	127087	星帅转 2	5,644,924.78	0.13
146	123114	三角转债	5,438,091.48	0.13
147	113051	节能转债	5,422,695.89	0.13
148	118044	赛特转债	5,343,353.51	0.12
149	118041	星球转债	5,321,375.13	0.12
150	113675	新 23 转债	4,813,417.38	0.11
151	127074	麦米转 2	4,786,147.92	0.11
152	127069	小熊转债	4,723,685.81	0.11
153	123187	超达转债	4,714,678.26	0.11
154	123091	长海转债	4,490,508.80	0.10
155	127076	中宠转 2	4,418,997.06	0.10
156	111013	新港转债	4,248,409.69	0.10
157	123100	朗科转债	4,174,330.19	0.10
158	127044	蒙娜转债	4,087,830.86	0.09
159	123201	纽泰转债	4,073,456.48	0.09
160	128130	景兴转债	4,071,416.39	0.09
161	123093	金陵转债	3,875,450.16	0.09
162	127054	双箭转债	3,799,677.20	0.09
163	118013	道通转债	3,794,863.07	0.09
164	113664	大元转债	3,758,228.63	0.09
165	123152	润禾转债	3,705,210.17	0.09
166	127093	章鼓转债	3,652,195.31	0.08
167	113542	好客转债	3,513,752.33	0.08
168	113674	华设转债	3,427,219.44	0.08
169	113671	武进转债	3,290,954.91	0.08
170	123129	锦鸡转债	3,086,306.41	0.07
171	123039	开润转债	2,765,626.10	0.06
172	123065	宝莱转债	2,680,658.30	0.06
173	123237	佳禾转债	2,402,672.67	0.06
174	111003	聚合转债	2,360,398.24	0.05
175	123195	蓝晓转 02	2,241,696.82	0.05
176	123130	设研转债	2,020,407.89	0.05
177	127025	冀东转债	2,011,328.12	0.05
178	128143	锋龙转债	1,978,830.67	0.05
179	123120	隆华转债	1,573,368.45	0.04
180	127051	博杰转债	1,499,780.75	0.03
181	111011	冠盛转债	1,054,487.44	0.02
182	123108	乐普转 2	812,902.25	0.02
183	128137	洁美转债	755,455.24	0.02
184	127055	精装转债	459,742.92	0.01

185	123072	乐歌转债	354,898.77	0.01
186	123112	万讯转债	296,824.51	0.01
187	123101	拓斯转债	290,435.59	0.01
188	110084	贵燃转债	216,095.92	0.00
189	128095	恩捷转债	197,127.52	0.00
190	123203	明电转 02	86,291.07	0.00
191	123145	药石转债	31,628.86	0.00
192	123199	山河转债	30,734.54	0.00
193	113637	华翔转债	1,249.80	0.00
194	123178	花园转债	1,227.39	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	安信目标收益债券 A	安信目标收益债券 C
报告期期初基金份额总额	3,470,960,949.91	994,697,942.01
报告期期间基金总申购份额	320,674,474.53	242,120,894.72
减：报告期期间基金总赎回份额	1,384,706,769.48	434,726,098.33
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	2,406,928,654.96	802,092,738.40

## § 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

单位：份

项目	安信目标收益债券 A	安信目标收益债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	15,928,639.69
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	15,928,639.69
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.50



## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2024-08-27	15,928,639.69	20,000,000.00	-
合计			15,928,639.69	20,000,000.00	

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率或费用与本基金法律文件的规定一致。

## § 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目标收益债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信目标收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信目标收益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