

# 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）2018 年第 2 季度报告

2018 年 06 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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。

安信永鑫增强债券型证券投资基金由安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型而成。安信永鑫定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为2018年4月16日至2018年5月11日，会议审议通过了《关于安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，权益登记日为2018年4月13日。2018年5月15日，本基金管理人发布《关于安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，该决议自2018年5月14日起生效。依据中国证监会2018年3月19日《关于准予安信永鑫定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]499号）及上述基金份额持有人大会决议，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金变更运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、基金估值、基金费用、收益分配等事项，并更名为“安信永鑫增强债券型证券投资基金”。自2018年6月12日起，由《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》生效，原《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

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。

安信永鑫增强债券型证券投资基金报告期自2018年6月12日起至2018年6月30日止，原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金报告期自2018年4月1日起至2018年6月11日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	安信永鑫增强债券
基金主代码	003637

基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 06 月 12 日	
报告期末基金份额总额	3,571,097.04 份	
投资目标	本基金在严格控制信用风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	资产配置方面，本基金通过上下结合的宏观和微观研究，综合考虑权益的估值水平、风险收益比和固定收益资产的预期收益状况，合理确定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。债券投资方面，本基金动态调整债券资产在信用债与利率债之间的配比，采用组合久期配置策略、品种配置策略、信用投资策略、可转债投资策略和可交债投资策略，进行积极的债券配置。股票投资方面，本基金将谨慎确定基金资产中权益类品种的投资比例，并根据对宏观经济、市场流动性、股票估值水平、市场情绪等因素的综合考量，对该投资比例进行动态调整。资产支持证券投资方面，本基金将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，制定周密的投资策略。此外，本基金将在严格控制风险的前提下，投资国债期货、权证等衍生金融工具。	
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
下属分级基金的交易代码	003637	003638
报告期末下属分级基金的份 额总额	3,377,040.50 份	194,056.54 份

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	安信永鑫定开债	
基金主代码	003637	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 01 月 13 日	
报告期末基金份额总额	3,611,858.22 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	为合理控制本基金在开放期内的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，在封闭期内，本基金将严格遵守投资组合久期与封闭期适当匹配的原则。本基金将基于宏观经济研究、货币政策研究、利率研究和证券市场政策分析等宏观基本面研究，综合信用分析、流动性分析、预期收益及市场结构等因素的分析结果，在符合本基金投资比例限制和久期配置的基础上，通过合理配置并调整国债、央票、金融债、企业债、公司债等不同债券类属券种在投资组合中的构成比例，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。在开放期内，基金管理人将采取各种有效措施保障基金运作安排，为防范流动性风险，本基金将主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的组合流动性，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C
下属分级基金的交易代码	003637	003638
报告期末下属分级基金的份 额总额	3,418,085.27 份	193,772.95 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年06月12日-2018年06月30日)	报告期(2018年06月12日-2018年06月30日)
	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
1. 本期已实现收益	3,364.44	161.93
2. 本期利润	12,446.19	684.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0035
4. 期末基金资产净值	3,554,378.81	204,300.06
5. 期末基金份额净值	1.0525	1.0528

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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年04月01日-2018年06月11日)	报告期(2018年04月01日-2018年06月11日)
	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C
1. 本期已实现收益	268,986.94	6,471.53
2. 本期利润	170,990.80	2,026.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0149	0.0098
4. 期末基金资产净值	3,619,145.60	205,642.91
5. 期末基金份额净值	1.0588	1.0613

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（转型后）

#### 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

安信永鑫增强债券 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

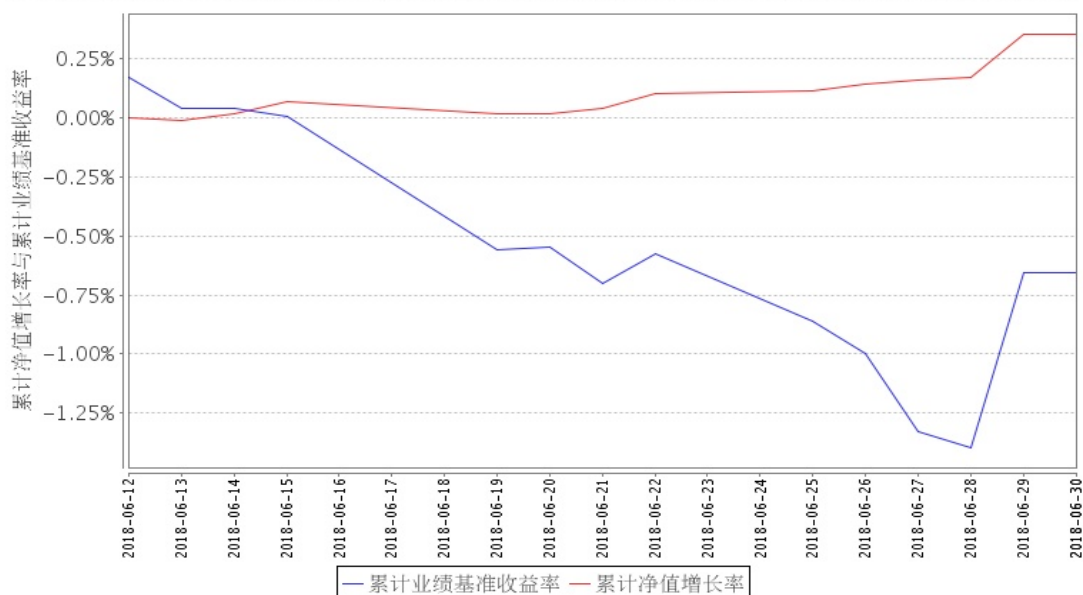
自基金转型以来	0.35%	0.05%	-0.65%	0.30%	1.00%	-0.25%
---------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

安信永鑫增强债券 C

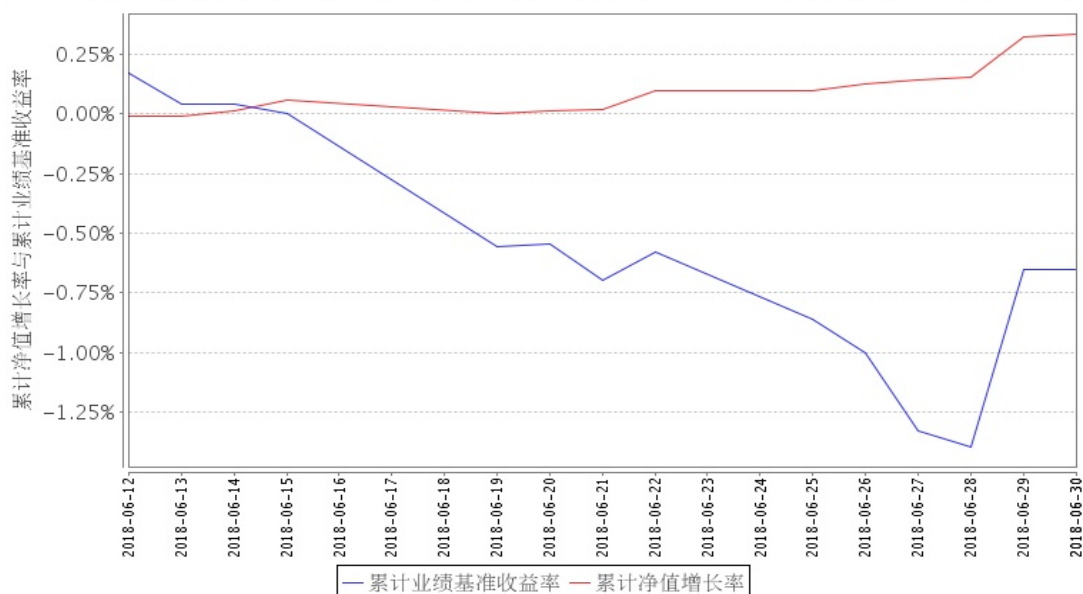
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型以来	0.33%	0.05%	-0.65%	0.30%	0.98%	-0.25%

### 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

安信永鑫增强债券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



安信永鑫增强债券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2018年6月12日由安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为2018年6月12日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

安信永鑫定开债 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
自2018年 4月1日起 至2018年 6月11日	0.91%	0.09%	0.76%	0.16%	0.15%	-0.07%

安信永鑫定开债 C

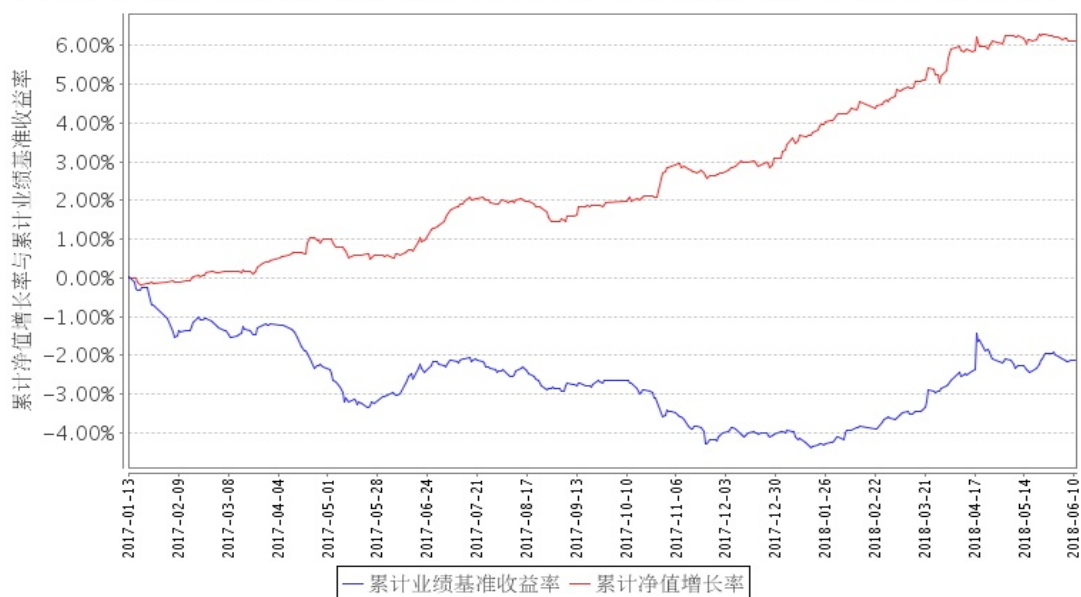
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
自2018年 4月1日起 至2018年 6月11日	0.89%	0.09%	0.76%	0.16%	0.13%	-0.07%

#### 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

安信永鑫定开债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



安信永鑫定开债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2017年1月13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。

3、本基金自2018年6月12日起，由《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》生效，原《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	2018年6月12日	-	13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）



					<p>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。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信永利信用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、安信尊享纯债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）、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
张翼飞	本基金的基金经理	2018年6月12日	-	7.5	<p>张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、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。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基</p>

					金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信尊享纯债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）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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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	-	13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。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。

					<p>现任安信永利信用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、安信尊享纯债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）、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
张翼飞	本基金的基金经理	2017年1月13日	-	7.5	<p>张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、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。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信现金管理货币市场基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、</p>

					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、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、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）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。

#### 4.2 管理人对报告期内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》、《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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，市场避险情绪抬升，导致债市出现比较显著的分化。中低评级债券有所下跌，高评级债券大致走平，而利率债有所上涨。市场资金比较充裕，但融资成本方面，尤其在跨月跨季的时点上，信用债融资成本和利率债融资成本出现了显著的差异。

期间，本基金投资组合继续坚持了中短久期和中高杠杆的策略，目前组合持仓以中高等级国企信用债、短久期利率债为主。在当前经济面临一定下行风险、信用事件时有发生的市场态势中，我们致力于在尽可能规避信用风险的前提下，获取“高质量”的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，安信永鑫增强债券型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.0525 元，自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 6 月 30 日止，基金份额净值增长率为 0.35%；截至 2018 年 6 月 30 日，安信永鑫增强债券型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.0528 元，自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 6 月 30 日止，基金份额净值增长率为 0.33%；同期业绩比较基准收益率为-0.65%。

截至 2018 年 6 月 11 日，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 A 类基金份额净值为 1.0588 元，自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，基金份额净值增长率为 0.91%；截至 2018 年 6 月 11 日，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 C 类基金份额净值为 1.0613 元，自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，基金份额净值增长率为 0.89%；同期业绩比较基准收益率为 0.76%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型后：

自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 6 月 30 日止，安信永鑫增强债券型证券投资基金未出现连续 20 个工作日持有人数不满 200 人或资产净值低于五千万的情形。

转型前：

自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金出现了连续 20 个工作日持有人数不满 200 人的情形，时间范围为 2018 年 4 月 2 日至 2018 年 6 月 11 日；自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2018 年 4 月 2 日至 2018 年 6 月 11 日。

## § 5 投资组合报告（转型后）

### 5.1 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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,761,718.60	92.28
	其中：债券	3,761,718.60	92.28
	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	254,381.86	6.24
8	其他资产	60,298.42	1.48
9	合计	4,076,398.88	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境内股票。

### 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港股通股票。

## 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

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	3,004,378.30	79.93
	其中：政策性金融债	3,003,369.60	79.90
4	企业债券	664,840.30	17.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	92,500.00	2.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,761,718.60	100.08

## 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	018005	国开 1701	29,920	3,003,369.60	79.90
2	122366	14 武钢债	3,150	314,842.50	8.38
3	136039	15 石化 01	2,720	270,884.80	7.21
4	132007	16 凤凰 EB	1,000	92,500.00	2.46
5	124463	PR 津住宅	410	24,964.90	0.66

## 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

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

### 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

本基金本报告期内未持有国债期货合约。

## 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除 13 中原债（证券代码：122299 SH，对应上市公司为中原证券，股票代码：601375），本期没有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。

2017 年 11 月 30 日，中原证券股份有限公司（以下简称“该公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）调查通知书（稽查总队调查通字 171577 号）。因该公司在担任天津丰利创新投资有限公司收购徐州杰能科技发展有限公司股权事项的财务顾问过程中涉嫌未勤勉尽责，证监会决定对其进行立案调查。

2018 年 2 月 9 日，该公司收到中国证券监督管理委员会河南监管局（以下简称“河南证监局”）《关于对中原证券股份有限公司实施责令改正等监督管理措施的决定》（[2018]1 号）。因该公司合规管理制度不健全，机制不完善；公司合规管理意识薄弱，合规人员配置不足；公司内控管理制度执行不到位；公司重业务收入，轻风险控制，考核激励机制失衡，河南证监局决定采取监督管理措施。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 5.10.2

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	6,551.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,463.38
5	应收申购款	9,283.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,298.42

#### 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	132007	16 凤凰 EB	92,500.00	2.46

#### 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 5.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,752,114.10	92.28
	其中：债券	3,752,114.10	92.28
	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	264,326.71	6.50
8	其他资产	49,578.90	1.22
9	合计	4,066,019.71	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境内股票。

#### 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港股通股票。

### 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

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	2,994,803.60	78.30
	其中：政策性金融债	2,993,795.20	78.27
4	企业债券	664,720.50	17.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	92,590.00	2.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,752,114.10	98.10

### 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	018005	国开 1701	29,920	2,993,795.20	78.27
2	122366	14 武钢债	3,150	314,811.00	8.23
3	136039	15 石化 01	2,720	270,748.80	7.08
4	132007	16 凤凰 EB	1,000	92,590.00	2.42
5	124463	PR 津住宅	410	25,022.30	0.65

### 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

#### 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

本基金本报告期内未持有国债期货合约。

## 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除 13 中原债（证券代码：122299 SH，对应上市公司为中原证券，股票代码：601375），本期没有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。

2017 年 11 月 30 日，中原证券股份有限公司（以下简称“该公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）调查通知书（稽查总队调查通字 171577 号）。因该公司在担任天津丰利创新投资有限公司收购徐州杰能科技发展有限公司股权事项的财务顾问过程中涉嫌未勤勉尽责，证监会决定对其进行立案调查。

2018 年 2 月 9 日，该公司收到中国证券监督管理委员会河南监管局（以下简称“河南证监局”）《关于对中原证券股份有限公司实施责令改正等监督管理措施的决定》（[2018]1 号）。因该公司合规管理制度不健全，机制不完善；公司合规管理意识薄弱，合规人员配置不足；公司内控管理制度执行不到位；公司重业务收入，轻风险控制，考核激励机制失衡，河南证监局决定采取监督管理措施。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.10.2

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	6,551.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,027.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	49,578.90
---	----	-----------

#### 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	132007	16 凤凰 EB	92,590.00	2.42

#### 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（转型后）

单位：份

项目	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
基金合同生效日（2018年6月12日）持有的基金份额	3,418,085.27	193,772.95
报告期期间基金总申购份额（自2018年6月12日起至2018年6月30日）	8,940.21	283.59
减：报告期期间基金总赎回份额（自2018年6月12日起至2018年6月30日）	49,984.98	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）（自2018年6月12日起至2018年6月30日）	-	-
报告期期末基金份额总额	3,377,040.50	194,056.54

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

### § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C
报告期期初基金份额总额	16,941,507.97	215,305.22
报告期期间基金总申购份额（自2018年4月1日起至2018年6月11日）	188.22	2,542.42
减：报告期期间基金总赎回份额（自2018年4月1日起至2018年6月11日）	13,523,610.92	24,074.69

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）（自2018年4月1日起至2018年6月11日）	-	-
报告期期末基金份额总额（2018年6月11日）	3,418,085.27	193,772.95

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末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（转型后）

### 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
个人	1	20180612-20180630;	1,994,557.95	-	-	1,994,557.95	55.85
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：							
（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动							

性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

#### 9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180401-20180514;	12,327,402.48	-	12,327,402.48	-	-
个人	1	20180515-20180611;	1,994,557.95	-	-	1,994,557.95	55.22

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略

略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信永鑫定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、中国证监会核准安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型的文件；
- 3、《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《安信永鑫增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《安信永鑫增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 6、《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 7、《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 10.3 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

2018年7月20日

