

安信长鑫增强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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	安信长鑫增强债券
基金主代码	020785
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 11 日
报告期末基金份额总额	1,438,567,681.61 份
投资目标	本基金在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定债券、衍生品、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、类属配置策略、个券选择策略、信用债投资策略等策略。在有效控制组合风险并保持基金资产流动性的前提下，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，精选个券，控制风险，增强基金资产的使用效率和投资收益。</p> <p>3、国债期货投资策略</p> <p>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。基金管理人将以套期保值为目的，按照相关法律</p>

	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。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+恒生指数收益率（经汇率调整后）*3%	
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信长鑫增强债券 A	安信长鑫增强债券 C
下属分级基金的交易代码	020785	020786
报告期末下属分级基金的份额总额	129,549,244.42 份	1,309,018,437.19 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）	
	安信长鑫增强债券 A	安信长鑫增强债券 C
1. 本期已实现收益	13,881.56	-404,736.47
2. 本期利润	547,833.44	762,144.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038	0.0004
4. 期末基金资产净值	130,926,437.54	1,319,999,669.64
5. 期末基金份额净值	1.0106	1.0084

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、本基金基金合同生效日为 2024 年 3 月 11 日，截至本报告末本基金合同生效未满一年。

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

安信长鑫增强债券 A

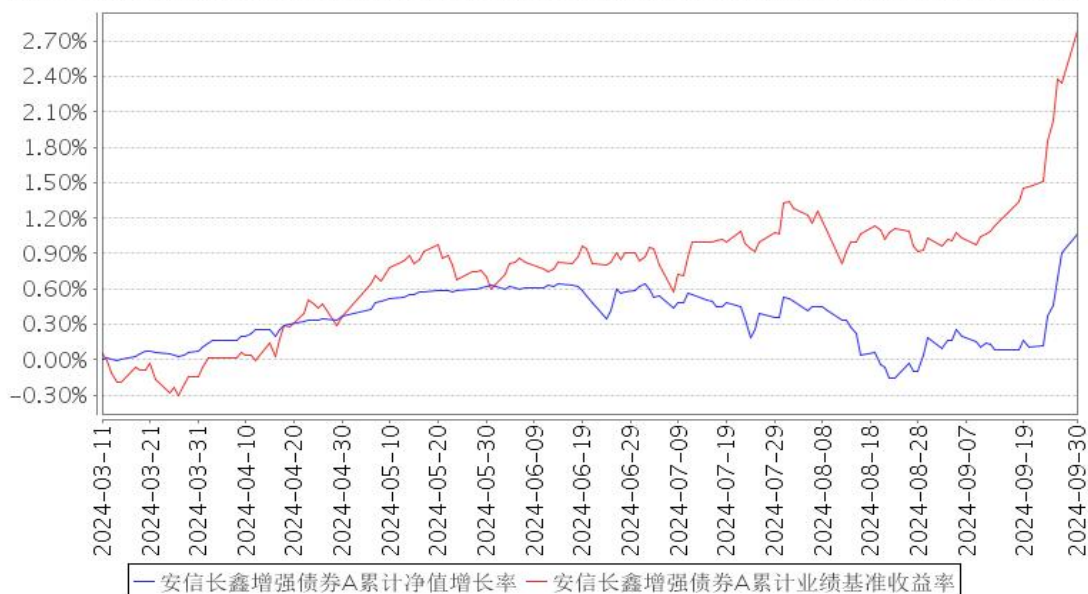
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.47%	0.09%	1.86%	0.12%	-1.39%	-0.03%
过去六个月	0.99%	0.07%	2.93%	0.10%	-1.94%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.06%	0.06%	2.78%	0.10%	-1.72%	-0.04%

安信长鑫增强债券 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
过去三个月	0.38%	0.09%	1.86%	0.12%	-1.48%	-0.03%
过去六个月	0.79%	0.07%	2.93%	0.10%	-2.14%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.84%	0.06%	2.78%	0.10%	-1.94%	-0.04%

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

安信长鑫增强债券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



安信长鑫增强债券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、本基金基金合同生效日为 2024 年 3 月 11 日，截至本报告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。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，混合资产投资部总经理	2024年3月11日	-	19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、混合资产投资部基金经理、混合资产投资部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部总经理。现任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、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；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、安信稳健汇利一年持有期

					混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、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。
--	--	--	--	--	--

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

三季度，权益市场基本延续了二季度以来的低风险偏好、偏防守的交易结构，直至 9 月底，随着央行等部门集中释放较大力度的多项举措，投资者的风险偏好迅速扭转。

值得一提的是，在投资者预期扭转后，资本市场的反应程度、场外资金涌入市场的速度，均

以一个非常猛烈的方式展开，这在资本市场过去多年的运行历史中也不多见。

我们认为，其背后的根本原因在于，过去两年权益市场的持续低迷，代表了住户部门的资产配置组合越来越偏离长期意向中枢，投资者普遍回避风险资产，对波动高度厌恶，同时，资金对无风险收益的追逐大幅压低了长端利率。

因而，预期改变后，住户部门的首要需求是重新调整资产配置，且由于过去两年的积累，重配置的规模较大，速度上也较为坚决，这同时导致权益资产的迅速回暖，以及 10 年期国债收益率的上行。我们预计这一过程需要较长的时间消化。

本季度，关于权益资产的投资运作，可以总结为两点，一是股票持仓比例总体保持稳定，维持相对均衡的股票组合，这样的组合并无法躲避掉市场系统性的下跌，但在弱势环境下，有助于熨平波动，二是在可转债市场恐慌的阶段，一度提高了可转债的持仓比例，相当于间接提升了权益持仓的比例。多数可转债的交易活跃度不高，叠加其投资者以机构为主，且容易受到负债端赎回的影响，导致可转债市场走弱阶段，更容易出现被动卖出带来的超调，因而在风险释放后，其隐含的风险收益比优于股票加纯债。

纯债方面，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，投资者对各类债券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。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，债券市场随之上演“V 型”反转行情，在此后的约一周时间快速回吐本季度的绝大部分涨幅。期间，本基金主要持有了利率债以及高等级信用债，并通过国债期货对冲策略，适时调整组合的久期风险敞口。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，同时比较好地控制了组合波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信长鑫增强债券 A 基金份额净值为 1.0106 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.47%；安信长鑫增强债券 C 基金份额净值为 1.0084 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.38%；同期业绩比较基准收益率为 1.86%。

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	34,086,544.00	2.30
	其中：股票	34,086,544.00	2.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,362,020,855.68	91.82
	其中：债券	1,362,020,855.68	91.82
	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	28,994,258.08	1.95
	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	50,001,885.31	3.37
8	其他资产	8,215,906.10	0.55
9	合计	1,483,319,449.17	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	417,780.00	0.03
C	制造业	23,870,038.00	1.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	750,066.00	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	921,816.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,537,831.00	0.31
K	房地产业	2,178,246.00	0.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,026,195.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	384,572.00	0.03
S	综合	-	-

合计	34,086,544.00	2.35
----	---------------	------

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 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	50,900	2,905,881.00	0.20
2	600585	海螺水泥	102,100	2,668,894.00	0.18
3	300750	宁德时代	7,800	1,964,742.00	0.14
4	600519	贵州茅台	1,100	1,922,800.00	0.13
5	002142	宁波银行	63,500	1,631,950.00	0.11
6	002466	天齐锂业	45,000	1,584,000.00	0.11
7	000568	泸州老窖	9,000	1,347,300.00	0.09
8	001979	招商蛇口	98,400	1,205,400.00	0.08
9	000858	五粮液	7,400	1,202,574.00	0.08
10	300015	爱尔眼科	64,500	1,026,195.00	0.07

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	3,027,124.11	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,316,318,609.69	90.72
	其中：政策性金融债	91,352,262.30	6.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	42,675,121.88	2.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,362,020,855.68	93.87

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	2028033	20 建设银行二级	1,400,000	142,865,090.41	9.85
2	2028025	20 浦发银行二级 01	1,400,000	142,772,629.04	9.84
3	2028024	20 中信银行二级	1,400,000	142,684,003.29	9.83
4	2028013	20 农业银行二级 01	1,400,000	142,499,824.66	9.82
5	2420021	24 南京银行 01	1,000,000	100,953,517.81	6.96

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
TF2412	国债 2412	-81	-84,673,350.00	-134.77	-
公允价值变动总额合计（元）					-134.77
国债期货投资本期收益（元）					-3,144,744.20
国债期货投资本期公允价值变动（元）					1,914,965.23

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金运用国债期货工具调节组合的期限结构以及久期水平。报告期内，产品择机通过国债期货交易，管理产品的利率风险，符合既定的投资策略和投资目标。

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 建设银行二级（代码：2028033 CY）、20 中信银行二级（2028024 CY）、20 农业银行二级 01（代码：2028013 CY）、24 交行债 01（代码：212480013 CY）、19 上海银行二级（代码：1920066 CY）、20 宁波银行二级（代码：2020044 CY）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. 中国建设银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，中国建设银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款、

没收违法所得。

2024 年 1 月 5 日，中国建设银行股份有限公司因内部制度不完善、违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

2. 中信银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，中信银行股份有限公司因违规提供担保及财务资助、违规经营被国家金融监督管理总局罚款、没收违法所得。

2024 年 1 月 5 日，中信银行股份有限公司因信息报送异常不及时整改被国家金融监督管理总局罚款。

3. 中国农业银行股份有限公司

2023 年 11 月 17 日，中国农业银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款、没收违法所得。

2023 年 12 月 1 日，中国农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罚款、没收违法所得。

4. 交通银行股份有限公司

2024 年 6 月 21 日，交通银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

5. 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。

6. 宁波银行股份有限公司

2023 年 12 月 1 日，宁波银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局宁波市分局罚款。

2024 年 6 月 21 日，宁波银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局宁波监管局罚款。

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	1,086,020.68
2	应收证券清算款	6,573,885.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	556,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,215,906.10

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	13,265,374.39	0.91
2	110059	浦发转债	3,324,318.90	0.23
3	123072	乐歌转债	2,983,170.41	0.21
4	123065	宝莱转债	2,423,903.27	0.17
5	113655	欧 22 转债	1,617,050.41	0.11
6	118034	晶能转债	1,182,242.30	0.08
7	123180	浙矿转债	1,105,461.23	0.08
8	123179	立高转债	884,564.43	0.06
9	113657	再 22 转债	817,807.40	0.06
10	110085	通 22 转债	808,377.30	0.06
11	113059	福莱转债	733,375.81	0.05
12	123214	东宝转债	690,610.56	0.05
13	123185	能辉转债	681,295.78	0.05
14	123093	金陵转债	629,862.15	0.04
15	123233	凯盛转债	596,427.45	0.04
16	113584	家悦转债	545,860.39	0.04
17	123104	卫宁转债	515,611.62	0.04
18	118036	力合转债	459,357.47	0.03
19	118011	银微转债	447,940.43	0.03
20	123183	海顺转债	443,228.33	0.03
21	113053	隆 22 转债	438,894.50	0.03
22	113681	镇洋转债	419,694.93	0.03
23	113654	永 02 转债	340,364.89	0.02
24	123039	开润转债	336,674.79	0.02
25	123108	乐普转 2	331,689.39	0.02

26	113605	大参转债	329,563.97	0.02
27	123159	崧盛转债	329,092.18	0.02
28	127031	洋丰转债	315,282.99	0.02
29	127059	永东转 2	299,218.33	0.02
30	118029	富淼转债	298,965.30	0.02
31	113608	威派转债	296,571.80	0.02
32	113660	寿 22 转债	289,433.54	0.02
33	123174	精锻转债	272,227.65	0.02
34	123119	康泰转 2	268,647.13	0.02
35	127042	嘉美转债	241,827.07	0.02
36	113542	好客转债	225,240.53	0.02
37	111004	明新转债	223,436.02	0.02
38	128097	奥佳转债	223,400.21	0.02
39	123113	仙乐转债	220,035.85	0.02
40	113656	嘉诚转债	204,904.63	0.01
41	123197	光力转债	195,483.62	0.01
42	118028	会通转债	155,177.79	0.01
43	123193	海能转债	150,171.75	0.01
44	113048	晶科转债	149,434.44	0.01
45	113627	太平转债	148,270.58	0.01
46	123165	回天转债	148,019.89	0.01
47	127073	天赐转债	147,799.32	0.01
48	128071	合兴转债	147,206.24	0.01
49	128117	道恩转债	145,212.06	0.01
50	123154	火星转债	140,304.31	0.01
51	123109	昌红转债	137,009.64	0.01
52	113650	博 22 转债	103,195.08	0.01
53	127016	鲁泰转债	97,865.16	0.01
54	123133	佩蒂转债	81,216.20	0.01
55	110089	兴发转债	80,971.40	0.01
56	128135	洽洽转债	80,384.57	0.01
57	123235	亿田转债	75,939.15	0.01
58	123151	康医转债	73,536.52	0.01
59	127024	盈峰转债	59,008.52	0.00
60	111014	李子转债	55,929.35	0.00
61	113624	正川转债	47,091.20	0.00
62	127090	兴瑞转债	34,488.15	0.00
63	123100	朗科转债	31,117.32	0.00
64	123122	富瀚转债	21,762.82	0.00
65	113618	美诺转债	21,256.96	0.00
66	118033	华特转债	20,900.49	0.00
67	113640	苏利转债	18,072.33	0.00

68	123152	润禾转债	17,488.41	0.00
69	123091	长海转债	13,694.05	0.00
70	123115	捷捷转债	11,400.81	0.00
71	111003	聚合转债	3,466.08	0.00
72	123112	万讯转债	1,241.94	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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	安信长鑫增强债券 A	安信长鑫增强债券 C
报告期期初基金份额总额	164,619,671.74	2,995,732,057.71
报告期期间基金总申购份额	10,394,682.10	77,961,815.03
减：报告期期间基金总赎回份额	45,465,109.42	1,764,675,435.55
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	129,549,244.42	1,309,018,437.19

§ 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、中国证监会准予安信长鑫增强债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信长鑫增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信长鑫增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信长鑫增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

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