

# 安信永鑫增强债券型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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 2024 年 7 月 17 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 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 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	4,660,898,069.03 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。 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。	
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	2,411,480,189.40 份	2,249,417,879.63 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 4 月 1 日-2024 年 6 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	-8,658,599.98	-10,180,074.31
2. 本期利润	21,891,733.49	24,984,924.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0091
4. 期末基金资产净值	2,535,334,084.60	2,363,508,457.00
5. 期末基金份额净值	1.0514	1.0507

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
过去三个月	0.59%	0.19%	0.38%	0.14%	0.21%	0.05%
过去六个月	0.32%	0.27%	2.05%	0.17%	-1.73%	0.10%
过去一年	0.44%	0.21%	0.48%	0.17%	-0.04%	0.04%

过去三年	8.42%	0.16%	-2.67%	0.21%	11.09%	-0.05%
过去五年	17.07%	0.14%	5.58%	0.23%	11.49%	-0.09%
自基金转型起至今	25.75%	0.13%	9.53%	0.24%	16.22%	-0.11%

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
过去三个月	0.56%	0.19%	0.38%	0.14%	0.18%	0.05%
过去六个月	0.27%	0.27%	2.05%	0.17%	-1.78%	0.10%
过去一年	0.32%	0.21%	0.48%	0.17%	-0.16%	0.04%
过去三年	7.78%	0.16%	-2.67%	0.21%	10.45%	-0.05%
过去五年	15.68%	0.14%	5.58%	0.23%	10.10%	-0.09%
自基金转型起至今	23.85%	0.13%	9.53%	0.24%	14.32%	-0.11%

### 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，本基金合同生效日为 2018 年 6 月 12 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，混合资产投资部总经理	2021年4月26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。
黄琬舒	本基金的基金经理	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、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。现任安信稳健增利混合型证券投资基金、安信稳健聚中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会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

二季度，沪深 300、中证 500、中证 1000 涨跌幅分别为-2.14%、-6.50%、-10.02%，不同宽基指数的表现延续了今年一季度的结构性反差。本季度内，各指数总体先涨后跌。在 5 月后的下跌过程，我们小幅建立了股票仓位，持仓整体较为分散。

本季度，针对经济、地产、资本市场等多个领域的政策频出，投资者的信心恢复程度依赖于政策效果的逐步体现。二季度，我们看到了利率市场、类债属性的红利股、成长股等不同驱动因素的资产表现迥异，其背后逻辑具备较为紧密的相关性。因而，若未来市场预期产生变化，我们认为也大概率会体现为各类资产的同步展开。

可转债的走势整体与股票高度关联，但本季度较为特殊的地方，一是 4 月下旬至 5 月中上旬，可转债相对股票表现出更显著的估值提升；二是在 6 月份，可转债市场对信用重定价，部分标的估值受到大幅冲击，这一过程的源头固然是部分股票跌幅较大，甚至个别标的产生退市风险，带来了投资者对转债违约事件的担忧，但也由于可转债本身的流动性偏弱，当投资者短期内一致调仓时，对估值的冲击容易过度反应，我们认为，有部分优质标的在此过程或被“错杀”，因而，在 6 月下跌的阶段，我们逆向提高了可转债的持仓比例。

在纯债方面，本季度的国内经济基本面情况保持平稳，生产端表现稳中偏强而需求端表现整体仍然偏弱。地产投资方面持续磨底，地产新政的效果有待进一步观察，而制造业 PMI 显示经济回升的基础仍需加强。资本市场方面，权益市场阶段性波动较大，资金风险偏好持续降低，受供

求因素影响，债券市场持续走牛，债券收益率持续下行，短端收益率下行幅度大于长端，曲线走陡。期间，本基金主要持有了利率债以及高等级信用债，同时以国债期货为工具，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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信永鑫增强债券 A 基金份额净值为 1.0514 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.59%；安信永鑫增强债券 C 基金份额净值为 1.0507 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.56%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 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	586,854,269.37	9.22
	其中：股票	586,854,269.37	9.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,626,827,303.78	88.36
	其中：债券	5,626,827,303.78	88.36
	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	3,000,000.00	0.05
	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	91,186,889.94	1.43
8	其他资产	60,129,894.65	0.94
9	合计	6,367,998,357.74	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	2,350,803.00	0.05
C	制造业	424,179,220.84	8.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,905,900.00	0.10
E	建筑业	2,584,528.00	0.05



F	批发和零售业	11,010,303.88	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	19,402,702.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,489,732.00	0.03
J	金融业	82,407,812.80	1.68
K	房地产业	22,557,389.85	0.46
L	租赁和商务服务业	1,567,116.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,159,333.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,721,400.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	2,518,028.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	586,854,269.37	11.98

### 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	600036	招商银行	621,700	21,255,923.00	0.43
2	601318	中国平安	492,600	20,373,936.00	0.42
3	600585	海螺水泥	764,400	18,032,196.00	0.37
4	000333	美的集团	239,000	15,415,500.00	0.31
5	600519	贵州茅台	10,200	14,967,378.00	0.31
6	300750	宁德时代	81,840	14,733,655.20	0.30
7	300470	中密控股	431,170	14,577,857.70	0.30
8	001979	招商蛇口	1,287,700	11,318,883.00	0.23
9	002466	天齐锂业	331,700	9,921,147.00	0.20
10	000858	五粮液	76,600	9,807,864.00	0.20

### 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	23,521,135.07	0.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,341,122,274.96	88.62
	其中：政策性金融债	328,043,002.04	6.70
4	企业债券	298,786.04	0.01
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,261,885,107.71	25.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,626,827,303.78	114.86

### 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	110059	浦发转债	4,360,230	480,825,975.92	9.82
2	113052	兴业转债	2,745,560	297,118,109.42	6.07
3	115648	23 招证 G6	1,640,000	169,468,514.84	3.46
4	150210	15 国开 10	1,600,000	164,641,928.77	3.36
5	148179	23 国证 02	1,500,000	154,209,427.40	3.15

### 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

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
T2409	10 年期国债 2409	-924	973,526,400.00	-10,605,117.84	-
公允价值变动总额合计（元）					-10,605,117.84
国债期货投资本期收益（元）					-8,951,604.69

国债期货投资本期公允价值变动（元）	-5,329,924.94
-------------------	---------------

### 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。

## 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）、23 招证 G6（代码：115648 SH）、23 国证 02（代码：148179 SZ）、23 交行债 01（代码：212380008 CY）、24 广发 06（代码：148711 SZ）、24 建行债 01A（代码：212480001 CY）、22 东证 04（代码：138727 SH）、23 中证 15（代码：115780 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。

#### 2. 招商证券股份有限公司

2023 年 9 月 11 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 2 月 2 日，招商证券股份有限公司因未及时披露公司重大事件被中国证券监督管理委员会安徽监管局出具警示函。

2024 年 2 月 9 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会深圳监管局责令合规检查与报告。

2024 年 4 月 30 日，招商证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所通报批评。

#### 3. 国信证券股份有限公司

2023 年 9 月 6 日，国信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会责令改正。

2024 年 1 月 4 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 4 月 19 日，国信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会深

圳监管局出具警示函。

2024 年 5 月 6 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函。

2024 年 5 月 10 日，国信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函。

2024 年 6 月 9 日，国信证券股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局北京市西城区税务局第六税务所责令改正。

#### 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. 广发证券股份有限公司

2023 年 7 月 18 日，广发证券股份有限公司因违规经营，提供虚假资料证明文件被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2023 年 8 月—2024 年 5 月，广发证券股份有限公司多次因未按期申报税款被国家税务总局广州市天河区税务局天河南税务所责令改正。

2023 年 8 月 31 日，广发证券股份有限公司多次因违反反洗钱法被中国人民银行广东省分行罚款。

2023 年 9 月 11 日，广发证券股份有限公司因违规经营、提供虚假资料证明文件被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2023 年 12 月 27 日，广发证券股份有限公司因未依法履行职责被国家税务总局广州市税务局第三税务分局采取行政监管措施。

2024 年 3 月 22 日，广发证券股份有限公司因内部制度不完善被上海证券交易所警示。

#### 6. 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。

2024 年 6 月 10 日，中国建设银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局北京市西城区税务局第四税务所责令改正。

#### 7. 东方证券股份有限公司

2024 年 2 月 2 日，东方证券股份有限公司因公司治理类问题被国家金融监督管理总局上海监

管局出具警示函。

8. 中信证券股份有限公司

2023 年 7 月 13 日，中信证券股份有限公司因违规经营被中国证券监督管理委员会深圳监管局监管警示。

2023 年 8 月 29 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所书面警示。

2023 年 9 月 25 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所监管警示、书面警示。

2023 年 9 月 28 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管约谈。

2024 年 1 月 12 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管警示。

2024 年 4 月 13 日，中信证券股份有限公司因涉嫌违反法律法规被中国证券监督管理委员会立案调查。

2024 年 4 月 19 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会警告、罚款、没收违法所得、责令改正。

2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会监管罚款、没收违法所得。

2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 5 月 10 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函。

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	20,408,459.62
2	应收证券清算款	38,821,194.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	900,240.13

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	60,129,894.65

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	110059	浦发转债	480,825,975.92	9.82
2	113052	兴业转债	297,118,109.42	6.07
3	128129	青农转债	56,262,927.98	1.15
4	113042	上银转债	52,253,437.63	1.07
5	113037	紫银转债	24,487,212.85	0.50
6	118034	晶能转债	22,435,746.19	0.46
7	110081	闻泰转债	14,698,845.21	0.30
8	127089	晶澳转债	13,179,143.61	0.27
9	110085	通 22 转债	11,139,381.88	0.23
10	113053	隆 22 转债	8,485,979.70	0.17
11	113655	欧 22 转债	7,914,013.14	0.16
12	113624	正川转债	6,867,396.38	0.14
13	123093	金陵转债	6,542,416.19	0.13
14	123179	立高转债	5,816,094.27	0.12
15	123144	裕兴转债	5,792,104.25	0.12
16	123215	铭利转债	5,753,488.55	0.12
17	123180	浙矿转债	5,586,630.58	0.11
18	113657	再 22 转债	5,291,188.05	0.11
19	113059	福莱转债	5,160,090.37	0.11
20	113640	苏利转债	5,069,213.81	0.10
21	123151	康医转债	4,958,538.72	0.10
22	113608	威派转债	4,881,814.14	0.10
23	113649	丰山转债	4,649,780.80	0.09
24	123065	宝莱转债	4,626,509.19	0.09
25	118029	富淼转债	4,513,062.76	0.09
26	123072	乐歌转债	4,398,831.49	0.09
27	118006	阿拉转债	4,284,210.39	0.09
28	113048	晶科转债	4,083,640.96	0.08
29	118032	建龙转债	4,074,167.80	0.08
30	123126	瑞丰转债	4,055,355.97	0.08
31	127059	永东转 2	3,938,386.20	0.08
32	123165	回天转债	3,905,453.95	0.08
33	127044	蒙娜转债	3,833,125.59	0.08
34	123168	惠云转债	3,780,315.07	0.08
35	123166	蒙泰转债	3,677,940.24	0.08
36	118005	天奈转债	3,675,941.92	0.08

37	118039	煜邦转债	3,629,576.43	0.07
38	128117	道恩转债	3,521,687.95	0.07
39	123122	富瀚转债	3,494,327.83	0.07
40	111009	盛泰转债	3,460,375.34	0.07
41	113650	博 22 转债	3,447,532.00	0.07
42	113644	艾迪转债	3,408,476.57	0.07
43	123082	北陆转债	3,361,501.04	0.07
44	111001	山玻转债	3,316,791.85	0.07
45	127087	星帅转 2	3,288,682.50	0.07
46	113641	华友转债	3,254,047.13	0.07
47	128144	利民转债	3,235,958.37	0.07
48	118040	宏微转债	3,150,273.22	0.06
49	113653	永 22 转债	2,999,625.20	0.06
50	127042	嘉美转债	2,957,206.58	0.06
51	113654	永 02 转债	2,944,168.14	0.06
52	118011	银微转债	2,820,725.55	0.06
53	123233	凯盛转债	2,805,231.76	0.06
54	111004	明新转债	2,699,101.42	0.06
55	113618	美诺转债	2,563,871.04	0.05
56	123071	天能转债	2,501,937.74	0.05
57	123185	能辉转债	2,499,083.98	0.05
58	127060	湘佳转债	2,428,149.67	0.05
59	128125	华阳转债	2,378,471.71	0.05
60	113668	鹿山转债	2,308,047.11	0.05
61	123183	海顺转债	2,305,055.65	0.05
62	123214	东宝转债	2,185,034.70	0.04
63	123193	海能转债	2,177,884.78	0.04
64	128097	奥佳转债	2,176,318.87	0.04
65	127068	顺博转债	2,168,628.34	0.04
66	123132	回盛转债	2,148,794.61	0.04
67	123154	火星转债	2,093,431.50	0.04
68	123100	朗科转债	2,053,499.90	0.04
69	118031	天 23 转债	1,986,087.87	0.04
70	123104	卫宁转债	1,967,359.72	0.04
71	113679	芯能转债	1,942,819.92	0.04
72	123160	泰福转债	1,925,701.55	0.04
73	123159	崧盛转债	1,875,809.57	0.04
74	127062	垒知转债	1,864,374.72	0.04
75	127024	盈峰转债	1,857,797.43	0.04
76	128095	恩捷转债	1,786,651.74	0.04
77	123121	帝尔转债	1,786,541.75	0.04
78	123149	通裕转债	1,712,185.58	0.03

79	128116	瑞达转债	1,710,777.18	0.03
80	123076	强力转债	1,706,117.40	0.03
81	113584	家悦转债	1,705,613.36	0.03
82	123113	仙乐转债	1,684,100.00	0.03
83	111014	李子转债	1,673,702.50	0.03
84	123124	晶瑞转 2	1,618,148.30	0.03
85	113606	荣泰转债	1,589,994.68	0.03
86	113542	好客转债	1,512,097.56	0.03
87	113647	禾丰转债	1,506,317.49	0.03
88	123088	威唐转债	1,502,698.15	0.03
89	113627	太平转债	1,491,608.64	0.03
90	118035	国力转债	1,466,815.19	0.03
91	123169	正海转债	1,461,550.89	0.03
92	123120	隆华转债	1,451,696.76	0.03
93	118014	高测转债	1,388,810.08	0.03
94	127051	博杰转债	1,264,597.87	0.03
95	123115	捷捷转债	1,255,852.63	0.03
96	118015	芯海转债	1,252,438.40	0.03
97	123174	精锻转债	1,248,063.87	0.03
98	128071	合兴转债	1,186,513.39	0.02
99	123211	阳谷转债	1,105,756.99	0.02
100	128135	洽洽转债	995,614.85	0.02
101	113636	甬金转债	963,599.79	0.02
102	128130	景兴转债	941,438.42	0.02
103	123039	开润转债	845,784.23	0.02
104	113677	华懋转债	845,047.35	0.02
105	123091	长海转债	764,485.56	0.02
106	128131	崇达转 2	762,485.90	0.02
107	113670	金 23 转债	756,565.07	0.02
108	127078	优彩转债	664,089.61	0.01
109	127046	百润转债	620,001.70	0.01
110	123161	强联转债	619,200.39	0.01
111	113597	佳力转债	606,349.06	0.01
112	127041	弘亚转债	505,753.86	0.01
113	123108	乐普转 2	497,230.13	0.01
114	123202	祥源转债	490,424.00	0.01
115	113579	健友转债	468,299.11	0.01
116	113605	大参转债	440,169.82	0.01
117	118033	华特转债	363,258.29	0.01
118	110082	宏发转债	326,220.00	0.01
119	123133	佩蒂转债	319,786.12	0.01
120	127088	赫达转债	313,694.33	0.01



121	118009	华锐转债	275,879.28	0.01
122	127017	万青转债	261,282.07	0.01
123	123064	万孚转债	250,608.85	0.01
124	110076	华海转债	249,785.36	0.01
125	118038	金宏转债	207,444.83	0.00
126	113660	寿 22 转债	175,017.75	0.00
127	123152	润禾转债	67,021.15	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	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
报告期期初基金份额总额	3,105,365,001.67	3,169,698,698.31
报告期期间基金总申购份额	65,092,364.76	219,481,166.04
减：报告期期间基金总赎回份额	758,977,177.03	1,139,761,984.72
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	2,411,480,189.40	2,249,417,879.63

## § 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永鑫定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信永鑫增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信永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 7 月 18 日