

# 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 年年度报告

2018 年 12 月 31 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

送出日期：2019 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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 12 月 31 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 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况（转型后） .....	5
2.1 基金基本情况（转型前） .....	5
2.2 基金产品说明（转型后） .....	6
2.2 基金产品说明（转型前） .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后).....	7
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前).....	8
3.2 基金净值表现（转型后） .....	9
3.2 基金净值表现（转型前） .....	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后） .....	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前） .....	15
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	20
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	22
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	23
<b>§ 6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>24</b>
<b>§ 6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>25</b>
<b>§ 7 年度财务报表（转型后）</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表 .....	27
7.2 利润表 .....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	29

7.4 报表附注 .....	30
<b>§ 7 年度财务报表（转型前） .....</b>	<b>51</b>
7.1 资产负债表 .....	51
7.2 利润表 .....	53
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	54
7.4 报表附注 .....	55
<b>§ 8 投资组合报告（转型后） .....</b>	<b>78</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	78
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	78
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	78
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	80
8.6 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 .....	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	80
8.8 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贵金属投资明细 .....	80
8.9 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 .....	80
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.11 投资组合报告附注 .....	81
<b>§ 8 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>82</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	82
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	83
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	83
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
8.6 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 .....	84
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	84
8.8 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贵金属投资明细 .....	84
8.9 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 .....	84
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.11 投资组合报告附注 .....	84
<b>§ 9 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	86
<b>§ 9 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>87</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	87
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	87
<b>§ 10 开放式基金份额变动（转型后） .....</b>	<b>87</b>
<b>§ 10 开放式基金份额变动（转型前） .....</b>	<b>88</b>

<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	89
11.4 基金投资策略的改变 .....	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	89
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	90
11.8 其他重大事件（转型后） .....	91
11.8 其他重大事件（转型前） .....	93
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）</b> .....	<b>96</b>
12.1 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 .....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）</b> .....	<b>96</b>
12.1 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 .....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	97
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>97</b>
13.1 备查文件目录 .....	97
13.2 存放地点 .....	98
13.3 查阅方式 .....	98

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	安信永鑫增强债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	52,696,663.39 份	
基金合同存续期	不定期	
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	2,969,442.49 份	49,727,220.90 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金	
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 1 月 13 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	
报告期末基金份额总额	3,611,858.22 份	
基金合同存续期	不定期	
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

## 2.2 基金产品说明（转型后）

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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王永民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4008-088-088	95566
传真	0755-82799292	010-66594942
注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	田路 6009 号新世界商务中心 36 层	
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518026	100818
法定代表人	刘入领	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 06 月 12 日（基金合同生效日）-2018 年 12 月 31 日	
	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
本期已实现收益	62,868.49	362,288.14
本期利润	72,350.15	426,556.93
加权平均基金份额本期利润	0.0228	0.0195
本期加权平均净值利润率	2.15%	1.85%
本期基金份额净值增长率	2.14%	1.96%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配利润	169,071.88	2,613,775.70
期末可供分配基金份额利润	0.0569	0.0526
期末基金资产净值	3,157,153.52	52,802,364.40
期末基金份额净值	1.0632	1.0618
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	



基金份额累计净值增长率	2.14%	1.96%
-------------	-------	-------

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 11 日		2017 年 01 月 13 日（基金合同生效日）-2017 年 12 月 31 日	
	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C
本期已实现收益	302,069.21	6,764.41	905,047.20	2,222,227.01
本期利润	621,107.73	7,451.71	979,640.76	1,823,725.55
加权平均基金份额本期利润	0.0382	0.0326	0.0241	0.0259
本期加权平均净值利润率	3.66%	3.11%	2.38%	2.59%
本期基金份额净值增长率	3.06%	2.98%	2.74%	3.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 6 月 11 日）		2017 年末	
期末可供分配利润	188,618.03	10,583.39	489,203.04	6,045.09
期末可供分配基金份额利润	0.0552	0.0546	0.0207	0.0209
期末基金资产净值	3,619,145.60	205,642.91	24,307,426.85	297,871.70

期末基金份额净值	1.0588	1.0613	1.0274	1.0306
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 6 月 11 日）		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	5.88%	6.13%	2.74%	3.06%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.17%	0.06%	-0.22%	0.32%	1.39%	-0.26%
过去六个月	1.79%	0.07%	-0.41%	0.29%	2.20%	-0.22%
自基金转型（2018 年 6 月 12 日）起至今	2.14%	0.07%	-1.06%	0.29%	3.20%	-0.22%

安信永鑫增强债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.09%	0.06%	-0.22%	0.32%	1.31%	-0.26%
过去六个月	1.62%	0.07%	-0.41%	0.29%	2.03%	-0.22%

自基金转型（2018年6月12日）起至今	1.96%	0.07%	-1.06%	0.29%	3.02%	-0.22%
----------------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

注：根据《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资的比较基准。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

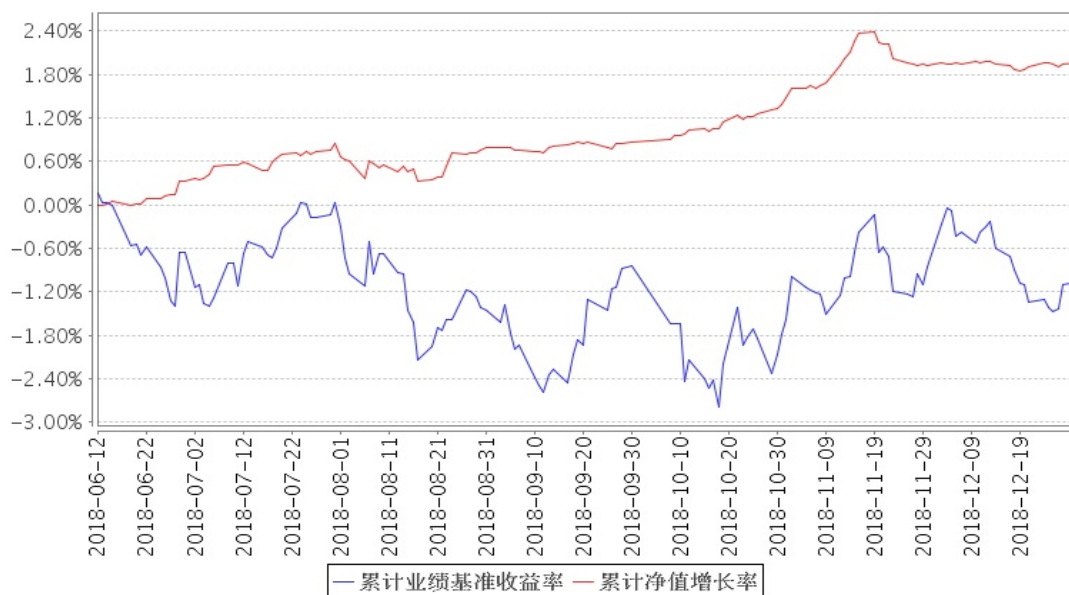
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额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

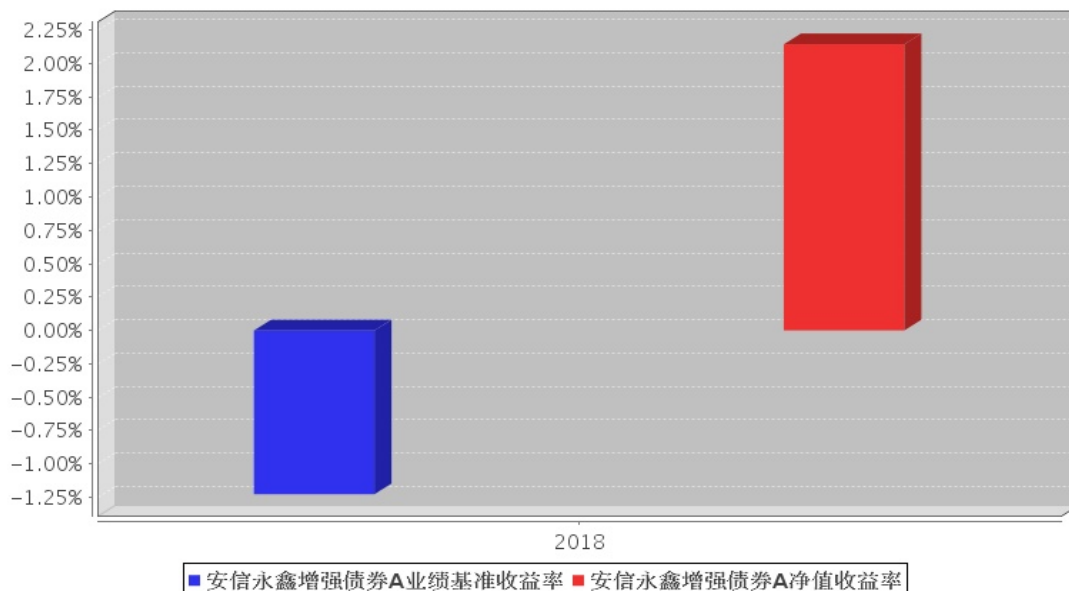


注:1、本基金 2018 年 6 月 12 日由安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为 2018 年 6 月 12 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

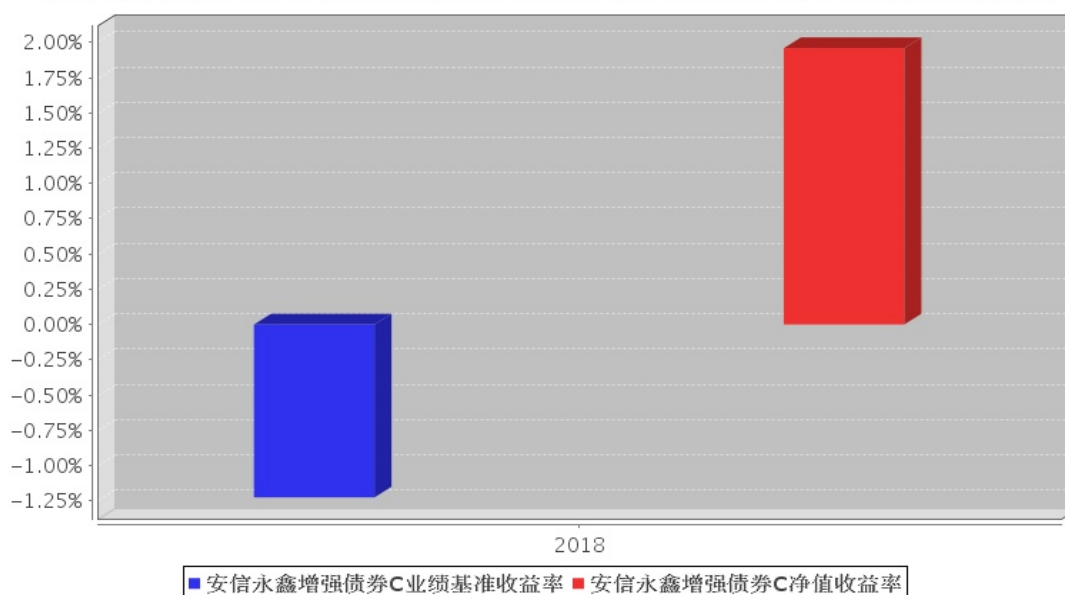
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3. 2. 3 自基金转型以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信永鑫增强债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

安信永鑫定开债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2018年4月1日至2018年6月11日	0.91%	0.09%	0.76%	0.16%	0.15%	-0.07%
2018年1月1日至2018年6月11日	3.06%	0.08%	1.98%	0.12%	1.08%	-0.04%
2017年7月1日至2018年6月11日	4.26%	0.07%	0.11%	0.10%	4.15%	-0.03%
自基金合同生效起至2018年6月11日	5.88%	0.07%	-2.12%	0.10%	8.00%	-0.03%

安信永鑫定开债 C

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	---------	------------	-----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	准差④		
2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日	0.89%	0.09%	0.76%	0.16%	0.13%	-0.07%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日	2.98%	0.08%	1.98%	0.12%	1.00%	-0.04%
2017 年 7 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日	4.73%	0.08%	0.11%	0.10%	4.62%	-0.02%
自基金合同生效起至 2018 年 6 月 11 日	6.13%	0.07%	-2.12%	0.10%	8.25%	-0.03%

注:根据《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:中债总指数(全价)收益率。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



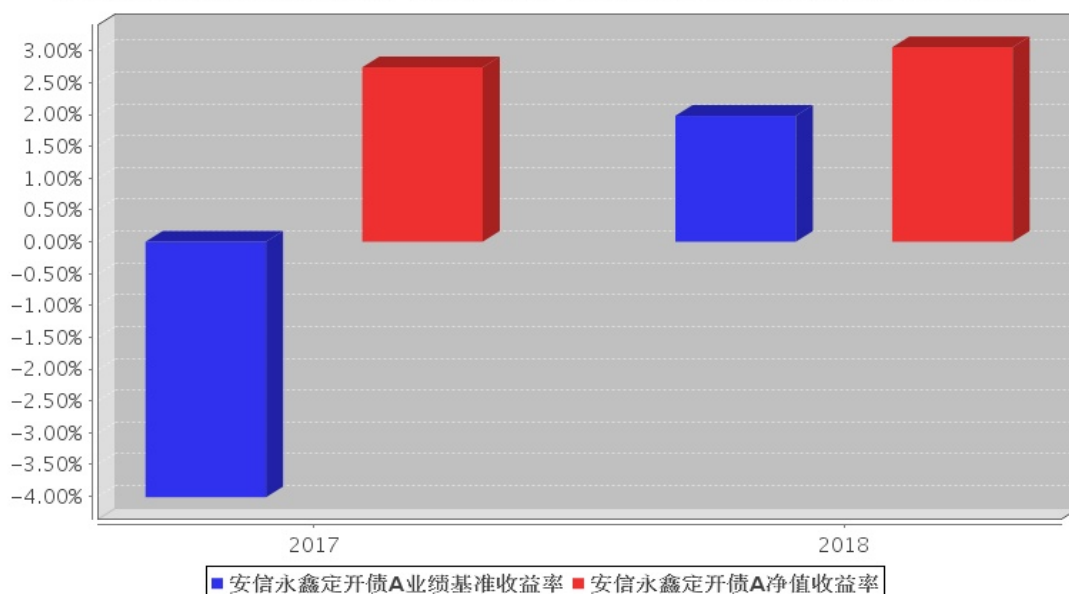
注:1、本基金合同生效日为 2017 年 1 月 13 日。

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。

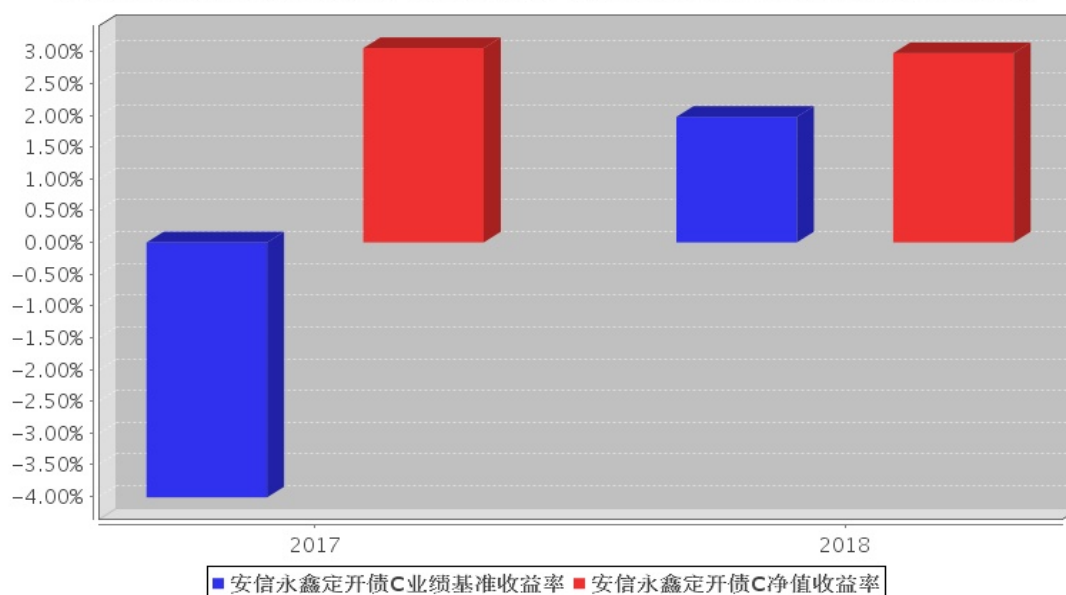
3、本基金自 2018 年 6 月 12 日起,由《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》生效,原《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信永鑫定开债C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

单位：元

安信永鑫增强债券 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.1800	57,932.59	408.50	58,341.09	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	0.1800	57,932.59	408.50	58,341.09	

安信永鑫增强债券 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.2000	193,466.39	7.53	193,473.92	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	0.2000	193,466.39	7.53	193,473.92	

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

安信永鑫定期开放债券型证券投资基金于 2017 年 1 月 13 日成立，截至最后运作日 2018 年 6 月 11 日未进行利润分配。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 45 只开放式基金，具体如下：从 2012 年 6 月 20 日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2012 年 9 月 25 日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从 2012 年 12 月 18 日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从 2013 年 2 月 5 日起管理安信现金管理货币市场基金；从 2013 年 7 月 24 日起管理安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）；从 2013 年 11 月 8 日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从 2013 年 12 月 31 日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2014 年 4 月 21 日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从 2014 年 11 月 24 日起管理安信现金增利货币市场基金；从 2015 年 3 月 19 日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从 2015 年 4 月 15 日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 14 日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从 2015 年 5 月 20 日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 5 月 25 日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 6 月 5 日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 3 月 9 日至 2018 年 5 月 28 日管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 7 月 28 日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 9 日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 8 月 19 日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 9 日至 2018 年 9 月 26 日管理安信保证金交易型货币市场基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从 2016 年 9 月 29 日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 10 日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从 2016 年 10 月 12 日起管理安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金；从 2016 年 10 月 17 日起管理安信活期宝货币市场基金；从 2016 年 12 月 9 日起管理安信新趋势灵活配置

混合型证券投资基金；从 2016 年 12 月 19 日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 6 月 11 日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 16 日起管理安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 3 月 29 日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 3 日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 7 月 20 日起管理安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从 2017 年 12 月 6 日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金；从 2017 年 12 月 28 日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 3 月 14 日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金；从 2018 年 3 月 21 日起管理安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金；从 2018 年 3 月 30 日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 6 月 1 日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金；从 2018 年 6 月 12 日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金；从 2018 年 6 月 21 日起管理安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金；从 2018 年 9 月 3 日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金；从 2018 年 9 月 26 日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金；从 2018 年 11 月 29 日起管理安信中证 500 指数增强型证券投资基金；从 2018 年 12 月 7 日起管理安信优享纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘巍	本基金的基金经理	2018年9月12日	-	9	潘巍先生，理学硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、信用研究员，中华联合保险控股股份有限公司债券投资经理，华夏基金管理有限公司专户投资经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
李君	本基金的基金经理	2018年6月12日	-	13	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。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。
张翼飞	本基金的基金经理	2018年6月12日	2018年9月12日	7.5	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、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；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的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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范围的相关规定。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2017年1月13日	-	7.5	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、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；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的基金经理。
李君	本基金的基金经理	2017年12月26日	-	13	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。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。
王坤	本基金的基金经理助理	2017年1月13日	2018年6月12日	3	王坤先生，金融学硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。曾任安信永鑫定期开放债券式证券投资基金的基金经

					理助理，现任安信基金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、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信新起点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的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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》、《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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年经济呈现下行趋势，内部融资环境较之前有所变差，外部环境也发生变化。全年资金面从偏紧转向宽松，利率债和高等级信用债收益率下行幅度可观。低等级债券风险事件明显增多，权益市场呈现震荡下行。期间，本组合以中高等级信用债为主，维持了一定的杠杆和久期，在权益和转债市场只是少量参与，最终取得了超越基准的业绩，期间最大回撤也维持较好水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 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 1.0632 元，自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日止，基金份额净值增长率为 2.14%；截至 2018 年 12 月 31 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 1.0618 元，自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日止，基金份额净值增长率为 1.96%；同期业绩比较基准收益率为-1.06%。

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 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，基金份额净值增长率为 3.06%；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 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日止，基金份额净值增长率为 2.98%；同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，投资、出口、消费三驾马车均面临压力，经济增速不太乐观。低等级债券信用利差维持高位，在宽信用目的没有达到之前，宽货币政策难以退出，债券市场依然会有一些表现，信用债的表现可能要好于利率债。但 2019 年的信用事件仍会较为频繁，做好信用风险管理是重中之重，对于低评级的信用债我们依然保持谨慎。

随着政策不断出台和落实，如果经济下滑进入中后期，权益类资产可能会有所表现，那么在 2019 年下半年我们可能会见到这个情景。作为进可攻、退可守的可转债资产，届时具有较好的配置价值。本组合是二级债基，希望通过可转债和对应正股的搭配投资，获取更稳健的超额收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照相关法律法规和本基金合同的规定及实际运作情况进行利润分配。本报告期内，本基金实施利润分配的金额合计为 251,815.01 元，其中本基金 A 类份额分配 58,341.09 元，C 类份额分配 193,473.92 元，符合相关法律法规及基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

转型后：

自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日止，安信永鑫增强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 6 月 12 日至 2018 年 8 月 31 日；自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日止，安信永鑫增强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 6 月 12 日至 2018 年 8 月 23 日，

2018 年 9 月 26 日至 2018 年 11 月 28 日。

转型前：

自 2018 年 1 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 1 月 2 日至 2018 年 6 月 11 日；自 2018 年 1 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 1 月 2 日至 2018 年 6 月 11 日。

自 2018 年 1 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持有人户数出现了连续 60 个工作日低于 200 人的情形，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金资产净值出现了连续 60 个工作日低于 5000 万元的情形。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）及基金份额持有人大会决议，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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安信永鑫增强债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。



## § 6 审计报告（转型后）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信永鑫增强债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信永鑫增强债券型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信永鑫增强债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信永鑫增强债券型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信永鑫增强债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>安信永鑫增强债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信永鑫增强债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督安信永鑫增强债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持</p>

	<p>职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信永鑫增强债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信永鑫增强债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 高鹤
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号，东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2019年3月27日

## § 6 审计报告（转型前）

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信永鑫定期开放债券型证券投资基金的财务报表，包括2018年6月11日（基金合同失效前日）的资产负债表，自2018年1月1日至2018年6月11日（基金合同失效前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信永鑫定期开放债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信永鑫定期开放债券型证券投资基金2018年6月11日（基金合同失效前日）的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月11日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安

	<p>信永鑫定期开放债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>安信永鑫定期开放债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信永鑫定期开放债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信永鑫定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信永鑫定期开放债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在</p>

	<p>审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信永鑫定期开放债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	高鹤
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号，东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2019年3月27日	

## § 7 年度财务报表（转型后）

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信永鑫增强债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	265,501.66
结算备付金		488,317.10
存出保证金		5,494.48
交易性金融资产	7.4.7.2	55,683,056.10
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		55,683,056.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	19,004,507.91
应收证券清算款		1,367,469.35
应收利息	7.4.7.5	804,085.08
应收股利		-
应收申购款		2.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		77,618,433.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

		2018 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		20,175,000.00
应付证券清算款		1,366,634.41
应付赎回款		-
应付管理人报酬		27,680.51
应付托管费		6,920.10
应付销售服务费		13,034.96
应付交易费用	7.4.7.7	4,358.44
应交税费		3,357.78
应付利息		11,929.56
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	50,000.00
负债合计		21,658,915.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	52,696,663.39
未分配利润	7.4.7.10	3,262,854.53
所有者权益合计		55,959,517.92
负债和所有者权益总计		77,618,433.68

注：（1）报告截止日 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.0632 元，C 类基金份额净值人民币 1.0618 元；基金份额总额 52,696,663.39 份，其中 A 类基金份额 2,969,442.49 份，C 类基金份额 49,727,220.90 份。

（2）本基金的基金合同于 2018 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

## 7.2 利润表

会计主体：安信永鑫增强债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		832,877.43
1. 利息收入		623,672.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,553.23
债券利息收入		554,941.76
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		63,177.27

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		135,333.18
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-17,545.00
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	152,878.18
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	73,750.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	121.54
减：二、费用		333,970.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	90,627.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	22,656.94
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	39,708.41
4. 交易费用	7.4.7.20	9,983.76
5. 利息支出		80,451.41
其中：卖出回购金融资产支出		80,451.41
6. 税金及附加		851.05
7. 其他费用	7.4.7.21	89,690.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		498,907.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		498,907.08

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信永鑫增强债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,611,858.22	212,930.29	3,824,788.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	498,907.08	498,907.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	49,084,805.17	2,802,832.17	51,887,637.34

其中：1. 基金申购款	70,656,523.90	4,048,299.06	74,704,822.96
2. 基金赎回款	-21,571,718.73	-1,245,466.89	-22,817,185.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-251,815.01	-251,815.01
五、期末所有者权益（基金净值）	52,696,663.39	3,262,854.53	55,959,517.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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（以下简称“安信永鑫定开债”）于 2018 年 6 月 12 日转型而来。基金转型事项获中国证券监督管理委员会 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）批复，并经安信永鑫定开债基金份额持有人大会决议通过。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，原基金安信永鑫定开债更名为安信永鑫增强债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），为契约型开放式基金，存续期限不定。

原安信永鑫定开债于基金合同失效前的基金资产净值为 3,824,788.51 元，基金份额为 3,611,858.22 份，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值、基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金转型后的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易的可转换债券）、可交换债券、债券回购、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等，股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货以及法律法规或中国证

监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、权证等资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。惟本会计期间为自 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。



#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的

终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

### 7.4.6.2 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 7.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	活期存款	265,501.66
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	265,501.66	

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	45,533,147.73	45,569,056.10	35,908.37
	银行间市场	10,080,340.00	10,114,000.00	33,660.00
	合计	55,613,487.73	55,683,056.10	69,568.37
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	55,613,487.73	55,683,056.10	69,568.37	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	18,604,507.91	-
合计	19,004,507.91	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	53.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	241.78
应收债券利息	760,041.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	43,745.47
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.64
合计	804,085.08

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,251.63
银行间市场应付交易费用	1,106.81
合计	4,358.44

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付信息披露费	30,000.00
应付审计费	20,000.00

合计	50,000.00
----	-----------

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信永鑫增强债券 A

项目	本期 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,418,085.27	3,418,085.27
本期申购	242,296.70	242,296.70
本期赎回（以“-”号填列）	-690,939.48	-690,939.48
本期末	2,969,442.49	2,969,442.49

安信永鑫增强债券 C

项目	本期 2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	193,772.95	193,772.95
本期申购	70,414,227.20	70,414,227.20
本期赎回（以“-”号填列）	-20,880,779.25	-20,880,779.25
本期末	49,727,220.90	49,727,220.90

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信永鑫增强债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	188,618.03	12,442.30	201,060.33
本期利润	62,868.49	9,481.66	72,350.15
本期基金份额交易产生的变动数	-24,073.55	-3,284.81	-27,358.36
其中：基金申购款	11,940.63	1,283.51	13,224.14
基金赎回款	-36,014.18	-4,568.32	-40,582.50
本期已分配利润	-58,341.09	-	-58,341.09
本期末	169,071.88	18,639.15	187,711.03
安信永鑫增强债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计



基金合同生效日	10,583.39	1,286.57	11,869.96
本期利润	362,288.14	64,268.79	426,556.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,434,378.09	395,812.44	2,830,190.53
其中：基金申购款	3,527,915.02	507,159.90	4,035,074.92
基金赎回款	-1,093,536.93	-111,347.46	-1,204,884.39
本期已分配利润	-193,473.92	-	-193,473.92
本期末	2,613,775.70	461,367.80	3,075,143.50

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
活期存款利息收入		2,980.86
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		2,523.92
其他		48.45
合计		5,553.23

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
卖出股票成交总额		3,169,759.00
减：卖出股票成本总额		3,187,304.00
买卖股票差价收入		-17,545.00

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		60,523,861.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		58,958,473.35
减：应收利息总额		1,412,509.89
买卖债券差价收入		152,878.18

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	73,750.45
股票投资	-
债券投资	73,750.45
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	73,750.45

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	121.54
合计	121.54

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	9,058.76

银行间市场交易费用	925.00
合计	9,983.76

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日
审计费用	6,685.22
信息披露费	60,000.00
银行间账户维护费	18,600.00
银行汇划费用	4,405.68
合计	89,690.90

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
安信证券	6,357,063.00	100.00

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
安信证券	4,521.74	100.00	3,251.63	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	90,627.88
其中：支付销售机构的客户维护费	14,940.76

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,656.94

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C	合计
中国银行	-	6,817.49	6,817.49
安信基金	-	32,782.53	32,782.53
安信证券	-	1.20	1.20
合计	-	39,601.22	39,601.22

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月12日（基金合同生效日）至2018年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	265,501.66	2,980.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

安信永鑫增强债券 A							
序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
1	2018年06 月28日	2018年06 月28日	0.1000	33,672.52	10.48	33,683.00	-
2	2018年10 月08日	2018年10 月08日	0.0800	24,260.07	398.02	24,658.09	-
合计	-	-	0.1800	57,932.59	408.50	58,341.09	-
安信永鑫增强债券 C							
序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注

1	2018年06月28日	2018年06月28日	0.1200	2,327.53	-	2,327.53	-
2	2018年10月08日	2018年10月08日	0.0800	191,138.86	7.53	191,146.39	-
合计	-	-	0.2000	193,466.39	7.53	193,473.92	-

#### 7.4.12 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为20,175,000.00元，分别于2019年1月2日、2019年1月4日及2019年1月10日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理

人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括在国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离债券、回购和银行存款等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 80.89%。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	300,030.00
合计	300,030.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。



2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日
AAA	36,371,492.30
AAA 以下	8,838,503.00
未评级	10,173,030.80
合计	55,383,026.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流

动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	265,501.66	-	-	-	265,501.66
结算备付金	488,317.10	-	-	-	488,317.10
存出保证金	5,494.48	-	-	-	5,494.48
交易性金融资产	25,436,095.50	28,027,433.40	2,219,527.20	-	55,683,056.10
买入返售金融资产	19,004,507.91	-	-	-	19,004,507.91
应收利息	-	-	-	804,085.08	804,085.08
应收申购款	-	-	-	2.00	2.00
应收证券清算款	-	-	-	1,367,469.35	1,367,469.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,199,916.65	28,027,433.40	2,219,527.20	2,171,556.43	77,618,433.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	27,680.51	27,680.51
应付托管费	-	-	-	6,920.10	6,920.10
应付证券清算款	-	-	-	1,366,634.41	1,366,634.41
卖出回购金融资产款	20,175,000.00	-	-	-	20,175,000.00

应付销售服务费	-	-	-	13,034.96	13,034.96
应付交易费用	-	-	-	4,358.44	4,358.44
应付利息	-	-	-	11,929.56	11,929.56
应交税费	-	-	-	3,357.78	3,357.78
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	20,175,000.00	-	-	1,483,915.76	21,658,915.76
利率敏感度缺口	25,024,916.65	28,027,433.40	2,219,527.20	687,640.67	55,959,517.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2018 年 12 月 31 日）
	1、市场利率下降 25 个基点	195,613.06
2、市场利率上升 25 个基点	-194,126.68	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中无划分为第一层级的余额，划分为第二层级的余额为人民币 55,683,056.10 元，无划分为第三层级余额。

#### 公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信永鑫定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 11 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 11 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	200,204.68	500,478.73
结算备付金		64,122.03	1,156,625.05
存出保证金		6,551.06	4,083.85

交易性金融资产	7.4.7.2	3,752,114.10	37,561,036.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,752,114.10	35,561,036.70
资产支持证券投资		-	2,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	83,817.41
应收利息	7.4.7.5	43,027.84	1,202,870.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,066,019.71	40,508,911.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月11日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		100,000.00	15,800,000.00
应付证券清算款		8.53	-
应付赎回款		126,549.66	-
应付管理人报酬		953.45	16,691.79
应付托管费		238.35	4,172.93
应付销售服务费		12.48	50.53
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		153.95	-
应付利息		-	-7,301.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	13,314.78	90,000.00
负债合计		241,231.20	15,903,613.34
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,611,858.22	23,948,233.74
未分配利润	7.4.7.10	212,930.29	657,064.81
所有者权益合计		3,824,788.51	24,605,298.55
负债和所有者权益总计		4,066,019.71	40,508,911.89

注：报告截止日 2018 年 6 月 11 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.0588 元，C 类基金份额净值人民币 1.0613 元；基金份额总额 3,611,858.22 份，其中 A 类基金份额 3,418,085.27 份，C 类基金份额 193,772.95 份。

## 7.2 利润表

会计主体：安信永鑫定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 13 日（基 金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		895,730.52	5,939,811.25
1. 利息收入		449,759.37	7,486,256.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,514.12	101,015.86
债券利息收入		403,633.19	6,195,187.72
资产支持证券利息收 入		25,396.37	69,163.84
买入返售金融资产收 入		9,215.69	1,120,889.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		121,344.96	-1,269,169.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	121,344.96	-1,269,169.81
资产支持证券投资收 益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.18	319,725.82	-323,907.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.19	4,900.37	46,632.50
减：二、费用		267,171.08	3,136,444.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	61,268.46	892,219.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	15,317.05	223,054.94
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	212.02	142,431.13
4. 交易费用	7.4.7.20	101.87	6,147.65
5. 利息支出		156,624.27	1,719,059.87
其中：卖出回购金融资产支 出		156,624.27	1,719,059.87
6. 税金及附加		320.44	-

7. 其他费用	7.4.7.21	33,326.97	153,531.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		628,559.44	2,803,366.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		628,559.44	2,803,366.31

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信永鑫定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,948,233.74	657,064.81	24,605,298.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	628,559.44	628,559.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-20,336,375.52	-1,072,693.96	-21,409,069.48
其中：1. 基金申购款	30,143.50	1,359.23	31,502.73
2. 基金赎回款	-20,366,519.02	-1,074,053.19	-21,440,572.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,611,858.22	212,930.29	3,824,788.51
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	314,514,672.03	-	314,514,672.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,803,366.31	2,803,366.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动	-290,566,438.29	-2,146,301.50	-292,712,739.79

数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	29,418,014.75	673,457.23	30,091,471.98
2. 基金赎回款	-319,984,453.04	-2,819,758.73	-322,804,211.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	23,948,233.74	657,064.81	24,605,298.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信永鑫定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2016 年 7 月 13 日下发的证监许可[2016]1602 号文《关于准予安信永鑫定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，以定期开放方式运作。存续期限不定。

本基金募集期间为 2016 年 12 月 5 日至 2017 年 1 月 10 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字 60962175\_H01 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 314,453,330.14 元。经向中国证监会备案，《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 13 日正式生效。截至 2017 年 1 月 12 日止，安信永鑫定期开放债券型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 314,453,330.14 元，折合 314,453,330.14 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 61,341.89 元，折合 61,341.89 份基金份额。其中永鑫定开 A 已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 62,666,630.14 元，折合 62,666,630.14 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 34,853.08 元，折合 34,853.08 份基金份额；永鑫定开 C 已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币



币 251,786,700.00 元，折合 251,786,700.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 26,488.81 元，折合 26,488.81 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 314,514,672.03 元，折合 314,514,672.03 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本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》，根据本基金份额持有人大会决议，本基金管理人于 2018 年 5 月 15 日发布《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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国债、金融债、央行票据、可转换债券（含可分离交易的可转换债券）、企业债券、公司债券、债券回购、非金融企业债务融资工具（包括中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股的首发或增发，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易的可转换债券而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，基金将在其可交易之日起的 3 个月内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金在开放期、封闭期前 10 个工作日以及封闭期最后 10 个工作日不受上述投资比例限制。在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为：中债总指数（全价）收益率。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 11 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。上年度会计期间为 2017 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止，本会计期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日（基金合同失效前日）止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算保证金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

#### 7.4.6.2 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 11 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	200,204.68	500,478.73
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-

合计	200,204.68	500,478.73
----	------------	------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018年6月11日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,756,296.18	3,752,114.10	-4,182.08
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,756,296.18	3,752,114.10	-4,182.08
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,756,296.18	3,752,114.10	-4,182.08
项目		上年度末 2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	35,884,944.60	35,561,036.70	-323,907.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	35,884,944.60	35,561,036.70	-323,907.90
资产支持证券		2,000,000.00	2,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		37,884,944.60	37,561,036.70	-323,907.90

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售资产。



#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	970.40	112.34
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,752.66	572.55
应收债券利息	37,292.00	1,133,025.60
应收资产支持证券利息	-	69,163.84
应收买入返售证券利息	-	-6.27
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	12.78	2.09
合计	43,027.84	1,202,870.15

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付信息披露费	-	60,000.00
应付审计费	13,314.78	30,000.00
合计	13,314.78	90,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信永鑫定开债 A

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月11日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	23,659,215.15	23,659,215.15
本期申购	1,152.45	1,152.45
本期赎回（以“-”号填列）	-20,242,282.33	-20,242,282.33
本期末	3,418,085.27	3,418,085.27

## 安信永鑫定开债 C

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月11日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	289,018.59	289,018.59
本期申购	28,991.05	28,991.05
本期赎回（以“-”号填列）	-124,236.69	-124,236.69
本期末	193,772.95	193,772.95

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信永鑫定开债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	489,203.04	159,008.66	648,211.70
本期利润	302,069.21	319,038.52	621,107.73
本期基金份额交易产生的变动数	-602,654.22	-465,604.88	-1,068,259.10
其中：基金申购款	25.23	25.05	50.28
基金赎回款	-602,679.45	-465,629.93	-1,068,309.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,618.03	12,442.30	201,060.33
安信永鑫定开债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,045.09	2,808.02	8,853.11
本期利润	6,764.41	687.30	7,451.71
本期基金份额交易产生的变动数	-2,226.11	-2,208.75	-4,434.86
其中：基金申购款	603.88	705.07	1,308.95
基金赎回款	-2,829.99	-2,913.82	-5,743.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,583.39	1,286.57	11,869.96

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 11日	上年度可比期间 2017年1月13日（基金合同生效日） 至2017年12月31日
	活期存款利息收入	2,380.91

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,102.28	45,909.23
其他	30.93	313.35
合计	11,514.12	101,015.86

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 11日	上年度可比期间 2017年1月13日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	70,128,314.91	614,796,798.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	69,036,798.57	605,169,852.80
减：应收利息总额	970,171.38	10,896,115.47
买卖债券差价收入	121,344.96	-1,269,169.81

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月11日	上年度可比期间 2017年1月13日（基金合同生效日） 至2017年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	2,075,414.79	-
减：卖出资产支持证券成本总额	2,000,000.00	-
减：应收利息总额	75,414.79	-
资产支持证券投资收益	-	-

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日(基金合 同生效日)至2017年12月31 日
1. 交易性金融资产	319,725.82	-323,907.90
股票投资	-	-
债券投资	319,725.82	-323,907.90
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	319,725.82	-323,907.90

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日(基金合 同生效日)至2017年12月31 日
基金赎回费收入	4,900.37	46,632.12
基金转换费收入	-	0.38
合计	4,900.37	46,632.50

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
交易所市场交易费用	101.87	610.15
银行间市场交易费用	-	5,537.50
合计	101.87	6,147.65

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日(基金合同生效日) 至2017年12月31日

审计费用	13,314.78	30,000.00
信息披露费	-	90,000.00
银行间账户维护费	18,600.00	21,700.00
银行汇划费用	1,412.19	10,481.36
其他	-	1,350.00
合计	33,326.97	153,531.36

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日（基金合 同生效日）至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	61,268.46	892,219.99
其中：支付销售机构的客户维护费	13,817.84	175,952.51

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月11日	上年度可比期间 2017年1月13日（基金合 同生效日）至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,317.05	223,054.94

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C	合计
中国银行	-	149.72	149.72
合计	-	149.72	149.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信永鑫定开债 A	安信永鑫定开债 C	合计
中国银行	-	16,660.10	16,660.10
安信基金	-	109,576.67	109,576.67
合计	-	126,236.77	126,236.77

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 11 日		上年度可比期间 2017年1月13日（基金合同生效日）至2017 年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	200,204.68	2,380.91	500,478.73	54,793.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2018 年 06 月 11 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 100,000.00 元，于 2018 年 6 月 12 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。



## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括在国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离债券、回购和银行存款等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2018 年 6 月 11 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 19.83%（2017 年 12 月 31 日：62.05%）。

#### 7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
AAA	731,081.20	6,091,360.10
AAA 以下	27,237.70	9,175,875.90
未评级	2,993,795.20	20,293,800.70
合计	3,752,114.10	35,561,036.70

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	2,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	2,000,000.00

注：1. 资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 资产支持证券投资以净价列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 11 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	200,204.68	-	-	-	200,204.68
结算备付金	64,122.03	-	-	-	64,122.03
存出保证金	6,551.06	-	-	-	6,551.06
交易性金融资产	3,592,584.80	159,529.30	-	-	3,752,114.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	43,027.84	43,027.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,863,462.57	159,529.30	-	43,027.84	4,066,019.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	126,549.66	126,549.66
应付管理人报酬	-	-	-	953.45	953.45
应付托管费	-	-	-	238.35	238.35
应付证券清算款	-	-	-	8.53	8.53
卖出回购金融资产款	100,000.00	-	-	-	100,000.00
应付销售服务费	-	-	-	12.48	12.48
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	153.95	153.95
其他负债	-	-	-	13,314.78	13,314.78
负债总计	100,000.00	-	-	141,231.20	241,231.20
利率敏感度缺口	3,763,462.57	159,529.30	-	-98,203.36	3,824,788.51
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	500,478.73	-	-	-	500,478.73
结算备付金	1,156,625.05	-	-	-	1,156,625.05
存出保证金	4,083.85	-	-	-	4,083.85
交易性金融资产	10,896,316.20	26,664,720.50	-	-	37,561,036.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,202,870.15	1,202,870.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	83,817.41	83,817.41
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,557,503.83	26,664,720.50	-	1,286,687.56	40,508,911.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	16,691.79	16,691.79
应付托管费	-	-	-	4,172.93	4,172.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	15,800,000.00	-	-	-	15,800,000.00
应付销售服务费	-	-	-	50.53	50.53
应付交易费用	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-7,301.91	-7,301.91
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	15,800,000.00	-	-	103,613.34	15,903,613.34
利率敏感度缺口	-3,242,496.17	26,664,720.50	-	1,183,074.22	24,605,298.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月11日）	上年度末（2017年12月31日）
	1、市场利率下降 25 个基点	2,855.59	92,345.07
	2、市场利率上升 25 个基点	-2,845.77	-91,827.74

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 11 日，本基金持有的交易性金融资产中无划分为第一层级余额，划分为第二层级的余额为人民币 3,752,114.10 元，无划分为第三层级余额（于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中无划分为第一层级余额，划分为第二层级的余额为人民币 37,561,036.70 元，无划分为第三层级余额）。

#### 公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金的资产净值为人民币 3,824,788.51 元，已连续超过六十个工作日持有人数量不满二百人且基金资产净值低于人民币五千万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

#### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告（转型后）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	55,683,056.10	71.74
	其中：债券	55,683,056.10	71.74
	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	19,004,507.91	24.48
	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	753,818.76	0.97
8	其他各项资产	2,177,050.91	2.80
9	合计	77,618,433.68	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	396,180.00	0.71
2	600201	生物股份	148,135.00	0.26
3	603393	新天然气	113,280.00	0.20
4	300232	洲明科技	113,040.00	0.20
5	300059	东方财富	105,600.00	0.19

6	002236	大华股份	102,000.00	0.18
7	600785	新华百货	81,765.00	0.15
8	600068	葛洲坝	81,360.00	0.15
9	600406	国电南瑞	74,685.00	0.13
10	601009	南京银行	71,800.00	0.13
11	300271	华宇软件	70,125.00	0.13
12	002555	三七互娱	69,815.00	0.12
13	300433	蓝思科技	68,160.00	0.12
14	300627	华测导航	68,005.00	0.12
15	601231	环旭电子	65,390.00	0.12
16	300568	星源材质	65,250.00	0.12
17	300607	拓斯达	64,830.00	0.12
18	603678	火炬电子	64,150.00	0.11
19	002396	星网锐捷	63,265.00	0.11
20	300054	鼎龙股份	61,100.00	0.11

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	377,130.00	0.67
2	600201	生物股份	137,040.00	0.24
3	300059	东方财富	130,360.00	0.23
4	300232	洲明科技	117,120.00	0.21
5	603393	新天然气	115,440.00	0.21
6	002236	大华股份	94,225.00	0.17
7	600785	新华百货	82,765.00	0.15
8	600068	葛洲坝	79,200.00	0.14
9	600406	国电南瑞	77,805.00	0.14
10	002555	三七互娱	76,450.00	0.14
11	300607	拓斯达	72,340.00	0.13
12	300627	华测导航	70,567.00	0.13
13	601009	南京银行	70,000.00	0.13
14	603678	火炬电子	69,880.00	0.12
15	300271	华宇软件	69,550.00	0.12
16	002396	星网锐捷	68,270.00	0.12
17	002343	慈文传媒	65,175.00	0.12
18	600048	保利地产	63,450.00	0.11
19	300568	星源材质	63,434.00	0.11
20	300054	鼎龙股份	61,978.00	0.11

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。



### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,187,304.00
卖出股票收入（成交）总额	3,169,759.00

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,947,805.40	23.14
	其中：政策性金融债	10,416,049.40	18.61
4	企业债券	36,843,895.20	65.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,809,895.30	10.38
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	81,460.20	0.15
10	其他	-	-
11	合计	55,683,056.10	99.51

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140227	14 国开 27	100,000	10,114,000.00	18.07
2	136184	16 上港 01	26,000	2,600,000.00	4.65
3	112296	15 东北债	25,000	2,530,750.00	4.52
4	136151	16 保利 01	25,000	2,502,000.00	4.47
5	136080	15 北汽 01	25,000	2,482,500.00	4.44

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

基金投资的前十名证券的发行主体除 15 际华 01（证券代码：122425）、16 义市 01（证券代码：136603），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。

际华集团股份有限公司于 2018 年 4 月 9 日收到上海证券交易所《关于对际华集团股份有限公司及其时任董事会秘书王兴智予以监管关注的决定》（上证公监函【2018】0006 号），公司因未及时履行信息披露义务，被上海证券交易所予以以下监管措施：对际华集团股份有限公司和时任董事会秘书王兴智予以监管关注。

义乌市市场发展集团有限公司于 2018 年 4 月 25 日收到义乌市行政执法局行政处罚书（义行政执法罚字【2018】第 01583 号），因非法占用土地，被予以行政处罚。

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,494.48
2	应收证券清算款	1,367,469.35
3	应收股利	-
4	应收利息	804,085.08
5	应收申购款	2.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,177,050.91

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132006	16 皖新 EB	2,297,056.30	4.10
2	132011	17 浙报 EB	1,770,314.00	3.16
3	120001	16 以岭 EB	1,500,600.00	2.68
4	132004	15 国盛 EB	241,925.00	0.43

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 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。

## § 8 投资组合报告（转型前）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	264,326.71	6.50
8	其他各项资产	49,578.90	1.22
9	合计	4,066,019.71	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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，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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	92,590.00	2.42

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 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。

## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信永鑫增强债券 A	203	14,627.80	-	0.00	2,969,442.49	100.00
安信永鑫增强债券 C	17	2,925,130.64	25,961,158.99	52.21	23,766,061.91	47.79
合计	220	239,530.29	25,961,158.99	49.27	26,735,504.40	50.73

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信永鑫增强债券 A	9.89	0.0003
	安信永鑫增强债券 C	-	-
	合计	9.89	0.0000

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	安信永鑫增强债券 A	0
	安信永鑫增强债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信永鑫增强债券 A	0
	安信永鑫增强债券 C	0
	合计	0

## § 9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信永鑫定开债 A	76	44,974.81	-	-	3,418,085.27	100.00
安信永鑫定开债 C	12	16,147.75	-	-	193,772.95	100.00
合计	88	41,043.84	-	-	3,611,858.22	100.00

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信永鑫定开债 A	9.71	0.0003
	安信永鑫定开债 C	-	-
	合计	9.71	0.0003

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信永鑫定开债 A	0
	安信永鑫定开债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信永鑫定开债 A	0
	安信永鑫定开债 C	0
	合计	0

## § 10 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）基金份额总额	3,418,085.27	193,772.95



本报告期期初（2018 年 6 月 12 日）基金份额总额	-	-
本报告期（自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日）基金总申购份额	242,296.70	70,414,227.20
减：本报告期（自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日）基金总赎回份额	690,939.48	20,880,779.25
本报告期（自 2018 年 6 月 12 日起至 2018 年 12 月 31 日）基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,969,442.49	49,727,220.90

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## § 10 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
基金合同生效日（2017 年 1 月 13 日）基金份额总额	62,701,483.22	251,813,188.81
本报告期期初基金份额总额	23,659,215.15	289,018.59
本报告期（自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日）基金总申购份额	1,152.45	28,991.05
减：本报告期（自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日）基金总赎回份额	20,242,282.33	124,236.69
本报告期（自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 11 日）基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末（2018 年 6 月 11 日）基金份额总额	3,418,085.27	193,772.95

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议对《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》进行了审议。本次大会表决投票时间从 2018 年 4 月 16 日起至 2018 年 5 月 11 日 17:00 止，并于 2018 年 5 月 14 日完成计票，表决通过上述议案，本

基金自 2018 年 6 月 12 日起正式实施转型，即自该日起，《安信永鑫定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效，《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》生效。关于本次会议的召集及决议情况，可参阅本基金管理人于 2018 年 4 月 10 日、2018 年 4 月 11 日、2018 年 4 月 12 日以及 2018 年 5 月 15 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上披露的相关公告。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

安信永鑫定期开放债券型证券投资基金从 2018 年 6 月 12 日起正式转型为安信永鑫增强债券型证券投资基金。运作方式由定期开放转为普通开放式运作，转型后的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制和业绩比较基准等按照《安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同》相关约定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 20,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣	

			交总额的比例		金总量的比例	
安信证券	2	6,357,063.00	100.00%	4,521.74	100.00%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	98,513,425.74	100.00%	410,012,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》,对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准,由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案,最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	99,972,048.86	100.00%	923,366,000.00	100.00%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信永鑫增强债券型证券投资基金基金合同内容摘要	证券时报	2018年6月8日

2	安信永鑫增强债券型证券投资基金招募说明书	证券时报	2018 年 6 月 8 日
3	安信永鑫增强债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 8 日
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中国中铁（601390）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 15 日
5	关于暂停安信永鑫增强债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 20 日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持上海电气（601727）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 20 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中兴通讯（000063）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 21 日
8	安信基金管理有限责任公司关于安信永鑫增强债券型证券投资基金 2018 年第一次分红公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 27 日
9	关于安信基金管理有限责任公司旗下开放式基金在上海好买基金销售有限公司开通定期定额投资和转换等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 29 日
10	安信基金管理有限责任公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 30 日
11	关于恢复安信永鑫增强债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 6 日
12	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 6 日
13	关于安信基金管理有限责任公司新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 12 日
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长生物（002680）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 17 日
15	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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 20 日
16	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长生物（002680）估值调	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 24 日

	整的公告		
17	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长生物（002680）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 7 月 26 日
18	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 8 月 10 日
19	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持 ST 长生（002680）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 8 月 16 日
20	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增开源证券股份有限公司为销售代理机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 8 月 22 日
21	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 年半年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 8 月 29 日
22	2018 年度 安信永鑫增强债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 9 月 12 日
23	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 9 月 18 日
24	安信基金管理有限责任公司关于基金直销账户信息变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 9 月 20 日
25	关于暂停安信永鑫增强债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 9 月 27 日
26	安信基金管理有限责任公司关于安信永鑫增强债券型证券投资基金 2018 年第二次分红公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 9 月 28 日
27	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持光环新网（300383）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 10 月 12 日
28	安信永鑫增强债券型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 10 月 25 日
29	关于恢复安信永鑫增强债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 11 月 27 日
30	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 12 月 13 日
31	关于暂停安信永鑫增强债券型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 12 月 27 日

### 11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于旗下	上海证券报、中国证券	2018 年 1 月 6 日

	中天金融（000540）估值调整的公告	报、证券时报	
2	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 10 日
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下奥瑞德（600666）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 10 日
4	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 20 日
5	安信基金管理有限责任公司关于增加基金直销账户的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 25 日
6	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 26 日
7	安信基金管理有限责任公司关于安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 2018 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 31 日
8	安信基金管理有限责任公司关于旗下东山精密（002384）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 2 月 2 日
9	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 2 月 9 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下万华化学（600309）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 2 月 10 日
11	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第 1 号）	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 2 月 27 日
12	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 2 日
13	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 12 日
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持三钢闽光（002110）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 24 日
15	关于安信基金管理有限责任公司新增天津市凤凰财富基金销售有限公司为开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 29 日
16	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 31 日
17	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 2 日
18	安信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开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的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 10 日
19	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 11 日

	会的第一次提示性公告		
20	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 12 日
21	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中兴通讯（000063）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 19 日
22	安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 20 日
23	关于安信基金管理有限责任公司新增北京植信基金销售有限公司为开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 26 日
24	安信基金管理有限责任公司关于安信永鑫定期开放债券型证券投资基金 2018 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 7 日
25	安信基金管理有限责任公司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	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 15 日
26	关于安信基金管理有限责任公司变更五矿证券有限公司代销旗下部分开放式证券投资基金产品的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 18 日
27	关于安信基金管理有限责任公司旗下部分开放式证券投资基金新增平安银行股份有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 18 日
28	关于安信基金管理有限责任公司旗下开放式基金在中国银河证券股份有限公司开通定期定额投资和转换等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 18 日
29	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中工国际（002051）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 29 日
30	关于安信基金管理有限责任公司新增长城证券股份有限公司为开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 1 日
31	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中兴通讯（000063）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 9 日



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

### 12.1 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	20180824-20180925		-20,855,057.35	20,855,057.35	-	-
	2	20180824-20181231		-23,698,928.81		-23,698,928.81	44.97
个人	1	20180612-20180823	1,994,557.95	-	-	1,994,557.95	3.78
	2	20181129-20181231		-23,551,577.96		-23,551,577.96	44.69

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2019 年 3 月 26 日发布《关于安信永鑫增强债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第一次提示性公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金合同的有关规定，本基金可能触发基金合同终止情形。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

### 12.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
--------	----------------	------------

者类别	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	20180101-20180514	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							
<p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

### 13.3 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

2019年03月29日