

# 安信永鑫增强债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 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：2022 年 7 月 20 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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 2022 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	1,451,458,082.04 份
投资目标	本基金在严格控制信用风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置方面，本基金通过上下结合的宏观和微观研究，综合考虑权益的估值水平、风险收益比和固定收益资产的预期收益状况，合理确定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。债券投资方面，本基金动态调整债券资产在信用债与利率债之间的配比，采用组合久期配置策略、品种配置策略、信用投资策略、可转债投资策略和可交债投资策略，进行积极的债券配置。股票投资方面，本基金将谨慎确定基金资产中权益类品种的投资比例，并根据对宏观经济、市场流动性、股票估值水平、市场情绪等因素的综合考量，对该投资比例进行动态调整。资产支持证券投资方面，本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，对普通的和创新性的资产支持证券品种进行深入分析，制定周密的投资策略。此外，本基金将在严格控制风险的前提下，投资国债期货、权证等衍生金融工具。
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%

风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
下属分级基金的交易代码	003637	003638
报告期末下属分级基金的份额总额	891,398,151.05 份	560,059,930.99 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（2022 年 4 月 1 日-2022 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	8,799,634.37	5,481,484.77
2. 本期利润	14,156,630.49	7,674,461.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0174	0.0139
4. 期末基金资产净值	946,720,366.85	593,893,602.12
5. 期末基金份额净值	1.0621	1.0604

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	1.48%	0.16%	1.31%	0.28%	0.17%	-0.12%
过去六个月	0.73%	0.17%	-1.95%	0.30%	2.68%	-0.13%
过去一年	4.28%	0.13%	-1.36%	0.26%	5.64%	-0.13%
过去三年	12.60%	0.11%	7.01%	0.25%	5.59%	-0.14%
自基金转型	20.94%	0.11%	11.01%	0.26%	9.93%	-0.15%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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	1.40%	0.16%	1.31%	0.28%	0.09%	-0.12%
过去六个月	0.57%	0.17%	-1.95%	0.30%	2.52%	-0.13%
过去一年	3.96%	0.13%	-1.36%	0.26%	5.32%	-0.13%
过去三年	11.58%	0.11%	7.01%	0.25%	4.57%	-0.14%
自基金转型起至今	19.46%	0.11%	11.01%	0.26%	8.45%	-0.15%

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，混合资产投资部副总经理	2021 年 4 月 26 日	-	17 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。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部副总经理。曾任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、安信中短利率债券型证券投资基金

					(LOF)、安信尊享纯债债券型证券投资基金、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;现任安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信中短利率债券型证券投资基金(LOF)、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,安信永利信用定期开放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、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、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、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
黄琬舒	本基金的基金经理	2022 年 1 月 18 日	-	7 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。曾任安信新趋势灵活配置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;现任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、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、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理,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、安信中短利率债券型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信永鑫增强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、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告(生效)日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度，在全球需求放缓以及国内疫情阶段性升温的背景下，经济基本面继续承压。本季度后期，随着企业复工复产的推进以及稳增长相关政策的逐步落实，经济的景气度略有好转。期间，为了应对疫情的附加冲击，央行实施“降准”操作，市场流动性保持合理充裕。而海外方面，因主要经济体通胀高企、相继加快货币紧缩进程，全球无风险利率水平有所抬升。在各种因素的影响下，国内债券市场收益率整体维持震荡。报告期内，在债券方面，本基金以中短久期利率债和高等级信用债为主要投资对象，在久期及杠杆的运用上偏谨慎。

本季度内，可转债跟随权益市场波动，尤其在 4 月下旬的恐慌情绪下，部分可转债出现了较有吸引力的定价。在风险预算允许的前提下，我们增加了一部分转债仓位，实现了一定收益。

股票市场在 4 月下旬创下年内至今的低点，随后快速反弹。我们的权益组合跟随市场上涨，在此过程中，我们也对持仓个股进行优化，强调维持个股的风险收益比，并力求控制股票组合的隐含波动率。目前持仓股票行业配置较为均衡。

#### 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 1.0621 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.48%；安信永鑫增强债券 C 基金份额净值为 1.0604 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%；同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 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	153,348,473.05	9.92
	其中：股票	153,348,473.05	9.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,286,526,448.91	83.19
	其中：债券	1,286,526,448.91	83.19
	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	95,008,416.44	6.14
	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	8,880,019.69	0.57
8	其他资产	2,814,097.23	0.18
9	合计	1,546,577,455.32	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	1,528,492.00	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	98,131,267.80	6.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,498,754.00	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,683,488.80	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	13,697,534.25	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-



I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,055,609.20	0.13
J	金融业	10,986,876.00	0.71
K	房地产业	10,264,342.00	0.67
L	租赁和商务服务业	3,270,084.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	961,380.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	2,250,255.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,020,390.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	153,348,473.05	9.95

### 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	603056	德邦股份	520,675	6,992,665.25	0.45
2	000002	万科A	154,700	3,171,350.00	0.21
3	600663	陆家嘴	292,300	3,028,228.00	0.20
4	002027	分众传媒	402,400	2,708,152.00	0.18
5	001979	招商蛇口	183,100	2,459,033.00	0.16
6	300470	中密控股	69,000	2,435,010.00	0.16
7	601318	中国平安	51,400	2,399,866.00	0.16
8	601688	华泰证券	168,600	2,394,120.00	0.16
9	600585	海螺水泥	66,900	2,360,232.00	0.15
10	002595	豪迈科技	99,900	2,231,766.00	0.14

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	941,436,766.88	61.11
	其中：政策性金融债	468,362,143.68	30.40
4	企业债券	875,255.57	0.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	344,214,426.46	22.34
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,286,526,448.91	83.51

### 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	1,319,160	139,829,333.63	9.08
2	210402	21 农发 02	1,100,000	112,605,643.84	7.31
3	092118003	21 农发清发 03	700,000	72,025,301.37	4.68
4	180408	18 农发 08	700,000	71,745,090.41	4.66
5	092218001	22 农发清发 01	700,000	70,460,945.21	4.57

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

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

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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 22 国君 G5(代码: 185814 SH)、21 国君 12(代码: 188736 SH)、21 中金 G3(代码: 175905 SH)、浦发转债(代码: 110059 SH)、18 农发 13(代码: 180413 CY)、18 农发 08(代码: 180408 CY)、22 农发清发 01(代码: 092218001 CY)、21 农发清发 03(代码: 092118003 CY)、21 农发 02(代码: 210402 CY)、20 信投 G5(代码: 163763 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. 国泰君安证券股份有限公司

2021 年 11 月 17 日, 国泰君安证券股份有限公司因未依法履行职责被全国中小企业股份转让系统有限责任公司诫勉谈话。

2022 年 1 月 21 日, 国泰君安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示。

### 2. 中国国际金融股份有限公司

2021 年 7 月 19 日, 中国国际金融股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行营业管理部罚款。

2021 年 11 月 5 日, 中国国际金融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北京监管局通知整改。

2021 年 12 月-2022 年 6 月, 中国国际金融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示、诫勉谈话。

### 3. 上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 7 月 16 日, 上海浦东发展银行股份有限公司因逾期未履行行政义务, 内部制度不完善, 违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2021 年 11 月 15 日, 上海浦东发展银行股份有限公司因提供虚假资料证明文件被国家外汇管理局上海市分局罚款。

2022 年 3 月 25 日, 上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

### 4. 中国农业发展银行

2022 年 3 月 25 日, 中国农业发展银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

### 5. 中信建投证券股份有限公司

2022 年 6 月 2 日, 中信建投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

警示。

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	153,962.84
2	应收证券清算款	2,413,563.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	246,571.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,814,097.23

### 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	139,829,333.63	9.08
2	113044	大秦转债	26,239,374.57	1.70
3	132015	18 中油 EB	24,879,306.85	1.61
4	132009	17 中油 EB	24,254,227.31	1.57
5	113042	上银转债	22,058,455.14	1.43
6	113021	中信转债	20,250,592.91	1.31
7	128129	青农转债	15,268,728.96	0.99
8	113037	紫银转债	15,245,585.61	0.99
9	113624	正川转债	3,765,860.66	0.24
10	113604	多伦转债	3,393,995.77	0.22
11	128074	游族转债	3,186,941.50	0.21
12	123056	雪榕转债	3,084,536.15	0.20
13	128118	瀛通转债	3,030,832.01	0.20
14	123076	强力转债	2,993,144.30	0.19
15	113569	科达转债	2,992,512.94	0.19
16	113608	威派转债	2,733,694.80	0.18
17	123126	瑞丰转债	2,561,696.68	0.17
18	113609	永安转债	2,493,108.72	0.16
19	123044	红相转债	2,265,857.38	0.15
20	113628	晨丰转债	2,222,114.20	0.14

21	127024	盈峰转债	2,042,656.84	0.13
22	113584	家悦转债	2,038,185.60	0.13
23	123104	卫宁转债	1,926,796.45	0.13
24	113610	灵康转债	1,770,026.02	0.11
25	113593	沪工转债	1,748,966.16	0.11
26	123128	首华转债	1,520,386.47	0.10
27	128063	未来转债	1,422,421.39	0.09
28	113530	大丰转债	1,226,009.26	0.08
29	128125	华阳转债	1,149,904.28	0.07
30	123099	普利转债	1,022,036.09	0.07
31	123059	银信转债	918,363.54	0.06
32	123109	昌红转债	839,441.10	0.05
33	123118	惠城转债	492,490.52	0.03
34	123113	仙乐转债	482,220.48	0.03
35	132022	20 广版 EB	470,311.15	0.03
36	113542	好客转债	454,357.18	0.03
37	127041	弘亚转债	322,048.33	0.02
38	113606	荣泰转债	209,234.42	0.01
39	128131	崇达转 2	195,111.47	0.01

### 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	667,332,918.61	505,352,097.37
报告期期间基金总申购份额	366,697,383.23	143,126,872.06
减：报告期期间基金总赎回份额	142,632,150.79	88,419,038.44
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	891,398,151.05	560,059,930.99

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	37,725,172.12
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	37,725,172.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	2.60

## 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

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	20220401-20220630	313,807,894.10	104,601,831.40	-	418,409,725.50	28.83

#### 产品特有风险

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

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

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

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

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

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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

2022 年 7 月 20 日