

安信永鑫增强债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信永鑫增强债券
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	272,266,159.06 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	29,705,868.99 份	242,560,290.07 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（2021年7月1日-2021年9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	408,886.38	3,281,448.89
2. 本期利润	453,967.12	3,729,723.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0153	0.0147
4. 期末基金资产净值	31,663,335.95	258,504,351.61
5. 期末基金份额净值	1.0659	1.0657

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

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	1.45%	0.08%	-0.35%	0.25%	1.80%	-0.17%
过去六个月	3.44%	0.08%	0.75%	0.23%	2.69%	-0.15%
过去一年	4.45%	0.10%	3.54%	0.25%	0.91%	-0.15%
过去三年	16.54%	0.10%	13.09%	0.26%	3.45%	-0.16%
自基金转型	17.66%	0.10%	12.15%	0.26%	5.51%	-0.16%

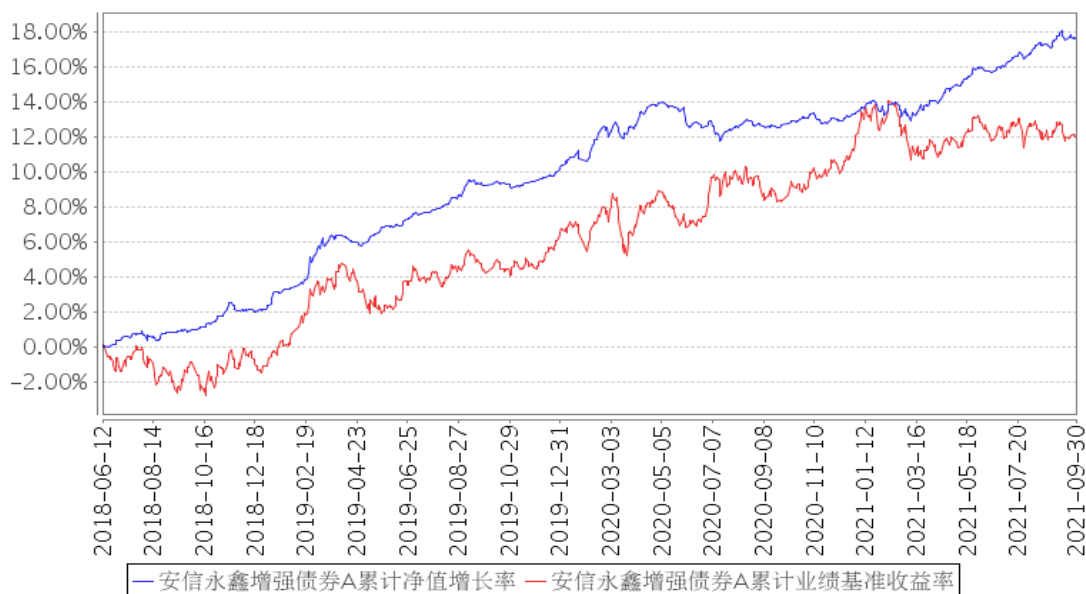
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

安信永鑫增强债券 C

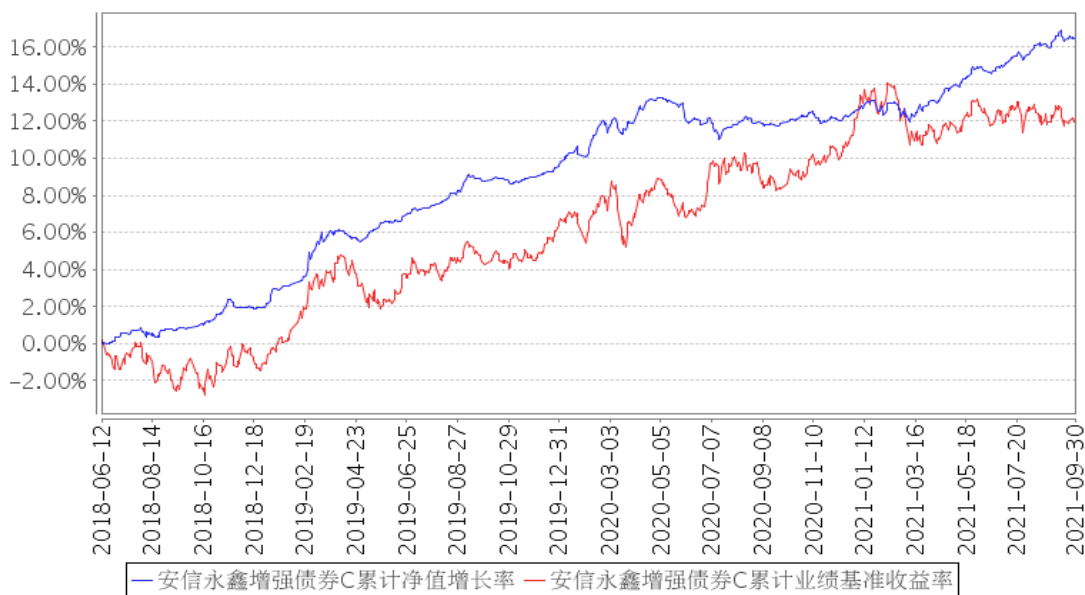
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.38%	0.08%	-0.35%	0.25%	1.73%	-0.17%
过去六个月	3.27%	0.08%	0.75%	0.23%	2.52%	-0.15%
过去一年	4.13%	0.10%	3.54%	0.25%	0.59%	-0.15%
过去三年	15.49%	0.10%	13.09%	0.26%	2.40%	-0.16%
自基金转型起至今	16.49%	0.10%	12.15%	0.26%	4.34%	-0.16%

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	-	16 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的基金经理;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、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信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的基金经理。
潘巍	本基金的基金经理	2018 年 9 月 12 日	-	12 年	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。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、的基金经理;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、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期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，央行进行“降准”操作，而经济基本面数据回落情况略超市场预期，消费受疫情反复影响表现低迷，投资受基建和地产拖累增速放缓，仅出口方面维持较高景气度。期间，央行公开市场操作方面维持稳健，债券市场整体先有所上涨，后维持震荡状态。报告期内，基于对信用风险的谨慎，本基金纯债部分进一步向利率债和高评级优质国企信用债集中。另一方面，可转债市场估值中枢继续上移，我们认为，这一估值中枢的变化，与同期股票市场的走势联动，也与市场参与者的乐观情绪相关。部分股票本身没有明显上涨的情况下，我们也时而观察到其所对应转债定价的上升，这意味着隐含风险收益比的下降。本基金从可转债标的的定价出发，对投资组合和个券的持仓比例进行调整。

权益方面，过去一个季度，市场整体而言表现出较为极端的结构化行情，低估值价值板块先抑后扬。本基金持仓从基本面和估值两个角度进行权衡，市场变得亢奋时，低估值组合某种程度上是一种“逆向”组合，低估值的原因来自于投资者对公司基本面的某些担忧。我们认为，当悲观情绪在股价中已充分体现时，低估值本身意味着长期看较好的风险收益比，我们首先排除价值陷阱的情况，然后选择估值处于低位、长期基本面稳定的个股，建立了一个较为分散的“逆向+低估值”组合，以求其收益兑现的平滑性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 1.0659 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.45%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.0657 元，本报告期基金份额净值增长率为

1.38%；同期业绩比较基准收益率为-0.35%。

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	24,312,889.50	7.02
	其中：股票	24,312,889.50	7.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	312,697,040.50	90.28
	其中：债券	312,697,040.50	90.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,815,463.25	1.68
8	其他资产	3,548,069.28	1.02
9	合计	346,373,462.53	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	959,221.00	0.33
B	采矿业	947,615.00	0.33
C	制造业	10,235,697.50	3.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,126,779.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	521,256.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,227,400.00	0.77
J	金融业	2,953,369.00	1.02
K	房地产业	4,305,202.00	1.48
L	租赁和商务服务业	346,386.00	0.12

M	科学研究和技术服务业	160,875.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	529,089.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	24,312,889.50	8.38

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	000002	万科A	59,200	1,261,552.00	0.43
2	600048	保利发展	75,000	1,052,250.00	0.36
3	001979	招商蛇口	80,000	1,035,200.00	0.36
4	600036	招商银行	16,200	817,290.00	0.28
5	600383	金地集团	72,000	806,400.00	0.28
6	300470	中密控股	20,400	758,676.00	0.26
7	002142	宁波银行	21,400	752,210.00	0.26
8	601088	中国神华	21,600	489,456.00	0.17
9	002867	周大生	16,450	328,177.50	0.11
10	002833	弘亚数控	9,300	311,550.00	0.11

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	266,502,640.00	91.84
	其中：政策性金融债	166,207,640.00	57.28
4	企业债券	2,918,095.10	1.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	43,276,305.40	14.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	312,697,040.50	107.76

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	210312	21 进出 12	500,000	50,300,000.00	17.33
2	200303	20 进出 03	400,000	39,736,000.00	13.69
3	170404	17 农发 04	300,000	30,696,000.00	10.58
4	190207	19 国开 07	200,000	20,096,000.00	6.93
5	188399	21 银河 G5	200,000	19,998,000.00	6.89

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 21 银河 G5（证券代码：188399 SH）、17 农发 04（证券代码：170404 CY）、21 进出 12（证券代码：210312 CY）、20 进出 03（证券代码：200303 CY）20 中金 07（证券代码：175122 SH）、21 申证 12（证券代码：149626 SZ）、浦发转债（证券代码：110059 SH）、21 华泰 G3（证券代码：188047 SH）、19 国开 07（证券代码：190207 CY）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 8 月 5 日，中国银河证券股份有限公司因未经著作权人许可,通过信息网络向公众传播其文章《自贸港负面清单彰显推进高水平开放决心》被北京市文化和旅游局警告、罚款人民币贰仟 2000 元【(京)文执罚(2021)第 500023 号】。

2021 年 4 月 12 日，中国农业发展银行因未依法履行职责被乌审旗住房和城乡建设局罚款人民币 2479.3 元【乌住建罚决字（2021）002 号】。

2021 年 7 月 16 日，中国进出口银行因违规经营被银保监会中国银行保险监督管理委员会罚款 7345.6 万元，没收违法所得【银保监罚决字（2021）31 号】。

2021 年 12 月 31 日，中国国际金融股份有限公司因内部制度不完善被中国证监会通知整改。

2021 年 1 月 20 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监会警示。

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人行中国人民银行营管部罚款 185.80 万元【银管罚（2021）19 号】。

2020 年 11 月 25 日，申万宏源证券有限公司因未依法履行职责被上海证监局通知整改【沪证监决[2020]168 号】。

2021 年 4 月，申万宏源证券有限公司因内部制度不完善、未依法履行职责被重庆证监局警示【中国证券监督管理委员会重庆监管局行政监督管理措施决定书(2021)12 号】。

2021 年 4 月 30 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被上海银保监局通知整改，罚款 760 万元【沪银保监罚决字（2021）29 号】。

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 6920 万元【银保监罚决字（2021）27 号】。

2020 年 11 月 24 日，华泰证券股份有限公司因未依法履行职责被江苏证监局警示【江苏证监局[2020]112 号】。

2020 年 10 月 26 日，国家开发银行因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局北京外汇管理部罚款 60 万元【京汇罚（2020）33 号、京汇罚（2020）32 号】。

2021 年 1 月 8 日，国家开发银行因提供虚假材料或隐瞒真实情况、弄虚作假,违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款 4,880 万元【银保监罚决字（2020）67 号】。

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	22,421.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,525,362.21
5	应收申购款	285.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,548,069.28

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	15,586,500.00	5.37
2	113042	上银转债	7,891,080.00	2.72
3	113037	紫银转债	7,681,942.40	2.65
4	113021	中信转债	1,901,752.00	0.66
5	132007	16 凤凰 EB	1,537,101.00	0.53
6	113044	大秦转债	685,880.00	0.24
7	123077	汉得转债	515,904.00	0.18
8	132022	20 广版 EB	457,785.00	0.16
9	128132	交建转债	438,213.00	0.15
10	128063	未来转债	345,000.00	0.12
11	123062	三超转债	344,670.00	0.12
12	113530	大丰转债	327,270.00	0.11
13	128129	青农转债	324,270.00	0.11
14	128117	道恩转债	285,714.00	0.10
15	123056	雪榕转债	251,184.00	0.09
16	113566	翔港转债	227,099.70	0.08

17	128070	智能转债	220,100.00	0.08
18	128139	祥鑫转债	219,429.20	0.08
19	123088	威唐转债	217,660.00	0.08
20	128069	华森转债	215,190.60	0.07
21	110064	建工转债	211,020.00	0.07
22	128049	华源转债	210,500.00	0.07
23	113604	多伦转债	209,980.00	0.07
24	123076	强力转债	208,240.00	0.07
25	128125	华阳转债	207,280.00	0.07
26	127016	鲁泰转债	206,740.00	0.07
27	113519	长久转债	200,564.00	0.07
28	113565	宏辉转债	199,799.60	0.07
29	113597	佳力转债	197,316.00	0.07
30	123059	银信转债	181,337.50	0.06
31	123065	宝莱转债	175,920.00	0.06
32	128123	国光转债	170,000.00	0.06
33	113567	君禾转债	164,955.00	0.06
34	123072	乐歌转债	118,620.00	0.04
35	123045	雷迪转债	114,590.00	0.04
36	113574	华体转债	97,362.00	0.03
37	113033	利群转债	93,393.00	0.03
38	113546	迪贝转债	78,890.00	0.03
39	113594	淳中转债	61,185.60	0.02
40	128143	锋龙转债	59,055.00	0.02
41	113599	嘉友转债	51,516.00	0.02
42	123044	红相转债	45,672.00	0.02
43	123081	精研转债	23,502.00	0.01
44	123039	开润转债	22,046.00	0.01
45	113524	奇精转债	13,032.00	0.00
46	113535	大业转债	10,642.00	0.00
47	113532	海环转债	7,338.80	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信永鑫增强债券 A	安信永鑫增强债券 C
报告期期初基金份额总额	29,250,415.97	261,970,417.01
报告期期间基金总申购份额	677,088.94	28,438,489.33
减:报告期期间基金总赎回份额	221,635.92	47,848,616.27
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	29,705,868.99	242,560,290.07

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210701-20210713	74,844,834.17	-	22,700,000.00	52,144,834.17	19.15
	1	20210714-20210726; 20210902-20210930	56,048,575.43	-	-	56,048,575.43	20.59
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>							

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

2021 年 10 月 26 日