安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信永盛定开债券
基金主代码	005677
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年03月30日
报告期末基金份额总额	1,609,999,000.00份
投资目标	本基金在控制组合净值波动率的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	封闭期内,本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金会根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素,确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险,并采取信用选择策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、杠杆投资策略和资产支持证券投资策略等,在合理管理并控制组合风险的前提下,最大化组合收益。在开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的品种,减小基金净值波动。
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,属于中低风险/收益的产品。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	15,092,287.37
2.本期利润	15,776,129.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0098
4.期末基金资产净值	1,641,491,769.69
5.期末基金份额净值	1.0196

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 本报告期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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	0.01%	0.17%	0.10%	0.80%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

注:1、本基金合同生效日为2018年3月30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。

§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		
李巍	本基金的基金经理	2018年6月27日	-	5年	李巍先生,理学硕士。历任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员，富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员，安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。现任安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理	2018年3月30日	-	14年	庄园女士,经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员,工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理,安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理，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）、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式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。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,中美贸易摩擦升级,央行货币政策进一步放松,定向降准实施,MLF超额投放。国务院常务会议提出维持流动性合理充裕,财政政策更加积极,理财新规细则也有所放松,"宽货币+宽信用"格局和稳杠杆基调确立。资金价格中枢整体较二季度大幅下行。

利率债受宏观调控,政策调整、供给放量以及通胀预期上行的影响,收益率有所回调。信用债在三季度伊始,各品种各期限现券收益率在短期内共同下行,然而在违约事件频发、地方债放量、流动性边际收紧的影响下,市场偏好重新开始分化。

本基金于3月底成立,三季度基本完成了组合建仓。主要投资标的为中短久期优质债券,整个三季度本基金净值平稳上升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0196元,本报告期基金份额净值增长率为0.97%,同期业绩比较基准收益率为0.17%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,且基金合同生效未满3年,故报告期不存在需要说明的情况。

§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（人民币元）	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	1,622,929,000.00	92.99
	其中:债券	1,622,929,000.00	92.99
	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	99,470,389.21	5.70
	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	8,195,159.15	0.47
8	其他资产	14,759,774.76	0.85
9	合计	1,745,354,323.12	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

本基金本报告期末未持有股票。

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股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	191,663,000.00	11.68
	其中:政策性金融债	91,053,000.00	5.55
4	企业债券	112,167,000.00	6.83
5	企业短期融资券	901,740,000.00	54.93
6	中期票据	222,639,000.00	13.56
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	194,720,000.00	11.86
9	其他	-	-
10	合计	1,622,929,000.00	98.87

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111814183	18江苏银行CD183	2,000,000	194,720,000.00	11.86
2	011801749	18中电投SCP025	1,500,000	150,150,000.00	9.15
3	011801544	18中信股SCP001	1,500,000	150,105,000.00	9.14
4	0980140	09铁道03	1,100,000	112,167,000.00	6.83
5	101454038	14华能MTN001	1,000,000	101,450,000.00	6.18

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金投资的前十名证券的发行主体除18中信股SCP001（证券代码:011801544）、18国药控股SCP006（证券代码:011801665）、17招商银行02（证券代码:1728015）,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。

中国中信有限公司于2018年3月28日收到国家外汇管理局北京外汇管理部关于违反外汇登记管理规定的处罚决定书（京汇简罚（2018）043号）依据《外汇管理条例》第四十八条第（五）项,给予中国中信有限公司警告,罚款0.1万元,并责令改正。

国药控股股份有限公司因涉嫌销售经检验不合格的胰酶肠溶片案，于2017年12月15日收到上海市长宁区市场监督管理局就生产（配制）/销售成份含量不符合药品标准规定药品的处罚决定书（沪食药监(长)罚处字[2017]第2120170016号）,予以没收违法所得(12999.54元),没收非法财物(795.93元)处罚。

招商银行股份有限公司于2018年2月12日收到中国银监会行政处罚决定书（银监罚决字〔2018〕1号），因内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款,销售同业非保本理财产品时违规承诺保本等十四项违规行为,被罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,759,774.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,759,774.76

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	1,609,999,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,609,999,000.00

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.62

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.62	10,000,000.00	0.62	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.62	10,000,000.00	0.62	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20180701-20180930;	1,599,999,000.00	-	-	1,599,999,000.00	99.38
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;

4、《安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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
2018年10月25日

安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25日

§1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信永泰定开债券
基金主代码	005479
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月28日
报告期末基金份额总额	1,536,754,406.44份
投资目标	本基金在严格控制信用风险的前提下,通过稳健的投资策略,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金兼顾资产的流动性和收益特征，通过严谨的大类资产配置和个券精选投资策略，运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值,力争获取高于业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*80%
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,属于中低风险/收益的产品。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	21,086,275.83
2.本期利润	31,670,278.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0213
4.期末基金资产净值	1,566,378,960.59
5.期末基金份额净值	1.0193

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;

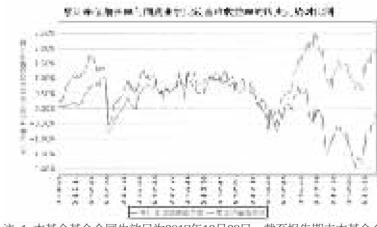
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	2.29%	0.22%	-0.18%	0.27%	2.47%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:1、本基金基金合同生效日为2017年12月28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。

§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		
肖芳芳	本基金的基金经理	2017年12月28日	-	7年	肖芳芳女士,经济学硕士。历任华宝证券有限责任公司资产管理部研究员、财达证券有限责任公司资产管理部投资助理。2016年4月5日加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投研助理,现任固定收益部基金经理。曾任安信保证金交易型货币市场基金的基金经理,安信安盈保本混合型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信保证金交易型货币市场基金的基金经理助理;现任安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新视野灵活配置混合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、安信活期宝货币市场基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
姚荻帆	本基金的基金经理	2017年12月28日	2018年9月13日	11年	姚荻帆先生,经济学学士。历任普华永道中天会计师事务所审计部审计师,中国国际金融有限公司研究部分析员,银华基金管理有限公司特定资产管理部投资经理,信诚基金管理有限公司量化投资部基金经理助理,安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

进入三季度,央行宽货币和宽信用并施,因此流动性宽松和社融增速（考虑地方债）企稳共存;财政政策发力集中发行专项地方债;宏观政策直指稳增长。宏观数据方面,固定资产投资增速、社会零售总额增速等经济数据表现仍然较弱;微观企业盈利也有恶化迹象,尤其是部分民营企业的资金问题较为显著。海外方面,美国加息预期仍在,若干新兴市场外汇暴跌,人民币也相对美元出现了一定幅度的贬值。

固定收益方面,三季度的前半段,宽货币带动信用债收益率持续下行、利率债则小幅震荡;后半段宽信用和汇率贬值带来的资本外流压力给债券市场带来一定压力，利率债和信用债先后对此作出了反应。三季度开放期结束后,本基金增加了长期利率债的配置,同时将信用债久期进一步拉长。组合债券投资部分在整个三季度获得了较好的收益率。

权益方面,三季度市场指数小幅下跌,而个股波动显著增大。风格上以银行为代表的大盘蓝筹走稳,而以创业板为代表的中小市值个股大幅下跌。投资者仍对几个不确定性担忧,一是市场预期美联储连续加息引发新兴市场危机,叠加中美贸易战对进出口有进一步负面影响;二是国内去杠杆进程下固定资产投资持续下行,经济仍处于一个经济周期的下行阶段,企业盈利缺乏持续增长的动力;三是社零增速持续下行,房价和棚改政策可能通过人均可支配收入对社会零售存在挤出效应。本基金在三季度维持中性仓位,积极调整持仓结构,持有了低估值的金融、电力设备等个股,继续布局具备防御性的公用事业以及具备避险性质的黄金类个股。

总的来说,三季度本基金获得了良好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0193元;本报告期基金份额净值增长率为2.29%,业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,且基金合同生效未满3年,故报告期不存在需要说明的情况。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	196,167,914.95	8.73
	其中:股票	196,167,914.95	8.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,004,928,500.00	89.18
	其中:债券	1,996,928,500.00	88.82
	资产支持证券	8,000,000.00	0.36
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	23,015,964.65	1.02
8	其他资产	24,067,869.09	1.07
9	合计	2,248,180,248.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	37,093,772.18	2.37
C	制造业	33,661,159.61	2.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,150,821.12	3.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	65,262,162.04	4.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,167,914.95	12.52

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 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	600483	福能股份	7,229,666	60,150,821.12	3.84
2	002202	金风科技	2,802,761	33,661,159.61	2.15
3	600547	山东黄金	1,311,654	31,046,850.18	1.98
4	600036	招商银行	558,900	17,152,641.00	1.10
5	002142	宁波银行	916,129	16,270,451.04	1.04
6	601288	农业银行	4,107,000	15,976,230.00	1.02
7	601939	建设银行	2,191,000	15,862,840.00	1.01
8	600988	赤峰黄金	1,393,300	6,046,922.00	0.39

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	716,865,400.00	45.77
	其中:政策性金融债	541,077,400.00	34.54
4	企业债券	800,507,100.00	51.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	341,528,000.00	21.80
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	138,028,000.00	8.81
10	合计	1,996,928,500.00	127.49

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	180205	18国开05	2,400,000	251,016,000.00	16.03
2	170215	17国开15	2,100,000	208,173,000.00	13.29
3	143109	18国证债	1,000,000	100,080,000.00	6.39
4	018005	国开1701	814,000	81,888,400.00	5.23
5	101800736	18华能MTN002	800,000	80,624,000.00	5.15

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	116834	18天元01	80,000	8,000,000.00	0.51

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

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将以套期保值为目的,按照相关法律法规的规定,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

报告期内基金投资的前十名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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	280,968.93
2	应收证券清算款	618,934.82
3	应收股利	-
4	应收利息	23,167,965.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,067,869.09

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

报告期期初基金份额总额	1,037,347,824.73
报告期期间基金总申购份额	499,406,581.71
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,536,754,406.44

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,000.10
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	10,001,000.10
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.65

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.10	0.65	10,001,000.10	0.65	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000.10	0.65	10,001,000.10	0.65	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20180701-20180930	420,041,000.00		-	420,041,000.00	27.33
机构	2	20180701-20180710	298,476,768.48		-	298,476,768.48	19.42
机构	3	20180710-20180930	198,984,180.68	199,380,919.15	-	398,365,099.83	25.92
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;

4、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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
2018年10月25日

安信永鑫增强债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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06月12日	
报告期末基金份额总额	26,975,465.55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换债投资策略,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	3,082,165.59份	23,893,299.96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(2018年07月01日 – 2018年09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	33,563.16	136,441.34
2.本期利润	21,141.78	141,553.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0065	0.0086
4.期末基金资产净值	3,263,716.40	25,287,790.30
5.期末基金份额净值	1.0589	1.0584

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

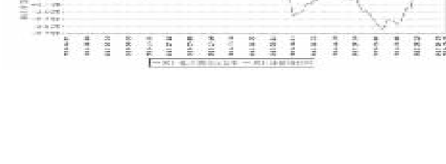
安信永鑫增强债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.61%	0.08%	-0.18%	0.27%	0.79%	-0.19%

安信永鑫增强债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.53%	0.08%	-0.18%	0.27%	0.71%	-0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:1、本基金合同生效日为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。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。

§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		
潘巍	本基金的基金经理	2018年9月12日	-	9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，中国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的基金经理。
李君	本基金的基金经理	2018年6月12日	-	13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监。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年	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、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。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度随着之前连续降准及对经济下行的悲观预期,债券收益率在8月初见了低点。人民币汇率继二季度后继续贬值,央行在离岸人民币逼近7.0时稳定了预期,同时国内短端利率从低点抬升,以防市场进行过度的套利操作。一系列稳增长措施、地方债放量发行、国开债修改招标规则、通胀预期抬头等,使债券收益率震荡走高。股票市场在三季度延续跌势,上证50跌幅较二季度减缓,但中小创指数连创新低。

报告期内,投资组合坚持以短久期利率债、中高等级国企信用债为主,以很少量仓位参与股票和转债,严格控制回撤,净值表现相对稳健。

4.4.2 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1.0589元，本报告期基金份额净值增长率为0.61%；截至本报告期末本基金C类基金份额净值为1.0584元，本报告期基金份额净值增长率为0.53%;同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日持有人数不满200人的情形,时间范围为2018年7月2日至2018年8月31日;本报告期内,本基金出现了连续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7月2日至2018年8月23日。

§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（人民币元）	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	33,056,596.90	95.45
	其中:债券	33,056,596.90	95.45
	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	109,696.44	0.32
8	其他资产	1,464,630.07	4.23
9	合计	34,630,923.41	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

本基金本报告期末未持有股票。

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股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	11,721,635.20	41.05
	其中:政策性金融债	11,720,624.00	41.05
4	企业债券	15,598,639.80	54.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,655,487.20	19.81
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	80,834.70	0.28
10	其他	-	-
11	合计	33,056,596.90	115.78

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	140227	14国开27	100,000	10,107,000.00	35.40
2	136272	16国控01	21,950	2,186,220.00	7.66
3	122425	15际华01	20,000	2,004,200.00	7.02
4	136270	16南网01	18,000	1,757,880.00	6.16
5	132011	17浙报EB	18,700	1,682,626.00	5.89

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

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国控01（证券代码:136272）,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。

际华集团股份有限公司（以下简称"公司"）于2017年12月12日收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称"北京证监局"）于2017年12月6日下发的《关于对际华集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定（[2017]155号）》的行政监管措施决定书,因未能及时发布临时公告予以披露,存在以定期报告代替临时公告、信息披露滞后的问题,被北京证监局予以警示,将相关违规行为记入诚信档案。

国药控股股份有限公司因涉嫌销售经检验不合格的胰酶肠溶片案，于2017年12月15日收到上海市长宁区市场监督管理局就生产（配制）/销售成份含量不符合药品标准规定药品的处罚决定书（沪食药监(长)罚处字[2017]第2120170016号）,予以没收违法所得(12999.54元),没收非法财物(795.93元)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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	7,048.11
2	应收证券清算款	866,796.64
3	应收股利	-
4	应收利息	590,785.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,464,630.07

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	132011	17浙报EB	1,682,626.00	5.89
2	132006	16皖新EB	1,329,482.70	4.66
3	132007	16凤凰EB	700,245.00	2.45
4	132003	15清控EB	229,448.00	0.8
5	127006	敖东转债	145,890.00	0.51
6	113017	吉视转债	135,810.00	0.48
7	132008	17山高EB	39,483.00	0.14

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信永鑫增强债券A	安信永鑫增强债券C
报告期期初基金份额总额	3,377,040.50	194,056.54
报告期期间基金总申购份额	194,687.33	44,560,438.12
减:报告期期间基金总赎回份额	489,562.24	20,861,194.70
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	3,082,165.59	23,893,299.96

§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

本报告期末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	20180824-20180925;	-	20,855,057.35	20,855,057.35	-	-
机构	2	20180824-20180930;	-	23,698,928.81	-	23,698,928.81	87.85
个人	1	20180701-20180823;	1,994,557.95	-	-	1,994,557.95	7.39

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、中国证监会核准安信永鑫定期开放债券型证券投资基金转型的文件;

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
2018年10月25日