（上接B194版）

关联方名称	本期		上年度可比期间			
	2018年1月1日 至 2018年6月11日		2017年01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30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	500,806.45	50,285.84		

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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300,000.00元，于2018年7月2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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

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	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	200,204.68	500,476.73
结算备付金	64,122.03	1,156,625.05
存出保证金	6,561.06	4,082.85
交易性金融资产	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	83,817.41
应收利息	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	-	-
资产总计	4,066,019.71	40,508,911.89
负债和所有者权益	本期末 2018年6月11日	上年度末 2017年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
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	238.36	4,172.93
应付销售服务费	12.48	50.53
应付交易费用	-	-
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	13,314.78	90,000.00
负债合计	241,231.20	15,903,613.34
所有者权益：		
实收基金	3,611,858.22	23,948,233.74
未分配利润	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：1）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。

2）本基金合同终止日为2018年6月11日，本报告期自2018年1月1日起至基金合同终止日2018年6月11日止。

6.2 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	本期 2018年1月1日 至 2018年6月11日	上年度可比期间 2017年01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30日
一、收入	895,730.52	4,884,939.55
1.利息收入	449,759.27	5,829,390.86
其中：存款利息收入	11,514.12	76,261.01
债券利息收入	403,633.19	4,648,147.00
资产支持证券利息收入	25,396.37	32,061.37
买入返售金融资产收入	9,215.69	1,072,921.48
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	121,344.96	-657,214.27
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	121,344.96	-657,214.27
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	319,725.82	-315,404.53
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	4,900.27	28,167.49
减：二、费用	267,171.88	2,476,526.65
1、管理人报酬	61,268.46	713,046.70
2、托管费	15,317.06	178,261.68
3、销售服务费	212.02	135,307.61
4、交易费用	101.97	5,809.42
5、利息支出	156,624.27	1,269,661.23
其中：卖出回购金融资产支出	156,624.27	1,269,661.23
6、税金及附加	320.44	-
7、其他费用	33,326.97	183,440.01
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	628,559.44	2,409,412.90
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	628,559.44	2,409,412.90

6.3 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	1,369.23	31,512.73
2.基金赎回款	-20,366,519.02	-1,074,063.19	-21,440,582.21
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01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30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）	-	2,409,412.90	2,409,412.90
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）	-278,808,232.56	-1,876,458.12	-280,684,690.68
其中：1.基金申购款	12,416.81	83.19	12,500.00
2.基金赎回款	-278,820,649.37	-1,876,541.31	-280,697,190.68
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）	35,706,439.47	532,954.78	36,239,394.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

___刘入领_____ _____范瑛_____ ____苗杨____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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《关于核准安信永鑫定期开放债券型证券投资基金募集的批复》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。

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。

6.4.2 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。

6.4.3 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日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月11日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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：1）本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。

2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	61,268.46	713,046.70
其中：支付销售机构的客户维护费	13,817.84	131,118.81

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

H＝E×0.80%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 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01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,317.06	178,261.68

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，托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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

6.4.8.2.3 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01月13日(基金合同生效日)至 2017年06月30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	-	16,402.50	16,402.50
安信基金	-	109,576.67	109,576.67
合计	-	125,979.17	125,979.17

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×0.20%÷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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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持有本基金份额。

6.4.8.5 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01月13日（基金合同生效日）至 2017年06月30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	500,806.45	50,285.84

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2018年06月11日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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 投资组合报告(转型后)

7.1 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	3,761,718.60	92.28
	其中：债券	3,761,718.60	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	264,381.86	6.24
8	其他各项资产	60,288.42	1.48
9	合计	4,076,388.88	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.5 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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,004,378.30	79.93
	其中：政策性金融债	3,003,369.60	79.90
4	企业债券	664,840.30	17.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	92,500.00	2.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,761,718.60	100.08

7.6 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（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	29,920	3,003,369.60	79.90
2	122366	14武钢债	3,150	314,842.50	8.38
3	136039	15石化01	2,720	270,748.80	7.08
4	132007	16凤凰EB	1,000	92,500.00	2.46
5	124463	PR津住宅	410	26,022.30	0.69

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未持有国债期货合约。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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 SH，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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	6,561.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,463.31
5	应收申购款	9,283.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,288.42

7.11.4 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	92,500.00	2.46

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§7 投资组合报告(转型前)

7.1 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	-	-
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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.5 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	2,993,796.20	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）	92,500.00	2.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,752,114.10	98.10

7.6 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	2,993,796.20	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	92,500.00	2.42
5	124463	PR津住宅	410	26,022.30	0.68

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未持有国债期货合约。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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 SH，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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	6,561.06
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

7.11.4 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	92,500.00	2.42

7.11.5 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。

7.11.6 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 基金份额持有人信息(转型后)

8.1 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	76	44,434.74	-	-	3,377,040.50	100.00
安信永鑫增强债券C	12	16,171.38	-	-	194,056.54	100.00
合计	88	40,580.65	-	-	3,571,097.04	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）。

8.2 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	9.81	0.0003
	安信永鑫增强债券C	-	-
	合计	9.81	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