

安信长鑫增强债券型证券投资基金

2025 年第 2 季度报告

2025 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 7 月 18 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 17 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 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信长鑫增强债券
基金主代码	020785
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 11 日
报告期末基金份额总额	492,362,890.95 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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期投资策略、收益率曲线策略、信用选择策略（含资产支持证券）、个券选择策略、息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金管理人将采用自下而上的研究方法，采取定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面进行深入分析，运用不同的估值方法对上市公司的估值水平进行分析，精选</p>

	<p>优质股票构建投资组合。</p> <p>4、国债期货投资策略 本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p> <p>5、基金投资策略 本基金仅投资于本基金管理人管理的权益类证券投资基金及全市场可上市交易的股票型交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>6、信用衍生品投资策略 本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。</p>
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+恒生指数收益率（经汇率调整后）*3%
风险收益特征	<p>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。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	安信长鑫增强债券 A 安信长鑫增强债券 C 安信长鑫增强债券 D 安信长鑫增强债券 E
下属分级基金的交易代码	020785 020786 024080 023241
报告期末下属分级基金的份额总额	151,779,512.81 份 340,463,107.62 份 1,951.03 份 118,319.49 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（2025 年 4 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日）		报告期（2025 年 4 月 21 日 - 2025 年 6 月 30 日）	
	安信长鑫增强债券 A	安信长鑫增强债券 C	安信长鑫增强债券 D	安信长鑫增强债券 E
1. 本期已实现收益	-246,508.67	-1,027,064.11	-4.04	-2,424.93
2. 本期利	993,241.01	1,692,094.89	3.55	16,796.53

润				
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0037	0.0018	0.0041
4. 期末基金资产净值	155,883,238.57	347,860,774.00	2,003.55	120,937.85
5. 期末基金份额净值	1.0270	1.0217	1.0269	1.0221

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、根据基金管理人 2025 年 4 月 21 日《关于安信长鑫增强债券型证券投资基金新增 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 4 月 21 日起，本基金增加 D 类份额。

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

安信长鑫增强债券 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	0.48%	0.05%	1.20%	0.10%	-0.72%	-0.05%
过去六个月	0.54%	0.05%	0.49%	0.11%	0.05%	-0.06%
过去一年	2.10%	0.06%	4.25%	0.13%	-2.15%	-0.07%
自基金合同生效起至今	2.70%	0.06%	5.20%	0.12%	-2.50%	-0.06%

安信长鑫增强债券 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	0.37%	0.05%	1.20%	0.10%	-0.83%	-0.05%
过去六个月	0.33%	0.05%	0.49%	0.11%	-0.16%	-0.06%
过去一年	1.70%	0.06%	4.25%	0.13%	-2.55%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	2.17%	0.06%	5.20%	0.12%	-3.03%	-0.06%

安信长鑫增强债券 D

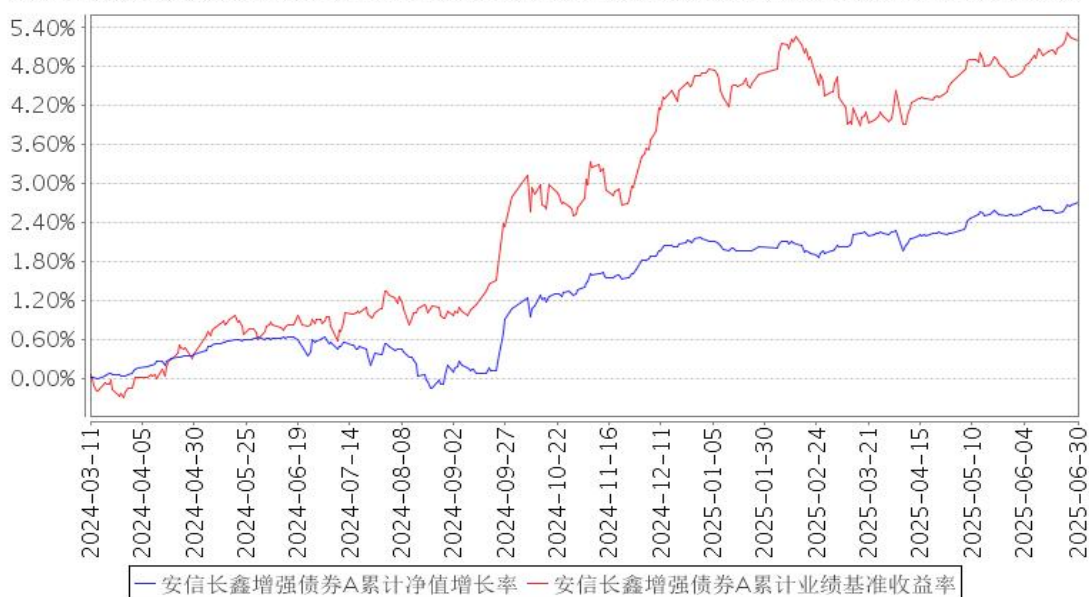
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.46%	0.03%	0.88%	0.07%	-0.42%	-0.04%

安信长鑫增强债券 E

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	0.41%	0.05%	1.20%	0.10%	-0.79%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	0.59%	0.05%	0.98%	0.12%	-0.39%	-0.07%

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

安信长鑫增强债券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



安信长鑫增强债券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



安信长鑫增强债券D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



安信长鑫增强债券E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、本基金基金合同生效日为 2024 年 3 月 11 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、根据基金管理人 2025 年 1 月 13 日《关于安信长鑫增强债券型证券投资基金新增 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 1 月 13 日起，本基金增加 E 类份额。

4、根据基金管理人 2025 年 4 月 21 日《关于安信长鑫增强债券型证券投资基金新增 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 4 月 21 日起，本基金增加 D 类份额。

§ 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		
黄琬舒	本基金的基金经理，混合资产投资部总经理助理	2024 年 12 月 9 日	-	10 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、固定收益部投资经理、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总经理助理。现任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、安信民稳增长混合型证券投资基金、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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债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、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；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、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信恒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，混合资产投资部总经理	2024 年 3 月 11 日	-	20 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、混合资产投资部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司混合资产投资部总经理。现任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、安信稳健汇利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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信稳健增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信长鑫增强债券型证券投资基金、安信稳健增利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》、《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

2025 年二季度，A 股市场呈现窄幅震荡格局，主要宽基指数波动率显著收敛。尽管期间受到

关税政策扰动等外部因素影响，但市场整体表现出较强韧性，平稳度过压力测试期。

我们认为，当前权益市场具备两个大的支撑要素：

1、资产的比价优势日益明显：伴随利率中枢持续下移，居民端对储蓄及固收类产品的收益预期逐步调降。从估值维度观察，无论是即期分红收益率（股息率），还是基于估值与长期盈利增长的隐含回报率，权益资产的吸引力已在历史高位区间，所需等待的无非是风险偏好何时回升；

2、实体经济领域酝酿积极的变化：上市公司资本开支在过去一年明显放缓，部分行业甚至呈现收缩态势。这种供给侧的自我调节，意味着由产能快速扩张导致的供需错配压力正接近尾声，企业盈利能力有望逐步企稳修复。

展望下半年，在低利率环境延续、需求复苏预期升温的背景下，叠加当前股票估值仍处历史偏低分位，我们认为再配置资金对权益市场的推动作用是值得期待的。

本季度基于市场波动率显著降低的特征，基金持仓水平基本稳定，运作重点聚焦于结构优化：

1、持仓结构特征：维持低估值、行业和个股较为分散，重点配置现金流创造能力强、资产负债表稳健的优质企业，随估值变动我们对所持仓的个股进行仓位比例调整；

2、风控逻辑：我们所选择持仓的个股，往往逆行于景气周期，正是由于处在景气度承压的阶段，才给予我们较便宜价格买入的机会。由于买点偏左侧，我们一方面比较重视对企业财务质量和抗住景气压力能力的评估，另一方面通过个股分散来控制风险暴露。

债券市场方面，本季度，经济基本面整体呈现弱复苏态势。内需修复有所放缓，其中基建投资形成主要支撑，而房地产领域延续拖累态势；消费在政策补贴拉动下增速有所回升。出口方面，尽管面临关税壁垒和地缘冲突等多重挑战，但外需仍展现出较强韧性。市场方面，季初受中美关系不确定性上升影响，资金面边际宽松，带动债券收益率在数个交易日内大幅下行，此后维持窄幅震荡至季末。综合来看，我们认为债市短期内缺乏明确的涨跌动能。基于此判断，本基金在久期策略上采取了偏谨慎的立场，券种上主要持有利率债和高等级信用债。总体而言，本基金在本季度有所盈利。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信长鑫增强债券 A 基金份额净值为 1.0270 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%；安信长鑫增强债券 C 基金份额净值为 1.0217 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.37%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%；安信长鑫增强债券 D 基金份额净值为 1.0269 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；安信长鑫增强债券 E 基金份额净值为 1.0221 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.41%，

同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

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	27,583,922.90	4.51
	其中：股票	27,583,922.90	4.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	530,704,376.88	86.81
	其中：债券	530,704,376.88	86.81
	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	8,000,000.00	1.31
	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	29,110,893.98	4.76
8	其他资产	15,912,698.63	2.60
9	合计	611,311,892.39	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 1,012,456.01 元，占净值比例 0.20%。

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	1,559,309.00	0.31
C	制造业	18,339,964.19	3.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	551,778.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	578,342.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,097,177.00	0.22
H	住宿和餐饮业	123,520.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	353,714.00	0.07

J	金融业	2,011,720.00	0.40
K	房地产业	985,856.00	0.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	433,093.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	76,779.00	0.02
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	460,214.70	0.09
S	综合	-	-
	合计	26,571,466.89	5.27

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	521,836.03	0.10
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	490,619.98	0.10
合计	1,012,456.01	0.20

注：以上分类采用财汇提供的国际通用行业分类标准。

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	600585	海螺水泥	46,300	994,061.00	0.20
2	002142	宁波银行	34,700	949,392.00	0.19
3	601318	中国平安	16,900	937,612.00	0.19
4	300750	宁德时代	3,300	832,326.00	0.17
5	600519	贵州茅台	500	704,760.00	0.14
6	000333	美的集团	9,400	678,680.00	0.13
7	002466	天齐锂业	16,300	522,252.00	0.10
8	06110	滔搏	187,000	521,836.03	0.10
9	601225	陕西煤业	26,200	504,088.00	0.10
10	300014	亿纬锂能	10,900	499,329.00	0.10

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	525,081,484.31	104.21
	其中：政策性金融债	65,982,800.00	13.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,622,892.57	1.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	530,704,376.88	105.33

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	2128042	21 兴业银行二级 02	400,000	41,883,866.30	8.31
2	212300003	23 江苏银行债 02	400,000	41,362,678.36	8.21
3	115368	23 华泰 11	330,000	34,066,755.29	6.76
4	240017	23 光证 G5	330,000	34,065,502.19	6.76
5	2128028	21 邮储银行二级 01	300,000	31,455,718.36	6.24

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

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 兴业银行二级 02（代码：2128042 CY）、23 江苏银行债 02（代码：212300003 CY）、23 华泰 11（代码：115368 SH）、23 光证 G5（代码：240017 SH）、21 邮储银行二级 01（代码：2128028 CY）、24 国开清发 03（代码：09240203 CY）、24 申证 03（代码：148976 SZ）、23 中证 G3（代码：138911 SH）、24 南京银行 01（代码：2420021 CY）、24 进出 09（代码：240309 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。

1. 兴业银行股份有限公司

2024 年 7 月 25 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局福建监管局罚款。

2024 年 10 月 31 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2025 年 1 月 27 日，兴业银行股份有限公司因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

2. 江苏银行股份有限公司

2025 年 1 月 27 日，江苏银行股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会江苏监管局责令改正。

3. 华泰证券股份有限公司

2024 年 12 月 4 日，华泰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江苏监管局出具警示函。

4. 光大证券股份有限公司

2024 年 10 月 18 日，光大证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会出具警示函。

5. 中国邮政储蓄银行股份有限公司

2024 年 12 月 2 日，中国邮政储蓄银行股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款。

6. 国家开发银行

2024 年 12 月 27 日，国家开发银行因违规经营被国家金融监督管理总局北京监管局罚款。

7. 申万宏源证券有限公司

2024 年 11 月 1 日，申万宏源证券有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行上海市分行罚款。

2024 年 12 月 24 日，申万宏源证券有限公司因未依法履行职责被中国证券监督管理委员会新疆监管局出具警示函。

2024 年 12 月 26 日，申万宏源证券有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函。

8. 中信证券股份有限公司

2024 年 8 月 7 日，中信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贵州监管局出具警示函。

2024 年 8 月 26 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被北京证券交易所监管执行部、深圳证券交易所出具警示函、通报批评。

2024 年 8 月 29 日，中信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出具警示函。

2024 年 11 月 8 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

2024 年 12 月 20 日，中信证券股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2025 年 5 月 14 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被上海证券交易所警示。

2025 年 6 月 6 日，中信证券股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所书面警示。

9. 南京银行股份有限公司

2025 年 1 月 27 日，南京银行股份有限公司因内部制度不完善被中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函。

10. 中国进出口银行

2025 年 6 月 27 日，中国进出口银行因违规经营被国家金融监督管理总局罚款。

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	25,228.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	8,650.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,878,819.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,912,698.63

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	123072	乐歌转债	3,046,999.41	0.60
2	123065	宝莱转债	2,532,535.36	0.50
3	127016	鲁泰转债	43,357.80	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	安信长鑫增强 债券 A	安信长鑫增强 债券 C	安信长 鑫增强 债券 D	安信长鑫增 强债券 E
报告期期初基金份额总额	269,271,989.51	568,381,554.12	-	6,106,016.13
报告期期间基金总申购份额	31,707,571.42	43,993,730.84	1,951.03	11,673.49
减：报告期期间基金总赎回份额	149,200,048.12	271,912,177.34	-	5,999,370.13
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	151,779,512.81	340,463,107.62	1,951.03	118,319.49

§ 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

无。

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长鑫增强债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信长鑫增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信长鑫增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信长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它文件。

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>

2025 年 7 月 18 日