

中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金

2026 年第 1 季度报告

2026 年 03 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 04 月 21 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 2026 年 04 月 20 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中信保诚安鑫回报债券
基金主代码	009730
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 07 月 29 日
报告期末基金份额总额	2,146,937,902.05 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成，主要对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势等，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类资产等工具的配置比例，动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）类属资产配置策略</p> <p>在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。</p>

	<p>(2) 普通债券投资策略</p> <p>对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>1) 目标久期控制</p> <p>本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。</p> <p>2) 期限结构配置</p> <p>在确定债券组合的久期之后，本基金将采用收益率曲线分析策略，自上而下进行期限结构配置。具体来说，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹型、哑铃型、梯形等配置方法，确定在短、中、长期债券的投资比例。</p> <p>3) 信用利差策略</p> <p>一般来说，信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。本基金将从宏观经济环境与信用债市场供需状况两个方面对市场信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于信用债市场供求，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。</p> <p>4) 相对价值投资策略</p> <p>本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。</p> <p>5) 回购放大策略</p> <p>本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当地通过回购融资来提高资金利用率，以增强组合收益。</p> <p>(3) 信用债投资策略</p> <p>本基金投资的信用债券的信用评级为 AA 级及以上。一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，本基金根据债券发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、债券收益率、流动性等因素，评估其投资价值，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。</p> <p>3、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，</p>
--	--

	<p>研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</p> <p>本基金在进行个股筛选时，将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1) 定性分析：根据对行业的发展情况和盈利状况的判断，从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2) 定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等； ROE、ROIC、毛利率、净利率等； PE、PEG、PB、PS 等。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，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，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平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，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。</p> <p>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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>			
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%			
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金，高于货币市场基金。			
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司			
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	中信保诚安鑫回报债券 A	中信保诚安鑫回报债券 C	中信保诚安鑫回报债券 D	中信保诚安鑫回报债券 E
下属分级基金的交易代码	009730	009731	023599	023600
报告期末下属分级基金的	357,816,519.01	405,312,793.21	1,247,257,354.13	136,551,235.70

份额总额	份	份	份	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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 03 月 31 日）			
	中信保诚安鑫回 报债券 A	中信保诚安鑫回 报债券 C	中信保诚安鑫回报 债券 D	中信保诚安鑫回 报债券 E
1. 本期已实现收益	3,794,645.65	4,749,561.58	8,644,513.59	1,340,487.49
2. 本期利润	6,871,871.05	10,290,440.30	10,914,148.24	2,226,412.72
3. 加权平均基金份额本期 利润	0.0182	0.0198	0.0109	0.0154
4. 期末基金资产净值	414,429,471.58	458,857,949.99	1,444,436,037.22	157,991,504.76
5. 期末基金份额净值	1.1582	1.1321	1.1581	1.1570

注：1、上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

中信保诚安鑫回报债券 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	1.58%	0.19%	0.10%	0.15%	1.48%	0.04%
过去六个月	2.98%	0.16%	0.54%	0.15%	2.44%	0.01%
过去一年	5.30%	0.13%	3.94%	0.14%	1.36%	-0.01%
过去三年	14.10%	0.17%	12.80%	0.15%	1.30%	0.02%
过去五年	12.00%	0.26%	17.12%	0.16%	-5.12%	0.10%
自基金合同生效起 至今	15.82%	0.26%	20.77%	0.17%	-4.95%	0.09%

中信保诚安鑫回报债券 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	1.48%	0.19%	0.10%	0.15%	1.38%	0.04%
过去六个月	2.78%	0.16%	0.54%	0.15%	2.24%	0.01%
过去一年	4.88%	0.13%	3.94%	0.14%	0.94%	-0.01%
过去三年	12.73%	0.17%	12.80%	0.15%	-0.07%	0.02%
过去五年	9.77%	0.26%	17.12%	0.16%	-7.35%	0.10%
自基金合同生效起 至今	13.21%	0.26%	20.77%	0.17%	-7.56%	0.09%

中信保诚安鑫回报债券 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
过去三个月	1.58%	0.19%	0.10%	0.15%	1.48%	0.04%
过去六个月	2.98%	0.16%	0.54%	0.15%	2.44%	0.01%
过去一年	5.29%	0.13%	3.94%	0.14%	1.35%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	5.21%	0.13%	3.69%	0.14%	1.52%	-0.01%

中信保诚安鑫回报债券 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	1.55%	0.19%	0.10%	0.15%	1.45%	0.04%
过去六个月	2.95%	0.16%	0.54%	0.15%	2.41%	0.01%
过去一年	5.20%	0.13%	3.94%	0.14%	1.26%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	5.11%	0.13%	3.69%	0.14%	1.42%	-0.01%

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

中信保诚安鑫回报债券 A



中信保诚安鑫回报债券 C



中信保诚安鑫回报债券 D



中信保诚安鑫回报债券 E



§ 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		
陈岚	固定收益部助理总监、 基金经理	2020 年 07 月 30 日	-	17	陈岚女士, 经济学硕士, CFA。曾担任国泰君安证券股份有限公司固收高级研究员、平安资产管理有限责任公司固收投资经理、瑞银证券有限责任公司经济学家。2018 年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司, 任高级投资经理。现任固定收益部助理总监, 中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
王颖	量化投资部副总监 (主持工作)、基金经理	2025 年 09 月 16 日	-	12	王颖女士, 经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司, 担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司, 历任助理投资经理、基金经理助理。现任量化投资部副总监 (主持工作), 中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚安鑫回

					报债券型证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同、招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券，满足条件时自动执行交易系统中的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行检查和统计分析。

本报告期，公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合

与公司旗下管理的其它投资组合之间未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，美国经济韧性仍在，美伊冲突爆发，油价大幅上涨，全球滞胀风险上升，美联储在降息节奏上保持谨慎，美元指数和美债收益率上行。国内经济在“十五五”开局之年展现出企稳修复态势，出口强势带动生产偏强，内需温和修复，政策前置发力特征明显，投资增速转正，消费表现平稳。通胀方面，受春节错位及假期消费提振影响，CPI 同比走高，有色拉动下 PPI 同比降幅收窄，3 月有望转正。

宏观政策方面，两会各项目标符合市场预期，政府工作报告中总量政策导向与经济工作会议基本一致，对内需和科技的重视度依然较高；一季度政策靠前发力，地方专项债发行节奏明显快于去年同期，利于后续形成实物工作量；货币政策方面，央行综合运用逆回购、MLF、买断式逆回购及国债买卖操作等平滑资金面，流动性维持合理充裕；同业存款自律管理加强，市场利率定价自律机制要求高于 7 天逆回购 OMO 政策利率的同业活期存款规模季度末占比不超过 10%-20%，以进一步稳定净息差，对短端资产有一定利好。

从债券市场看，一季度利率债收益率整体呈现区间震荡格局，十年国债收益率在 1.75%-1.9% 之间波动，1-2 月资金面平稳、权益市场有所降温、配置型资金流入带来需求上升带动债市情绪有所升温，曲线走平，3 月中东动荡局势引发通胀预期升温，叠加各项宏观数据超出市场预期，长端和超长端有所调整，曲线陡峭化；信用债方面，年初机构配置需求旺盛，信用利差普遍压缩。

权益方面，一季度 A 股市场先涨后跌，震荡加剧。从行业表现上看，一季度，煤炭、石油石化、通信领涨，消费、非银、商贸零售跌幅相对居前；从板块上看，油气、光通信、光模块、电网设备等主题表现较突出，并呈现轮动行情。从量化角度看，一季度全 A 内量化因子表现波动较大：1-2 月，动量、成长、分析师预期类因子表现较强，估值类因子明显回撤；3 月，估值、盈利类因子表现较突出，流动性、动量等因子回撤较大。

本季度，安鑫回报的纯债部分持仓主要以中高等级信用债为主，中短久期，适度杠杆。2026 年一季度，债市收益率整体震荡下行，中短端信用利差收窄，组合纯债部分取得了较好的票息和利差收窄带来

的收益。

本季度，安鑫回报的股票部分延续之前的产品风格，并基于市场情况小幅调整了权益仓位。在投资策略部分，本基金主要结合行业景气度、业绩趋势、估值等多个维度，挖掘整体估值较低的上市公司的投资机会，力争获取估值修复带来的投资收益，并在此基础上结合量价表现进行交易调整。

展望 2026 年二季度，美国大选周期的政治博弈或将加剧，中东局势不确定性仍在，全球滞胀风险仍存，美联储政策相机抉择。国内步入传统生产与施工旺季，前期发行的政府债资金有望继续转化为实物工作量，“十五五”重大项目对投资有所支撑，但地缘政治带来的原材料价格大幅上行可能给后续出口带来不确定性。通胀方面，CPI 同比或偏震荡，PPI 同比继续上行的可能性较大。政策方面，财政继续前置发力，政府债供给有望提速，净融资额相比一季度有所上行，超长期特别国债发行节奏或偏快；在货币和财政协同发力的背景下，货币政策继续保持流动性合理充裕的必要性较强。

债券市场投资方面，基本面现实缓慢修复，大宗商品价格受外围扰动叠加普遍低库存，从通胀方面影响债券中长端的定价，预计十年国债收益率或在 1.75-1.85% 之间震荡；信用方面，利率偏震荡的情况下，票息或仍将为组合主要收益来源，但当前短端信用利差已经压缩至历史较低水平，中长期信用利差或仍有一定压缩空间，在配置时仍需要综合考虑负债端稳定性和个券流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚安鑫回报债券 A 份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%；中信保诚安鑫回报债券 C 份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%；中信保诚安鑫回报债券 D 份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%；中信保诚安鑫回报债券 E 份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%。

4.6 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，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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	154,017,196.38	4.99
	其中：股票	154,017,196.38	4.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,840,877,447.02	92.03
	其中：债券	2,840,877,447.02	92.03
	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	12,000,419.18	0.39
	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	55,659,560.39	1.80
8	其他资产	24,267,952.83	0.79
9	合计	3,086,822,575.80	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	1,260,811.00	0.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,121,720.27	4.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	690,921.00	0.03
E	建筑业	4,837,174.00	0.20
F	批发和零售业	7,072,218.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,413,563.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,689,677.45	0.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,097,105.00	0.08
L	租赁和商务服务业	682,385.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	9,038,011.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	9,040,374.66	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	676,148.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,397,088.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	154,017,196.38	6.22

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投资股票。

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	300854	中兰环保	27,500	786,225.00	0.03
2	603819	神力股份	57,800	753,134.00	0.03
3	300906	日月明	22,500	752,625.00	0.03
4	001219	青岛食品	51,000	751,740.00	0.03
5	688163	赛伦生物	27,128	750,631.76	0.03
6	688069	德林海	24,422	750,488.06	0.03
7	003030	祖名股份	36,300	749,232.00	0.03
8	603182	嘉华股份	46,100	748,664.00	0.03
9	000790	华神科技	180,700	746,291.00	0.03
10	000632	三木集团	149,200	746,000.00	0.03

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	150,822,795.63	6.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,085,374,640.27	43.84
	其中：政策性金融债	101,259,298.63	4.09
4	企业债券	1,402,295,144.14	56.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	152,999,796.71	6.18
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,385,070.27	1.99
9	其他	-	-
10	合计	2,840,877,447.02	114.75

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	243216	兖矿 KY04	1,000,000	101,329,632.88	4.09
2	019773	25 国债 08	1,000,000	101,327,452.05	4.09

3	250202	25 国开 02	900,000	91,217,367.12	3.68
4	242380013	23 建行永续债 01	700,000	74,062,251.51	2.99
5	242580004	25 江苏银行永续债 01BC	700,000	71,557,313.97	2.89

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，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，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平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，力求实现委托财产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，报告编制日前一年内，招商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚；中国建设银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚，受到中国人民银行处罚（银罚决字[2026]5号）；中国民生银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局宁波监管局处罚；国家开发银行受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚（银罚决字[2025]66号、京汇罚[2025]30号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

5.11.2 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中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,385.13
2	应收证券清算款	23,747,063.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	370,504.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,267,952.83

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚安鑫回 报债券 A	中信保诚安鑫回 报债券 C	中信保诚安鑫回报 债券 D	中信保诚安鑫回 报债券 E
报告期期初基金份额总额	387,934,751.70	723,121,951.99	734,377,815.98	141,497,639.65
报告期期间基金总申购份 额	53,011,586.63	127,848,478.17	1,181,287,238.36	112,531,405.15
减：报告期期间基金总赎回 份额	83,129,819.32	445,657,636.95	668,407,700.21	117,477,809.10
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	357,816,519.01	405,312,793.21	1,247,257,354.13	136,551,235.70

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，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

无

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情 况

别	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

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、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2026 年 04 月 21 日