

中信建投稳丰 63 个月定期开放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:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 04 月 22 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年04月21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

基金简称	中信建投稳丰 63 个月债
基金主代码	009585
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 07 月 28 日
报告期末基金份额总额	7,999,989,894.43 份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以定期开放方式进行投资运作。在开放期，本基金原则上将使基金资产保持现金状态。在封闭期内，本基金采用买入并持有策略构建投资组合，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产在开放前可完全变现。本基金投资于含回售权的债券，且债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不应当持有至到期。一般情况下，本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。但基金管理人可基于基金份额持有人利益优先原则，在不违反企业会计准则的前提下，对尚未到期的固定收益类资产提前处置。主要投资策略包括债券类属配置策略，信用债投资策略，银行定期存款、协议存款及大额存单投资策略，杠杆投资策略，资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的

	中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率（税后）+0.5%
风险收益特征	本基金为定期开放债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 03 月 31 日）
1. 本期已实现收益	35,972,332.56
2. 本期利润	35,972,332.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0045
4. 期末基金资产净值	8,063,244,638.08
5. 期末基金份额净值	1.0079

注：1、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。

2、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。

3.2 基金净值表现

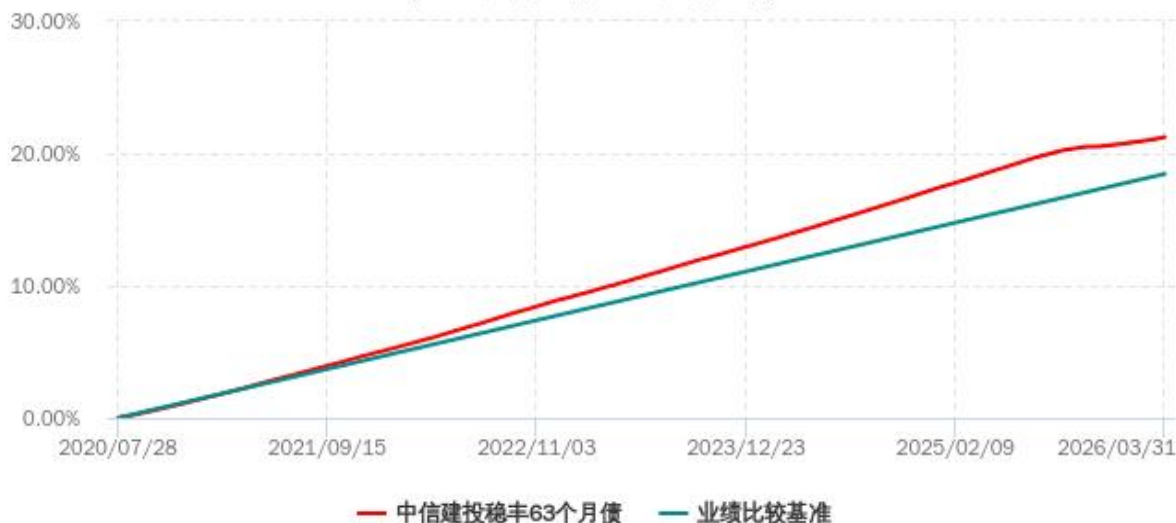
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.45%	0.01%	0.68%	0.01%	-0.23%	0.00%
过去六个月	0.74%	0.01%	1.39%	0.01%	-0.65%	0.00%
过去一年	2.42%	0.01%	2.82%	0.01%	-0.40%	0.00%
过去三年	10.22%	0.01%	8.98%	0.01%	1.24%	0.00%
过去五年	18.60%	0.01%	15.91%	0.01%	2.69%	0.00%
自基金合同生 效起至今	21.24%	0.01%	18.46%	0.01%	2.78%	0.00%

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

中信建投稳丰63个月债累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年07月28日-2026年03月31日)



§ 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		
邵彦棋	本基金的基金经理	2025-06-26	-	6年	中国籍，中央财经大学经济学硕士。曾任清华大学五道口金融学院国家金融研究院宏观研究员、山西证券股份有限公司宏观固收研究员。2022年3月加入中信建投基金管理有限公司，曾任本公司固定收益研究部宏观研究员、基金经理助理，现任本公司固定收益部基金经理，担任中信建投稳裕定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳丰63个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投景晟债券型证券投资基金、中信建投景润3个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投中

					债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中信建投中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，宏观指标整体表现平稳。1-2 月份，受到季节性因素和春节影响，制造业 PMI 回到 50 荣枯线下，但 3 月份，制造业 PMI 重新回到荣枯线上。出口延续去年强势表现，依旧是拉动经济的主要动力。另外，地产在春节后迎来“小阳春”，二手房成交量上升，同时一线城市二手房成交价格在一季度趋稳。通胀在一季度出现积极变化，受原材料价格上升和春节错位的影响，CPI 和 PPI 同比在 2 月均有回升。政策方面，3 月两会设定 2026 年增长目标为 4.5%-5%，赤字率 4%左右，财政政策在总量上相对克制，与增长目标相一致。海外方面，地缘政治存在不确定性。1 月初美国发动对委内瑞拉的斩首行动，3 月份有对伊朗展开军事行动。地缘冲突导致资产价格波动，尤其原油价格的上升，引发输入型通胀的担忧。债市在一季度有所回暖，长端和短端表现分化。其中长端收益率在 1-2 月有所修复，一是前期悲观情绪有所消化，二是机构在年初有一定配置需求。进入 3 月后，长端利率受到通胀预期的影响有所调整，但资金面宽松使得曲线中短端的各类债券品种表现偏强。本基金在本季度基本完成新一轮配置，配置主要为信用债和地方债。

后续来看，利率走势的核心还是通胀变化，以及货币政策预期，债市或延续震荡。后续，该产品主要通过控制融资成本，实施杠杆套息策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投稳丰 63 个月债基金份额净值为 1.0079 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 0.45%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,547,293,697.63	99.44
	其中：债券	12,547,293,697.63	99.44
	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	70,376,200.48	0.56
8	其他资产	126,808.17	0.00
9	合计	12,617,796,706.28	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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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	摊余成本(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	91,245,743.92	1.13
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	909,908,899.67	11.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	7,512,129,846.86	93.17
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	4,034,009,207.18	50.03
10	合计	12,547,293,697.63	155.61

5.5 报告期末按摊余成本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)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	235480	25 吉林 42	7,000,000	703,940,525.90	8.73
2	235426	25 江西 66	5,800,000	584,681,069.07	7.25
3	235440	25 重庆 54	5,700,000	574,175,080.78	7.12
4	235668	25 辽宁 44	2,500,000	251,185,720.41	3.12
5	235747	25 甘肃 43	2,400,000	243,285,194.78	3.02

5.6 报告期末按摊余成本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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现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、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	126,808.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	126,808.17

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	7,999,989,894.43
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	7,999,989,894.43

§ 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，基金管理人未持有本基金份额。

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，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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2026 年 3 月 27 日、2026 年 3 月 30 日、2026 年 3 月 31 日分别披露《中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》《中信建投基金管理有限公司关于

以通讯方式召开中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二六年四月二十二日