

中银证券安弘债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

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 7 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 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银证券安弘债券	
基金主代码	004807	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 9 日	
报告期末基金份额总额	3,554,457,137.54 份	
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金通过大类资产配置策略、类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略、可转债投资策略、中小企业私募债券投资策略、股票投资策略及资产支持证券投资策略等，以期获得长期稳定收益。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*85%+中证 A500 指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期收益和预期风险低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中银证券安弘债券 A	中银证券安弘债券 C
下属分级基金的交易代码	004807	004808
报告期末下属分级基金的份额总额	2,801,112,185.50 份	753,344,952.04 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	中银证券安弘债券 A	中银证券安弘债券 C
1. 本期已实现收益	155,422,819.61	34,864,143.62
2. 本期利润	356,197,049.36	82,571,958.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1274	0.1239
4. 期末基金资产净值	4,170,120,433.59	1,092,228,092.27
5. 期末基金份额净值	1.4887	1.4498

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

中银证券安弘债券 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	9.61%	0.45%	2.64%	0.22%	6.97%	0.23%
过去六个月	9.82%	0.42%	2.61%	0.20%	7.21%	0.22%
过去一年	19.02%	0.38%	4.48%	0.17%	14.54%	0.21%
过去三年	27.16%	0.34%	10.76%	0.14%	16.40%	0.20%
过去五年	21.83%	0.34%	10.80%	0.13%	11.03%	0.21%
过去七年	44.00%	0.34%	16.45%	0.13%	27.55%	0.21%
自基金合同生效起至今	56.05%	0.30%	21.10%	0.13%	34.95%	0.17%

中银证券安弘债券 C

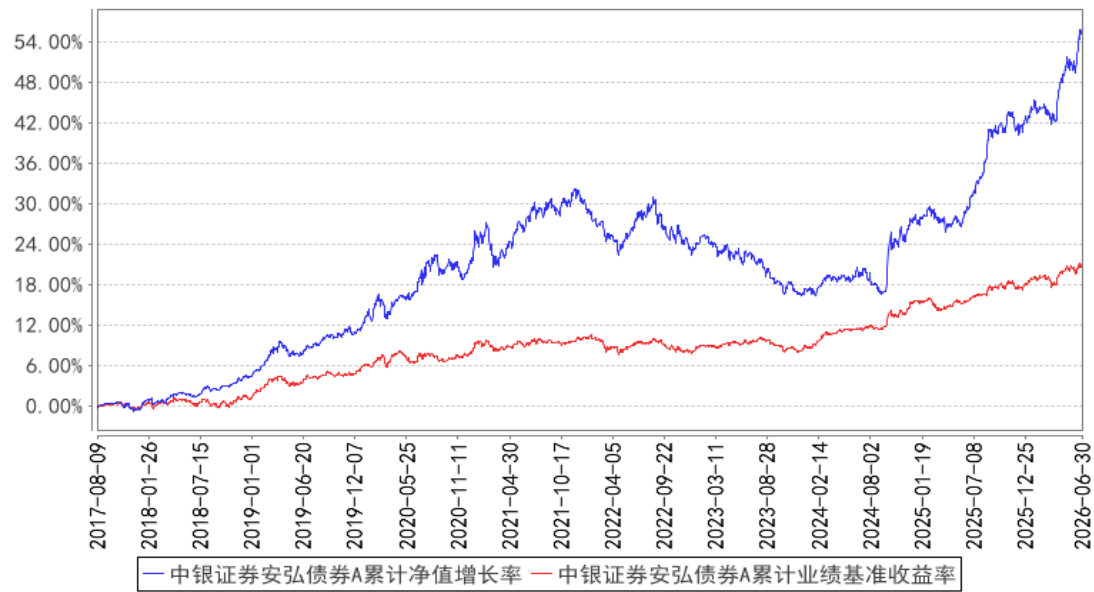
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	9.51%	0.45%	2.64%	0.22%	6.87%	0.23%
过去六个月	9.63%	0.41%	2.61%	0.20%	7.02%	0.21%
过去一年	18.61%	0.38%	4.48%	0.17%	14.13%	0.21%
过去三年	25.81%	0.34%	10.76%	0.14%	15.05%	0.20%
过去五年	19.70%	0.34%	10.80%	0.13%	8.90%	0.21%
过去七年	40.51%	0.34%	16.45%	0.13%	24.06%	0.21%
自基金合同 生效起至今	52.15%	0.30%	21.10%	0.13%	31.05%	0.17%

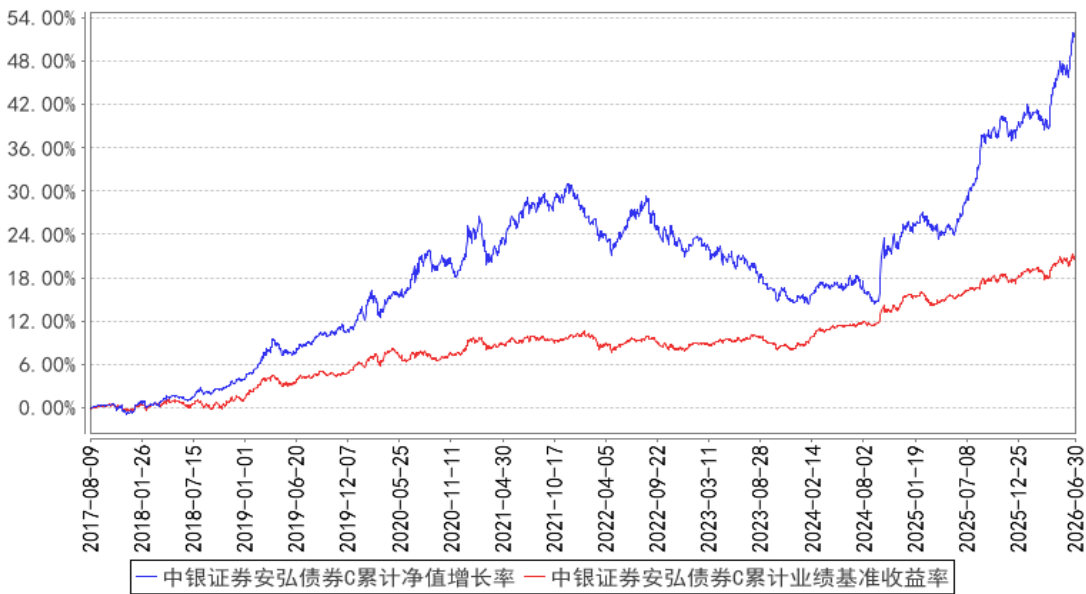
注：自基金成立至 2025 年 4 月 20 日,本基金业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10% 自 2025 年 4 月 21 日起,本基金业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*85%+中证 A500 指数收益率*15%。

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

中银证券安弘债券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



中银证券安弘债券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



注：本基金合同于 2017 年 8 月 9 日生效。

3.3 其他指标

注：无。

§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		
罗雨	本基金的基金经理	2023 年 9 月 1 日	—	12 年	罗雨，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任职于莫尼塔(上海)投资发展有限公司；2013 年 12 月至 2015 年 9 月任职于国泰君安证券股份有限公司，担任研究员；2015 年 9 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券安怡债券型证券投资基金基金经理。
王文华	本基金的基金经理	2024 年 9 月 20 日	—	18 年	王文华，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。曾任中诚信证券评估有限公司分析员，高级分析师、华泰联合证券有限责任公司高级经理；2012 年 3 月至 2021 年 7 月任职于东吴基金管理有限公司，担任债券研究员、债券基金经理助理、基金经理；2021 年 8 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券安

					泰债券型证券投资基金、中银证券安澈债券型证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券和瑞一年持有期混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘用日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日期；

2、证券从业的涵义遵从《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》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

注：无

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为、违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《资产管理业务公平交易管理办法》、《资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，投资监督团队负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，

报告期内，未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金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

二季度国内经济受到地缘政治冲突带来的涨价冲击，出现了一定程度的走弱。市场热盼的上游涨价向中下游行业传导的现象并未大范围出现，成本价格上涨后，我们发现多数行业涨价乏力，涨价对企业毛利率形成了直接的冲击。出口依然保持相对强劲，但投资和内需型消费十分疲弱，经济增长的亮点依然持续在出口和科技方向。国内经济的实际走势与年初对国内经济的预判差距进一步放大，这成为资本市场走势分化的核心驱动力。

国内资本市场二季度走势呈现 K 型分化。在 A 股市场，以双创为代表的科技股和其他行业、板块的公司走势显著不同，持续快速上涨并创下历史新高；而消费、周期、传统制造等宽基指数的传统权重行业，则受到基本面景气下滑和“国家队”持续卖出指数产品的影响，从 4 月下旬开始持续下跌。过去四年一直走势较强的小微盘股票受到流动性和业绩预期的双重压制，领跌全市场，年初至今的涨幅自过去三年以来第一次落后市场水平。正如我们上季度的季报中所述，地缘政治冲突不影响 A 股市场整体的流动性，但会促使投资者快速地从题材驱动型选股、转向业绩驱动型选股。而科技以外行业整体景气的乏善可陈，成为股市 K 型分化的重要诱因。债券方面，收益率先下后上。油价从高位回落之后，虽然市场的通胀预期有所平抑，但地缘政治冲突最烈的时候国内政策维持的宽松流动性，自 5 月末开始逐渐收紧，成为债市先涨后跌的伏线。商品则一改 3 月之前的强势，出现了普遍的下跌。临近季末，除了少数重点投资于科技的特例以外，大部分含权产品上半年的净值收益一般，含权固收加产品的整体收益甚至略低于纯债类产品。

报告期内，本产品纯债的配置仍然以长久期利率债和高等级信用债为主。二季度本产品纯债配置上操作不多，主要是应对申购赎回对头寸带来的变化和影响。受益于权益持仓带来的超额收益，截至季末，本产品相对业绩比较基准的超额收益依然为正。

股票方面，我们在 3 月末加回了因地缘政治冲突加剧减少的权益仓位。由于 4 月初我们准确

地预判了地缘政治冲突的后续走向，因此我们持续超配成长风格，同时适当保留了部分高股息股票作为底仓，这个股票配置为产品二季度净值走势带来了不错的收益。经过 4 月底季报之后的例行调仓，产品当前重仓的股票主要集中在电子、通信、新能源等方向。整体而言，本产品股票组合的股价弹性继续得到了维持。在上涨过程中市场出现震荡时，由于我们对冲头寸的缓释，产品净值的下跌相比其他同样弹性的含权产品略少。6 月之后，A 股市场的 K 型分化更为极致，部分科技和成长指数出现了超出我们预期的大幅上涨，这使得这些方向的指数和标的的隐含波动率大幅上升。成长和科技配置的整体性价比进一步走低。从当下往后展望，我们认为成长风格整体的配置性价比已不如其他方向。未来即使成长类指数创新高，过程想必也会十分坎坷。基于这一判断，下半年我们将缓慢地减配成长风格、增配红利风格。这个过程会进行地相对较慢，以保持产品整体净值的相对稳定。我们相信，在成长股向红利持续切换的窗口期，整体市场呈现投资线索混乱的大背景下，依靠我们选股策略带来的超额收益，产品整体净值较好的绝对和相对收益表现有望继续。

转债方面，整体维持了仓位，在结构和行业上略有调整。截至期末，转债比例依然维持在 9% 上下，略高于同类产品的平均水平。在二季度下跌的过程中，我们认为转债的投资机会、特别是平衡型和债性转债的投资机会在逐渐增加。这是因为二季度转债整体的下跌，跌的主要是估值，但和股票不同，转债有债底支撑。估值的回落意味着债底的看跌期权保护更强，经风险调整后的投资价值也就更高，这支持我们继续维持 9% 左右的转债仓位。整体上，产品当前的转债持仓仍以债性和平衡型转债为主，对转债的配置依然整体采取了求稳求票息收益的思路，在配置上对行业 and 个券的选择继续保持分散。截至报告期末，本产品在转债上的投资对标同样以债性转债为主的转债 50 指数依然保持了超额正收益，同时转债持仓的回撤一直控制在产品整体净值波动可以接受的范围内。

在大类资产配置层面，本产品目前实行的长久期债券+高仓位股票+债性转债的配置预计将保持不变。展望 2026 年三季度的市场走势，我们认为科技风格短期出现下跌之后，市场将处于一个寻找新上涨方向的状态，但国内经济和流动性环境却并不支持股指继续大幅地创新高，因此 A 股将呈现宽幅震荡的走势特征。相反，受益于通胀预期的回落，债市可能持续走强。这一局面仍然有利于本产品当前的资产配置。在后续产品运营的过程中，我们仍将密切关注可能引发净值回撤的风险，和过去一样，继续将净值回撤控制在符合产品定位的水平上。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安弘债券 A 基金份额净值为 1.4887 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.61%；同期业绩比较基准收益率为 2.64%。截至本报告期末中银证券安弘债券 C 基金份额净

值为 1.4498 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.51%；同期业绩比较基准收益率为 2.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 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	950,418,166.11	17.25
	其中：股票	950,418,166.11	17.25
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,508,119,894.29	81.81
	其中：债券	4,508,119,894.29	81.81
	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	—	—
	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	15,475,216.62	0.28
8	其他资产	36,395,567.81	0.66
9	合计	5,510,408,844.83	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	5,522,980.00	0.10
B	采矿业	31,196,739.00	0.59
C	制造业	755,207,851.71	14.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,454,430.00	0.54
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	42,960,000.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	33,696,010.00	0.64
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,553,551.00	0.12
J	金融业	36,803,223.40	0.70

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	4,478,071.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	5,545,310.00	0.11
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	950,418,166.11	18.06

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金投资范围未包括港股通投资股票，无相关投资。

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	688525	佰维存储	140,700	69,608,511.00	1.32
2	688012	中微公司	137,700	64,512,450.00	1.23
3	688498	源杰科技	31,258	58,952,588.00	1.12
4	300308	中际旭创	40,400	51,308,000.00	0.98
5	300857	协创数据	134,632	45,761,416.80	0.87
6	300475	香农芯创	143,200	42,960,000.00	0.82
7	688766	普冉股份	52,200	40,016,520.00	0.76
8	300223	北京君正	135,000	33,601,500.00	0.64
9	688519	南亚新材	78,200	29,719,128.00	0.56
10	688110	东芯股份	138,000	28,110,600.00	0.53

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	1,462,329,949.58	27.79
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,430,036,169.14	27.17
	其中：政策性金融债	827,440,387.76	15.72
4	企业债券	246,759,789.89	4.69
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	795,222,115.60	15.11
7	可转债（可交换债）	474,983,045.90	9.03
8	同业存单	98,788,824.18	1.88
9	其他	—	—
10	合计	4,508,119,894.29	85.67

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	2600002	26 超长特别国债 02	7,900,000	789,152,584.70	15.00
2	2600001	26 超长特别国债 01	4,600,000	461,116,568.31	8.76
3	250215	25 国开 15	3,000,000	297,146,301.37	5.65
4	250211	25 国开 11	2,500,000	253,216,438.36	4.81
5	240210	24 国开 10	1,300,000	136,526,712.33	2.59

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：：本基金本报告期末未持有权证投资。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金投资范围未包括国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资评价。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

国家开发银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的行政处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	244,477.47
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	36,151,090.34
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	36,395,567.81

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	113062	常银转债	41,211,113.01	0.78
2	113056	重银转债	32,243,166.94	0.61
3	113052	兴业转债	28,584,318.10	0.54
4	113042	上银转债	27,726,345.21	0.53
5	127110	广核转债	26,338,113.36	0.50
6	127089	晶澳转债	23,837,366.90	0.45
7	127067	恒逸转 2	20,237,594.52	0.38
8	113066	平煤转债	19,787,799.45	0.38
9	113048	晶科转债	19,671,043.80	0.37
10	113661	福 22 转债	18,639,886.16	0.35
11	113631	皖天转债	17,860,674.08	0.34
12	127109	电化转债	16,949,265.69	0.32
13	110087	天业转债	15,044,568.86	0.29
14	127068	顺博转债	13,300,970.76	0.25
15	123262	神宇转债	10,522,860.48	0.20
16	113051	节能转债	9,623,768.39	0.18
17	127040	国泰转债	9,470,012.83	0.18
18	123158	宙邦转债	8,120,335.75	0.15
19	127103	东南转债	7,635,303.42	0.15

20	118031	天 23 转债	7,588,209.51	0.14
21	113046	金田转债	6,815,858.00	0.13
22	118022	锂科转债	6,317,050.39	0.12
23	110085	通 22 转债	6,122,602.44	0.12
24	113059	福莱转债	5,941,297.29	0.11
25	118035	国力转债	5,445,527.19	0.10
26	113673	岱美转债	5,359,475.25	0.10
27	113679	芯能转债	4,994,032.59	0.09
28	113640	苏利转债	4,757,694.92	0.09
29	113053	隆 22 转债	4,735,046.72	0.09
30	110098	南药转债	4,264,958.80	0.08
31	127056	中特转债	4,222,581.81	0.08
32	110086	精工转债	4,197,123.57	0.08
33	127030	盛虹转债	4,112,340.36	0.08
34	113659	莱克转债	4,058,114.43	0.08
35	113688	国检转债	4,024,659.45	0.08
36	113043	财通转债	3,905,469.86	0.07
37	110097	天润转债	3,862,283.10	0.07
38	127045	牧原转债	3,781,299.48	0.07
39	111009	盛泰转债	3,714,434.79	0.07
40	111004	明新转债	2,820,222.42	0.05
41	111018	华康转债	2,744,947.28	0.05
42	111022	锡振转债	1,322,280.27	0.03
43	113646	永吉转债	1,169,093.21	0.02
44	123091	长海转债	1,154,565.45	0.02
45	111002	特纸转债	747,369.61	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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

项目	中银证券安弘债券 A	中银证券安弘债券 C
报告期期初基金份额总额	2,568,072,222.37	619,295,824.82
报告期期间基金总申购份额	1,609,300,636.88	490,595,487.54
减：报告期期间基金总赎回份额	1,376,260,673.75	356,546,360.32
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	2,801,112,185.50	753,344,952.04

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

项目	中银证券安弘债券 A	中银证券安弘债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	36,943,254.03	—
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	36,943,254.03	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.32	—

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详细内容请阅读本基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《中银国际证券股份有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银证券安弘债券型证券投资基金注册的批复
- 2、《中银证券安弘债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中银证券安弘债券型证券投资基金托管协议》

- 4、法律意见书
- 5、基金管理人的业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人的业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券股份有限公司

2026 年 7 月 21 日