

中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 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：2023 年 10 月 24 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 2023 年 10 月 23 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 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 | 145,166,164.99 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</p> |

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。

（2）普通债券投资策略

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。

1) 目标久期控制

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。

2) 期限结构配置

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。

3) 信用利差策略

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。

4) 相对价值投资策略

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。

5) 回购放大策略

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。

（3）信用债投资策略

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。

3、资产支持证券的投资策略

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，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。

4、股票投资策略

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。

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。

5、国债期货投资策略

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。

6、存托凭证投资策略

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。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。

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 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 |
| 下属分级基金的交易代码 | 009730 | 009731 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 109,827,858.66 份 | 35,338,306.33 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（2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日） | |
|-----------------|--|---------------|
| | 中信保诚安鑫回报债券 A | 中信保诚安鑫回报债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | -612,520.37 | -232,515.23 |
| 2. 本期利润 | -866,484.80 | -314,904.39 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0076 | -0.0087 |
| 4. 期末基金资产净值 | 110,092,937.10 | 34,975,427.70 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0024 | 0.9897 |

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 | -0.78% | 0.18% | -0.03% | 0.13% | -0.75% | 0.05% |
| 过去六个月 | -1.25% | 0.19% | 0.54% | 0.12% | -1.79% | 0.07% |
| 过去一年 | -1.78% | 0.28% | 2.34% | 0.14% | -4.12% | 0.14% |
| 过去三年 | 0.04% | 0.33% | 7.88% | 0.17% | -7.84% | 0.16% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.24% | 0.32% | 7.64% | 0.17% | -7.40% | 0.15% |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|

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 | -0.89% | 0.18% | -0.03% | 0.13% | -0.86% | 0.05% |
| 过去六个月 | -1.45% | 0.19% | 0.54% | 0.12% | -1.99% | 0.07% |
| 过去一年 | -2.17% | 0.28% | 2.34% | 0.14% | -4.51% | 0.14% |
| 过去三年 | -1.16% | 0.33% | 7.88% | 0.17% | -9.04% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.03% | 0.32% | 7.64% | 0.17% | -8.67% | 0.15% |

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



中信保诚安鑫回报债券 C



§ 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 | | |
| 韩海平 | 副总经理、固定收益负责人、混合资产投资部总监、基金经理 | 2020年07月29日 | - | 18 | 韩海平先生，经济学硕士，CFA，FRM。历任招商基金数量分析师，国投瑞银基金固定收益组副总监、基金经理，融通基金固定收益部总监、基金经理，国投瑞银基金总经理助理、固定收益部总经理。2019年3月加入中信保诚基金管理有限公司，担任总经理助理、固定收益负责人。现任副总经理，固定收益负责人，混合资产投资部总监，中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保 |

| | | | | | |
|----|------|------------------|---|----|--|
| | | | | | 诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚安鑫回报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、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 陈岚 | 基金经理 | 2020 年 07 月 30 日 | - | 15 | 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。现任中信保诚安鑫回报债券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，不同投资组合同同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，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统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，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，相关情况由投资组合经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品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（完全复制的指数基金除外）。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每月对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

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

2023 年三季度，美国经济韧性较强，就业市场仍然紧张，但薪资通胀边际松动，核心 CPI 同比持续下行。美联储货币政策维持紧缩，7 月美联储再度加息 25bp，9 月维持政策利率不变，三季度美元指数和美债利率明显走高。国内经济见底回升，出口环比出现恢复迹象，内需方面，暑期消费热度较高，中秋国庆假期数据显示人均消费有所好转，基建、制造业对经济有所支撑，地产对经济的影响仍然较大，但地产需求端放松政策密集出台，9 月销售边际有所好转。社融增速见底回升，政策支持力度加大，政府债券发行贡献较多，但信贷内生需求仍有待恢复，居民和企业加杠杆意愿有待信心的逐步修复。通胀有所上行但仍处于低位，PPI 同比跌幅收窄，CPI 同比转负后有所回升。

宏观政策方面，三季度逆周期调控力度明显加大，地方债密集发行，地产宽松政策陆续落地，如北上

广深放开“认房不认贷”，广州部分区域放松限购等。8月央行超预期降息，OMO/MLF 利率分别下调 10bp/15bp，9月央行降准 0.25 个百分点，另外，多家全国性银行再下调存款挂牌利率，存量房贷利率下调落地。

从债券市场看，三季度经济逐渐修复，稳增长政策持续出台，长端利率整体先下后上，波动区间基本在 2.55%-2.7%。短端调整幅度更加明显，8月以来资金面受到税期、地方债发行、信贷投放、人民币汇率贬值等因素影响边际收敛，短端明显上行，收益率曲线整体经历了从牛陡到熊平的过程；信用债表现整体好于利率债，7月-8月中下旬机构配置需求仍然较为旺盛，信用债收益率下行，8月末之后有阶段性调整，中高等级和低等级品种信用利差有所分化；权益方面，国内经济环比修复但力度有限，中美利差处于低位，外资流出较多，市场风险偏好较低，三季度沪深 300 指数下跌 3.98%，中证转债指数下跌 0.52%。

截止本报告期末，安鑫回报的纯债部分持仓主要以中高等级信用债和利率债为主，适度杠杆，3季度纯债部分取得了正收益；3季度股票仓位整体小幅下降，板块配置有所调整，转债仓位基本维持，股票和转债在整体权益市场的分化波动过程中有一定回撤。

展望 2023 年四季度，财政支撑下美国经济韧性较强，美联储维持高利率的时间可能更久。国内经济或继续修复，出口基数走低，同比增速可能逐步上行，内需方面，9月制造业 PMI 回到荣枯线以上，经济环比修复带动居民收入改善，消费可能依然有一定恢复空间。基建对经济仍然是托底作用，地产销售修复的持续性有待观察。往后看，如果前期地产宽松政策继续落地见效，地产需求能够稳住，叠加基建的发力和消费的逐步改善，经济环比或有望继续上行。但今年地产对经济的拉动明显弱于以往年份，消费带动经济复苏的斜率可能较为平缓。通胀方面，预计 CPI 和 PPI 整体仍在低位。货币政策方面，经济修复基础尚不稳固，流动性可能保持合理充裕。

债券市场投资方面，预计政策会持续出台，力争 5% 的经济增长目标实现，汇率仍有压力，长端利率仍有调整风险，但考虑到经济修复斜率较缓，上行空间可能也较为有限，将关注机构行为层面的风险，以及特殊再融资债、新增财政工具等可能带来的供给压力；信用债方面，将关注中短久期，杠杆方面也将有所控制；权益方面，股市整体估值处于低位，股债收益差显示权益资产配置价值相对占优，将关注稳增长和高质量发展等相关的机会。

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-0.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%；中信保诚安鑫回报债券 C 份额净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

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 | 23,070,319.60 | 13.08 |
| | 其中：股票 | 23,070,319.60 | 13.08 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 150,687,591.40 | 85.43 |
| | 其中：债券 | 150,687,591.40 | 85.43 |
| | 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 | 500,000.00 | 0.28 |
| | 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 | 1,087,775.75 | 0.62 |
| 8 | 其他资产 | 1,050,954.79 | 0.60 |
| 9 | 合计 | 176,396,641.54 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,893,370.00 | 2.68 |
| C | 制造业 | 11,519,999.60 | 7.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 824,600.00 | 0.57 |
| E | 建筑业 | 1,161,300.00 | 0.80 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,607,300.00 | 1.11 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 854,200.00 | 0.59 |
| J | 金融业 | 2,503,850.00 | 1.73 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 528,700.00 | 0.36 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 177,000.00 | 0.12 |
| 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 | 23,070,319.60 | 15.90 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 1,000 | 1,798,550.00 | 1.24 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 8,000 | 1,624,240.00 | 1.12 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 99,000 | 1,200,870.00 | 0.83 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 210,000 | 1,161,300.00 | 0.80 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 18,000 | 998,640.00 | 0.69 |
| 6 | 600938 | 中国海油 | 40,000 | 845,600.00 | 0.58 |
| 7 | 601857 | 中国石油 | 100,000 | 798,000.00 | 0.55 |
| 8 | 600377 | 宁沪高速 | 70,000 | 727,300.00 | 0.50 |
| 9 | 600900 | 长江电力 | 30,000 | 667,200.00 | 0.46 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 140,000 | 655,200.00 | 0.45 |

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 | 7,862,635.07 | 5.42 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 51,699,716.01 | 35.64 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,521,453.55 | 14.15 |
| 4 | 企业债券 | 59,285,804.40 | 40.87 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 10,178,322.40 | 7.02 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 7 | 可转债（可交换债） | 21,661,113.52 | 14.93 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 150,687,591.40 | 103.87 |

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 | 2128044 | 21 工商银行永续债 02 | 100,000 | 10,448,200.00 | 7.20 |
| 2 | 2128047 | 21 招商银行永续债 | 100,000 | 10,436,012.60 | 7.19 |
| 3 | 230205 | 23 国开 05 | 100,000 | 10,318,453.55 | 7.11 |
| 4 | 2228011 | 22 农业银行永续债 01 | 100,000 | 10,294,049.86 | 7.10 |
| 5 | 138886 | 23 华泰 G5 | 100,000 | 10,290,893.15 | 7.09 |

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，中国农业银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字〔2023〕8号）；华泰证券股份有限公司受到国家外汇管理局江苏省分局处罚（苏汇检罚〔2023〕5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 | 10,138.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,040,813.38 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 3.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,050,954.79 |

5.11.4 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 | 110079 | 杭银转债 | 1,396,753.64 | 0.96 |
| 2 | 113044 | 大秦转债 | 1,295,115.89 | 0.89 |
| 3 | 110088 | 淮 22 转债 | 989,269.04 | 0.68 |
| 4 | 110082 | 宏发转债 | 911,523.29 | 0.63 |
| 5 | 118031 | 天 23 转债 | 842,569.86 | 0.58 |
| 6 | 110085 | 通 22 转债 | 829,514.00 | 0.57 |
| 7 | 113641 | 华友转债 | 741,734.00 | 0.51 |
| 8 | 113051 | 节能转债 | 729,024.82 | 0.50 |
| 9 | 127032 | 苏行转债 | 727,361.92 | 0.50 |
| 10 | 113056 | 重银转债 | 726,658.30 | 0.50 |
| 11 | 111010 | 立昂转债 | 698,886.41 | 0.48 |
| 12 | 113060 | 浙 22 转债 | 625,427.81 | 0.43 |
| 13 | 127012 | 招路转债 | 574,310.34 | 0.40 |
| 14 | 110089 | 兴发转债 | 558,999.32 | 0.39 |
| 15 | 128132 | 交建转债 | 519,970.41 | 0.36 |
| 16 | 113631 | 皖天转债 | 503,386.74 | 0.35 |
| 17 | 127070 | 大中转债 | 471,463.40 | 0.32 |
| 18 | 118025 | 奕瑞转债 | 471,079.67 | 0.32 |
| 19 | 113042 | 上银转债 | 436,274.52 | 0.30 |
| 20 | 113048 | 晶科转债 | 419,710.33 | 0.29 |
| 21 | 113619 | 世运转债 | 374,510.14 | 0.26 |
| 22 | 127058 | 科伦转债 | 368,205.42 | 0.25 |
| 23 | 127039 | 北港转债 | 356,120.88 | 0.25 |
| 24 | 113045 | 环旭转债 | 350,722.44 | 0.24 |
| 25 | 113563 | 柳药转债 | 313,070.55 | 0.22 |
| 26 | 110062 | 烽火转债 | 271,779.56 | 0.19 |
| 27 | 118019 | 金盘转债 | 265,892.88 | 0.18 |
| 28 | 113061 | 拓普转债 | 264,638.52 | 0.18 |
| 29 | 127050 | 麒麟转债 | 263,210.14 | 0.18 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 30 | 128081 | 海亮转债 | 262,404.66 | 0.18 |
| 31 | 110045 | 海澜转债 | 255,611.23 | 0.18 |
| 32 | 127054 | 双箭转债 | 254,588.49 | 0.18 |
| 33 | 127082 | 亚科转债 | 251,553.97 | 0.17 |
| 34 | 113602 | 景 20 转债 | 244,149.86 | 0.17 |
| 35 | 113655 | 欧 22 转债 | 239,624.93 | 0.17 |
| 36 | 113659 | 莱克转债 | 235,122.90 | 0.16 |
| 37 | 113666 | 爱玛转债 | 233,049.32 | 0.16 |
| 38 | 113638 | 台 21 转债 | 229,124.93 | 0.16 |
| 39 | 113024 | 核建转债 | 206,467.84 | 0.14 |
| 40 | 127020 | 中金转债 | 196,440.00 | 0.14 |
| 41 | 123158 | 宙邦转债 | 196,433.22 | 0.14 |
| 42 | 123091 | 长海转债 | 122,608.08 | 0.08 |
| 43 | 127018 | 本钢转债 | 122,287.48 | 0.08 |
| 44 | 127016 | 鲁泰转债 | 113,065.34 | 0.08 |

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 |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 119,713,885.10 | 38,976,630.74 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 23,527.32 | 3,258.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 9,909,553.76 | 3,641,583.17 |
| 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 | 109,827,858.66 | 35,338,306.33 |

§ 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，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--------|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|------|
| | 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

2023 年 10 月 24 日