

---

# 汇安嘉诚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:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年4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1月1日起至2026年3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉诚债券	
基金主代码	007609	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年08月09日	
报告期末基金份额总额	44,630,594.46份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险并保持资产流动性的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	1、债券投资策略 2、资产支持证券投资策略 3、可转换债券投资策略 4、国债期货投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C

下属分级基金的交易代码	007609	007610
报告期末下属分级基金的份额总额	18,189,785.59份	26,440,808.87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)	
	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C
1.本期已实现收益	789,485.82	982,986.37
2.本期利润	-348,495.15	-507,198.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0176	-0.0187
4.期末基金资产净值	22,120,112.19	31,429,666.46
5.期末基金份额净值	1.2161	1.1887

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

汇安嘉诚债券A净值表现

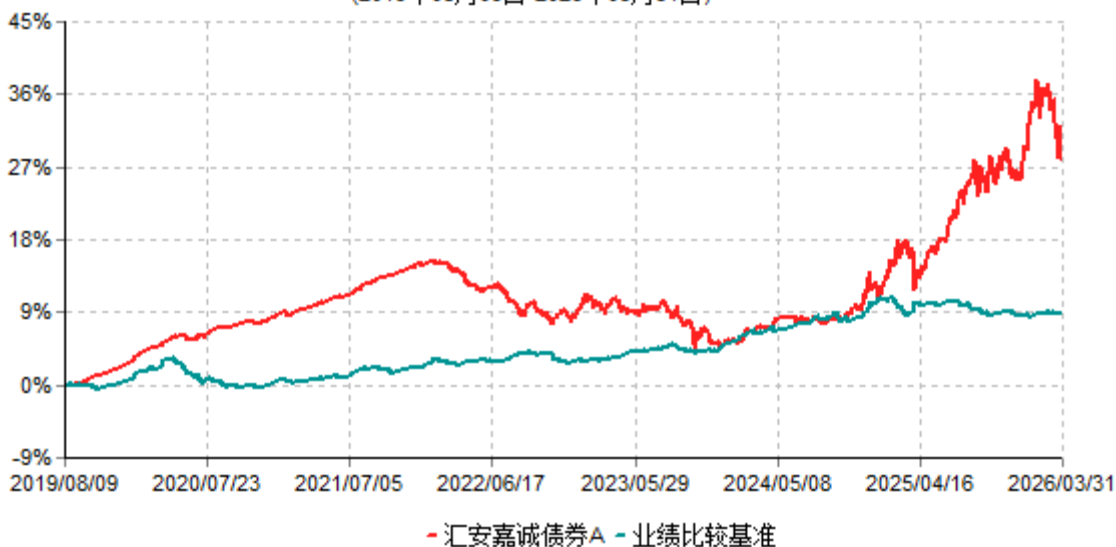
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.08%	0.86%	0.29%	0.04%	-1.37%	0.82%
过去六个月	0.17%	0.70%	0.33%	0.05%	-0.16%	0.65%
过去一年	10.24%	0.64%	-0.12%	0.07%	10.36%	0.57%
过去三年	16.07%	0.43%	5.45%	0.08%	10.62%	0.35%
过去五年	16.70%	0.34%	8.29%	0.07%	8.41%	0.27%
自基金合同生效起至今	27.93%	0.30%	8.95%	0.07%	18.98%	0.23%

汇安嘉诚债券C净值表现

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	-1.18%	0.86%	0.29%	0.04%	-1.47%	0.82%
过去六个月	-0.03%	0.70%	0.33%	0.05%	-0.36%	0.65%
过去一年	9.81%	0.64%	-0.12%	0.07%	9.93%	0.57%
过去三年	14.68%	0.43%	5.45%	0.08%	9.23%	0.35%
过去五年	14.39%	0.34%	8.29%	0.07%	6.10%	0.27%
自基金合同生效起至今	24.57%	0.30%	8.95%	0.07%	15.62%	0.23%

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

汇安嘉诚债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年08月09日-2026年03月31日)



汇安嘉诚债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年08月09日-2026年03月31日)



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

## §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		
张靖	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2024-11-20	-	9年	张靖先生，美国马里兰大学帕克分校金融学硕士，9年证券、基金行业从业经验。2017年1月1日加入汇安基金管理有限责任公司任投资经理，现任绝对收益组基金经理。2024年8月8日至今，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2024年8月8日至今，任汇安嘉利混合型证券投资基金基金经理；2024年8月8日至今，任汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2024年8月8日至今，任汇安

					添利18个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2024年11月20日至今，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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》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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年一季度，国民经济于“十五五”开局之际稳健复苏。高技术制造业在“新质生产力”方针引领下增长强劲，内需修复带动通胀指标温和回升，通缩压力实质性缓解。虽地产开发投资仍处盘整期，但二手房成交回暖显露筑底迹象。后续仍需密切关注居民收入预期、消费等层面政策力度和恢复情况。海外方面，二月底伊朗局势升级推升油价，致使美联储降息预期大幅修正，全球风险偏好显著降温。

一季度市场结构性特征显著。权益资产呈现AI产业链与顺周期资源品双主线活跃态势。债市在政策预期与流动性博弈中震荡，利率债收益率反弹，信用债则凭借利差压缩表现出更强韧性。转债市场估值虽有阶段性回调，但整体仍处于历史相对高位，呈现防守属性偏弱的特征。

展望后市，可转债的供需失衡问题仍然显著，这一因素给与转债偏高估值一定支撑。股票市场在政策托底叠加流动性的边际改善的背景下，仍然有望走出持续慢牛行情。因此组合中仍然配置一定比例的可转债，择券上仔细甄别品种，选取正股基本面坚实、转债估值合理的品种进行投资，注重风险收益比，充分利用转债下有底、上有弹性的特征。债券方面，组合继续维持较低久期，积极捕捉利率债波段机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉诚债券A基金份额净值为1.2161元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.29%；截至报告期末汇安嘉诚债券C基金份额净值为1.1887元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.18%，同期业绩比较基准收益率为0.29%。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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	49,318,186.15	91.79
	其中：债券	49,318,186.15	91.79
	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	3,495,000.00	6.51
	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	819,832.77	1.53
8	其他资产	93,606.54	0.17
9	合计	53,726,625.46	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	2,821,144.99	5.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	46,497,041.16	86.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,318,186.15	92.10

## 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	113042	上银转债	40,480	5,005,296.55	9.35
2	127045	牧原转债	23,990	3,046,720.14	5.69
3	019792	25国债19	28,000	2,821,144.99	5.27

4	110087	天业转债	10,850	1,435,532.29	2.68
5	127049	希望转2	12,230	1,394,171.42	2.60

**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**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**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**  
本基金本报告期末投资国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**  
本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**  
本基金本报告期末未投资国债期货。

**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调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海银行股份有限公司、上海起帆电缆股份有限公司在本报告编制前一年内曾受立案调查或公开处罚，对上述主体发行的相关证券的投资决策流程均符合相关法律法规和基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期末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。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,561.63
2	应收证券清算款	47,148.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,895.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	93,606.54

### 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	113042	上银转债	5,005,296.55	9.35
2	127045	牧原转债	3,046,720.14	5.69
3	110087	天业转债	1,435,532.29	2.68
4	127049	希望转2	1,394,171.42	2.60
5	118034	晶能转债	1,384,320.26	2.59
6	113048	晶科转债	1,359,322.92	2.54
7	118030	睿创转债	1,345,252.82	2.51
8	111000	起帆转债	1,329,576.55	2.48
9	113640	苏利转债	1,320,917.96	2.47
10	118031	天23转债	1,301,217.02	2.43
11	123107	温氏转债	1,267,531.95	2.37
12	110077	洪城转债	1,261,845.19	2.36
13	113062	常银转债	1,212,661.90	2.26
14	110081	闻泰转债	1,185,675.64	2.21
15	127018	本钢转债	1,138,449.33	2.13
16	127089	晶澳转债	1,052,819.73	1.97
17	113051	节能转债	924,820.46	1.73

18	127024	盈峰转债	899,419.25	1.68
19	113054	绿动转债	893,446.63	1.67
20	113053	隆22转债	881,207.37	1.65
21	128121	宏川转债	870,351.19	1.63
22	113691	和邦转债	765,704.05	1.43
23	123188	水羊转债	727,789.02	1.36
24	110073	国投转债	698,750.19	1.30
25	123149	通裕转债	689,869.22	1.29
26	128141	旺能转债	659,935.38	1.23
27	127061	美锦转债	658,470.70	1.23
28	118024	冠宇转债	639,893.41	1.19
29	123071	天能转债	633,957.08	1.18
30	127070	大中转债	620,394.78	1.16
31	127026	超声转债	618,001.67	1.15
32	127030	盛虹转债	593,879.04	1.11
33	118003	华兴转债	574,444.66	1.07
34	113605	大参转债	555,385.60	1.04
35	110075	南航转债	519,492.33	0.97
36	111010	立昂转债	517,202.54	0.97
37	113039	嘉泽转债	510,864.66	0.95
38	113616	韦尔转债	509,231.58	0.95
39	113687	振华转债	507,501.16	0.95
40	113584	家悦转债	481,333.95	0.90
41	123178	花园转债	427,777.17	0.80
42	127027	能化转债	425,067.41	0.79
43	113661	福22转债	399,527.17	0.75
44	127041	弘亚转债	369,447.16	0.69
45	118006	阿拉转债	347,881.12	0.65
46	113644	艾迪转债	294,265.06	0.55
47	123088	威唐转债	290,338.75	0.54
48	123076	强力转债	280,440.63	0.52
49	123119	康泰转2	272,468.94	0.51
50	110093	神马转债	270,813.21	0.51

51	127088	赫达转债	246,713.86	0.46
52	113649	丰山转债	211,970.04	0.40
53	123150	九强转债	207,722.10	0.39
54	123216	科顺转债	189,583.72	0.35
55	111002	特纸转债	167,176.49	0.31
56	123236	家联转债	103,190.74	0.19

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C
报告期期初基金份额总额	18,236,220.80	26,671,233.35
报告期期间基金总申购份额	6,343,663.75	8,105,987.94
减：报告期期间基金总赎回份额	6,390,098.96	8,336,412.42
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	18,189,785.59	26,440,808.87

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

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安嘉诚债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安嘉诚债券型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉诚债券型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层  
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司  
2026年04月22日