

# 信诚优质纯债债券型证券投资基金

## 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 01 月 17 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 16 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 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 信诚优质纯债债券   |
| 基金主代码      | 550018   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2013 年 02 月 07 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 879,629,931.60 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险的基础上,本基金主要通过投资于精选的优质债券,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>2、固定收益类资产的投资策略</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</p> |

|                 |  |                  |            |
|-----------------|--|------------------|------------|
|                 | <p>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、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。</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，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> |                  |            |
| 业绩比较基准          | 中证综合债指数收益率   |                  |            |
| 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，属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。  |                  |            |
| 基金管理人           | 中信保诚基金管理有限公司   |                  |            |
| 基金托管人           | 中信银行股份有限公司   |                  |            |
| 下属分级基金的基金简称     | 信诚优质纯债债券 A   | 信诚优质纯债债券 B       | 信诚优质纯债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 550018   | 550019           | 017463     |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 711,237,935.79 份   | 168,391,146.91 份 | 848.90 份   |

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

### § 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（2022 年 10 月 01 日-2022 年 12 月 31 日） |                |            |
|-----------------|--|----------------|------------|
|                 | 信诚优质纯债债券 A                             | 信诚优质纯债债券 B     | 信诚优质纯债债券 C |
| 1. 本期已实现收益      | 5,291,117.87                           | 880,929.50     | 1.28       |
| 2. 本期利润         | -7,653,917.71                          | -1,867,896.81  | -1.33      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0122                                | -0.0144        | -0.0017    |
| 4. 期末基金资产净值     | 812,502,780.33                         | 190,540,274.02 | 969.81     |

|             |       |       |       |
|-------------|-------|-------|-------|
| 5. 期末基金份额净值 | 1.142 | 1.132 | 1.142 |
|-------------|-------|-------|-------|

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

信诚优质纯债债券 A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.91%     | 0.09%         | -0.04%         | 0.07%                 | -0.87% | 0.02% |
| 过去六个月          | 0.41%      | 0.08%         | 1.47%          | 0.06%                 | -1.06% | 0.02% |
| 过去一年           | 2.18%      | 0.07%         | 3.32%          | 0.06%                 | -1.14% | 0.01% |
| 过去三年           | 11.46%     | 0.08%         | 11.95%         | 0.07%                 | -0.49% | 0.01% |
| 过去五年           | 26.86%     | 0.18%         | 26.68%         | 0.06%                 | 0.18%  | 0.12% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 75.45%     | 0.27%         | 51.98%         | 0.08%                 | 23.47% | 0.19% |

信诚优质纯债债券 B

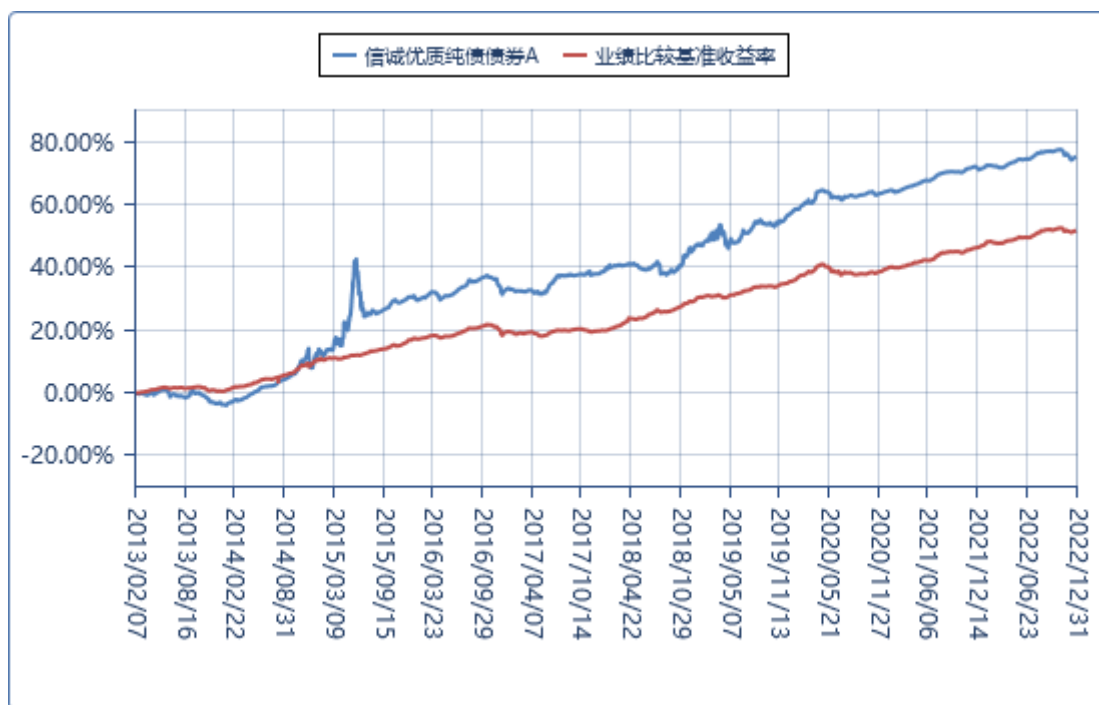
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.00%     | 0.09%         | -0.04%         | 0.07%                 | -0.96% | 0.02% |
| 过去六个月          | 0.27%      | 0.07%         | 1.47%          | 0.06%                 | -1.20% | 0.01% |
| 过去一年           | 1.90%      | 0.06%         | 3.32%          | 0.06%                 | -1.42% | 0.00% |
| 过去三年           | 10.15%     | 0.08%         | 11.95%         | 0.07%                 | -1.80% | 0.01% |
| 过去五年           | 23.87%     | 0.17%         | 26.68%         | 0.06%                 | -2.81% | 0.11% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 66.78%     | 0.27%         | 51.98%         | 0.08%                 | 14.80% | 0.19% |

信诚优质纯债债券 C

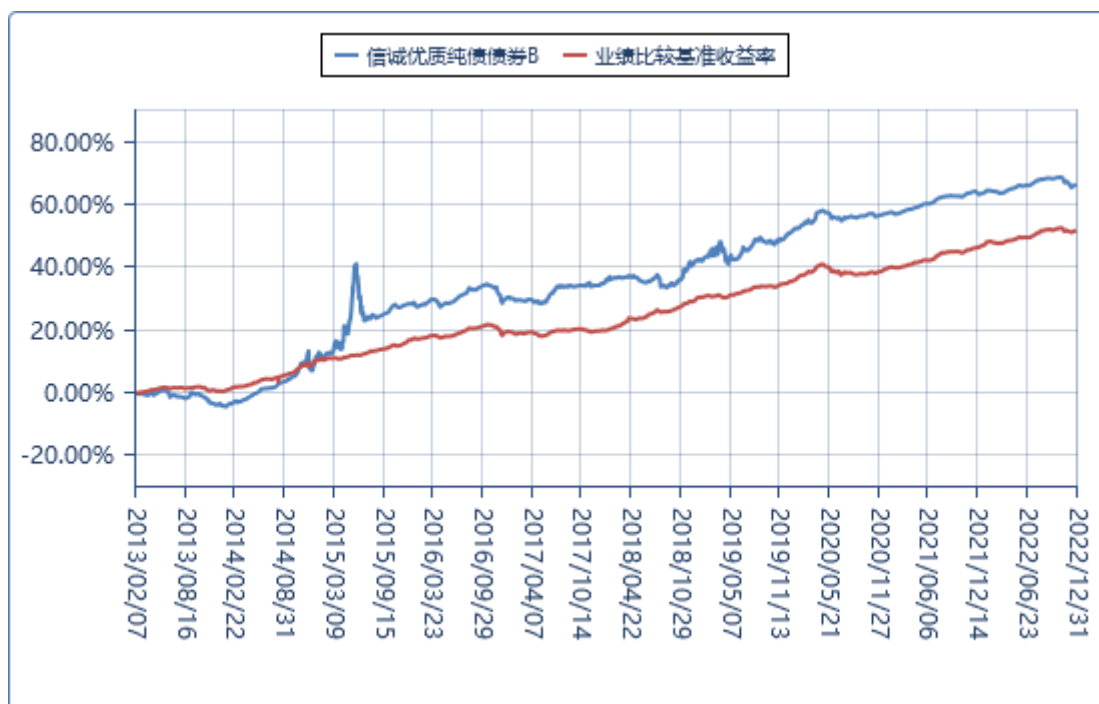
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | -0.16%     | 0.10%         | 0.14%          | 0.05%                 | -0.30% | 0.05% |

### 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

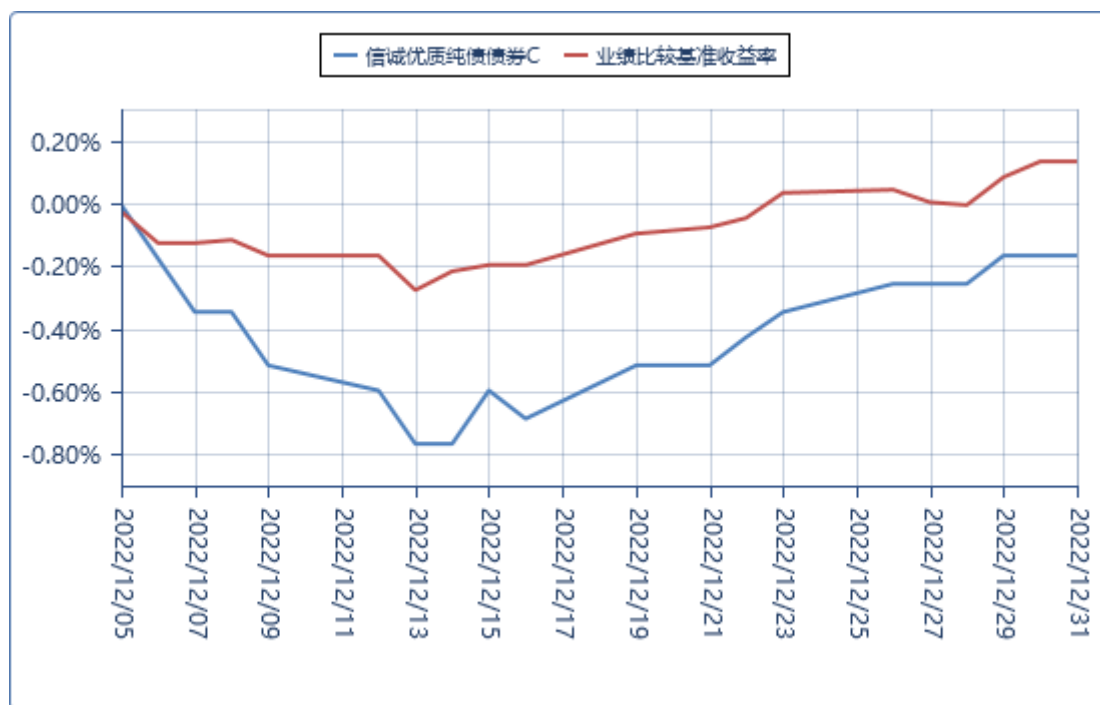
信诚优质纯债债券 A



信诚优质纯债债券 B



信诚优质纯债债券 C



注：本基金于 2022 年 12 月 5 日起新增 C 类份额。

## § 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 |        |   |
| 吴胤希 | 固定收益部副总监、基金经理 | 2019 年 11 月 21 日 | -    | 6      | 吴胤希先生，理学硕士。曾任职于远东国际租赁有限公司，担任投资分析师；于 Excel Markets 担任外汇交易员；于重庆农村商业银行股份有限公司，担任债券交易员。2016 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司。现任固定收益部副总监，中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚嘉 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚景华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遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同》、《信诚优质纯债债券型证券投资基金招募说明书》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》，以及公司拟定的《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》，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，未发现有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《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资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、每周对现券、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

2022 年四季度，海外通胀高位运行，主要发达经济体货币政策延续收紧态势，全球经济活动普遍放缓，我国出口动能受到较大影响。国内需求收缩、供给冲击、预期转弱压力进一步加大，对经济运行制约明显，短期经济仍面临下行压力。工业生产循环受到冲击，制造业和基建投资表现仍然较好，对投资有较强支撑，但地产销售、投资和开工对经济的影响仍然明显。政策方面，5000 亿地方专项债结存限额发行完毕，地产政策从保项目转向保主体，“第二支箭”、“第三支箭”加速落地，有利于修复市场对行业的信心。通胀方面，基数影响下 PPI 延续回落趋势，食品项影响下 CPI 转为下行，通胀压力整体可控。

货币政策方面，四季度央行整体仍然维持宽松基调，资金利率中枢低于政策利率，但相比三季度有所抬升。12 月央行降准 0.25 个百分点，释放约 5000 亿长期资金，有利于保持流动性合理充裕，降低实体经济综合融资成本。

从债券市场看，外需回落影响下基本面仍然偏弱，但地产政策不断出台使得市场对经济修复信心提升，资金面边际有所收敛，叠加理财抛售债券加剧调整，利率整体明显上行，10 年国债收益率上行至 2.84%；信用方面，市场调整背景下银行理财赎回压力加剧，银行理财被动大幅抛售债券特别是各类信用债使得信用债波动加大，信用利差大幅扩大。

信诚优质纯债债券型证券投资基金坚持高等级信用债打底，利率债波段增强策略。四季度，基金仓位水平维持较高水平，总资产久期控制在中性水平，券种以信用债为主。但四季度信用利差走扩，基金净



值有所回撤。未来，我们将继续坚持为持有人争取相对有竞争力的收益。

展望 2023 年一季度，我们认为美国通胀下行趋势基本确定，但斜率仍待观察，联储激进加息预期缓解，海外风险对国内影响将逐步由金融风险转向实体经济需求下行风险。外需下行背景下，国内经济增长动能料将逐步向内需切换。预计短期国内经济或仍有所波动，地产链条修复尚需时间，一季度基本面整体仍然保持缓慢修复态势。通胀方面，我们认为需求仍相对疲弱，CPI 整体较为温和，PPI 低位震荡。货币政策方面，中央经济工作会议定调“保持流动性合理充裕，保持广义货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配”，预计 2023 年外部流动性约束有所放松，稳增长背景下总量宽松的可能性仍然存在。

债券市场投资方面，我们认为经济基本面仍然较弱且货币政策也将保持宽松，并不支持收益率在短期内大幅上行，整体看债市经历短期大幅超调后预计到 2023 年年初或有一定机会；信用策略上，随着理财净值化的推进，负债端管理要求加强，信用风险偏好将进一步向资质和流动性较好的债券集中，资质较差的信用债利差或难以恢复，高等级中短端信用债好于低资质长端信用债。

基金投资操作上，我们考虑将组合的久期适度缩短，杠杆水平的中枢也略微下降。信用债方面，由于信用扩张力度依旧不会太大，弱资质发债主体的融资难度增大，不利于低评级债券，我们在持仓上也会坚持利率债和高等级信用债的配置方向。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚优质纯债债券 A 份额净值增长率为-0.91%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%；信诚优质纯债债券 B 份额净值增长率为-1.00%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%；信诚优质纯债债券 C 份额净值增长率为-0.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.14%。

#### 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（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  | -     | -            |
|    | 其中：股票 | -     | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 1,305,273,098.25 | 99.75  |
|   | 其中：债券             | 1,305,273,098.25 | 99.75  |
|   | 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      | 2,512,174.85     | 0.19   |
| 8 | 其他资产              | 696,945.62       | 0.05   |
| 9 | 合计                | 1,308,482,218.72 | 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境内投资股票。

### 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投资股票。

## 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

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  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 849,583,488.77   | 84.70        |
|    | 其中：政策性金融债 | 61,570,706.85    | 6.14         |
| 4  | 企业债券      | 145,786,384.00   | 14.53        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 309,903,225.48   | 30.90        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,305,273,098.25 | 130.13       |

**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  | 1928006 | 19 工商银行二级 01 | 500,000 | 52,401,515.07 | 5.22         |
| 2  | 1828003 | 18 浙商银行二级 01 | 500,000 | 51,682,054.79 | 5.15         |
| 3  | 1828009 | 18 浦发银行二级 02 | 500,000 | 51,435,739.73 | 5.13         |
| 4  | 2220080 | 22 厦门国际银行    | 500,000 | 49,740,808.22 | 4.96         |
| 5  | 2020080 | 20 长沙银行二级    | 450,000 | 45,905,572.60 | 4.58         |

**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**

本基金投资范围不包括国债期货投资。

**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，中国工商银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]11号）；浙商银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]27号）；上海浦东发展银行股份有限公司受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会处罚（上海汇管罚字[2022]3111220601号、银保监罚决字[2022]25号）；长沙银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会湖南监管局处罚（湘银保监罚决字[2022]6号）；平安银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]24号）；重庆农村商业银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会重庆监管局、中国人民银行重庆营业管理部处罚（渝银保监罚决字[2022]5号、渝银保监罚决字[2022]44号、渝银罚[2022]2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分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、中国银行保险监督管理委员会及其派出机构、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

本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过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   | 1,278.88   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 695,666.74 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 其他    | -          |
| 8 | 合计    | 696,945.62 |

#### 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

本基金本报告期末未持有股票投资，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                        | 信诚优质纯债债券 A     | 信诚优质纯债债券 B     | 信诚优质纯债债券 C |
|---------------------------|----------------|----------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 534,176,292.21 | 89,587,258.93  | -          |
| 报告期期间基金总申购份额              | 235,967,964.82 | 129,662,325.02 | 848.90     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 58,906,321.24  | 50,858,437.04  | -          |
| 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               | 711,237,935.79 | 168,391,146.91 | 848.90     |

## § 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                       | 信诚优质纯债债券 A    | 信诚优质纯债债券 B | 信诚优质纯债债券 C |
|--------------------------|---------------|------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 11,989,608.31 | -          | -          |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -          | -          |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 2,450,000.00  | -          | -          |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 9,539,608.31  | -          | -          |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.08          | -          | -          |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期            | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率   |
|----|------|-----------------|---------------|---------------|--------|
| 1  | 赎回   | 2022年10月<br>14日 | -2,450,000.00 | -3,014,230.10 | 0.0030 |
| 合计 |      |                 | -2,450,000.00 | -3,014,230.10 |        |

## § 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

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2022 年 12 月 5 日发布了《关于信诚优质纯债债券型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2022 年 12 月 5 日起，本基金增加 C 类份额并对基金合同、托管协议、招募说明书等相关法律文件进行修订。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、信诚优质纯债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、信诚优质纯债债券型证券投资基金基金合同
- 4、信诚优质纯债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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2023 年 01 月 17 日