

中银证券安弘债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 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 4 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 4 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 1 月 1 日起至 3 月 31 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	3,187,368,047.19 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	2,568,072,222.37 份	619,295,824.82 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 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 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	-10,370,542.30	-4,705,730.48
2. 本期利润	-2,024,846.47	2,342,355.43
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0008	0.0033
4. 期末基金资产净值	3,488,068,582.05	819,890,900.24
5. 期末基金份额净值	1.3582	1.3239

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	0.19%	0.36%	-0.02%	0.17%	0.21%	0.19%
过去六个月	0.71%	0.35%	0.12%	0.17%	0.59%	0.18%
过去一年	12.01%	0.34%	3.24%	0.14%	8.77%	0.20%
过去三年	15.68%	0.33%	8.27%	0.12%	7.41%	0.21%
过去五年	16.58%	0.33%	8.79%	0.12%	7.79%	0.21%
自基金合同生效起至今	42.37%	0.30%	17.99%	0.13%	24.38%	0.17%

中银证券安弘债券 C

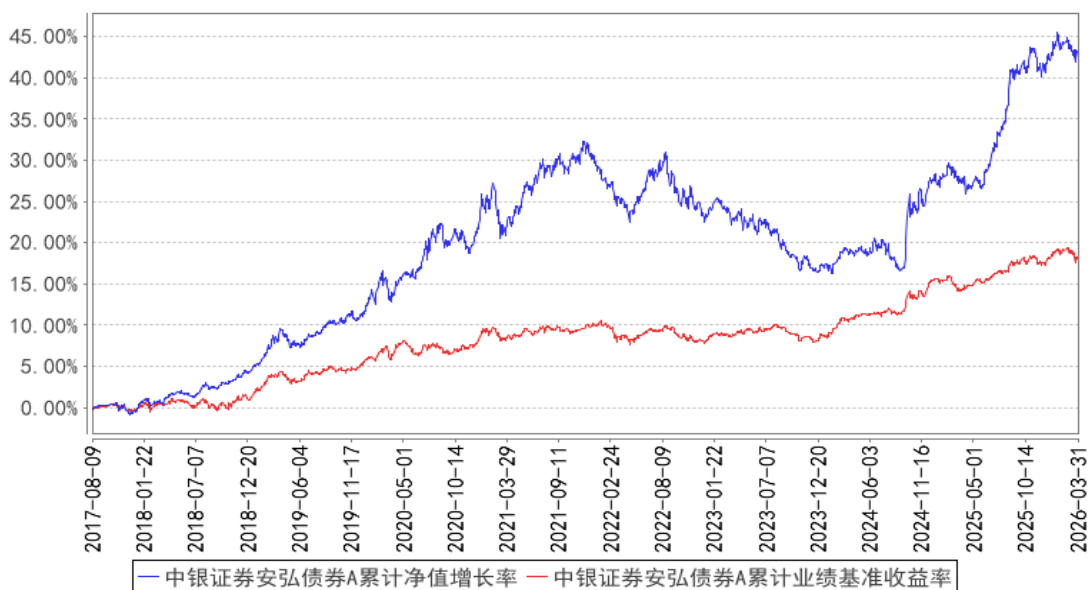
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.11%	0.36%	-0.02%	0.17%	0.13%	0.19%

过去六个月	0.54%	0.34%	0.12%	0.17%	0.42%	0.17%
过去一年	11.61%	0.34%	3.24%	0.14%	8.37%	0.20%
过去三年	14.46%	0.33%	8.27%	0.12%	6.19%	0.21%
过去五年	14.55%	0.33%	8.79%	0.12%	5.76%	0.21%
自基金合同生效起至今	38.93%	0.30%	17.99%	0.13%	20.94%	0.17%

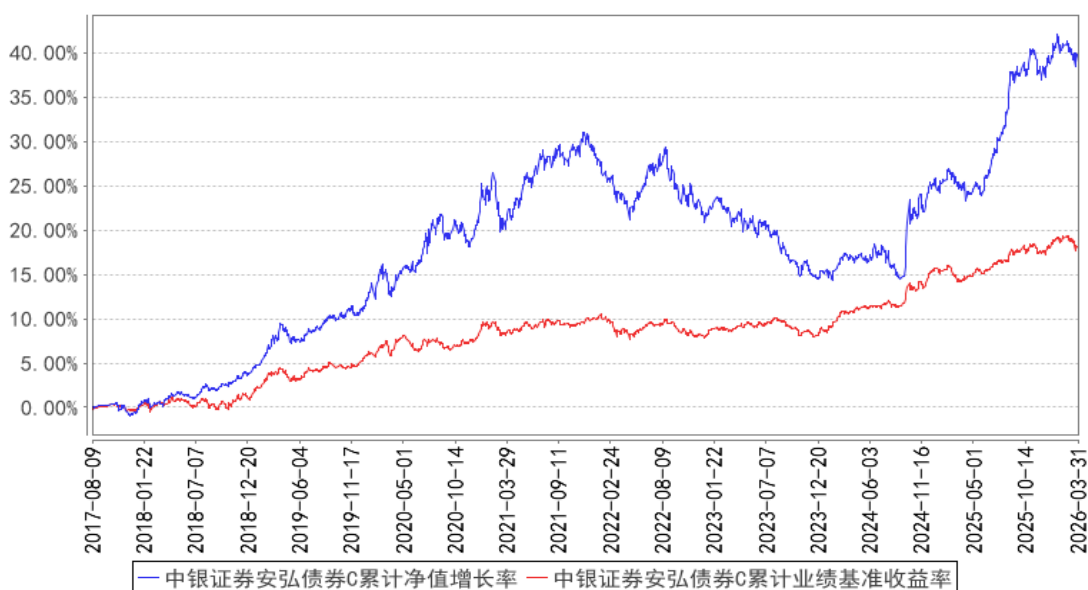
注：自基金成立至 2025 年 4 月 20 日, 本基金业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10% 自 2025 年 4 月 21 日起, 本基金业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*85%+ 中证 A500 指数收益率*15%。

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	-	17 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、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、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

一季度国内经济的走势完全超出了市场的预期和想象。一方面，出口出现了远超预期的同比增长，且在制造业和科技行业中的高增长分布广泛；另一方面，海外地缘政治冲突导致油价大幅上行，国内通胀比市场预期更早出现了快速的回升。受到价格因素的托举，1-2 月份的经济数据出现了名义增长的修复，但扣除通胀之后的实际增长，投资、地产和社会消费品依然复苏乏力。地缘政治冲突和油价快速上涨带来的冲击，并没有改变国内经济主要依靠科技和新兴制造业以及与之相关的出口产业和财政托举的趋势。外部冲击烈度下降之后，国内投资者将会发现，市场年初对国内经济的预判，同时低估了部分领域上行的潜力和其他方向下行的压力。

国内资本市场一季度的走势整体呈现宽幅震荡的特征，股债资产基本都有先强后弱的特点，有基本面支撑的科技股后来居上，而前期涨幅较多的资源类股票，在油价冲击之后，出现了普遍的调整。油价中枢的变化主要影响了投资者对利率中枢的展望，这一方面影响国内债券价格的变动，另一方面也改变了 2025 年以来一直走势较强的小微盘股票和题材股的走势。我们知道，股票估值与利率水平呈负相关，投资者预期利率水平的上移，使得 3 月以后的 A 股开始承受估值下修的压力，这其中没有业绩支撑、因而估值较贵的小微盘公司和主题概念类股票体现出的下行压力尤为显著。因此，我们认为地缘政治冲突对 A 股的影响主要不在流动性，而在投资者对于业绩和题材的偏好。如果后续油价持续处于高位，则投资者将逐渐从题材驱动，转向业绩驱动，那么上面提到的营收和利润增长更快的科技行业和高端制造行业的公司，它们的股价将会展现更长期限的吸引力。债券方面，自油价快速上涨，债券价格普遍回落之后的 3 月中旬开始，投资者对后续债券价格走势的分歧开始加剧。部分投资者认为高油价可能导致滞胀的局面，从而使得国内债券利率的水平出现系统性抬升；而另一些投资者则认为高油价的持续通过价格效应和对供应链的冲击，必然会导致内需的走弱，这可能导致宏观政策再次加力，中短端的各券种反而有可能会受益。

临近季末，大部分投资者对未来的预期开始转向混沌，绝大部分含权产品的净值在一季度末出现了较为明显的回撤，不少产品年初以来的涨幅甚至转负，这也导致部分注重年初至今收益的客户赎回了部分调整压力较大的产品。

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。一季度本产品在纯债配置上的主要操作，一是将部分超长债的持仓，置换为波动更小的等久期的 10 年国债，以降低利率波动对组合净值的影响；二是在地缘政治冲突之后，小幅减少了产品组合的久期和杠杆，试图减少外部冲击对产品净值的影响。整体而言，由于投资策略的及时调整，产品较长的债券久期对组合净值的影响和拖累相对有限，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，产品在地缘政治冲突爆发的初期小幅降低了权益仓位，在方向上则继续以成长风格为主，以高股息股票为底仓的配置。安弘以基本面为股票选择的首要因素，而在一季报的报告期内由于没有更新的季报数据，因此我们维持了绝大部分的前期股票持仓。股票部分的满仓收益率在报告期内也有较好的表现。目前，产品重仓的股票主要集中在电子、新能源和通信等方向。整体而言，本产品股票组合的股价弹性继续得到了维持，而在 3 月市场的下跌过程中，选股带来的超额收益又使得产品整体净值的回撤持续处于可控的区间。预计 2026 年二三季度产品净值也将继续受益于偏成长风格的市场走势。

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，转债比例从 9.5% 小幅减少至 9%，维持同类产品的平均水平。我们依然认为转债整体的估值较贵，考虑到大部分转债的正股为小微盘股票，而后者在市场估值调整的压力中可能面临更多的下行风险，因此我们计划将小幅调整转债持仓的结构，更多地配置估值和溢价更为合理的转债标的。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，在配置上对行业和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较小的范围内。

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 年二季度的市场走势，我们认为投资者的风险偏好将有所恢复，而由于外部冲突带来的供应链冲击，市场对宏观政策的期望可能逐渐加大，这些变化可能会导致市场重新转向“股强债不弱”的趋势。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 1.3582 元，本报告期基金份额净值增长

率为 0.19%；同期业绩比较基准收益率为-0.02%。截至本报告期末中银证券安弘债券 C 基金份额净值为 1.3239 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%；同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

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	705,313,451.84	15.74
	其中：股票	705,313,451.84	15.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,754,427,848.46	83.77
	其中：债券	3,754,427,848.46	83.77
	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	14,062,165.01	0.31
8	其他资产	7,775,748.02	0.17
9	合计	4,481,579,213.33	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	-	-
C	制造业	510,801,580.30	11.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,640,652.00	0.41
E	建筑业	2,149,545.00	0.05
F	批发和零售业	10,176,176.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	20,953,106.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,076,505.04	1.14

J	金融业	69,650,915.50	1.62
K	房地产业	858,816.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,976,961.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	4,974,044.00	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	11,055,151.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	705,313,451.84	16.37

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	300308	中际旭创	98,600	56,143,826.00	1.30
2	688072	拓荆科技	122,216	45,219,920.00	1.05
3	688525	佰维存储	212,100	44,963,079.00	1.04
4	300750	宁德时代	100,300	40,290,510.00	0.94
5	300433	蓝思科技	1,387,150	38,812,457.00	0.90
6	300033	同花顺	112,497	33,580,354.50	0.78
7	688183	生益电子	375,200	31,389,232.00	0.73
8	300136	信维通信	430,700	27,978,272.00	0.65
9	688303	大全能源	1,231,100	25,853,100.00	0.60
10	300390	天华新能	410,100	23,990,850.00	0.56

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	1,796,577,707.12	41.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	534,897,068.89	12.42
	其中：政策性金融债	258,248,794.31	5.99
4	企业债券	269,573,205.25	6.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	763,310,387.39	17.72
7	可转债（可交换债）	390,069,479.81	9.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,754,427,848.46	87.15

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	250022	25 附息国债 22	8,000,000	802,589,171.27	18.63
2	260002	26 附息国债 02	6,700,000	677,501,779.01	15.73
3	250211	25 国开 11	2,500,000	252,262,808.22	5.86
4	2400001	24 特别国债 01	1,700,000	178,937,116.02	4.15
5	2400006	24 特别国债 06	1,100,000	106,239,823.37	2.47

**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。

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。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的行政处罚，受到中国银行间市场交易商协会的行政监督管理措施。

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规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定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	333,663.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,442,084.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,775,748.02

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	113042	上银转债	26,375,489.30	0.61
2	113062	常银转债	25,885,617.87	0.60
3	113052	兴业转债	23,143,783.11	0.54
4	127089	晶澳转债	20,416,200.17	0.47
5	113056	重银转债	17,404,890.81	0.40
6	127067	恒逸转 2	15,997,678.78	0.37
7	127103	东南转债	13,719,301.92	0.32
8	113661	福 22 转债	13,335,753.45	0.31
9	127068	顺博转债	10,823,750.38	0.25
10	113048	晶科转债	9,355,036.08	0.22
11	111010	立昂转债	7,892,273.81	0.18
12	118003	华兴转债	7,762,042.70	0.18
13	113691	和邦转债	7,686,303.12	0.18
14	128141	旺能转债	7,685,306.91	0.18
15	113631	皖天转债	7,643,002.72	0.18
16	118031	天 23 转债	7,606,239.41	0.18
17	123091	长海转债	7,558,787.04	0.18
18	113632	鹤 21 转债	7,534,247.15	0.17
19	111002	特纸转债	7,390,262.27	0.17

20	127026	超声转债	7,287,851.27	0.17
21	128129	青农转债	7,259,045.10	0.17
22	127018	本钢转债	7,078,392.04	0.16
23	118022	锂科转债	5,569,211.05	0.13
24	110085	通 22 转债	5,548,529.65	0.13
25	113046	金田转债	5,429,468.78	0.13
26	110087	天业转债	5,268,469.65	0.12
27	113059	福莱转债	5,079,527.33	0.12
28	127025	冀东转债	4,600,311.59	0.11
29	113640	苏利转债	4,330,901.16	0.10
30	113053	隆 22 转债	4,320,255.62	0.10
31	123158	宙邦转债	3,945,605.22	0.09
32	118035	国力转债	3,891,181.11	0.09
33	127056	中特转债	3,757,829.16	0.09
34	110086	精工转债	3,725,430.50	0.09
35	128134	鸿路转债	3,638,310.23	0.08
36	118041	星球转债	3,633,989.18	0.08
37	110098	南药转债	3,572,802.36	0.08
38	127090	兴瑞转债	3,565,802.79	0.08
39	127030	盛虹转债	3,541,851.75	0.08
40	110073	国投转债	3,524,830.31	0.08
41	113673	岱美转债	3,523,888.78	0.08
42	127066	科利转债	3,480,526.19	0.08
43	110097	天润转债	3,462,943.61	0.08
44	113659	莱克转债	3,434,521.82	0.08
45	123216	科顺转债	3,425,764.55	0.08
46	127045	牧原转债	3,421,368.93	0.08
47	127109	电化转债	3,311,294.52	0.08
48	111009	盛泰转债	3,201,884.29	0.07
49	123247	万凯转债	2,974,084.43	0.07
50	111004	明新转债	2,655,921.88	0.06
51	123121	帝尔转债	2,509,640.10	0.06
52	111018	华康转债	2,469,415.17	0.06
53	128138	侨银转债	2,245,464.50	0.05
54	111023	利柏转债	555,212.05	0.01
55	113697	应流转债	552,143.25	0.01
56	123257	安克转债	513,200.63	0.01
57	113696	伯 25 转债	511,990.61	0.01
58	123255	鼎龙转债	493,115.04	0.01
59	110074	精达转债	411,721.67	0.01
60	118030	睿创转债	395,814.77	0.01
61	127084	柳工转 2	389,167.91	0.01

62	113687	振华转债	372,936.46	0.01
63	118058	微导转债	362,378.50	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	2,192,194,255.18	731,908,890.19
报告期期间基金总申购份额	1,659,145,569.15	332,881,758.32
减：报告期期间基金总赎回份额	1,283,267,601.96	445,494,823.69
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	2,568,072,222.37	619,295,824.82

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	0.00	-
报告期期间买入/申购总份额	36,943,254.03	-
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（%）	1.44	-

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	申购	2026-03-24	36,943,254.03	49,999,000.00	-
合计			36,943,254.03	49,999,000.00	

注：根据本基金招募说明书相关规定，该笔交易收取固定费用 1,000.00 元。

§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

无

§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 4 月 21 日