

---

# 信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2024年第2季度报告

### 2024年06月30日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月18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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年4月1日起至2024年6月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	信达添利三个月持有债券
基金主代码	970054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年09月15日
报告期末基金份额总额	93,906,253.19份
投资目标	本集合计划在严格控制风险和满足充分流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，努力为投资者实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场型基金，属于较低风险、较低收益的产品。
基金管理人	信达证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”“本基金”或“信达添利三个月持有债券”。

### §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（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	770,521.14
2.本期利润	923,243.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	102,126,622.66
5.期末基金份额净值	1.0875

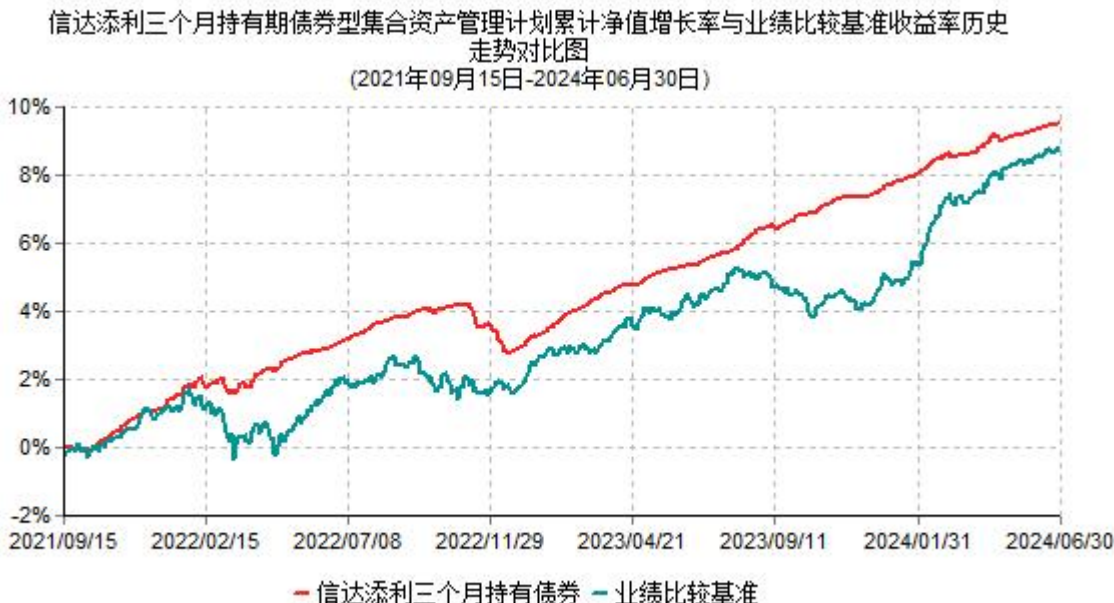
注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

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	0.83%	0.03%	1.36%	0.08%	-0.53%	-0.05%
过去六个月	1.75%	0.02%	3.52%	0.09%	-1.77%	-0.07%
过去一年	3.94%	0.02%	4.32%	0.09%	-0.38%	-0.07%
自基金合同生效起至今	9.56%	0.03%	8.81%	0.11%	0.75%	-0.08%

### 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



### 3.3 其他指标

本集合计划本报告期内无其他指标。

## §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		
王琳	本基金的基金经理、 基金经理	2021-09-15	-	7	王琳，北京大学经济学院硕士研究生。2020年6月加入信达证券，具有多年债券从业经验，曾就职于华创证券固定收益部，有丰富的债券研究和交易经验。已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。现任信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2021年6月22日

					起任职)、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理(自2021年9月15日起任职)、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理(自2021年10月20日起任职)、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划基金经理(自2022年2月9日起任职)、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划基金经理(自2022年2月14日起任职)、信达现金宝货币型集合资产管理计划基金经理(自2022年5月9日起任职)。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据本集合计划管理人决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据本集合计划管理人决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证券监督管理委员会《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》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

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、中国证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，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

本集合计划管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和本集合计划管理人内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期内，管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在任何异常关联交易及与禁止交易对手间的交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本集合计划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，未发现本集合计划有可能导致不公平和利益输送的异常交易，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

债券市场方面，二季度债市继续延续牛市格局，利率债收益率震荡下行，1年、3年、5年、7年、10年国债收益率分别下行20BP、27BP、24BP、23BP、10BP。二季度信用债收益率也整体下行，AA+评级的3年中票、5年中票、3年城投债、5年城投债、7年城投债收益率分别下行41BP、46BP、40BP、43BP、43BP。

转债市场方面，受4月份国十九条、6月份低价券退市担忧等政策和市场流动性冲击，二季度转债市场跟随权益市场先涨后跌，二季度中证转债指数上涨0.75%。

二季度，债券方面，管理人主要配置中短久期、中高评级的信用债，并根据市场行情的变化调整仓位；转债方面，管理人配置了部分金融转债。

前瞻性看，债市方面，当前经济仍面临有效需求不足，地产下行压力仍大，货币政策保持偏宽松，降息降准仍有空间，考虑稳汇率等诉求，后续央行降息或许需要等待美联储实质降息，一旦美联储启动降息，央行下调OMO和MLF利率空间有望打开，此外，实体经济融资需求不足，化债背景下资产荒格局预计仍将持续，上述因素支撑债市中期走强，债市收益率曲线仍然易下难上，但是，同时需要关注央行借入国债卖出、7月重要会议可能推出的增量政策、政府债供给压力和机构止盈等因素可能带来的冲击或者扰动，若债市发生调整且幅度较大，将迎来较好配置机会。

转债方面，转债估值趋于合理，管理人将静待市场行情，择机加大转债资产的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达添利三个月持有债券基金份额净值为1.0875元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率为1.36%。

#### 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，本集合计划未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万或基金份额持有人数量不足200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	124,926,850.84	99.25
	其中：债券	124,926,850.84	99.25
	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	791,558.79	0.63
8	其他资产	153,724.70	0.12
9	合计	125,872,134.33	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

本集合计划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

本集合计划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前十名股票投资明细

本集合计划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	5,317,427.02	5.21
2	央行票据	-	-



3	金融债券	10,265,334.58	10.05
	其中：政策性金融债	5,196,875.68	5.09
4	企业债券	27,655,464.16	27.08
5	企业短期融资券	8,356,783.06	8.18
6	中期票据	63,533,875.41	62.21
7	可转债（可交换债）	9,797,966.61	9.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,926,850.84	122.33

### 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	110059	浦发转债	88,850	9,797,966.61	9.59
2	102102183	21晋能电力MTN011	50,000	5,275,688.52	5.17
3	102383333	23淮北建投MTN011	50,000	5,261,839.34	5.15
4	042380495	23武清国资CP004	50,000	5,233,306.01	5.12
5	240205	24国开05	50,000	5,196,875.68	5.09

### 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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

股指期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。



## 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

本集合计划管理人按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，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，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本集合计划无国债期货持仓。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本集合计划未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 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

23中证G4（115020.SH）发行中体中信证券股份有限公司

2024年1月12日，中国证监会对中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）采取出具警示函的行政监管措施，具体为：中国证监会发现中信证券保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上。

对于前述事项，管理人认为对发行主体的经营和偿债能力无重大影响，后续管理人将对前述发行主体进行持续关注。

### 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

本报告期末，本集合计划未持有股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,412.37
2	应收证券清算款	149,795.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,516.99
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	153,724.70
---	----	------------

#### 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	110059	浦发转债	9,797,966.61	9.59

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

报告期期初基金份额总额	107,117,308.20
报告期期间基金总申购份额	12,752,105.87
减：报告期期间基金总赎回份额	25,963,160.88
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	93,906,253.19

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,079,532.12
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	6,079,532.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.47

### §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

无。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024/6/26 信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果（2024年第二季度）的公告

2024/6/28 关于信达证券股份有限公司旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件
- 2、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 9.2 存放地点

北京市西城区宣武门西大街甲 127 号金隅大厦 B 座

### 9.3 查阅方式

- 1、投资者可在办公时间到管理人办公场所免费查阅
- 2、登录管理人网站查阅基金产品相关信息：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)
- 3、拨打管理人客户服务电话垂询：95321

信达证券股份有限公司

2024年07月19日