

# 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型 证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：达诚基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人及基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.6 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 .....    | 41        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 42        |
| 7.8 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贵金属投资明细 ..... | 42        |
| 7.9 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 .....    | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 42        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 44        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 45        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>47</b> |
| 11.1 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 .....    | 47        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 47        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 47        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                             |                      |
|-----------------|-----------------------------|----------------------|
| 基金名称            | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金 |                      |
| 基金简称            | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债          |                      |
| 基金主代码           | 013964                      |                      |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                      |                      |
| 基金合同生效日         | 2022 年 3 月 22 日             |                      |
| 基金管理人           | 达诚基金管理有限公司                  |                      |
| 基金托管人           | 上海银行股份有限公司                  |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 945,692,052.10 份            |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                         |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A        | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 013964                      | 013965               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 685,257,409.01 份            | 260,434,643.09 份     |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                             |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。                                                           |
| 投资策略   | 本基金主要投资于短期债券，并控制投资组合久期，力求在承担较低风险和保持组合较好流动性的前提下，实现基金资产的稳健增值。本基金主要投资策略有固定收益类资产投资策略、衍生产品投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1 年以下）指数收益率×85%+一年期定期存款基准利率（税后）×15%                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。                                                 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                          | 基金托管人            |
|---------|------|--------------------------------|------------------|
| 名称      |      | 达诚基金管理有限公司                     | 上海银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 丁险峰                            | 周直毅              |
|         | 联系电话 | 021-60581280                   | 021-68475608     |
|         | 电子邮箱 | dingxf@integrity-funds.com     | custody@bosc.cn  |
| 客户服务电话  |      | 021-60581258                   | 95594            |
| 传真      |      | 021-60581234                   | 021-68476901     |
| 注册地址    |      | 上海市虹口区东大名路 1089 号 29 层 2903 单元 | 上海市黄浦区中山南路 688 号 |
| 办公地址    |      | 上海市虹口区东大名路 1089 号 29           | 中国（上海）自由贸易试验区银   |

|       |           |                |
|-------|-----------|----------------|
|       | 层 2903 单元 | 城中路 168 号 37 层 |
| 邮政编码  | 200080    | 200120         |
| 法定代表人 | 宋宜农       | 顾建忠            |

2.4 信息披露方式

|                     |                                |
|---------------------|--------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                        |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.integrity-funds.com        |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市虹口区东大名路 1089 号 29 层 2903 单元 |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                         |
|--------|--------------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 中信中证投资服务有限责任公司     | 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦      |
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数<br>据和指标   | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |                      |
|---------------------|-------------------------------------|----------------------|
|                     | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A                | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |
| 本期已实现收益             | 19,681,113.39                       | 5,275,166.52         |
| 本期利润                | 7,985,501.71                        | 1,822,175.21         |
| 加权平均基金份<br>额本期利润    | 0.0069                              | 0.0056               |
| 本期加权平均净<br>值利润率     | 0.63%                               | 0.51%                |
| 本期基金份额净<br>值增长率     | 0.68%                               | 0.58%                |
| 3.1.2 期 末 数<br>据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |                      |
|                     |                                     |                      |
| 期末可供分配利<br>润        | 56,272,436.33                       | 19,941,310.26        |
| 期末可供分配基<br>金份额利润    | 0.0821                              | 0.0766               |
| 期末基金资产净<br>值        | 746,531,730.92                      | 282,284,959.95       |

|              |                       |        |
|--------------|-----------------------|--------|
| 期末基金份额净值     | 1.0894                | 1.0839 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 11.53%                | 10.80% |

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. 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.14%    | 0.01%       | 0.16%      | 0.01%         | -0.02% | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.53%    | 0.02%       | 0.49%      | 0.01%         | 0.04%  | 0.01% |
| 过去六个月      | 0.68%    | 0.02%       | 0.78%      | 0.01%         | -0.10% | 0.01% |
| 过去一年       | 1.97%    | 0.02%       | 1.84%      | 0.01%         | 0.13%  | 0.01% |
| 过去三年       | 10.68%   | 0.02%       | 6.61%      | 0.01%         | 4.07%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.53%   | 0.02%       | 7.40%      | 0.01%         | 4.13%  | 0.01% |

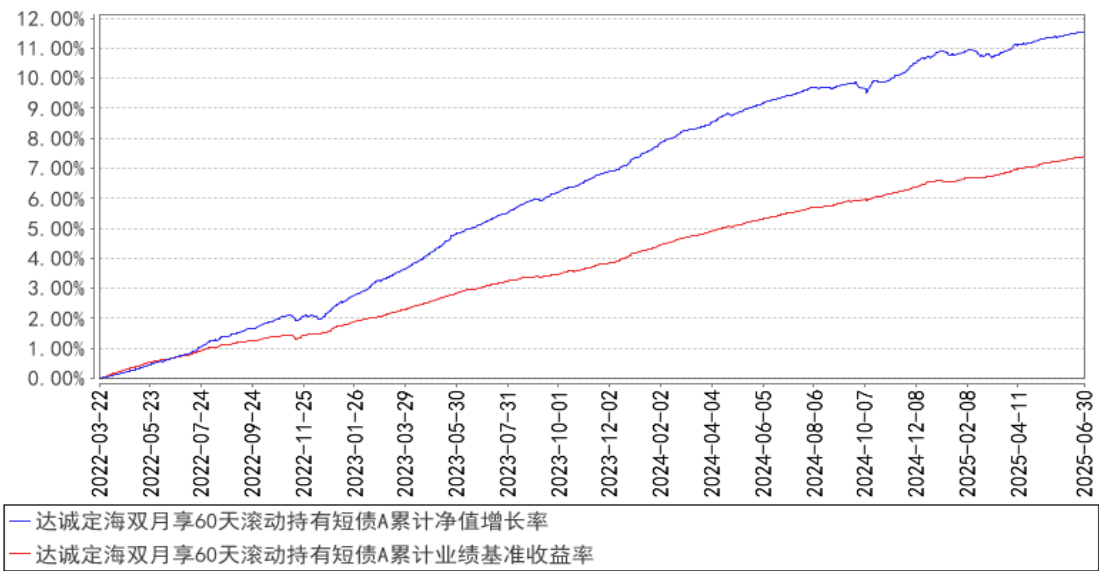
达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.12%    | 0.01%       | 0.16%      | 0.01%         | -0.04% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.49%    | 0.02%       | 0.49%      | 0.01%         | 0.00%  | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.58%    | 0.02%       | 0.78%      | 0.01%         | -0.20% | 0.01% |
| 过去一年  | 1.76%    | 0.02%       | 1.84%      | 0.01%         | -0.08% | 0.01% |
| 过去三年  | 10.02%   | 0.02%       | 6.61%      | 0.01%         | 3.41%  | 0.01% |

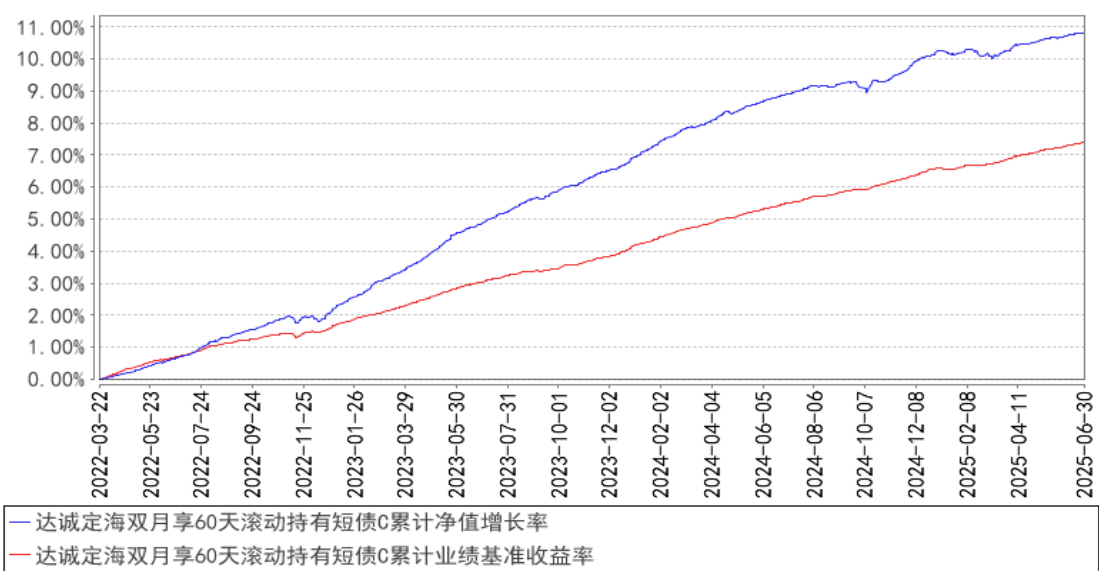
|                |        |       |       |       |       |       |
|----------------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 10.80% | 0.02% | 7.40% | 0.01% | 3.40% | 0.01% |
|----------------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

达诚定海双月享60天滚动持有短债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



达诚定海双月享60天滚动持有短债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



3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

达诚基金管理有限公司（以下简称“达诚基金”）经中国证监会证监许可[2019]1127 号文批准，于 2019 年 8 月 5 日注册成立，是由五位资深专业人士发起设立的自然人控股公募基金管理公司。公司注册地和主动办公所在地均为上海市虹口区，注册资本为 10490 万元人民币，经营范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证券监督管理委员会许可的其他业务。

截至报告期末，达诚基金旗下管理 9 只公开募集证券投资基金，具体包括达诚成长先锋混合型证券投资基金、达诚策略先锋混合型证券投资基金、达诚宜创精选混合型证券投资基金、达诚价值先锋灵活配置混合型证券投资基金、达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、达诚腾益债券型证券投资基金、达诚致益债券型发起式证券投资基金、达诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、达诚添利利率债债券型证券投资基金。同时，达诚基金还管理多个私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |                 | 证券从业年限 | 说明                                                                                                        |
|----|----------|-----------------|-----------------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          | 任职日期            | 离任日期            |        |                                                                                                           |
| 陈佶 | 本基金的基金经理 | 2022 年 3 月 22 日 | -               | 10 年   | 陈佶先生，硕士。拥有 10 年证券相关行业经验，曾任永赢基金管理有限公司交易员、交易主管；华宝证券有限责任公司交易主管。现任达诚基金管理有限公司基金经理。                             |
| 王栋 | 本基金的基金经理 | 2022 年 5 月 27 日 | 2025 年 2 月 13 日 | 13 年   | 王栋先生，硕士。拥有 17 年金融行业从业经验，曾任中国民生银行深圳分行金融同业业务业务经理；平安银行总行资管部固收投资投资经理；平安理财有限责任公司固收投资投资经理。现任达诚基金管理有限公司固收投资部门总监。 |

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

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、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，未损害基金份额持有人利益。本基金投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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中国证监会《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，建立了健全、有效的公平交易制度体系，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等各业务环节。基金管理人通过完善各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异以及分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内，不同时间窗口下同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易中成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。未发现不公平交易和利益输送的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，对等关税、地缘冲突、国内基本面修复情况等因素共同影响着股债市场。宏观经济整体呈现“稳中有增、结构分化”的特征，政策托底效应逐步显现，经济在消费回暖、基建托底及出口结构优化的支撑下保持韧性，但物价低迷、地产调整及外部风险仍构成挑战。一季度生产端工业与服务业协同扩张，新能源汽车、工业机器人等新质生产力相关产品产量实现两位数增长，反映产业升级成效，同时数字经济对服务业的带动作用同样显著。二季度关税效应使得外部环境逐步恶化，制造业 PMI 也重新落入收缩区间，反映出制造业发展面临的压力与挑战在加剧，增长动能有所减弱，新订单需求后劲不足，消费者购买力与企业投资意愿受到多种因素制约，整体形势面临挑战。

通胀方面，今年以来 CPI 同比在 0 附近波动，PPI 同比持续为负，且已经连续 30 多个月为负了，这也显示内需不足和工业通缩压力，预计下半年核心 CPI 通胀或逐季小幅改善，但全年均值

仍处 0 区间。若三季度 CPI 仍在 0 附近，央行可能通过降准降息引导实际利率下行，推动债券收益率曲线“牛平”。同时输入性通胀的风险有限，全球大宗商品价格受债务杠杆乏力和需求疲软制约，预计维持震荡下行。原油价格虽然因近期中东战事的升级快速上涨，但若稳定在 80 美元/桶以下，输入性通胀对市场的压制较小。

消费数据是上半年最大的亮点，数据在政策驱动下超预期反弹，以旧换新政策带动家电、通讯器材等升级类商品销售增长，各节假日出行同比增长明显，带动旅游、文娱消费快速增长，消费结构向服务化升级趋势明显。但居民收入增长乏力仍是长期制约，财产性收入改善尚未形成规模效应，消费内生动力仍需强化。

进出口与就业方面，出口韧性犹存，市场结构加速调整，受关税影响，对美出口同比下降 34.5%，但对欧盟、东盟出口分别增长 12%和 14.8%，市场多元化策略成效显著；进口端下降主要受国内需求疲软及大宗商品价格下跌影响，铁矿砂、原油等进口量同比下降，反映经济转型期传统行业需求收缩。就业端尽管政府设定城镇调查失业率目标为 5.5%，但劳动密集度下降和灵活就业占比上升，显示就业质量改善有限，若下半年失业率超预期攀升，可能加剧市场对内需疲软的担忧，推动资金向利率债避险。

债券市场方面，上半年呈现出较为复杂的走势，不同类型债券表现各异，整体呈现“先扬后抑再修复”的波动态势。1 月初受汇率因素制约，央行暂停国债买入，市场资金面紧张，导致短债回调，长债震荡，但债市表现仍好于权益市场。春节前后 DeepSeek 的横空出世让资金投资科技板块的热情迅速升温，同时临近“两会”，政策的预期同样推动权益行情延续，债券资金回流股市也导致利率加速回调，直到一季度末央行态度边际呵护，债券下跌趋势才趋于平缓。随着 4 月到来的中美“对等关税”宣布，短短几周内美中美关税水平经历了“过山车”，直接带动债市利率冲击新低后反弹，虽然短期内的局势缓和以及历史最低位的收益率均使得债券收益率突破的动力不足，但 5 月的降息、降准，则直接引导资金利率在年内首次低于 OMO 政策利率，债券也重回下行趋势。

权益市场方面，经历了元旦之后的大跌，逐渐企稳，尤其是春节前后市场加速上涨，科技创新带动了科技板块的投资热情迅速升温，也成为春季行情主要的推手之一，之后临近“两会”，政策的预期使得权益市场行情延续。与此同时，股债跷跷板效应尤为突出，在风险偏好增强，股票收益预期变高的情况下，原本投资于债券的资金流入股市，推动股市进一步上涨。4 月初中美“对等关税”的影响让 A 股经历了历史上最严重的下跌，但伴随着恐慌情绪的释放市场也很快回归理性，短短几周后美中美关税水平经历了“过山车”，外围的缓和叠加国内双降政策的落地，股市也逐步修复并冲击年内新高，市场情绪高涨。

2025 年上半年，达诚定海双月享 60 天滚动持有短债依旧以严控信用风险和回撤为主，降久

期、降杠杆成为前两个月的主要策略，同时在 3 月中下旬开始积极配置，适当拉长久期并提高杠杆水平，4 月中美“对等关税”落地后也阶段性降低了产品久期，并在央行宣布降息、降准后逐步提升久期和杠杆，保持组合票息的同时增强组合的弹性，依旧延续哑铃型的配置策略，1 年以内的信用债搭配长久期的利率债和银行二级资本债，适当拉长久期跟随市场节奏，顺势而为。整个上半年产品整体运作稳定，净值稳中有升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A 基金份额净值为 1.0894 元，本报告期份额净值增长率为 0.68%；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 基金份额净值为 1.0839 元，本报告期份额净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准增长率为 0.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，从宏观经济层面而言，虽然上半年 GDP 同比增速或达到 5.4%，但下半年面临出口回落、消费补贴效应减弱等压力，预计增速逐步放缓，同时经济放缓可能促使央行通过降准、降息等工具稳定增长，直接压低债券收益率。

其次是今年以来 CPI 同比一直在 0 附近波动，PPI 则同比持续为负，且已经连续 30 多个月为负了，这也显示内需不足和工业通缩压力，虽然下半年核心 CPI 通胀或逐季小幅改善，但全年均值仍可能处在 0 区间，通胀压力不大。

第三是货币政策层面，二季度货币政策委员会的例会纪要中，虽然删除“择机降准降息”的表述，叠加重申“资金防空转”的要求，但整体政策仍将维持宽松基调，维持当前的流动性状态使得债券利率没有大幅调整的趋势。

第四是房地产行业持续疲软，1-5 月的房地产开发投资增速同比是-10.7%，继续向下，且跌幅扩大，数据依旧走弱，地产融资起不来，信贷需求不足，利率就没有大幅上行的空间。

所以对于债券而言，年内仍不看空。宏观经济预期决定了利率大致的方向，货币政策导向则给了债券支撑，虽然短期内货币宽松博弈空间相对有限，一定程度或演绎利好出尽的行情，同时中美关税政策仍在缓和窗口，降低了贸易摩擦对经济增长的不确定性，一定程度或削弱债市的“避险溢价”，加大利率波动和上行风险。但是宏观数据的疲软以及资金面的宽松预期都将为债市提供强有力的支持，利率大幅上行的概率较小，因此年内债券的胜率依旧较高。

对于股票来说，双降通常会市场流动性和资金成本，宽松的货币政策可以降低企业融资成本，提高盈利预期，从而推动股价上涨，尤其是对利率敏感的行业。科技创新再贷款额度扩大至 8000 亿元，以及服务消费与养老再贷款工具，可以满足科技型企业和设备更新领域激增的融资需求。同时中美关税博弈迎来实质性缓和，缓解了贸易摩擦对出口链的压制，一定程度提振经济

增长预期，叠加货币政策与财政政策、产业政策形成合力，有助于提升市场对“经济软着陆”的信心，保险资金入市和汇金增持也为股市提供长期支撑，市场风险偏好回升，均可能对股市构成一定利好。因此在内部政策提振外加外部矛盾缓和的前提下，股票市场也将迎来结构性的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会由公司总经理、督察长、基金运营部的分管高管、基金投资部门的分管领导、基金运营部负责人、风险与合规管理部负责人组成。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，香港联合交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内共进行 1 次利润分配。2025 年 4 月 21 日，本基金进行了利润分配，达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A 每 10 份基金份额分红 0.185 元，共计分配利润 21,697,980.46 元；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 每 10 份基金份额分红 0.172 元，共计分配利润 4,998,569.69 元。符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额

持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 825,932.88             | 1,001,358.95             |
| 结算备付金    |         | 23,630,781.37          | 83,411.55                |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 1,295,670,941.45       | 2,484,421,489.01         |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 1,293,891,708.19       | 2,436,591,462.56         |
| 资产支持证券投资 |         | 1,779,233.26           | 47,830,026.45            |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资     | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资  |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资   | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款    |         | -                      | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |

|           |          |                        |                          |
|-----------|----------|------------------------|--------------------------|
| 应收申购款     |          | 408,428.62             | 6,893,933.68             |
| 递延所得税资产   |          | -                      | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.8  | -                      | -                        |
| 资产总计      |          | 1,320,536,084.32       | 2,492,400,193.19         |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债:      |          |                        |                          |
| 短期借款      |          | -                      | -                        |
| 交易性金融负债   |          | -                      | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3  | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |          | 289,061,427.33         | 385,079,195.31           |
| 应付清算款     |          | -                      | -                        |
| 应付赎回款     |          | 2,065,681.23           | 10,566,161.50            |
| 应付管理人报酬   |          | 260,667.85             | 550,081.68               |
| 应付托管费     |          | 43,444.66              | 91,680.29                |
| 应付销售服务费   |          | 47,669.46              | 79,920.34                |
| 应付投资顾问费   |          | -                      | -                        |
| 应交税费      |          | 77,867.19              | 221,092.98               |
| 应付利润      |          | -                      | -                        |
| 递延所得税负债   |          | -                      | -                        |
| 其他负债      | 6.4.7.9  | 162,635.73             | 127,929.50               |
| 负债合计      |          | 291,719,393.45         | 396,716,061.60           |
| 净资产:      |          |                        |                          |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 945,692,052.10         | 1,906,514,025.29         |
| 其他综合收益    | 6.4.7.11 | -                      | -                        |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | 83,124,638.77          | 189,170,106.30           |
| 净资产合计     |          | 1,028,816,690.87       | 2,095,684,131.59         |
| 负债和净资产总计  |          | 1,320,536,084.32       | 2,492,400,193.19         |

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 945,692,052.10 份，其中达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A 基金份额总额 685,257,409.01 份，基金份额净值 1.0894 元；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 基金份额总额 260,434,643.09 份，基金份额净值 1.0839 元。

6.2 利润表

会计主体：达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目       | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|-----------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入   |          | 16,020,928.88                            | 70,928,423.19                                 |
| 1. 利息收入   |          | 53,255.04                                | 55,959.22                                     |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 40,068.70                                | 40,249.95                                     |

|                            |            |                |               |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 债券利息收入                     |            | -              | -             |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -              | -             |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 13,186.34      | 15,709.27     |
| 其他利息收入                     |            | -              | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 31,116,276.83  | 55,932,364.17 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -              | -             |
| 基金投资收益                     |            | -              | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | 31,292,690.87  | 54,954,077.74 |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.16   | 303,255.49     | 1,228,018.79  |
| 收益                         |            |                |               |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -              | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -479,669.53    | -249,732.36   |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | -              | -             |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -              | -             |
| 其他投资收益                     |            | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20   | -15,148,602.99 | 14,940,099.80 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -              | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21   | -              | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 6,213,251.96   | 10,716,599.81 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,427,017.51   | 4,778,099.20  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -              | -             |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 404,502.99     | 796,349.88    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 356,597.09     | 1,014,979.90  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 2,814,827.44   | 3,832,206.30  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,814,827.44   | 3,832,206.30  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -              | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 87,568.58      | 181,870.87    |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 122,738.35     | 113,093.66    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 9,807,676.92   | 60,211,823.38 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 9,807,676.92   | 60,211,823.38 |
| <b>五、其他综合收益的税后</b>         |            | -              | -             |

|          |  |              |               |
|----------|--|--------------|---------------|
| 净额       |  |              |               |
| 六、综合收益总额 |  | 9,807,676.92 | 60,211,823.38 |

6.3 净资产变动表

会计主体：达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                           | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                 |                   |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                              | 实收基金                                       | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                    | 1,906,514,025.29                           | 189,170,106.30  | 2,095,684,131.59  |
| 二、本期期初净资产                                    | 1,906,514,025.29                           | 189,170,106.30  | 2,095,684,131.59  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -960,821,973.19                            | -106,045,467.53 | -1,066,867,440.72 |
| (一)、综合收益总额                                   | -                                          | 9,807,676.92    | 9,807,676.92      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)      | -960,821,973.19                            | -89,156,594.30  | -1,049,978,567.49 |
| 其中：1. 基金申购款                                  | 250,686,102.56                             | 23,431,003.85   | 274,117,106.41    |
| 2. 基金赎回款                                     | -1,211,508,075.75                          | -112,587,598.15 | -1,324,095,673.90 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动<br>(净资产减少以“-”号填列) | -                                          | -26,696,550.15  | -26,696,550.15    |
| 四、本期期末净资产                                    | 945,692,052.10                             | 83,124,638.77   | 1,028,816,690.87  |
| 项目                                           | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|                                              | 实收基金                                       | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                    | 3,050,231,645.18                           | 198,115,039.19  | 3,248,346,684.37  |
| 二、本期期初净资产                                    | 3,050,231,645.18                           | 198,115,039.19  | 3,248,346,684.37  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -298,558,573.90                            | 36,315,520.10   | -262,243,053.80   |
| (一)、综合收益总额                                   | -                                          | 60,211,823.38   | 60,211,823.38     |

|                                          |                   |                 |                   |
|------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -298,558,573.90   | -23,896,303.28  | -322,454,877.18   |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 1,842,932,722.65  | 137,070,182.22  | 1,980,002,904.87  |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,141,491,296.55 | -160,966,485.50 | -2,302,457,782.05 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                 | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,751,673,071.28  | 234,430,559.29  | 2,986,103,630.57  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

李宇龙

田中甲

徐毅翔

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3234 号《关于准予达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由达诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 217,855,476.47 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0231 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 217,882,319.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 26,842.84 份基金份额。本基金的基金管理人为达诚基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金对每份基金份额设置 60 天的运作日。对于每份基金份额,运作期指基金合同生效日(对认购份额而言)或该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)起至基金合同生效日或基金份额

申购申请日后的第 60 天(即运作期到期日。如该日为非工作日,则顺延至下一工作日)。每个运作期到期日前,基金份额持有人不能提出赎回申请;每个运作期到期日,基金份额持有人可提出赎回申请。

根据《达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购基金份额时收取认购/申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认/申购基金份额时不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置不同的基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%,其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%;每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为:中债综合财富(1 年以下)指数收益率 $\times$ 85%+一年期定期存款基准利率(税后) $\times$ 15%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### （1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### （2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### （4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 818,074.00             |
| 等于：本金          | 817,943.21             |
| 加：应计利息         | 130.79                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | 7,858.88               |
| 等于：本金          | 7,856.20               |
| 加：应计利息         | 2.68                   |

|        |            |
|--------|------------|
| 减：坏账准备 | -          |
| 合计     | 825,932.88 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |               |                  |              |
|---------------|-------|------------------------|---------------|------------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                      | -             | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 30,003,528.77          | 576,438.35    | 30,799,438.35    | 219,471.23   |
|               | 银行间市场 | 1,247,679,687.61       | 12,532,669.84 | 1,263,092,269.84 | 2,879,912.39 |
|               | 合计    | 1,277,683,216.38       | 13,109,108.19 | 1,293,891,708.19 | 3,099,383.62 |
| 资产支持证券        |       | 1,775,300.00           | 833.26        | 1,779,233.26     | 3,100.00     |
| 基金            |       | -                      | -             | -                | -            |
| 其他            |       | -                      | -             | -                | -            |
| 合计            |       | 1,279,458,516.38       | 13,109,941.45 | 1,295,670,941.45 | 3,102,483.62 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 49,197.38              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 49,197.38              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 113,438.35             |
| 合计          | 162,635.73             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               | 基金份额（份）          | 账面金额             |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末          | 1,483,404,404.26 | 1,483,404,404.26 |
| 本期申购          | 166,128,624.32   | 166,128,624.32   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -964,275,619.57  | -964,275,619.57  |
| 基金拆分/份额折算前    | -                | -                |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                | -                |
| 本期申购          | -                | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                | -                |
| 本期末           | 685,257,409.01   | 685,257,409.01   |

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 423,109,621.03                        | 423,109,621.03  |
| 本期申购          | 84,557,478.24                         | 84,557,478.24   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -247,232,456.18                       | -247,232,456.18 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -               |
| 本期末           | 260,434,643.09                        | 260,434,643.09  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 123,656,410.18 | 25,411,378.08  | 149,067,788.26 |
| 本期期初           | 123,656,410.18 | 25,411,378.08  | 149,067,788.26 |
| 本期利润           | 19,681,113.39  | -11,695,611.68 | 7,985,501.71   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -65,367,106.78 | -8,713,880.82  | -74,080,987.60 |
| 其中：基金申购款       | 13,748,465.76  | 1,959,297.26   | 15,707,763.02  |
| 基金赎回款          | -79,115,572.54 | -10,673,178.08 | -89,788,750.62 |
| 本期已分配利润        | -21,697,980.46 | -              | -21,697,980.46 |
| 本期末            | 56,272,436.33  | 5,001,885.58   | 61,274,321.91  |

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 32,862,480.26 | 7,239,837.78 | 40,102,318.04 |
| 本期期初 | 32,862,480.26 | 7,239,837.78 | 40,102,318.04 |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期利润           | 5,275,166.52   | -3,452,991.31 | 1,822,175.21   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,197,766.83 | -1,877,839.87 | -15,075,606.70 |
| 其中：基金申购款       | 6,664,953.88   | 1,058,286.95  | 7,723,240.83   |
| 基金赎回款          | -19,862,720.71 | -2,936,126.82 | -22,798,847.53 |
| 本期已分配利润        | -4,998,569.69  | -             | -4,998,569.69  |
| 本期末            | 19,941,310.26  | 1,909,006.60  | 21,850,316.86  |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 12,778.62                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 250.73                                |
| 结算备付金利息收入 | 27,039.35                             |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 40,068.70                             |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 27,100,532.88              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,192,157.99               |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |
| 合计                           | 31,292,690.87              |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                        | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,924,938,549.70     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,878,645,308.22     |
| 减：应计利息总额               | 42,063,094.99        |
| 减：交易费用                 | 37,988.50            |
| 买卖债券差价收入               | 4,192,157.99         |

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 303,255.49                 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -                          |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入       | -                          |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入       | -                          |
| 合计                       | 303,255.49                 |

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 46,143,305.87              |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 45,835,000.00              |
| 减：应计利息总额       | 308,305.87                 |
| 减：交易费用         | -                          |
| 资产支持证券投资收益     | 0.00                       |

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 国债期货投资收益 | -479,669.53                     |

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -15,148,602.99                  |
| 股票投资                   | -                               |
| 债券投资                   | -15,005,902.99                  |
| 资产支持证券投资               | -142,700.00                     |
| 基金投资                   | -                               |
| 贵金属投资                  | -                               |
| 其他                     | -                               |
| 2. 衍生工具                | -                               |
| 权证投资                   | -                               |
| 3. 其他                  | -                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                               |
| 合计                     | -15,148,602.99                  |

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 44,630.98                             |
| 信息披露费    | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金  | -                                     |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他       | 600.00                                |
| 合计       | 122,738.35                            |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系      |
|------------|--------------|
| 达诚基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 上海银行股份有限公司 | 基金托管人        |
| 宋宜农        | 基金管理人的股东     |
| 章月平        | 基金管理人的股东     |
| 赵楠         | 基金管理人的股东     |
| 徐蔓青        | 基金管理人的股东     |
| 李峻         | 基金管理人的股东     |
| 李宇龙        | 基金管理人的股东     |

注：1. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,427,017.51                             | 4,778,099.20                                  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 915,051.80                               | 2,298,035.21                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,511,965.71                             | 2,480,063.99                                  |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。日管理人报酬的计算方法为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%÷当年实际天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 404,502.99                               | 796,349.88                                    |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年实际天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |                          |          |
|----------------|---------------------------------|--------------------------|----------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                          |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                          |          |
|                | 达诚定海双月享 60 天<br>滚动持有短债 A        | 达诚定海双月享 60 天<br>滚动持有短债 C | 合计       |
| 达诚基金管理有限公司     | -                               | 359.34                   | 359.34   |
| 上海银行股份有限公司     | -                               | -                        | -        |
| 合计             | -                               | 359.34                   | 359.34   |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |                          |          |
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                          |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                          |          |
|                | 达诚定海双月享 60 天<br>滚动持有短债 A        | 达诚定海双月享 60 天<br>滚动持有短债 C | 合计       |
| 达诚基金管理有限公司     | -                               | 1,572.82                 | 1,572.82 |
| 上海银行股份有限公司     | -                               | -                        | -        |
| 合计             | -                               | 1,572.82                 | 1,572.82 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给达诚基金，再由达诚基金计算并按代销中约定的支付频率支付给各基金销售机构。销售服务费的计算方法为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.20% ÷ 当年实际天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                      |
|---------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|
|                                 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A                       | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |
| 基金合同生效日（2022 年 3 月 22 日）持有的基金份额 | -                                          | -                    |
| 报告期初持有的基金份额                     | 4,118,228.45                               | -                    |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                                          | -                    |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                          | -                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 4,118,228.45                               | -                    |
| 报告期末持有的基金份额                     | -                                          | -                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | -                                          | -                    |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                      |
|                                 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A                       | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |
| 基金合同生效日（2022 年 3 月 22 日）持有的基金份额 | -                                          | -                    |
| 报告期初持有的基金份额                     | 5,918,228.45                               | -                    |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                                          | -                    |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                          | -                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                                          | -                    |
| 报告期末持有的基金份额                     | 5,918,228.45                               | -                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.31%                                      | -                    |

注：1、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。

2、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                     | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                     |
|-------|------------------------|---------------------|--------------------------|---------------------|
|       | 持有的基金份额                | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额                  | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
| 李宇龙   | 15,629.06              | 0.002               | -                        | -                   |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           |
|------------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 上海银行股份有限公司 | 818,074.00                            | 12,778.62 | 1,117,125.38                               | 16,715.06 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A |                 |     |                 |                       |                      |                   |                  |    |
|----------------------|-----------------|-----|-----------------|-----------------------|----------------------|-------------------|------------------|----|
| 序号                   | 权益<br>登记日       | 除息日 |                 | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|                      |                 | 场内  | 场外              |                       |                      |                   |                  |    |
| 1                    | 2025 年 4 月 21 日 | -   | 2025 年 4 月 21 日 | 0.1850                | 19,868,055.53        | 1,829,924.93      | 21,697,980.46    | -  |
| 合计                   | -               | -   | -               | 0.1850                | 19,868,055.53        | 1,829,924.93      | 21,697,980.46    | -  |

| 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |                 |     |                 |                       |                      |                   |                  |    |
|----------------------|-----------------|-----|-----------------|-----------------------|----------------------|-------------------|------------------|----|
| 序号                   | 权益<br>登记日       | 除息日 |                 | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|                      |                 | 场内  | 场外              |                       |                      |                   |                  |    |
| 1                    | 2025 年 4 月 21 日 | -   | 2025 年 4 月 21 日 | 0.1720                | 4,456,963.66         | 541,606.03        | 4,998,569.69     | -  |
| 合计                   | -               | -   | -               | 0.1720                | 4,456,963.66         | 541,606.03        | 4,998,569.69     | -  |

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 289,061,427.33 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称                | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|---------------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 102382392 | 23 西咸新发 MTN003      | 2025 年 7 月 1 日 | 102.30 | 200,000 | 20,460,701.37 |
| 102480067 | 24 水发集团 MTN001A     | 2025 年 7 月 1 日 | 102.72 | 82,000  | 8,422,630.67  |
| 102480284 | 24 云投 MTN001B       | 2025 年 7 月 1 日 | 104.07 | 100,000 | 10,407,320.55 |
| 2500001   | 25 超长特别国债 01        | 2025 年 7 月 1 日 | 101.72 | 200,000 | 20,344,491.80 |
| 2500002   | 25 超长特别国债 02        | 2025 年 7 月 1 日 | 100.77 | 200,000 | 20,154,830.60 |
| 250210    | 25 国开 10            | 2025 年 7 月 1 日 | 101.10 | 170,000 | 17,187,652.05 |
| 240421    | 24 农发 21            | 2025 年 7 月 2 日 | 101.35 | 313,000 | 31,724,007.81 |
| 012580708 | 25 碧水源 SCP002(科创票据) | 2025 年 7 月 3 日 | 100.80 | 300,000 | 30,239,769.86 |
| 102281589 | 22 陆家嘴 MTN001       | 2025 年 7 月 3 日 | 102.80 | 100,000 | 10,279,923.29 |
| 102300363 | 23 西咸新发 MTN001      | 2025 年 7 月 3 日 | 100.86 | 22,000  | 2,218,886.73  |
| 200212    | 20 国开 12            | 2025 年 7 月 3 日 | 103.29 | 400,000 | 41,316,416.44 |
| 240421    | 24 农发 21            | 2025 年 7 月 3 日 | 101.35 | 85,000  | 8,615,145.89  |
| 012580771 | 25 津保投 SCP004       | 2025 年 7 月 4 日 | 100.67 | 300,000 | 30,201,558.90 |
| 102101186 | 21 华发实业 MTN002      | 2025 年 7 月 4 日 | 100.28 | 200,000 | 20,055,671.23 |
| 102480547 | 24 水发集团 MTN002      | 2025 年 7 月 4 日 | 101.66 | 137,000 | 13,927,407.24 |
| 102485446 | 24 云投 MTN022        | 2025 年 7 月 4 日 | 101.73 | 227,000 | 23,093,259.78 |

|    |  |  |  |           |                |
|----|--|--|--|-----------|----------------|
| 合计 |  |  |  | 3,036,000 | 308,649,674.21 |
|----|--|--|--|-----------|----------------|

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常投资管理过程中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。本基金在银行间市场进行的交易均通过银行间同业拆借中心的前台系统达成，并由中央结算公司和上海清算所完成资金和证券的交收清算；本基金在交易所进行的交易均由中国证券登记结算有限责任公司完成证券和资金的交收清算，因此违约风险发生的可能性较小。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行。本基金在进入银行间同业市场交易前，根据交易对手的信用级别，将交易对手进行了分类，并根据不同的交易对手类别设置了不同的交易额度。交易对手的信用评级会进行定期和不定期复评，并根据交易对手资信情况的动态变化随时调整，以此来控制相应的违约风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |

|     |                |                  |
|-----|----------------|------------------|
| 未评级 | 614,043,932.87 | 1,046,960,305.68 |
| 合计  | 614,043,932.87 | 1,046,960,305.68 |

注：未评级债券为政策性金融债和短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资  
无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 396,779.66             | -                        |
| 合计     | 396,779.66             | -                        |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 143,001,757.25         | 299,383,690.46           |
| AAA 以下 | 67,687,308.21          | 89,492,172.27            |
| 未评级    | 468,761,930.20         | 1,000,755,294.15         |
| 合计     | 679,450,995.66         | 1,389,631,156.88         |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、公司债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 1,779,233.26           | 47,830,026.45            |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 1,779,233.26           | 47,830,026.45            |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资  
无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人

于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，使得基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外（如有），本期末本基金的其他资产均能及时变现。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息 | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|---------------|-----|------------------|
| 资产                     |                |                |               |     |                  |
| 货币资金                   | 825,932.88     | -              | -             | -   | 825,932.88       |
| 结算备付金                  | 23,630,781.37  | -              | -             | -   | 23,630,781.37    |
| 交易性金融资产                | 1,004,261,419. | 200,534,435.29 | 90,875,086.34 | -   | 1,295,670,941.45 |

|                          |                  |                |               |               |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
|                          | 82               |                |               |               |                  |
| 应收申购款                    | -                | -              | -             | 408,428.62    | 408,428.62       |
| 资产总计                     | 1,028,718,134.07 | 200,534,435.29 | 90,875,086.34 | 408,428.62    | 1,320,536,084.32 |
| 负债                       |                  |                |               |               |                  |
| 应付赎回款                    | -                | -              | -             | 2,065,681.23  | 2,065,681.23     |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -             | 260,667.85    | 260,667.85       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -             | 43,444.66     | 43,444.66        |
| 卖出回购金融资产款                | 289,061,427.33   | -              | -             | -             | 289,061,427.33   |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -             | 47,669.46     | 47,669.46        |
| 应交税费                     | -                | -              | -             | 77,867.19     | 77,867.19        |
| 其他负债                     | -                | -              | -             | 162,635.73    | 162,635.73       |
| 负债总计                     | 289,061,427.33   | -              | -             | 2,657,966.12  | 291,719,393.45   |
| 利率敏感度缺口                  | 739,656,706.74   | 200,534,435.29 | 90,875,086.34 | -2,249,537.50 | 1,028,816,690.87 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内            | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                  |                |               |               |                  |
| 货币资金                     | 1,001,358.95     | -              | -             | -             | 1,001,358.95     |
| 结算备付金                    | 83,411.55        | -              | -             | -             | 83,411.55        |
| 交易性金融资产                  | 1,680,011,281.98 | 761,945,598.81 | 42,464,608.22 | -             | 2,484,421,489.01 |
| 应收申购款                    | -                | -              | -             | 6,893,933.68  | 6,893,933.68     |
| 资产总计                     | 1,681,096,052.48 | 761,945,598.81 | 42,464,608.22 | 6,893,933.68  | 2,492,400,193.19 |
| 负债                       |                  |                |               |               |                  |
| 应付赎回款                    | -                | -              | -             | 10,566,161.50 | 10,566,161.50    |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -             | 550,081.68    | 550,081.68       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -             | 91,680.29     | 91,680.29        |
| 卖出回购金融资产款                | 385,079,195.31   | -              | -             | -             | 385,079,195.31   |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -             | 79,920.34     | 79,920.34        |
| 应交税费                     | -                | -              | -             | 221,092.98    | 221,092.98       |
| 其他负债                     | -                | -              | -             | 127,929.50    | 127,929.50       |
| 负债总计                     | 385,079,195.31   | -              | -             | 11,636,866.29 | 396,716,061.60   |
| 利率敏感度缺口                  | 1,296,016,857.17 | 761,945,598.81 | 42,464,608.22 | -4,742,932.61 | 2,095,684,131.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                |                             |
|----|--------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 市场利率曲线平行变动，除市场利率以外的其他市场变量保持不变。 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变                       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|  | 动             | 本期末（2025 年 6 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|--|---------------|----------------------|------------------------|
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 5,357,700.22         | 6,096,990.77           |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -5,357,700.22        | -6,096,990.77          |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金本报告期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 1,295,670,941.45       | 2,484,421,489.01         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 1,295,670,941.45       | 2,484,421,489.01         |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 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            | 1,295,670,941.45 | 98.12         |
|    | 其中：债券             | 1,293,891,708.19 | 97.98         |
|    | 资产支持证券            | 1,779,233.26     | 0.13          |
| 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      | 24,456,714.25    | 1.85          |
| 8  | 其他各项资产            | 408,428.62       | 0.03          |
| 9  | 合计                | 1,320,536,084.32 | 100.00        |

注：1. 本基金本报告期末未持有港股通股票。

2. 本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 70,654,319.22    | 6.87          |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 102,079,046.57   | 9.92          |
|    | 其中：政策性金融债 | 102,079,046.57   | 9.92          |
| 4  | 企业债券      | 30,799,438.35    | 2.99          |
| 5  | 企业短期融资券   | 573,502,069.86   | 55.74         |
| 6  | 中期票据      | 495,347,698.37   | 48.15         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | 396,779.66       | 0.04          |
| 9  | 其他        | 21,112,356.16    | 2.05          |
| 10 | 合计        | 1,293,891,708.19 | 125.77        |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 200212    | 20 国开 12       | 400,000 | 41,316,416.44 | 4.02          |
| 2  | 102480037 | 24 海发宝诚 MTN001 | 400,000 | 40,925,617.53 | 3.98          |
| 3  | 042480593 | 24 青岛上合 CP005  | 400,000 | 40,590,224.66 | 3.95          |

|   |           |             |         |               |      |
|---|-----------|-------------|---------|---------------|------|
| 4 | 042480648 | 24 象屿 CP002 | 400,000 | 40,561,683.29 | 3.94 |
| 5 | 240421    | 24 农发 21    | 400,000 | 40,541,863.01 | 3.94 |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 262368 | 德银 02A1 | 110,000 | 1,038,456.84 | 0.10         |
| 2  | 262365 | 东煜 01A2 | 200,000 | 740,776.42   | 0.07         |

### 7.8 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贵金属投资明细

无。

### 7.9 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

无。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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

报告期内基金投资的前十名证券发行主体没有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。

#### 7.11.2 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

无。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | —          |
| 2  | 应收清算款 | —          |
| 3  | 应收股利  | —          |
| 4  | 应收利息  | —          |
| 5  | 应收申购款 | 408,428.62 |
| 6  | 其他应收款 | —          |
| 7  | 待摊费用  | —          |
| 8  | 其他    | —          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 408,428.62 |
|---|----|------------|

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                            | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构         |                   |                |                   |
|---------------------------------|------------------|---------------|---------------|-------------------|----------------|-------------------|
|                                 |                  |               | 机构投资者         |                   | 个人投资者          |                   |
|                                 |                  |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 达诚定海<br>双月享 60<br>天滚动持<br>有短债 A | 16,538           | 41,435.33     | 49,264,118.41 | 7.19              | 635,993,290.60 | 92.81             |
| 达诚定海<br>双月享 60<br>天滚动持<br>有短债 C | 9,291            | 28,030.85     | 1,000.18      | 0.00              | 260,433,642.91 | 100.00            |
| 合计                              | 24,718           | 38,259.25     | 49,265,118.59 | 5.21              | 896,426,933.51 | 94.79             |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），  
户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                           | 份额级别                 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------------------|----------------------|-----------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A | 16,022.81 | 0.002       |
|                              | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C | 25,852.09 | 0.010       |
|                              | 合计                   | 41,874.90 | 0.004       |

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A | 0~10              |
|                                | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C | 0~10              |
|                                | 合计                   | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A | 0                 |
|                                | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C | 0                 |
|                                | 合计                   | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C |
|----------------------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日<br>(2022 年 3 月 22 日)<br>基金份额总额 | 204,221,278.94       | 13,661,040.37        |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 1,483,404,404.26     | 423,109,621.03       |
| 本报告期基金总申购份额                            | 166,128,624.32       | 84,557,478.24        |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 964,275,619.57       | 247,232,456.18       |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | —                    | —                    |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 685,257,409.01       | 260,434,643.09       |

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 2 月 28 日，本基金管理人发布《达诚基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，聘请张力先生担任本基金管理人副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或行政处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|            |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 国海证券股份有限公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 中信证券股份有限公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|-----|------|--------|------|
|-----|------|--------|------|

| 称          | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
|------------|------|------------------|------|--------------------|------|------------------|
| 国海证券股份有限公司 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 中信证券股份有限公司 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                |

注：无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                  | 法定披露方式                              | 法定披露日期          |
|----|---------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|
| 1  | 达诚基金定海双月享 2024 年第 4 季度报告              | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站            | 2025 年 1 月 22 日 |
| 2  | 达诚基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告  | 上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报               | 2025 年 1 月 22 日 |
| 3  | 达诚基金定海双月享基金经理变更公告                     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报      | 2025 年 2 月 15 日 |
| 4  | 达诚基金定海双月享产品资料概要更新                     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站            | 2025 年 2 月 15 日 |
| 5  | 达诚基金定海双月享招募说明书更新                      | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站            | 2025 年 2 月 15 日 |
| 6  | 达诚基金定海双月享招募说明书及产品资料概要更新提示性公告          | 上海证券报                               | 2025 年 2 月 15 日 |
| 7  | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金 2024 年度报告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站            | 2025 年 3 月 31 日 |
| 8  | 达诚基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告        | 上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报               | 2025 年 3 月 31 日 |
| 9  | 达诚基金关于新增万联证券为旗下开放式基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、证券时报 | 2025 年 4 月 9 日  |
| 10 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金分红公告       | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电                 | 2025 年 4 月 21 日 |

|    |                                         |                                                |                 |
|----|-----------------------------------------|------------------------------------------------|-----------------|
|    |                                         | 子披露网站、上海证券报                                    |                 |
| 11 | 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金 2025 年一季度报告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报                 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 12 | 达诚基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报                          | 2025 年 4 月 22 日 |
| 13 | 达诚基金关于新增华创证券为旗下开放式基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告   | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 5 月 9 日  |
| 14 | 2025 年度定期更新产品资料概要                       | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网                        | 2025 年 6 月 27 日 |
| 15 | 2025 年度定期更新产品招募说明书                      | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网                        | 2025 年 6 月 27 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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                                                                                                                                      | 1              | 20250101-20250514       | 459,600,974.35 | 0.00 | 459,600,974.35 | 0.00       | 0       |
| 产品特有风险                                                                                                                                  |                |                         |                |      |                |            |         |
| 本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。 |                |                         |                |      |                |            |         |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金募集注册文件

- (2) 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同
- (3) 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人网站 [www.integrity-funds.com](http://www.integrity-funds.com) 或客服电话 021-60581258。

达诚基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日