信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月28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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日起至2025年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 12
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
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 47
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 47
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 47
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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 投资组合报告附注 48
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
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 49
§9 开放式基金份额变动 50
§10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
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 51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 51
10.8 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
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 53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 53
§12 备查文件目录 53
12.1 备查文件目录 53
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划
基金简称	信达睿益鑫享混合
基金主代码	970115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年2月14日
基金管理人	信达证券股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,499,818.94份
基金合同存续期	自本集合计划合同变更生效日起存续期至2025年9月30日，存续期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。

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。信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”“本基金”或“信达睿益鑫享混合”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极大类资产配置和个股个券精选，实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、股票市场投资策略 3、债券的投资策略 4、可转换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、股指期货、国债期货投资策略 7、融资业务的投资策略
业绩比较基准	中证800指数收益率×40%+中债总财富指数收益率×60%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场

	型基金，属于中风险/收益的产品。

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		信达证券股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	万颖	王小飞
	联系电话	010-83252700	021-60637103
	电子邮箱	wanying@cindasc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95321	021-60637228
传真		010-83252871	021-60635778
注册地址		北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100031	100033
法定代表人		张毅	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cindasc.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座8层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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 期间数据和指标	报告期 （2025年1月1日- 2025年6月30日）
本期已实现收益	663,300.50
本期利润	321,951.50
加权平均基金份额本期利润	0.0123
本期加权平均净值利润率	1.18%
本期基金份额净值增长率	0.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2025年6月30日）
期末可供分配利润	378,761.70
期末可供分配基金份额利润	0.0185
期末基金资产净值	21,552,255.24
期末基金份额净值	1.0513
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	5.13%

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	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	0.23%	0.01%	1.47%	0.24%	-1.24%	-0.23%
过去三个月	1.03%	0.06%	1.51%	0.43%	-0.48%	-0.37%
过去六个月	0.87%	0.06%	0.98%	0.41%	-0.11%	-0.35%

过去一年	3.64%	0.13%	9.74%	0.56%	-6.10%	-0.43%
过去三年	4.00%	0.12%	5.57%	0.44%	-1.57%	-0.32%
自基金合同生效起至今	5.13%	0.13%	5.17%	0.46%	-0.04%	-0.33%

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

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

信达证券股份有限公司（以下简称“信达证券”或“公司”）成立于2007年，系由中国信达资产管理股份有限公司为主要发起人设立的股份有限公司。公司注册地为北京，在北京、上海、广东、深圳等全国多个省、自治区、直辖市设有100余家分支机构，经过多年发展，公司具备了较为齐全的经营资质，致力于发展成为一家资产质量优良、专业能力突出、业务特色鲜明、具备差异化竞争优势的综合类证券公司。2023年2月1日，信达证券在上海证券交易所主板上市交易（证券代码：601059）。

信达证券主要业务板块包括证券经纪业务、证券自营业务、投资银行业务和资产管理业务等，并通过控股子公司信达期货有限公司、信风投资管理有限公司、信达创新投资有限公司、信达澳亚基金管理有限公司和信达国际控股有限公司（通过信达证券的控股平台信达证券（香港）控股有限公司持有）分别从事期货业务、私募股权投资基金业务、另类投资业务、公募基金管理业务和境外业务。

信达证券根据《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，截至2022年5月9日，旗下7只存量大集合产品已全部完成公募化改造，分别为“信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”“信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划”“信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划”“信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划”“信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划”“信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划”和“信达现金宝货币型集合资产管理计划”。

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		
王琳	本基金的基金经理、基金经理	2022-02-22	-	8	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21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22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）。
程媛媛	本基金的基金经理、基金经理	2022-11-24	-	8	程媛媛，CFA，北京大学经济学、管理学双学士，清华大学管理学硕士。2017年5月加入信达证券，历任研究员、投资经理。担任研究员期间，深度覆盖消费和周期行业，擅长抓“落难王子”的业绩拐点。坚持价值投资理念，深度研究公司基本面，并对企业股权价值进行评估，选择股价安全边际较大的时机买入。着眼于股票长期价值的实现，并持续比较各种标的的机会成本，力争做出较优的决策。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。现任信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资

					产管理计划基金经理（自2022年11月24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11月24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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》及其他相关法律法规、中国证监会规定和本集合计划合同的约定，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 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

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，无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 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

债券市场方面， 2025年上半年债市整体呈震荡行情，一季度债市收益率震荡上行，二季度债市收益率震荡下行。具体来看，截至6月30日，1年、3年、5年、7年国债收益率较年初分别上行26BP、21BP、10BP、2BP，10年国债收益率较年初下行3BP。AA+评级的3年中票、5年中票、3年城投债、5年城投债、7年城投债收益率较年初分别下行1BP、3BP、1BP、5BP、16BP。

股票市场方面，2025年上半年A股在政策托底与外部扰动博弈下维持“慢牛”格局。上半年沪深300指数上涨0.03%。从整个上半年来看，由于经济基本面还处于恢复过程中，市场流动性较为充裕，因此以中证2000指数、北证50指数为代表的小盘股、题材股涨幅领先。

二季度，债券方面，管理人主要做了部分利率债投资和波段交易。弹性资产方面，管理人主要配置基本面优质、估值较低的标的；同时管理人根据市场行情的变化灵活调整股债比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达睿益鑫享混合基金份额净值为1.0513元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.87%，同期业绩比较基准收益率为0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前瞻性看，股票市场方面，虽然经济阶段性还是面临需求不足和地产等持续下行造成的居民资产负债表压力，但是当前的经济政策直面市场担忧的通缩问题，国内经济增速未来有望见底回升。目前沪深300指数仍处于历史估值的偏低位置，未来经济的逐步修复回升将会在后面带来上市公司业绩和估值的双升，且市场流动性较为充裕，所以这个位置我们还是以中长期相对多头思维看待市场。

债市方面，短期看，决策层“反内卷“政策下焦煤、碳酸锂等大宗商品价格上涨，修正市场对 PPI 增速的预期，流动性和市场情绪推动下，权益市场风险偏好抬升，股指持续上涨，股债跷跷板效应显现，固收类产品净值回撤，加大非银资管产品赎回压力，债市短期或有一定调整压力。中期来看，“强预期、弱现实”的情况仍未改变，近期公布的 2025 年 7 月工业增加值、社零、投资、社融信贷数据等仍比较疲软，社融主要靠发行政府债和地方债支撑，私人部门融资需求低迷。央行二季度报告显示降准降息仍有空间，货币政策依然保持“支持性”，债市中期并不悲观，若债市调整幅度过大，将逐步孕育配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本集合计划管理人设置资产管理业务估值委员会，负责组织制定和适时修订集合计划估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、集合计划从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或集合计划估值运作等方面的专业能力。集合计划基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未实施利润分配。

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

2025年2月26日至2025年5月19日，本集合计划连续五十五个交易日出现投资者人数低于200人的情况。2025年5月20日，本集合计划的投资者人数已恢复至200人以上。2025年6月11日至2025年6月30日，本集合计划连续十四个交易日出现投资者人数低于200人的情况。2024年12月10日至2025年3月7日，本集合计划连续五十七个交易日资产净值低于五千万元。2025年3月10日，本集合计划的资产净值已恢复至五千万元以上。由于市场及投资者赎回等因素，2025年4月8日至2025年7月4日（首尾均含），本集合计划出现连续60个工作日资产净值低于五千万元的情形。截至本报告出具之日，前述情形尚未消除。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，为充分保护份额持有人利益，管理人向中国证监会提交了本集合计划变更注册的申请，将本集合计划管理人变更为管理人控股子公司信达澳亚基金管理有限公司（以下简称“信达澳亚基金”），并申请将本集合计划变更注册为信澳睿益鑫享混合型证券投资基金。

2025年8月1日，中国证监会印发《关于准予信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2025〕1631号），准予本集合计划变更注册。管理人将

尽快完成本集合计划变更注册工作。变更注册后，基金管理人将在做好本基金日常投资运营工作的同时，加大持续营销工作投入，探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为 。

报告期内，本基金利润分配情况符合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

本托管人复核审查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。

§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：信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	87,936.87	384,582.16
结算备付金		160,541.92	1,923,793.66
存出保证金		2,862.31	6,076.06
交易性金融资产	6.4.7.2	18,850,056.50	16,904,912.93
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		18,850,056.50	16,904,912.93
资产支持证券投资		-	-
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	2,600,013.00	-556.23
应收清算款		102,135.09	18,347,181.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	5,903.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,803,545.69	37,571,894.45
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年6月30日	上年度末 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		84,093.64	18,696,075.07
应付管理人报酬		11,108.04	21,319.33
应付托管费		1,851.37	3,553.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,554.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	154,237.40	161,651.75

负债合计		251,290.45	18,884,153.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	21,173,493.54	18,521,573.90
未分配利润	6.4.7.8	378,761.70	166,167.09
净资产合计		21,552,255.24	18,687,740.99
负债和净资产总计		21,803,545.69	37,571,894.45

注：报告截止日2025年6月30日，本集合计划份额净值1.0513元，本集合计划总份额20,499,818.94份。

6.2 利润表

会计主体：信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划

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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
一、营业总收入		477,060.47	758,124.75
1.利息收入		69,487.66	62,339.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,817.14	7,702.99
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		60,670.52	54,636.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		631,524.74	662,105.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-62,305.44
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	631,524.74	637,373.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	87,037.78
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-341,349.00	-14,014.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	117,397.07	47,693.86
减：二、营业总支出		155,108.97	195,720.88
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	79,957.88	126,955.69
2.托管费	6.4.10.2.2	13,326.28	21,159.24
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		27.71	68.98
其中：卖出回购金融资产支出		27.71	68.98
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		11.12	1,651.69
8.其他费用	6.4.7.19	61,785.98	45,885.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		321,951.50	562,403.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		321,951.50	562,403.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		321,951.50	562,403.87

6.3 净资产变动表

会计主体：信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划

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 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	18,521,573.90	166,167.09	18,687,740.99
二、本期期初净资产	18,521,573.90	166,167.09	18,687,740.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,651,919.64	212,594.61	2,864,514.25
（一）、综合收益总额	-	321,951.50	321,951.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,651,919.64	-109,356.89	2,542,562.75
其中：1.基金申购款	38,486,069.95	300,434.00	38,786,503.95
2.基金赎回款	-35,834,150.31	-409,790.89	-36,243,941.20
（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	21,173,493.54	378,761.70	21,552,255.24
项 目	上年度可比期间 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	44,037,495.67	-1,309,876.63	42,727,619.04

产			
二、本期期初净资产	44,037,495.67	-1,309,876.63	42,727,619.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,474,574.57	600,743.80	-3,873,830.77
（一）、综合收益总额	-	562,403.87	562,403.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,474,574.57	38,339.93	-4,436,234.64
其中：1.基金申购款	10,894,737.92	-279,157.76	10,615,580.16
2.基金赎回款	-15,369,312.49	317,497.69	-15,051,814.80
（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	39,562,921.10	-709,132.83	38,853,788.27

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:

万颖	张毅	俞仕龙
————————	————————	————————
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

信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划由信达满堂红主题投资集合资产管理计划变更而来。管理人信达证券股份有限公司于2022年2月14日发布《关于信达睿益鑫享混

合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告》。根据该公告，自2022年2月14日起，信达满堂红主题投资集合资产管理计划正式更名为信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划，《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同》《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划托管协议》《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件正式生效，原《信达满堂红主题投资集合资产管理计划资产管理合同》《信达满堂红主题投资集合资产管理计划说明书》和《信达满堂红主题投资集合资产管理计划风险揭示书》等法律文件同时失效。信达证券于2025年8月4日发布《信达证券股份有限公司关于信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告》，本集合计划自合同变更生效日起延长存续期至2025年9月30日，存续期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的有关规定和《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的比例为0-40%，本集合计划投资于同业存单的比例不超过集合计划资产的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，本集合计划管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本集合计划的业绩比较基准为：中证800指数收益率×40%+中债总财富指数收益率×60%。

本财务报表由管理人于2025年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、

中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同》《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划2025年1月1日至2025年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

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

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行计量，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生工具公允价值变动产生的利得或损失直接计入当期损益。本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留

了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（2）对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，股票的股息、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。

（3）对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2025年6月30日
活期存款	87,936.87
等于：本金	87,920.11
加：应计利息	16.76
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	87,936.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 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	18,608,734.61	192,629.50	18,850,056.50	48,692.39
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	18,608,734.61	192,629.50	18,850,056.50	48,692.39
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		18,608,734.61	192,629.50	18,850,056.50	48,692.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,600,013.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,600,013.00	-

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.04

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	90,306.38
其中：交易所市场	90,306.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,930.98
合计	154,237.40

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	17,930,998.11	18,521,573.90
本期申购	37,260,480.71	38,486,069.95
本期赎回（以“-”号填列）	-34,691,659.88	-35,834,150.31
本期末	20,499,818.94	21,173,493.54

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	705,159.64	-538,992.55	166,167.09
本期期初	705,159.64	-538,992.55	166,167.09
本期利润	663,300.50	-341,349.00	321,951.50
本期基金份额交易产生的变动数	91,989.43	-201,346.32	-109,356.89
其中：基金申购款	2,286,555.40	-1,986,121.40	300,434.00
基金赎回款	-2,194,565.97	1,784,775.08	-409,790.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,460,449.57	-1,081,687.87	378,761.70

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	7,653.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,154.50
其他	9.59
合计	8,817.14

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	139,158.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	492,366.06
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	631,524.74

6.4.7.12.2 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	34,800,956.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,022,010.41
减：应计利息总额	279,603.49
减：交易费用	6,976.59
买卖债券差价收入	492,366.06

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 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	-341,349.00
——股票投资	-
——债券投资	-341,349.00
——资产支持证券投资	-
——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	-341,349.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	117,397.07
合计	117,397.07

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	55.00
账户维护费	17,100.00
合计	61,785.98

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

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

1、本集合计划管理人信达证券根据相关法律法规的规定及《信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，经与托管人中国建设银行协商一致，决定延长本集合计划的存续期限。2025年8月4日，管理人发布《信达证券股份有限公司关于信

达睿益鑫享混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告》，本集合计划的存续期限延长至2025年9月30日。

2、根据《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》的相关要求，为充分保护本集合计划份额持有人的利益，我公司已与我公司控股子公司——信达澳亚基金协商一致，共同推动将本集合计划管理人变更为信达澳亚基金并注册为公募基金事项。我公司已于2025年8月取得中国证监会变更注册批复，管理人将在本集合计划到期前完成变更注册工作。

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

中国信达资产管理股份有限公司（以下简称中国信达）为管理人控股股东。中华人民共和国财政部（以下简称财政部）拟将其所持有的中国信达的股权全部划转至中央汇金投资有限责任公司（以下简称汇金公司），国家金融监督管理总局已正式批准中国信达本次股权变更。具体内容详见管理人于2025年5月9日披露的《信达证券股份有限公司关于控股股东股权结构变更进展情况的公告》（2025-010）。

2025年6月7日，管理人发布《信达证券股份有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告》，表明公司已于近日取得中国证券监督管理委员会批复（证监许可〔2025〕1175号），核准汇金公司成为公司实际控制人。本次划转完成后，公司控股股东仍为中国信达，实际控制人将由财政部变更为汇金公司。

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
信达证券股份有限公司	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国建设银行股份有限公司	集合计划托管人、集合计划销售机构
信达期货有限公司	集合计划管理人的全资子公司

注：此处列示与本集合计划有重大利害关系的各个关联方。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		股票成交总额的比例		股票成交总额的比例
信达证券股份有限公司	-	-	32,136,382.97	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
信达证券股份有限公司	68,215,900.15	100.00%	35,603,934.73	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
信达证券	502,090,000.00	100.00%	664,080,000.00	100.00%

股份有限公司				

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券股份有限公司	11,079.56	100.00%	90,306.38	100.00%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券股份有限公司	20,423.91	100.00%	60,079.58	100.00%

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 2025年1月1日至2025年6月30日	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管理费	79,957.88	126,955.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,714.76	36,093.26
应支付基金管理人的净管理费	68,243.12	90,862.43

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷当年天数

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人收到划款指令后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	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托管费	13,326.28	21,159.24

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
基金合同生效日（2022年2月14日）持有的基金份额	607,067.03	607,067.03
报告期初持有的基金份额	6,425,167.79	6,425,167.79
报告期间申购/买入总份额	12,014,803.42	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,425,167.79	0.00
报告期末持有的基金份额	12,014,803.42	6,425,167.79
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	58.61%	16.77%

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

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 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
信达期货	1,897,236.54	9.25%	1,897,236.54	10.58%

有限公司				

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 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
中国建设银行股份有限公司	87,936.87	7,653.05	101,159.29	2,313.37

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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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

本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本集合计划本报告期末无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险等。本集合计划管理人制定了相应的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。

本集合计划管理人根据全面性原则、全员原则、适应性原则、合理性原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的风险管理体系，建立了董事会--总经理办公会--资产管理业务投资决策委员会--资产管理事业部--大集合业务部多层级决策体系，按照授权原则有效控制风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险主要是指本集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成集合计划资产损失的风险。本集合计划的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评估来控制信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,816,151.67	1,019,111.23
合计	1,816,151.67	1,019,111.23

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	823,051.00	7,144,971.81
AAA以下	-	-
未评级	16,210,853.83	8,740,829.89
合计	17,033,904.83	15,885,801.70

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险主要包括：

（1）在某些情况下如果本集合计划持有的某些投资品种的流动性不佳、交易量不足，将会导致证券交易的执行难度提高，例如该投资品种的买入成本提高，或者不能迅速、低成本地变现，从而对本集合计划财产造成不利的影响。

（2）本集合计划的运作方式为契约型开放式，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。

一般情况下，本集合计划拟投资的资产类别具有较好的流动性，但是在特殊市场环境下本集合计划仍有可能出现流动性不足的情形。本集合计划将严格控制投资于流动受

限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。本集合计划管理人还将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。同时，本集合计划管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。本集合计划规模将随着投资者的申购和赎回而不断波动。若出现巨额赎回，导致本集合计划的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售证券，将会使本集合计划资产净值受到不利影响。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与集合计划合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本集合计划主要投资于集合计划合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本集合计划投资种类包括交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应 的利率风险。本集合计划的基金管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控， 并通过调整投资组合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2025年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	87,936.87	-	-	-	-	-	87,936.87
结算备付金	160,541.92	-	-	-	-	-	160,541.92
存出保证金	2,862.31	-	-	-	-	-	2,862.31
交易性金融资产	-	-	2,639,202.67	14,648,178.08	1,562,675.75	-	18,850,056.50
买入返售金融资产	2,600,013.00	-	-	-	-	-	2,600,013.00
应收清算款	-	-	-	-	-	102,135.09	102,135.09
资产总计	2,851,354.10	-	2,639,202.67	14,648,178.08	1,562,675.75	102,135.09	21,803,545.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	84,093.64	84,093.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,108.04	11,108.04
应付托管费	-	-	-	-	-	1,851.37	1,851.37
其他负债	-	-	-	-	-	154,237.40	154,237.40
负债总计	-	-	-	-	-	251,290.45	251,290.45
利率	2,851,354.10	-	2,639,202.67	14,648,178.0	1,562,675.75	-149,155.36	21,552,255.2

敏感度缺口				8			4
上年度末2024年12月31日	**1个月以内**	**1-3个月**	**3个月-1年**	**1-5年**	**5年以上**	**不计息**	**合计**
资产							
货币资金	384,582.16	-	-	-	-	-	384,582.16
结算备付金	1,923,793.66	-	-	-	-	-	1,923,793.66
存出保证金	6,076.06	-	-	-	-	-	6,076.06
交易性金融资产	1,019,111.23	-	7,144,971.81	-	8,740,829.89	-	16,904,912.93
买入返售金融资产	-556.23	-	-	-	-	-	-556.23
应收清算款	-	-	-	-	-	18,347,181.89	18,347,181.89
应收申购款	-	-	-	-	-	5,903.98	5,903.98
资产总计	3,333,006.88	-	7,144,971.81	-	8,740,829.89	18,353,085.87	37,571,894.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,696,075.07	18,696,075.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,319.33	21,319.33
应付	-	-	-	-	-	3,553.24	3,553.24

托管费							
应交税费	-	-	-	-	-	1,554.07	1,554.07
其他负债	-	-	-	-	-	161,651.75	161,651.75
负债总计	-	-	-	-	-	18,884,153.46	18,884,153.46
利率敏感度缺口	3,333,006.88	-	7,144,971.81	-	8,740,829.89	-531,067.59	18,687,740.99

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	市场利率上升25个基点	-92,906.93	-295,558.05
	市场利率下降25个基点	93,503.47	300,850.11

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。本集合计划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

本集合计划所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	18,850,056.50	87.46	16,904,912.93	90.46
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,850,056.50	87.46	16,904,912.93	90.46

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

第一层次	823,051.00	980,998.77
第二层次	18,027,005.50	15,923,914.16
第三层次	-	-
合计	18,850,056.50	16,904,912.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划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股票和债券，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，本集合计划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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本集合计划本报告期末无第三层次公允价值变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末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

无。

§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	18,850,056.50	86.45

	其中：债券	18,850,056.50	86.45
	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	2,600,013.00	11.92
	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	248,478.79	1.14
8	其他各项资产	104,997.40	0.48
9	合计	21,803,545.69	100.00

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

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 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无港股通投资股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期未投资股票。

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

本集合计划本报告期未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期未投资股票。

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	18,027,005.50	83.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	823,051.00	3.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,850,056.50	87.46

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	019755	24国债19	145,000	14,648,178.08	67.97
2	019758	24国债21	18,000	1,816,151.67	8.43
3	019753	24国债17	15,000	1,562,675.75	7.25
4	110059	浦发转债	7,300	823,051.00	3.82

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本集合计划在投资股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

报告期内，本集合计划未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

否。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,862.31
2	应收清算款	102,135.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	104,997.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	823,051.00	3.82

7.12.5 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。

7.12.6 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有尾差。

§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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
190	107,893.78	14,902,549.46	72.70%	5,597,269.48	27.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	478,019.60	2.33%

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	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年2月14日)基金份额总额	3,135,072.14
本报告期期初基金份额总额	17,930,998.11
本报告期基金总申购份额	37,260,480.71
减：本报告期基金总赎回份额	34,691,659.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,499,818.94

§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，本集合计划未召开份额持有人大会。

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，本集合计划管理人无重大人事变动。

本报告期内，本集合计划托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本集合计划管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本集合计划管理人的基金投资策略严格遵循本集合计划招募说明书及其更新中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本集合计划聘用北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）负责本集合计划审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

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

本集合计划本报告期内，管理人及其高级管理人员在开展资产管理业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本集合计划本报告期内，托管人及其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	
信达证券	2	-	-	11,079.56	100.00%	-

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
信达证券	68,215,900.15	100.00%	502,090,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	信达睿益鑫享混合型集合资	中国证监会的指定媒介	2025-02-07

	产管理计划暂停申购、定期定额投资公告		
2	关于信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会的指定媒介	2025-02-13
3	信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新（2025年2月）	中国证监会的指定媒介	2025-02-13
4	信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同（更新）	中国证监会的指定媒介	2025-02-13
5	信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划招募说明书（2025年2月）	中国证监会的指定媒介	2025-02-13
6	信达证券股份有限公司关于控股股东股权结构变更暨公司实际控制人变更的提示性公告	中国证监会的指定媒介	2025-02-15
7	信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划恢复申购、定期定额投资公告	中国证监会的指定媒介	2025-02-20
8	信达证券股份有限公司关于信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划在直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会的指定媒介	2025-04-03
9	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（2025年第一季度）的公告	中国证监会的指定媒介	2025-04-17

§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	2025/01/01-2025/03/04,2025/03/10-2025/06/30	6,425,167.79	12,014,803.42	6,425,167.79	12,014,803.42	58.61%
	2	2025/03/05-2025/04/07	0.00	14,408,261.29	14,408,261.29	0.00	0.00%
产品特有风险							
本集合计划在报告期内存在单一投资者持有份额达到或超过集合计划总份额20%的情况，可能面临巨额赎回情况，可能导致：（1）如果集合计划出现巨额赎回，集合计划在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回，将对投资者的赎回办理进度造成影响；（2）管理人为应对巨额赎回被迫抛售资产，则可能使集合计划资产净值受到不利影响，影响集合计划的投资运作和收益水平；（3）巨额赎回后，集合计划资产规模过小，可能导致部分资产投资比例被动超标、投资受限等而不得不被动调整，从而无法有效实现资产管理合同约定的投资目的及投资策略。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、为更好地服务本集合计划的投资者，在切实保护现有份额持有人利益的前提下，本集合计划延长存续期至2025年9月30日。

2、2025年6月7日，管理人发布《信达证券股份有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告》，表明公司已于近日取得中国证券监督管理委员会批复（证监许可〔2025〕1175号），核准汇金公司成为公司实际控制人。本次划转完成后，公司控股股东仍为中国信达，实际控制人将由财政部变更为汇金公司。

3、根据《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》的相关要求，为充分保护本集合计划份额持有人的利益，我公司已与我公司控股子公司——信达澳亚基金协商一致，共同推动将本集合计划管理人变更为信达澳亚基金并注册为公募基金事项。我公司已于2025年8月取得中国证监会变更注册批复，管理人将在本集合计划到期前完成变更注册工作。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会同意合同变更的文件

2、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划资产管理合同及其更新

3、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划托管协议

4、信达睿益鑫享混合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

12.2 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8层

12.3 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
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

二〇二五年八月二十九日