

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 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 2026 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	5
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	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
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	9
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40

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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	44
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 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	439,191,069.72 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	325,176,883.89 份	114,014,185.83 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 层 2903 单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.integrity-funds.com
基金中期报告置备地点	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 21 层
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 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 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	4,770,542.57	1,569,920.04
本期利润	4,060,056.54	1,313,996.17
加权平均基金份 额本期利润	0.0112	0.0101
本期加权平均净 值利润率	1.02%	0.92%
本期基金份额净 值增长率	1.01%	0.91%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	34,366,259.45	11,152,047.66
期末可供分配基 金份额利润	0.1057	0.0978

期末基金资产净值	359,949,152.89	125,316,032.57
期末基金份额净值	1.1069	1.0991
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	13.32%	12.36%

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
过去三个月	0.43%	0.01%	0.38%	0.01%	0.05%	0.00%
过去六个月	1.01%	0.01%	0.84%	0.01%	0.17%	0.00%
过去一年	1.61%	0.01%	1.60%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三年	7.77%	0.02%	5.90%	0.01%	1.87%	0.01%
自基金合同生效起至今	13.32%	0.02%	9.12%	0.01%	4.20%	0.01%

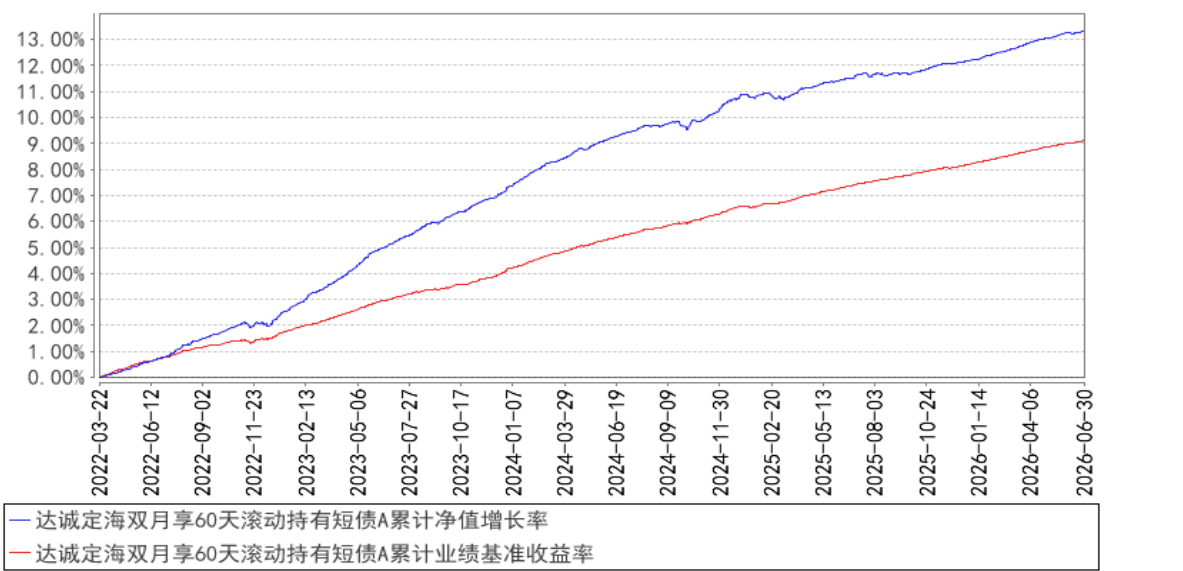
达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

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
过去三个月	0.38%	0.01%	0.38%	0.01%	0.00%	0.00%
过去六个月	0.91%	0.01%	0.84%	0.01%	0.07%	0.00%
过去一年	1.40%	0.01%	1.60%	0.01%	-0.20%	0.00%
过去三年	7.13%	0.02%	5.90%	0.01%	1.23%	0.01%
自基金合同生效起	12.36%	0.02%	9.12%	0.01%	3.24%	0.01%

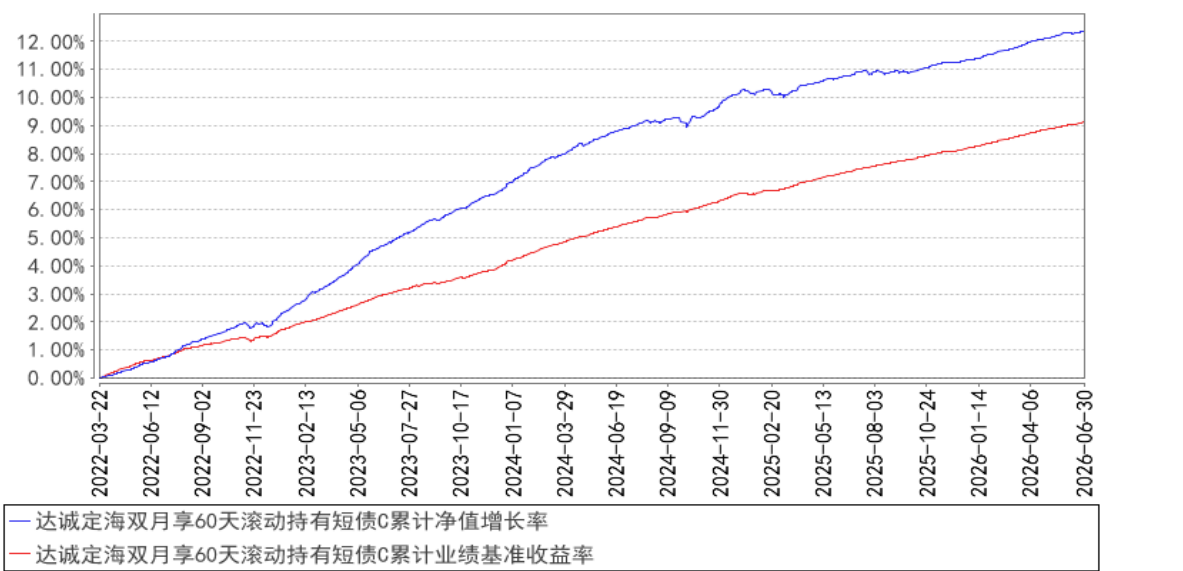
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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		
何盼盼	本基金的基金经理	2025 年 10 月 15 日	-	3 年	何盼盼女士，硕士。拥有 14 年金融相关行业从业经验，曾任平安利顺货币经纪有限责任公司货币经纪人；嘉兴银行股份有限公司金融市场部资管中心投资经理、资产管理部投资经理。现任达诚基金管理有限公司基金经理。

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遵规守信情况的说明

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，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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

2026 年二季度，全球经济延续温和复苏态势，但增长动能较一季度有所走弱。海外方面，美以伊冲突推动全球通胀再度走高，全球能源贸易格局加速重构，主要央行维持谨慎观望态度。国内方面，二季度经济走势整体平稳，高技术产业保持较快增长，出口延续高景气，但投资和消费两大内需指标同步走弱。

债券市场方面，2026 年上半年债市走出超预期上涨行情。二季度债市交易信心逐步恢复，基金从一季度的票息防守策略转向快速追涨长端利率债。10 年期国债收益率进一步下行，最低一度下探至 1.70%附近。市场整体在流动性宽松、经济温和复苏、供需错位等因素作用下，呈现“长端领涨、短端稳健”的“牛平”特征。信用债方面，中长久期及二永类利率品种迎来补涨，整体表现优于短端品种。

报告期内，本基金紧密围绕“严格控制风险、实现资产长期稳健增值”的投资目标，基于对

宏观经济走势、货币政策取向及债券市场运行节奏的判断，采取了以下投资策略：

1. 久期管理方面。本基金根据资金面变化和市场利率走势，在短端利率下行阶段适度拉长组合久期至中短期限，以获取收益率下行带来的资本利得；在 6 月资金面边际收紧、短端利率上行期间，及时缩短组合久期，降低利率波动对组合净值的冲击。通过灵活的久期管理，较好地控制了组合的利率风险敞口。

2. 杠杆策略方面。报告期内，本基金在 4 月至 5 月资金面持续宽松期间，适度维持一定的杠杆水平，利用资金成本与债券收益率之间的套息空间增厚组合收益。进入 6 月后，随着资金利率向政策利率回归、DR001 和 DR007 稳定处于政策利率上方，本基金适度降低了组合杠杆水平，以防范资金面波动带来的流动性风险。

3. 流动性管理方面。报告期内，本基金密切跟踪资金面变化和机构行为变化，在 6 月资金面收紧、部分短债基金遭遇赎回压力期间，本基金凭借充裕的流动性储备较好地平稳度过了市场波动，未出现流动性压力。

4. 风险控制方面。本基金坚持中高等级信用债为主的配置方向，严格规避信用下沉风险。在信用债投资中，重点选择 AA+及以上评级的短期品种，分散化配置以降低个券集中度风险。在利率风险管理上，坚持短久期运作，将组合久期控制在合理范围内，降低利率波动对组合净值的冲击。在流动性风险管理上，保持高流动性资产占比，确保组合在极端市场环境下的抗风险能力。

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 1.1069 元，本报告期份额净值增长率为 1.01%；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 基金份额净值为 1.0991 元，本报告期份额净值增长率为 0.91%，同期业绩比较基准增长率为 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，货币政策预计将继续保持适度宽松基调。三季度预计将是年内政府债券供给高峰，货币政策将与财政政策密切配合。债券市场方面，短端利率在资金面呵护下仍有下行空间；同业存单利率在跨季压力消退后有望向合理中枢回归。本基金将继续坚持短久期、高信用等级稳健投资策略，紧密跟踪宏观经济、货币政策和市场资金面的变化，灵活调整组合的久期、杠杆和类属配置，在严控风险的前提下力争为持有人获取稳健的投资回报。

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

本基金本报告期末进行利润分配，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遵规守信、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	352,438.13	387,624.95
结算备付金		9,588,815.77	11,557,501.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	508,845,178.79	690,559,363.64
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		508,845,178.79	690,559,363.64
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	-	-
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		656,028.00	360,909.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		519,442,460.69	702,865,399.50
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		32,008,275.78	78,004,265.98

应付清算款		-	-
应付赎回款		1,857,424.63	892,153.59
应付管理人报酬		122,386.15	163,451.64
应付托管费		20,397.72	27,241.93
应付销售服务费		21,078.55	30,088.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35,943.78	53,743.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	111,768.62	92,838.98
负债合计		34,177,275.23	79,263,784.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	439,191,069.72	570,023,047.26
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	46,074,115.74	53,578,568.08
净资产合计		485,265,185.46	623,601,615.34
负债和净资产总计		519,442,460.69	702,865,399.50

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 439,191,069.72 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 325,176,883.89 份，基金份额净值 1.1069 元；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 基金份额总额 114,014,185.83 份，基金份额净值 1.0991 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,992,014.51	16,020,928.88
1. 利息收入		36,129.35	53,255.04
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,142.59	40,068.70
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		4,986.76	13,186.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,922,295.06	31,116,276.83
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	7,928,633.00	31,292,690.87

资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	303,255.49
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-6,337.94	-479,669.53
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	-966,409.90	-15,148,602.99
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	-	-
减：二、营业总支出		1,617,961.80	6,213,251.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	808,447.90	2,427,017.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,741.37	404,502.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	142,175.73	356,597.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		403,648.43	2,814,827.44
其中：卖出回购金融资产 支出		403,648.43	2,814,827.44
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13,812.80	87,568.58
8. 其他费用	6.4.7.23	115,135.57	122,738.35
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		5,374,052.71	9,807,676.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		5,374,052.71	9,807,676.92
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		5,374,052.71	9,807,676.92

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	570,023,047.26	53,578,568.08	623,601,615.34
二、本期期初净资产	570,023,047.26	53,578,568.08	623,601,615.34
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-130,831,977.54	-7,504,452.34	-138,336,429.88
(一)、综合收益总额	-	5,374,052.71	5,374,052.71
(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)	-130,831,977.54	-12,878,505.05	-143,710,482.59
其中：1. 基金申购款	63,402,620.70	6,308,039.02	69,710,659.72
2. 基金赎回款	-194,234,598.24	-19,186,544.07	-213,421,142.31
(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	439,191,069.72	46,074,115.74	485,265,185.46
项目	上年度可比期间 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 (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 (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	-	-26,696,550.15	-26,696,550.15

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	945,692,052.10	83,124,638.77	1,028,816,690.87

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 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。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	351,577.18
等于：本金	351,326.38
加：应计利息	250.80
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	860.95
等于：本金	860.94
加：应计利息	0.01
减：坏账准备	-
合计	352,438.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 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	-	-	-	-
	银行间市场	504,040,843.97	5,341,853.79	508,845,178.79	-537,518.97
	合计	504,040,843.97	5,341,853.79	508,845,178.79	-537,518.97
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		504,040,843.97	5,341,853.79	508,845,178.79	-537,518.97

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 2026 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	8,249.07
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,249.07
应付利息	-
预提费用	103,519.55
合计	111,768.62

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	413,554,945.53	413,554,945.53
本期申购	46,475,725.48	46,475,725.48
本期赎回（以“-”号填列）	-134,853,787.12	-134,853,787.12
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	325,176,883.89	325,176,883.89

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,468,101.73	156,468,101.73
本期申购	16,926,895.22	16,926,895.22
本期赎回（以“-”号填列）	-59,380,811.12	-59,380,811.12
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	114,014,185.83	114,014,185.83

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	38,302,284.49	1,323,937.58	39,626,222.07
本期期初	38,302,284.49	1,323,937.58	39,626,222.07
本期利润	4,770,542.57	-710,486.03	4,060,056.54
本期基金份额交易产生的变动数	-8,706,567.61	-207,442.00	-8,914,009.61
其中：基金申购款	4,604,838.32	115,973.98	4,720,812.30
基金赎回款	-13,311,405.93	-323,415.98	-13,634,821.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,366,259.45	406,009.55	34,772,269.00

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	13,443,230.16	509,115.85	13,952,346.01
本期期初	13,443,230.16	509,115.85	13,952,346.01
本期利润	1,569,920.04	-255,923.87	1,313,996.17
本期基金份额交易产生的变动数	-3,861,102.54	-103,392.90	-3,964,495.44
其中：基金申购款	1,543,538.08	43,688.64	1,587,226.72
基金赎回款	-5,404,640.62	-147,081.54	-5,551,722.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,152,047.66	149,799.08	11,301,846.74

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,525.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	164.41
结算备付金利息收入	18,452.63
其他	-
合计	31,142.59

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,433,013.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-504,380.87
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	7,928,633.00

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	382,486,193.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	376,131,926.81
减：应计利息总额	6,854,571.75
减：交易费用	4,076.00
买卖债券差价收入	-504,380.87

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

无。

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

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-6,337.94

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-966,409.90
股票投资	-
债券投资	-966,409.90
资产支持证券投资	-
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	-966,409.90

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,316.02
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	115,135.57

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、关联关系

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	808,447.90	2,427,017.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	393,546.47	915,051.80
应支付基金管理人的净管理费	414,901.43	1,511,965.71

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,741.37	404,502.99

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 滚动持有短债 A	达诚定海双月享 60 天 滚动持有短债 C	合计
达诚基金管理有限公司	—	15.64	15.64
上海银行股份有限公司	—	—	—
合计	—	15.64	15.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 滚动持有短债 A	达诚定海双月享 60 天 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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	—	—
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	—	—
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 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	—	—

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	0.005	15,629.06	0.004

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	351,577.18	12,525.55	818,074.00	12,778.62

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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 2026 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 32,008,275.78 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
012582858	25 昆明交通 SCP007	2026 年 7 月 2 日	101.39	140,000	14,194,040.00
102484985	24 津保投 MTN004	2026 年 7 月 2 日	102.20	200,000	20,440,900.82
合计				340,000	34,634,940.82

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 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	121,098,293.69	262,663,034.53
合计	121,098,293.69	262,663,034.53

注：未评级债券为短期融资券。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	1,335,009.97	595,765.58
合计	1,335,009.97	595,765.58

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	110,430,023.67	133,169,698.63
AAA 以下	15,477,846.58	15,913,368.49
未评级	260,504,004.88	278,217,496.41
合计	386,411,875.13	427,300,563.53

注：未评级债券为政策性金融债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

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 2026 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	352,438.13	-	-	-	352,438.13
结算备付金	9,588,815.77	-	-	-	9,588,815.77
交易性金融资产	432,822,716.48	76,022,462.31	-	-	508,845,178.79
应收申购款	-	-	-	656,028.00	656,028.00
资产总计	442,763,970.38	76,022,462.31	-	656,028.00	519,442,460.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,857,424.63	1,857,424.63
应付管理人报酬	-	-	-	122,386.15	122,386.15
应付托管费	-	-	-	20,397.72	20,397.72
卖出回购金融资产款	32,008,275.78	-	-	-	32,008,275.78
应付销售服务费	-	-	-	21,078.55	21,078.55
应交税费	-	-	-	35,943.78	35,943.78
其他负债	-	-	-	111,768.62	111,768.62
负债总计	32,008,275.78	-	-	2,168,999.45	34,177,275.23
利率敏感度缺口	410,755,694.60	76,022,462.31	-	-1,512,971.45	485,265,185.46
上年度末 2025 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	387,624.95	-	-	-	387,624.95
结算备付金	11,557,501.66	-	-	-	11,557,501.66
交易性金融资产	549,728,641.66	140,428,854.91	401,867.07	-	690,559,363.64
应收申购款	-	-	-	360,909.25	360,909.25
资产总计	561,673,768.27	140,428,854.91	401,867.07	360,909.25	702,865,399.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	892,153.59	892,153.59
应付管理人报酬	-	-	-	163,451.64	163,451.64
应付托管费	-	-	-	27,241.93	27,241.93
卖出回购金融资产款	78,004,265.98	-	-	-	78,004,265.98
应付销售服务费	-	-	-	30,088.82	30,088.82
应交税费	-	-	-	53,743.22	53,743.22
其他负债	-	-	-	92,838.98	92,838.98
负债总计	78,004,265.98	-	-	1,259,518.18	79,263,784.16
利率敏感度缺口	483,669,502.29	140,428,854.91	401,867.07	-898,608.93	623,601,615.34

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,141,397.13	1,140,122.86
	市场利率上升 25 个基点	-1,141,397.13	-1,140,122.86

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-

第二层次	508,845,178.79	690,559,363.64
第三层次	—	—
合计	508,845,178.79	690,559,363.64

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 2026 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	508,845,178.79	97.96
	其中：债券	508,845,178.79	97.96
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

7	银行存款和结算备付金合计	9,941,253.90	1.91
8	其他各项资产	656,028.00	0.13
9	合计	519,442,460.69	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,298,871.23	8.30
	其中：政策性金融债	30,246,986.30	6.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	121,098,293.69	24.96
6	中期票据	276,059,516.12	56.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,335,009.97	0.28
9	其他	70,053,487.78	14.44
10	合计	508,845,178.79	104.86

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	102481669	24 安瑞科控 MTN001	300,000	30,324,650.96	6.25
2	260401	26 农发 01	300,000	30,246,986.30	6.23
3	102483555	24 景国资 MTN003	200,000	20,942,141.37	4.32
4	2123016	21 阳光财险	200,000	20,732,356.16	4.27
5	102383336	23 津城建 MTN015	200,000	20,704,602.74	4.27

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

无。

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

根据产品合同，本基金可投资国债期货。本基金投资国债期货，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、或降低建仓或调仓过程中的冲击成本。本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行、阳光财产保险股份有限公司和中国工商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	656,028.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	656,028.00

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	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A	9,909	32,816.32	9.18	0.00	325,176,874.71	100.00
达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C	4,917	23,187.75	1,000.18	0.00	114,013,185.65	100.00
合计	14,253	30,813.94	1,009.36	0.00	439,190,060.36	100.00

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A	15,831.05	0.005
	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C	10,194.04	0.009
	合计	26,025.09	0.006

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 (2022 年 3 月 22 日) 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	413,554,945.53	156,468,101.73
本报告期基金总申购份额	46,475,725.48	16,926,895.22
减：本报告期基金总赎回份额	134,853,787.12	59,380,811.12
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	325,176,883.89	114,014,185.83

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，本基金管理人无重大人事变动。

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人从业人员未受到任何调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	-	-	540.12	99.15	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	4.63	0.85	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

10.7.2 基金租用或者通过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	
	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	10,399,056.	100.00	2,000,000.00	30.17	-	-

券股份 有限公 司	00					
中信证 券股份 有限公 司	-	-	4,630,000.00	69.83	-	-

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	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金 4 季报	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上证报	2026 年 1 月 22 日
2	达诚基金 4 季报提示性公告	各家报社	2026 年 1 月 22 日
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 2025 年年报	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上证报	2026 年 3 月 31 日
4	2025 年年报提示性公告	各家报社	2026 年 3 月 31 日
5	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金 2026 年 1 季报	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、上证报	2026 年 4 月 22 日
6	达诚基金管理有限公司 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2026 年 4 月 22 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

无。

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 或客服电话 021-60581258。

达诚基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日