

---

# 信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划

## 2022年第3季度报告

### 2022年09月30日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年7月1日起至2022年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信达月月盈30天持有债券
基金主代码	970129
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月09日
报告期末基金份额总额	576,151,925.90份
投资目标	本集合计划在严格控制投资组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划通过密切跟踪分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，挖掘价值被低估的标的券种。本集合计划采取的投资策略主要包括资产配置策略、固定收益类品质投资策略等。
业绩比较基准	中债总财富（1-3年）指数收益率×85%+一年期定期存款利率（税后）×15%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，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、股票型基金。
基金管理人	信达证券股份有限公司

基金托管人	兴业银行股份有限公司
-------	------------

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”、“本基金”或“信达月月盈30天持有债券”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	4,410,800.91
2. 本期利润	5,483,564.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0102
4. 期末基金资产净值	606,718,075.08
5. 期末基金份额净值	1.0531

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.03%	0.02%	0.87%	0.03%	0.16%	-0.01%
过去六个月	2.30%	0.02%	1.60%	0.03%	0.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.52%	0.02%	1.67%	0.03%	0.85%	-0.01%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年02月09日-2022年09月30日)



### 3.3 其他指标

本集合计划本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王琳	本基金的基金经理、基金经理	2022-02-09	-	5	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。自2021年6月起担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9月起担任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 10 月起担任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 2022 年 2 月起担任信达月月盈 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的基金经理；自 2022 年 5 月起担任信达现金宝货币型集合资产管理计划的基金经理。
--	--	--	--	---

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”为根据公司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”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证券监督管理委员会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3、自2022年10月13日起，本集合计划新增徐华先生为基金经理，本集合计划的基金经理由王琳女士和徐华先生共同担任。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平和利益输送的异常交易，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券市场方面，三季度，受疫情等因素影响，经济修复力度有限，货币政策中性偏松，除去跨季因素，资金面整体偏宽松，R007季度均值1.64%，低于央行7天逆回购利率36BP。利率债收益率整体下行，1年、3年、5年、7年、10年国债收益率分别下行9.7BP、11.5BP、6.9BP、8.2BP、6.0BP，信用债收益率跟随利率债整体下行，AA+评级的3年中票、5年中票、3年城投债、5年城投债、7年城投债收益率分别下行29BP、26BP、23BP、24BP、19BP。

三季度，债券方面，管理人主要配置中短久期、较高票息、信用风险可控的信用债。

前瞻性看，债券方面，美国9月劳动力市场仍相对强劲，美国9月非农就业人数增加26.3万人，高于预期的25.5万人，失业率为3.5%，预期和前值为3.7%，为美联储11月议息会议再次鹰派加息提供了条件，增加人民币贬值、中美利差倒挂以及资本外流压力，或将对债市构成一定扰动。但是，中国9月官方制造业PMI为50.1%，升至扩张区间，预期为49.2%，前值为49.4%；财新制造业PMI录得48.1，较上月回落1.4ppt；官方非制造业PMI为50.6%，环比下降2.0个百分点，仍位于扩张区间，非制造业扩张有所放缓；综合PMI产出指数为50.9%，环比下降0.8个百分点，疫情反复、消费复苏节奏缓慢、地产下行以及出口放缓影响下，经济修复基础并不稳固，国内货币政策预计以我为主，兼顾外部均衡，宽松仍为主调，宽货币+弱信用格局下，资金面仍然偏松，资产荒料将延续。总体来看，美联储因高通胀而持续加息或对债市造成一定扰动，债市收益率曲线在经济基本面下行、政策面和资金面偏宽松的支撑下预计中期震荡下行。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达月月盈30天持有债券基金份额净值为1.0531元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.03%，同期业绩比较基准收益率为0.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本集合计划本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万或基金份额持有人数量不足200人的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	641,666,654.25	91.73
	其中：债券	641,666,654.25	91.73
	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	18,995,538.08	2.72
	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	33,967,996.49	4.86
8	其他资产	4,896,143.75	0.70
9	合计	699,526,332.57	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	32,799,522.41	5.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	184,390,077.02	30.39
5	企业短期融资券	187,999,141.66	30.99
6	中期票据	236,477,913.16	38.98

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	641,666,654.25	105.76

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	102100903	21上饶城投MTN001	200,000	20,789,095.89	3.43
2	102001209	20浏阳城建MTN001	200,000	20,423,479.45	3.37
3	163211	20海国01	200,000	20,416,410.96	3.37
4	012282155	22常德经建SCP001	200,000	20,179,917.81	3.33
5	012282218	22武汉城建SCP002	200,000	20,141,616.44	3.32

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。



本集合计划将关注国内其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许集合计划投资该衍生工具，本集合计划将在履行适当程序后制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期内未参与国债期货，无相关投资评价。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

否。

##### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划本报告期末未持有股票。

##### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,683.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,883,460.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,896,143.75

##### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	472,981,030.10
报告期期间基金总申购份额	356,224,407.40
减：报告期期间基金总赎回份额	253,053,511.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	576,151,925.90

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,823,638.15
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,823,638.15
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.53

注：报告期内管理人持有本集合计划份额无变化。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息****8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

无。

**8.2 报告期内重要信息披露情况**

2022/07/08 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（2022 年二季度）的公告

2022/08/09 信达证券股份有限公司关于信达月月盈 30 天持有期债券型集合资产管理计划新增上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告

2022/08/09 关于信达证券股份有限公司旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告

### 8.3 其他

本集合计划本报告期末未持有信用衍生品。本集合计划信用衍生品投资策略为：管理人将依托于公司整体的信用研究团队，当预期某只债券有较高的违约风险时，可以购买对应债券的信用衍生品来控制标的债券的信用风险冲击。本集合计划按风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易，同时会根据实际情况尽量保持信用衍生品的名义本金与对应标的债券的面值相一致。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件
- 2、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书
- 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
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

### 9.3 查阅方式

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

信达证券股份有限公司

2022年10月26日