

# 信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 2023 年 1 月 1 日起至 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                                | 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合规守信情况的说明              | 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             | 13 |
| 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                 | 14 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 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 |
| §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（基金净值）变动表                        | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 21 |
| §7 投资组合报告                               | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 47 |
| 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       | 48 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 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      | 52 |
| 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   | 52 |
| 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   | 52 |
| 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      | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 53 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 53 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 54 |

|  |    |
|--|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 54 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 54 |
| 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 .....   | 55 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 55 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 55 |
| 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 .....   | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 56 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 56 |
| 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 .....      | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 57 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 57 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 58 |
| 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 ..... | 58 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 58 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 59 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 59 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 59 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 59 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                               |
|------------|-------------------------------|
| 基金名称       | 信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划         |
| 基金简称       | 信达信利六个月持有债券                   |
| 基金主代码      | 970055                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                        |
| 基金合同生效日    | 2021年10月20日                   |
| 基金管理人      | 信达证券股份有限公司                    |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司                    |
| 报告期末基金份额总额 | 49,761,244.79份                |
| 基金合同存续期    | 本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过三年。 |

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。信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”“本基金”或“信达信利六个月持有债券”。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本集合计划在严格控制风险和满足充分流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，努力为投资者实现资产的长期稳定增值。        |
| 投资策略   | 本集合计划的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。       |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%                             |
| 风险收益特征 | 本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场型基金，属于较低风险、较低收益的产品。 |

### 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        | 招商银行股份有限公司           |                             |
| 信息披露负责人 | 姓名                | 万颖                   | 张姗                          |
|         | 联系电话              | 010-63081089         | 0755-83077987               |
|         | 电子邮箱              | wanying@cindasc.com  | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  | 95321             | 95555                |                             |
| 传真      | 010-63080953      | 0755-83195201        |                             |
| 注册地址    | 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |                             |
| 办公地址    | 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |                             |
| 邮政编码    | 100031            | 518040               |                             |
| 法定代表人   | 祝瑞敏               | 缪建民                  |                             |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报              |
| 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          | 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 |

## 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                       |
|               | (2023年01月01日-2023年06月30日) |

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 本期已实现收益              | 540,270.98            |
| 本期利润                 | 956,255.18            |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0193                |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.89%                 |
| 本期基金份额净值增长率          | 2.12%                 |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2023年06月30日) |
| 期末可供分配利润             | 1,274,795.52          |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0256                |
| 期末基金资产净值             | 51,036,040.31         |
| 期末基金份额净值             | 1.0256                |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2023年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率          | 3.41%                 |

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      | 0.21%    | 0.10%       | 0.50%      | 0.08%         | -0.29% | 0.02%  |
| 过去三个月      | 0.32%    | 0.11%       | 0.99%      | 0.08%         | -0.67% | 0.03%  |
| 过去六个月      | 2.12%    | 0.10%       | 2.33%      | 0.08%         | -0.21% | 0.02%  |
| 过去一年       | 0.66%    | 0.10%       | 2.23%      | 0.10%         | -1.57% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 3.41%    | 0.10%       | 4.50%      | 0.11%         | -1.09% | -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



### 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”）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17个省、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，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挂牌上市交易（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，并通过控股子公司信达期货、信风投资、信达创新、信达澳亚和信达国际分别从事期货业务、私募投资基金业务、另类投资业务、基金管理业务和境外业务。

经过多年挖掘、精心培育，信达证券与众多国有企业、民营企业客户建立了良好的合作关系。近年来，信达证券的收入、利润持续提升，同时在专业领域快速成长。投行业务在企业并购重组、产业整合等方面具有竞争优势，多次被上交所评为“资产证券化



业务优秀管理人”；研究业务异军突起，在能源、化工、金融工程等行业形成较强市场影响力，多次获得行业大奖；资产管理业务满足客户多层次资产配置需求，固收及固收+产品规模跻身行业前列，连续三年获得中国最佳券商资管成长“英华奖”；信达澳亚基金中长期投资业绩优秀，荣获“金牛卓越回报奖”等多个奖项。信达证券的专业实力和差异化竞争优势不断增强，为未来发展奠定了坚实基础。

未来信达证券将坚持以客户为中心，不断提升各项业务核心竞争力和市场影响力，增强持续盈利能力和综合实力，成为一家专业能力突出、业务特色鲜明、具备差异化竞争优势的精品投资银行。

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 2023 年 6 月 30 日，旗下存续 7 只已完成公募化改造的大集合计划，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”“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 | 2021-10-20      | -    | 6      | 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 |

|     |               |            |   |   |   |
|-----|---------------|------------|---|---|---|
|     |               |            |   |   | <p>（自2021年6月22日起任职）、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2021年9月15日起任职）、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2021年10月20日起任职）、信达月月盈30天持有期债券型集合资产管理计划基金经理（自2022年2月9日起任职）、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划基金经理（自2022年2月14日起任职）、信达现金宝货币型集合资产管理计划基金经理（自2022年5月9日起任职）。</p> |
| 唐国磊 | 本基金的基金经理、基金经理 | 2022-01-06 | - | 7 | <p>唐国磊，法国巴黎第十一大学物理学博士。2011年6月加入中国国际期货有限公司，历任资产管理部量化分析师、投资经理。2015年6月加入信达证券资产管理事业部，历任量化分析师、投资经理。投资经验较为丰富，曾参与可转债系列、量化对冲系列产品的策略开发和投研工作，在量化投资策略、低风险投资策略方面有较深的研究和投资实践。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</p>                           |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>罚。现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2022年1月6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2022年1月6日起任职）、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8月16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8月16日起任职）。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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、因公司业务发展的需要，自 2023 年 8 月 18 日起，唐国磊先生不再担任本基金的基金经理，本基金的基金经理由王琳女士担任。

#### 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》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

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，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 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，2023 年上半年，债市整体呈现牛市格局，利率债震荡后走牛，信用债收益率基本下行。一季度受经济指标有所回暖、资金面有所收紧影响，利率债震荡上行；3 月以来随着降准、经济环比走弱、资金面转松及降息等影响，利率债收益率整体下行；6 月中旬稳增长政策加码预期带来一定利空扰动，利率快上快下。截至 6 月 30 日，1 年、3 年、5 年、7 年、10 年国债收益率较年初分别下行 22BP、18BP、22BP、19BP、20BP。信用债在经历去年 11 月、12 月的至暗时刻后，信用债收益率大幅飙升，配置价值凸显，随着摊余成本法、混合估值法等平滑波动产品的推出，理财资金端恢复增长，债券配置需求增加，同时，低价信贷挤压债券净发行，优质债券供给减少，债市从担心负债端到资产荒卷土重来，信用债估值持续修复，直至 6 月中旬稳增长政策加码预期引发小幅调整，但整体来看上半年信用债收益率下行。截至 6 月 30 日，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 53BP、54BP、65BP、53BP、53BP。

股票市场方面，出于对疫后经济复苏的强预期，1 月份市场涨幅较大，但从 2 月份开始，主要宽基指数在对经济复苏强度的怀疑中开始调整。特别是 4 月以来多项经济指标低于预期，市场对经济的预期再度转弱，主要宽基指数出现较大调整。由于国内经济内生动力不足，叠加海外 chatgpt 引发的产业浪潮，A 股呈现出明显的结构化行情，与经济总量相关度较低的 TMT 板块以及中特估相关的主题概念板块涨幅较好，其他板块大多处于下跌状态，行情走势比较分化。2023 年上半年，上证指数、深证指数、沪深 300 指数、创业板指涨幅分别为 3.65%、0.1%、-0.75%、-5.61%。

转债市场方面，中证转债指数跟随正股走震荡行情，但整体波动幅度较小，具体表现为在正股上涨阶段的跟涨弹性弱于正股，在正股调整阶段表现较为抗跌，估值被动抬升，展现防御属性。2023 年上半年中证转债指数上涨 3.37%。

上半年，债券方面，管理人主要配置中短久期、中高评级的信用债，并根据市场行

情的变化调整仓位；转债方面，选券方面以低价转债为主，优选基本面良好、估值合理的转债，规避双高转债；股票方面，管理人自下而上精选个股，根据市场景气度、个股基本面等多个维度建立投资组合。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达信利六个月持有债券基金份额净值为1.0256元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.12%，同期业绩比较基准收益率为2.33%。

#### 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，债市方面，经济复苏相对缓慢，货币政策将延续稳中偏松的基调，下半年仍有降息或降准的可能，资产荒格局短期难以逆转，理财和银行等配置压力仍大，预计信用利差仍有压缩空间，利率大幅上行的空间和概率不大，债券投资环境仍偏有利。债市的不确定性来自国内可能出台稳增长政策，但管理人认为目前出台强刺激政策的可能性较小，更多可能是托底，后续管理人会持续关注经济基本面变化、政策节奏和力度预期差及海外市场情况等。

股票市场方面，当前的市场现状是经济复苏相对一般，没有通胀的压力，流动性比较充裕。这种宏观背景和流动性组合很容易体现为主题震荡风格。短期的波动主要来自政策或者政策预期，中期关注美联储降息时点。政策预期强，经济相关度高的板块短期就会表现比较好；政策预期弱，与经济相关性低的主题板块就会表现比较好，有点跷跷板效应。尽管市场震荡，但管理人认为，优秀的公司仍有穿越周期的力量。管理人会坚持自上而下和自下而上相结合的方法进行标的选择。

转债市场方面，宽松的资金面对目前的转债高估值形成支撑，转债价格跟随权益市场波动，但高估值将在一定程度上缩小转债的弹性与博弈空间，转债整体弹性弱于正股。近期新券发行速度加快，新券上市后短期内通常较老券具有更好的性价比，可以挖掘新券上市后的投资机会。如果出现类似 2022 年 4 月或者 12 月转债估值压缩到合理位置的机会，将会加大转债资产的配置。

#### 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有估值委员会，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胜任能力。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

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

### §5 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|------------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                    |                     |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 245,581.08         | 250,503.28          |
| 结算备付金         |            | 502,072.80         | 617,896.45          |
| 存出保证金         |            | 8,228.82           | 4,977.38            |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 61,140,486.02      | 44,855,002.38       |
| 其中：股票投资       |            | 4,205,007.97       | 2,077,761.71        |
| 基金投资          |            | -                  | -                   |
| 债券投资          |            | 54,897,694.82      | 42,777,240.67       |
| 资产支持证券投资      |            | 2,037,783.23       | -                   |
| 贵金属投资         |            | -                  | -                   |
| 其他投资          |            | -                  | -                   |
| 衍生金融资产        |            | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.3    | 1,599,656.27       | 2,199,571.52        |
| 债权投资          |            | -                  | -                   |
| 其中：债券投资       |            | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资      |            | -                  | -                   |
| 其他投资          |            | -                  | -                   |
| 其他债权投资        |            | -                  | -                   |
| 其他权益工具投资      |            | -                  | -                   |
| 应收清算款         |            | 181,709.13         | 41,038.43           |
| 应收股利          |            | -                  | -                   |
| 应收申购款         |            | -                  | -                   |
| 递延所得税资产       |            | -                  | -                   |
| 其他资产          |            | -                  | -                   |
| 资产总计          |            | 63,677,734.12      | 47,968,989.44       |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>         |

|             |         | 2023年06月30日   | 2022年12月31日   |
|-------------|---------|---------------|---------------|
| <b>负债：</b>  |         |               |               |
| 短期借款        |         | -             | -             |
| 交易性金融负债     |         | -             | -             |
| 衍生金融负债      |         | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款   |         | 12,383,702.64 | 6,726,899.94  |
| 应付清算款       |         | 203,937.81    | 50,606.00     |
| 应付赎回款       |         | -             | -             |
| 应付管理人报酬     |         | 29,911.98     | 26,428.36     |
| 应付托管费       |         | 6,409.71      | 5,663.21      |
| 应付销售服务费     |         | -             | -             |
| 应付投资顾问费     |         | -             | -             |
| 应交税费        |         | 4,522.60      | 5,428.70      |
| 应付利润        |         | -             | -             |
| 递延所得税负债     |         | -             | -             |
| 其他负债        | 6.4.7.4 | 13,209.07     | 98,324.05     |
| 负债合计        |         | 12,641,693.81 | 6,913,350.26  |
| <b>净资产：</b> |         |               |               |
| 实收基金        | 6.4.7.5 | 49,761,244.79 | 40,881,837.82 |
| 其他综合收益      |         | -             | -             |
| 未分配利润       | 6.4.7.6 | 1,274,795.52  | 173,801.36    |
| 净资产合计       |         | 51,036,040.31 | 41,055,639.18 |
| 负债和净资产总计    |         | 63,677,734.12 | 47,968,989.44 |

注：报告截止日2023年6月30日，本集合计划份额净值1.0256元，本集合计划总份额49,761,244.79份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|



|                               |          | 2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 2022年01月01日至202<br>2年06月30日 |
|-------------------------------|----------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                |          | 1,299,084.47                | 2,054,955.83                |
| 1.利息收入                        |          | 17,717.58                   | 36,852.28                   |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9  | 4,778.47                    | 8,466.10                    |
| 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                    |          | 12,939.11                   | 28,386.18                   |
| 证券出借利息收入                      |          | -                           | -                           |
| 其他利息收入                        |          | -                           | -                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）              |          | 865,382.69                  | 1,954,458.19                |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10 | 80,729.72                   | -665,666.81                 |
| 基金投资收益                        | 6.4.7.11 | -                           | -                           |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.12 | 750,655.56                  | 2,590,832.22                |
| 资产支持证券投资<br>收益                | 6.4.7.13 | 4,708.10                    | -                           |
| 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 | 29,289.31                   | 29,292.78                   |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认<br>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）         | 6.4.7.17 | 415,984.20                  | 63,645.36                   |
| 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 | -                           | -                           |

|                     |            |            |              |
|---------------------|------------|------------|--------------|
| 减：二、营业总支出           |            | 342,829.29 | 619,770.24   |
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 174,663.56 | 330,261.66   |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 37,427.92  | 70,770.34    |
| 3. 销售服务费            |            | -          | -            |
| 4. 投资顾问费            |            | -          | -            |
| 5. 利息支出             |            | 101,706.78 | 92,202.11    |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 101,706.78 | 92,202.11    |
| 6. 信用减值损失           |            | -          | -            |
| 7. 税金及附加            |            | 2,780.76   | 5,192.05     |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.20   | 26,250.27  | 121,344.08   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 956,255.18 | 1,435,185.59 |
| 减：所得税费用             |            | -          | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 956,255.18 | 1,435,185.59 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -          | -            |
| 六、综合收益总额            |            | 956,255.18 | 1,435,185.59 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目              | 本期                      |        |            |               |
|-----------------|-------------------------|--------|------------|---------------|
|                 | 2023年01月01日至2023年06月30日 |        |            |               |
|                 | 实收基金                    | 其他综合收益 | 未分配利润      | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 40,881,837.82           | -      | 173,801.36 | 41,055,639.18 |
| 加：会计政策变更        | -                       | -      | -          | -             |

|  |               |   |              |               |
|--|---------------|---|--------------|---------------|
| 前期差错更正                                   | -             | - | -            | -             |
| 其他                                       | -             | - | -            | -             |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 40,881,837.82 | - | 173,801.36   | 41,055,639.18 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 8,879,406.97  | - | 1,100,994.16 | 9,980,401.13  |
| （一）、综合收益总额                               | -             | - | 956,255.18   | 956,255.18    |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 8,879,406.97  | - | 144,738.98   | 9,024,145.95  |
| 其中：1.基金申购款                               | 16,549,841.33 | - | 284,120.35   | 16,833,961.68 |
| 2.基金赎回款                                  | -7,670,434.36 | - | -139,381.37  | -7,809,815.73 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -             | - | -            | -             |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -            | -             |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 49,761,244.79 | - | 1,274,795.52 | 51,036,040.31 |

| 项目                                  | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        |              |                |
|-------------------------------------|------------------------------------|--------|--------------|----------------|
|                                     | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 105,758,685.42                     | -      | -176,822.14  | 105,581,863.28 |
| 加：会计政策变更                            | -                                  | -      | -            | -              |
| 前期差错更正                              | -                                  | -      | -            | -              |
| 其他                                  | -                                  | -      | -            | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                     | 105,758,685.42                     | -      | -176,822.14  | 105,581,863.28 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -52,474,388.52                     | -      | 1,184,118.03 | -51,290,270.49 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                  | -      | 1,435,185.59 | 1,435,185.59   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -52,474,388.52                     | -      | -251,067.56  | -52,725,456.08 |
| 其中：1.基金申购款                          | 8,851,132.13                       | -      | 66,038.72    | 8,917,170.85   |
| 2.基金赎回款                             | -61,325,520.65                     | -      | -317,106.28  | -61,642,626.93 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值           | -                                  | -      | -            | -              |

|                  |               |   |              |               |
|------------------|---------------|---|--------------|---------------|
| 变动（净值减少以“-”号填列）  |               |   |              |               |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | -             | - | -            | -             |
| 四、本期期末净资产（基金净值）  | 53,284,296.90 | - | 1,007,295.89 | 54,291,592.79 |

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

信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划由信达信利3号集合资产管理计划变更而来。管理人于2021年10月20日发布了《关于信达信利六个月持有期债券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2021年10月20日起，《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件正式生效，原《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同（二〇二〇年七月）》《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划说明书（二〇二〇年七月）》和《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划风险揭示书（二〇二〇年七月）》等法律文件同时失效。本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的有关规定和《信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债、政府支持机构债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等固定收益类品种、股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）等权益类品种，国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，集合

计划管理人在履行适当程序后，本集合计划可以将其纳入投资范围。本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或变更投资比例限制，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。本集合计划业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%。

本财务报表由管理人于 2023 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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》《信达信利六个月持有期债券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。

#### 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2023年1月1日至2023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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023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 重要会计政策和会计估计

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

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本集合计划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）金融负债分类

本集合计划的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；



(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

## 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 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 245,581.08         |
| 等于：本金        | 245,368.67         |
| 加：应计利息       | 212.41             |
| 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        | 245,581.08 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日 |               |               |               |             |
|---------------|--------------------|---------------|---------------|---------------|-------------|
|               | 成本                 | 应计利息          | 公允价值          | 公允价值变动        |             |
| 股票            | 4,300,449.02       | -             | 4,205,007.97  | -95,441.05    |             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -             | -             | -             |             |
| 债券            | 交易所市场              | 24,894,194.02 | 497,693.59    | 25,257,381.58 | -134,506.03 |
|               | 银行间市场              | 29,223,487.35 | 480,413.24    | 29,640,313.24 | -63,587.35  |
|               | 合计                 | 54,117,681.37 | 978,106.83    | 54,897,694.82 | -198,093.38 |
| 资产支持证券        | 2,000,756.93       | 44,663.23     | 2,037,783.23  | -7,636.93     |             |
| 基金            | -                  | -             | -             | -             |             |
| 其他            | -                  | -             | -             | -             |             |
| 合计            | 60,418,887.32      | 1,022,770.06  | 61,140,486.02 | -301,171.36   |             |

#### 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<br>2023年06月30日 |           |
|----|--------------------|-----------|
|    | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
|    |                    |           |

|       |              |   |
|-------|--------------|---|
| 交易所市场 | 1,599,656.27 | - |
| 银行间市场 | -            | - |
| 合计    | 1,599,656.27 | - |

#### 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内未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年06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      | 8,249.67           |
| 其中：交易所市场    | 6,765.93           |
| 银行间市场       | 1,483.74           |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 4,959.40           |
| 合计          | 13,209.07          |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |               |
|---------------|-------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末          | 40,881,837.82                 | 40,881,837.82 |
| 本期申购          | 16,549,841.33                 | 16,549,841.33 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,670,434.36                 | -7,670,434.36 |
| 本期末           | 49,761,244.79                 | 49,761,244.79 |

**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      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 本期期初           | 885,659.49   | -711,858.13 | 173,801.36   |
| 本期利润           | 540,270.98   | 415,984.20  | 956,255.18   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 223,040.12   | -78,301.14  | 144,738.98   |
| 其中：基金申购款       | 442,416.78   | -158,296.43 | 284,120.35   |
| 基金赎回款          | -219,376.66  | 79,995.29   | -139,381.37  |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -            |
| 本期末            | 1,648,970.59 | -374,175.07 | 1,274,795.52 |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,155.85                      |
| 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 | 3,568.54                      |
| 其他        | 54.08                         |
| 合计        | 4,778.47                      |

**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**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 34,399,729.09                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 34,247,931.49                 |
| 减：交易费用     | 71,067.88                     |
| 买卖股票差价收入   | 80,729.72                     |

**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                      |
|------------------------------|-------------------------|
|                              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 796,264.34              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -45,608.78              |
| 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                           | 750,655.56              |

**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                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 30,743,402.22           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,187,433.61           |
| 减：应计利息总额               | 596,559.86              |
| 减：交易费用                 | 5,017.53                |
| 买卖债券差价收入               | -45,608.78              |

**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**

单位：人民币元

| 项目                       | 本期                      |
|--------------------------|-------------------------|
|                          | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 4,912.14                |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -204.04                 |
| 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                       | 4,708.10                |

**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**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      |
|----------------|-------------------------|
|                | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出资产支持证券成交总额   | -                       |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | -                       |
| 减：应计利息总额       | -                       |
| 减：交易费用         | 204.04                  |
| 资产支持证券投资收益     | -204.04                 |

**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**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |
|---------------|-------------------------|
|               | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 29,289.31               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                       |
| 基金投资产生的股利收益   | -                       |
| 合计            | 29,289.31               |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称      | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 415,984.20              |



|                        |            |
|------------------------|------------|
| ——股票投资                 | -72,552.54 |
| ——债券投资                 | 496,173.67 |
| ——资产支持证券投资             | -7,636.93  |
| ——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                     | 415,984.20 |

#### 6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 4,959.40                      |
| 信息披露费   | -                             |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 汇划手续费   | 2,690.87                      |
| 账户维护费   | 18,000.00                     |
| 其他费用    | 600.00                        |
| 合计      | 26,250.27                     |

## 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，本集合计划无需作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本集合计划无需作披露的资产负债表日后事项。

## 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

本集合计划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          |
|------------|------------------|
| 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 |
| 招商银行股份有限公司 | 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    |

## 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                          | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |                          |
|--------------------|-------------------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|
|                    | 成交金额                          | 占当期<br>股票成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额                               | 占当期<br>股票成<br>交总额<br>的比例 |
| 信达证券<br>股份有限<br>公司 | 70,847,459.38                 | 100.00%                  | 20,036,894.26                      | 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06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 | 30,328,314.26                 | 100.00%        | 107,286,631.80                     | 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06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 |
| 信达证券股份有限公司 | 501,291,000.00                | 100.00%        | 639,033,000.00                     | 100.00%        |

## 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<br>2023年01月01日至2023年06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 | 39,689.28                     | 100.00%    | 6,765.93 | 100.00%      |
| 关联方名       | 上年度可比期间                       |            |          |              |

| 称          | 2022年01月01日至2022年06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 | 24,711.36               | 100.00%    | 5,039.60 | 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 174,663.56                    | 330,261.66                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 66,327.24                     | 122,861.43                         |

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 37,427.92                     | 70,770.34                          |

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划托管费划款指令，集合计划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<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2021年10月20日）持有的基金份额 | 17,000.00                         | 17,000.00                              |
| 报告期初持有的基金份额                 | 5,942,925.93                      | 17,000.00                              |
| 报告期间申购/买入总份额                | 0.00                              | 5,925,925.93                           |
| 报告期间因拆分变动份额                 | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额                 | 5,942,925.93                      | 5,942,925.93                           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比          | 11.94%                            | 14.54%                                 |

|   |  |  |
|---|--|--|
| 例 |  |  |
|---|--|--|

#### 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<br>2023年06月30日 |                  | 上年度末<br>2022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 |
| 信达期货有限公司 | 14,783,165.78      | 29.71%           | 14,783,165.78       | 36.16%           |

#### 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>2023年01月01日至2023年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |          |
|------------|-------------------------------|----------|------------------------------------|----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入   | 期末余额                               | 当期利息收入   |
| 招商银行股份有限公司 | 245,581.08                    | 1,155.85 | 150,916.20                         | 2,911.78 |

#### 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（2023年06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未持有因认购新发/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

截至本报告期末（2023年6月30日），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为2,100,061.29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       |
|-----------|------------------|------------|--------|--------|--------------|
| 102001881 | 20邵阳城投MT<br>N003 | 2023-07-07 | 104.53 | 30,000 | 3,135,888.49 |
| 合计        |                  |            |        | 30,000 | 3,135,888.49 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2023年6月30日），本集合计划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为10,007,457.18元，于2023年7月3日、2023年7月4日到期。该类交易要求本集合计划转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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。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、全员性原则、适应性原则、合理性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——大集合业务部多层次决策体系，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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 11,058,724.91      | 13,243,454.58       |
| 合计     | 11,058,724.91      | 13,243,454.58       |

#### 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投资。

#### 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>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 33,920,118.03      | 17,846,812.55       |
| AAA以下  | 7,896,860.19       | 11,686,973.54       |
| 未评级    | 2,021,991.69       | -                   |
| 合计     | 43,838,969.91      | 29,533,786.09       |

#### 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>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | -                   |
| AAA以下  | 2,037,783.23       | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |



|    |              |   |
|----|--------------|---|
| 合计 | 2,037,783.23 | - |
|----|--------------|---|

#### 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，包括中国境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。

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。

#### 6.4.13.4 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<br>2023<br>年 06<br>月 30<br>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                               |               |              |               |               |            |              |               |
| 银行存款                             | 245,581.08    | -            | -             | -             | -          | -            | 245,581.08    |
| 结算备付金                            | 500,906.10    | -            | -             | -             | -          | 1,166.70     | 502,072.80    |
| 存出保证金                            | 8,228.82      | -            | -             | -             | -          | -            | 8,228.82      |
| 交易性金融资产                          | 2,950,439.64  | 7,216,033.94 | 30,868,759.39 | 15,761,002.21 | 139,242.87 | 4,205,007.97 | 61,140,486.02 |
| 买入返售金融资产                         | 1,599,656.27  | -            | -             | -             | -          | -            | 1,599,656.27  |
| 应收清算款                            | -             | -            | -             | -             | -          | 181,709.13   | 181,709.13    |
| 资产总计                             | 5,304,811.91  | 7,216,033.94 | 30,868,759.39 | 15,761,002.21 | 139,242.87 | 4,387,883.80 | 63,677,734.12 |
| 负债                               |               |              |               |               |            |              |               |
| 卖出回购金融资产款                        | 12,383,702.64 | -            | -             | -             | -          | -            | 12,383,702.64 |
| 应付清算款                            | -             | -            | -             | -             | -          | 203,937.81   | 203,937.81    |
| 应付管理人报酬                          | -             | -            | -             | -             | -          | 29,911.98    | 29,911.98     |
| 应付托管费                            | -             | -            | -             | -             | -          | 6,409.71     | 6,409.71      |

信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告

|                       |               |              |               |               |            |              |               |
|-----------------------|---------------|--------------|---------------|---------------|------------|--------------|---------------|
| 应交税费                  | -             | -            | -             | -             | -          | 4,522.60     | 4,522.60      |
| 其他负债                  | -             | -            | -             | -             | -          | 13,209.07    | 13,209.07     |
| 负债总计                  | 12,383,702.64 | -            | -             | -             | -          | 257,991.17   | 12,641,693.81 |
| 利率敏感度缺口               | -7,078,890.73 | 7,216,033.94 | 30,868,759.39 | 15,761,002.21 | 139,242.87 | 4,129,892.63 | 51,036,040.31 |
| 上年度末 2022 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                    |               |              |               |               |            |              |               |
| 银行存款                  | 250,503.28    | -            | -             | -             | -          | -            | 250,503.28    |
| 结算备付金                 | 616,729.75    | -            | -             | -             | -          | 1,166.70     | 617,896.45    |
| 存出保证金                 | 4,977.38      | -            | -             | -             | -          | -            | 4,977.38      |
| 交易性金融资产               | -             | 2,094,446.25 | 25,552,103.72 | 14,963,964.45 | 166,726.25 | 2,077,761.71 | 44,855,002.38 |
| 买入返售金融资产              | 2,199,571.52  | -            | -             | -             | -          | -            | 2,199,571.52  |
| 应收清算款                 | -             | -            | -             | -             | -          | 41,038.43    | 41,038.43     |
| 资产总计                  | 3,071,781.93  | 2,094,446.25 | 25,552,103.72 | 14,963,964.45 | 166,726.25 | 2,119,966.84 | 47,968,989.44 |
| 负债                    |               |              |               |               |            |              |               |
| 卖出回购金融资产款             | 6,726,899.94  | -            | -             | -             | -          | -            | 6,726,899.94  |
| 应付清算款                 | -             | -            | -             | -             | -          | 50,606.00    | 50,606.00     |
| 应付管理人报酬               | -             | -            | -             | -             | -          | 26,428.36    | 26,428.36     |
| 应付托管                  | -             | -            | -             | -             | -          | 5,663.21     | 5,663.21      |

|         |               |              |               |               |            |              |               |
|---------|---------------|--------------|---------------|---------------|------------|--------------|---------------|
| 费       |               |              |               |               |            |              |               |
| 应交税费    | -             | -            | -             | -             | -          | 5,428.70     | 5,428.70      |
| 其他负债    | -             | -            | -             | -             | -          | 98,324.05    | 98,324.05     |
| 负债总计    | 6,726,899.94  | -            | -             | -             | -          | 186,450.32   | 6,913,350.26  |
| 利率敏感度缺口 | -3,655,118.01 | 2,094,446.25 | 25,552,103.72 | 14,963,964.45 | 166,726.25 | 1,933,516.52 | 41,055,639.18 |

#### 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<br>2023年06月30日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 市场利率上升25个基点        | -84,766.00                  | -94,495.39          |
|    | 市场利率下降25个基点        | 85,095.90                   | 94,964.56           |

#### 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<br>2023年06月30日 |     | 上年度末<br>2022年12月31日 |     |
|----|--------------------|-----|---------------------|-----|
|    | 公允价值               | 占基金 | 公允价值                | 占基金 |
|    |                    |     |                     |     |

|               |               | 资产净<br>值比例<br>(%) |               | 资产净<br>值比例<br>(%) |
|---------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 4,205,007.97  | 8.24              | 2,077,761.71  | 5.06              |
| 交易性金融资产—基金投资  | -             | -                 | -             | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | 54,897,694.82 | 107.57            | 42,777,240.67 | 104.19            |
| 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            | 59,102,702.79 | 115.81            | 44,855,002.38 | 109.25            |

#### 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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 5,985,414.75       | 5,318,323.30        |
| 第二层次          | 55,155,071.27      | 39,536,679.08       |
| 第三层次          | -                  | -                   |

|    |               |               |
|----|---------------|---------------|
| 合计 | 61,140,486.02 | 44,855,002.38 |
|----|---------------|---------------|

#### 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    | 4,205,007.97  | 6.60         |
|    | 其中：股票   | 4,205,007.97  | 6.60         |
| 2  | 基金投资    | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 56,935,478.05 | 89.41        |
|    | 其中：债券   | 54,897,694.82 | 86.21        |
|    | 资产支持证券  | 2,037,783.23  | 3.20         |
| 4  | 贵金属投资   | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资 | -             | -            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 6 | 买入返售金融资产          | 1,599,656.27  | 2.51   |
|   | 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      | 747,653.88    | 1.17   |
| 8 | 其他各项资产            | 189,937.95    | 0.30   |
| 9 | 合计                | 63,677,734.12 | 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 73,207.20    | 0.14         |
| B  | 采矿业              | 282,827.00   | 0.55         |
| C  | 制造业              | 2,372,785.19 | 4.65         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 169,535.00   | 0.33         |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 484,814.58   | 0.95         |
| J  | 金融业              | 446,104.00   | 0.87         |
| K  | 房地产业             | 200,098.00   | 0.39         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 45,178.00    | 0.09         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 130,459.00   | 0.26         |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 4,205,007.97 | 8.24         |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------|------------|----------------------|
| 1  | 300059 | 东方财富 | 18,300 | 259,860.00 | 0.51                 |
| 2  | 600893 | 航发动力 | 5,000  | 211,300.00 | 0.41                 |
| 3  | 300438 | 鹏辉能源 | 4,100  | 196,964.00 | 0.39                 |
| 4  | 600109 | 国金证券 | 17,200 | 149,124.00 | 0.29                 |
| 5  | 300775 | 三角防务 | 4,100  | 138,498.00 | 0.27                 |
| 6  | 301071 | 力量钻石 | 3,000  | 132,000.00 | 0.26                 |
| 7  | 300001 | 特锐德  | 6,300  | 130,914.00 | 0.26                 |
| 8  | 600048 | 保利发展 | 9,400  | 122,482.00 | 0.24                 |
| 9  | 600339 | 中油工程 | 27,700 | 112,739.00 | 0.22                 |
| 10 | 002446 | 盛路通信 | 11,800 | 111,510.00 | 0.22                 |
| 11 | 600062 | 华润双鹤 | 6,100  | 106,262.00 | 0.21                 |
| 12 | 600497 | 驰宏锌锗 | 18,000 | 90,360.00  | 0.18                 |
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 300    | 89,940.00  | 0.18                 |
| 14 | 688019 | 安集科技 | 525    | 86,535.75  | 0.17                 |
| 15 | 688777 | 中控技术 | 1,311  | 82,304.58  | 0.16                 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 3,600  | 80,244.00  | 0.16                 |
| 17 | 603690 | 至纯科技 | 2,300  | 80,132.00  | 0.16                 |
| 18 | 600938 | 中国海油 | 4,400  | 79,728.00  | 0.16                 |
| 19 | 600050 | 中国联通 | 16,500 | 79,200.00  | 0.16                 |
| 20 | 300339 | 润和软件 | 3,300  | 79,068.00  | 0.15                 |
| 21 | 300413 | 芒果超媒 | 2,300  | 78,683.00  | 0.15                 |
| 22 | 002624 | 完美世界 | 4,600  | 77,694.00  | 0.15                 |
| 23 | 002244 | 滨江集团 | 8,800  | 77,616.00  | 0.15                 |
| 24 | 601636 | 旗滨集团 | 9,000  | 77,580.00  | 0.15                 |



|    |        |      |        |           |      |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 25 | 688981 | 中芯国际 | 1,524  | 76,992.48 | 0.15 |
| 26 | 688200 | 华峰测控 | 501    | 76,653.00 | 0.15 |
| 27 | 601669 | 中国电建 | 12,900 | 74,046.00 | 0.15 |
| 28 | 300087 | 荃银高科 | 7,080  | 73,207.20 | 0.14 |
| 29 | 603195 | 公牛集团 | 700    | 67,242.00 | 0.13 |
| 30 | 600760 | 中航沈飞 | 1,260  | 56,700.00 | 0.11 |
| 31 | 300393 | 中来股份 | 4,000  | 56,160.00 | 0.11 |
| 32 | 601668 | 中国建筑 | 9,600  | 55,104.00 | 0.11 |
| 33 | 000338 | 潍柴动力 | 4,400  | 54,824.00 | 0.11 |
| 34 | 600176 | 中国巨石 | 3,800  | 53,808.00 | 0.11 |
| 35 | 603986 | 兆易创新 | 500    | 53,125.00 | 0.10 |
| 36 | 688299 | 长阳科技 | 3,350  | 52,494.50 | 0.10 |
| 37 | 600718 | 东软集团 | 4,900  | 52,234.00 | 0.10 |
| 38 | 688697 | 纽威数控 | 2,022  | 52,228.26 | 0.10 |
| 39 | 688188 | 柏楚电子 | 275    | 51,854.00 | 0.10 |
| 40 | 600600 | 青岛啤酒 | 500    | 51,815.00 | 0.10 |
| 41 | 300251 | 光线传媒 | 6,400  | 51,776.00 | 0.10 |
| 42 | 002812 | 恩捷股份 | 500    | 48,175.00 | 0.09 |
| 43 | 002271 | 东方雨虹 | 1,700  | 46,342.00 | 0.09 |
| 44 | 300347 | 泰格医药 | 700    | 45,178.00 | 0.09 |
| 45 | 601186 | 中国铁建 | 4,100  | 40,385.00 | 0.08 |
| 46 | 300433 | 蓝思科技 | 3,400  | 39,984.00 | 0.08 |
| 47 | 601318 | 中国平安 | 800    | 37,120.00 | 0.07 |
| 48 | 301269 | 华大九天 | 300    | 36,852.00 | 0.07 |
| 49 | 300408 | 三环集团 | 1,000  | 29,350.00 | 0.06 |
| 50 | 601179 | 中国西电 | 5,000  | 27,050.00 | 0.05 |
| 51 | 688008 | 澜起科技 | 460    | 26,413.20 | 0.05 |
| 52 | 002594 | 比亚迪  | 100    | 25,827.00 | 0.05 |
| 53 | 300682 | 朗新科技 | 1,100  | 25,608.00 | 0.05 |
| 54 | 002384 | 东山精密 | 700    | 18,130.00 | 0.04 |
| 55 | 600487 | 亨通光电 | 1,200  | 17,592.00 | 0.03 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额   | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 600258 | 首旅酒店 | 705,239.00 | 1.72               |
| 2  | 600977 | 中国电影 | 614,296.00 | 1.50               |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 604,834.00 | 1.47               |
| 4  | 600048 | 保利发展 | 596,190.00 | 1.45               |
| 5  | 600497 | 驰宏锌锗 | 545,873.00 | 1.33               |
| 6  | 600339 | 中油工程 | 525,996.00 | 1.28               |
| 7  | 688083 | 中望软件 | 476,557.35 | 1.16               |
| 8  | 600109 | 国金证券 | 457,448.00 | 1.11               |
| 9  | 600718 | 东软集团 | 440,274.00 | 1.07               |
| 10 | 688981 | 中芯国际 | 433,281.56 | 1.06               |
| 11 | 601816 | 京沪高铁 | 405,607.00 | 0.99               |
| 12 | 300447 | 全信股份 | 391,202.00 | 0.95               |
| 13 | 300438 | 鹏辉能源 | 386,812.00 | 0.94               |
| 14 | 603690 | 至纯科技 | 382,300.00 | 0.93               |
| 15 | 688037 | 芯源微  | 375,111.54 | 0.91               |
| 16 | 600893 | 航发动力 | 369,217.00 | 0.90               |
| 17 | 688019 | 安集科技 | 357,296.32 | 0.87               |
| 18 | 601995 | 中金公司 | 357,106.00 | 0.87               |
| 19 | 300413 | 芒果超媒 | 351,607.00 | 0.86               |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 343,559.00 | 0.84               |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 600258 | 首旅酒店 | 698,864.00 | 1.70               |
| 2  | 600977 | 中国电影 | 663,145.00 | 1.62               |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 3  | 601816 | 京沪高铁 | 563,327.00 | 1.37 |
| 4  | 600048 | 保利发展 | 532,320.00 | 1.30 |
| 5  | 688083 | 中望软件 | 459,925.46 | 1.12 |
| 6  | 600497 | 驰宏锌锗 | 458,796.00 | 1.12 |
| 7  | 600339 | 中油工程 | 443,528.00 | 1.08 |
| 8  | 601995 | 中金公司 | 426,059.00 | 1.04 |
| 9  | 688037 | 芯源微  | 420,953.38 | 1.03 |
| 10 | 600718 | 东软集团 | 408,040.00 | 0.99 |
| 11 | 300447 | 全信股份 | 396,498.00 | 0.97 |
| 12 | 688981 | 中芯国际 | 396,103.18 | 0.96 |
| 13 | 601155 | 新城控股 | 371,814.00 | 0.91 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 330,254.00 | 0.80 |
| 15 | 300059 | 东方财富 | 328,066.00 | 0.80 |
| 16 | 300294 | 博雅生物 | 327,766.00 | 0.80 |
| 17 | 603690 | 至纯科技 | 319,098.00 | 0.78 |
| 18 | 301236 | 软通动力 | 307,874.00 | 0.75 |
| 19 | 601668 | 中国建筑 | 306,335.00 | 0.75 |
| 20 | 603920 | 世运电路 | 300,052.00 | 0.73 |

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 36,447,730.29 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 34,399,729.09 |

### 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      | 2,938,373.89 | 5.76         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |

|    |           |               |        |
|----|-----------|---------------|--------|
| 4  | 企业债券      | 20,538,600.91 | 40.24  |
| 5  | 企业短期融资券   | 8,120,351.02  | 15.91  |
| 6  | 中期票据      | 21,519,962.22 | 42.17  |
| 7  | 可转债(可交换债) | 1,780,406.78  | 3.49   |
| 8  | 同业存单      | -             | -      |
| 9  | 其他        | -             | -      |
| 10 | 合计        | 54,897,694.82 | 107.57 |

### 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  | 102002033 | 20重庆发展MTN001 | 40,000 | 4,095,934.25 | 8.03         |
| 2  | 102100256 | 21皖投集MTN001  | 40,000 | 4,091,168.00 | 8.02         |
| 3  | 102001881 | 20邵阳城投MTN003 | 30,000 | 3,135,888.49 | 6.14         |
| 4  | 124415    | 13鄂投01       | 30,000 | 3,130,628.55 | 6.13         |
| 5  | 149202    | 20深投05       | 30,000 | 3,076,823.42 | 6.03         |

### 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  | 135599 | 天星10优 | 20,000 | 2,037,783.23 | 3.99         |

### 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

股指期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

## 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

本集合计划管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。

### 7.11.2 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投资，因此无相关投资评价。

## 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

否。

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 | 8,228.82   |
| 2  | 应收清算款 | 181,709.13 |
| 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    | 189,937.95 |

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 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|---|------|------|------|---------|
|---|------|------|------|---------|

| 号  |        |      |            | 比例 (%) |
|----|--------|------|------------|--------|
| 1  | 113037 | 紫银转债 | 273,979.00 | 0.54   |
| 2  | 127032 | 苏行转债 | 272,510.78 | 0.53   |
| 3  | 110079 | 杭银转债 | 161,020.75 | 0.32   |
| 4  | 110043 | 无锡转债 | 157,333.93 | 0.31   |
| 5  | 113065 | 齐鲁转债 | 139,242.87 | 0.27   |
| 6  | 113057 | 中银转债 | 138,125.20 | 0.27   |
| 7  | 110067 | 华安转债 | 132,875.70 | 0.26   |
| 8  | 127039 | 北港转债 | 116,103.42 | 0.23   |
| 9  | 113044 | 大秦转债 | 110,895.52 | 0.22   |
| 10 | 113046 | 金田转债 | 109,529.78 | 0.21   |
| 11 | 110073 | 国投转债 | 64,907.85  | 0.13   |
| 12 | 127042 | 嘉美转债 | 61,776.69  | 0.12   |
| 13 | 113542 | 好客转债 | 42,105.29  | 0.08   |

#### 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 |
| 285      | 174,600.86 | 20,726,091.71 | 41.65% | 29,035,153.08 | 58.35% |

#### 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 | 2,722,196.63 | 5.47%    |

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| 基金合同生效日(2021年10月20日)基金份额总额 | 116,206.34    |
| 本报告期期初基金份额总额               | 40,881,837.82 |
| 本报告期基金总申购份额                | 16,549,841.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 7,670,434.36  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -             |
| 本报告期期末基金份额总额               | 49,761,244.79 |

## §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

1、2023年3月13日，商健先生和俞仕龙先生担任本集合计划管理人副总经理；邓强先生离任本集合计划管理人副总经理。

2、2023年3月14日，俞仕龙先生不再担任管理人资产管理业务的分管领导；本集合计划管理人资产管理业务的分管领导由管理人总经理祝瑞敏女士担任。

3、本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

| 措施 1                  | 内容   |
|-----------------------|--|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 信达证券股份有限公司   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2023 年 6 月 2 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证监会北京监管局   |
| 受到的具体措施类型             | 责令改正   |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 指出管理人在资产管理业务中存在内部控制管理不完善等问题，对管理人采取责令改正的监管措施。   |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 管理人收到监管措施后，高度重视，积极落实相关整改工作，已向北京证监局提交了整改报告。上述监管措施未对管理人资产管理业务的正常投资运作造成重大不利影响。目前，管理人各项资产管理业务平稳运行。 |
| 其他                    | -  |
| 措施 2                  | 内容   |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人时任高级管理人员张延强   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2023 年 6 月 2 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证监会北京监管局   |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 指出管理人在资产管理业务中存在内部控制管理不完善等问题，对管理人采取责令改正的监管措施，并对时任分管资产管理业务的高级管理人员张延强出具了警示函。                      |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 管理人收到监管措施后，高度重视，积极落实相关整改工作，已向北京证监局提交了整改报告。上述监管措施未对管理人资产管理业务的正常投资运作造成重大不利影响。目前，管理人各项资产管理业务平稳    |



|    |     |
|----|-----|
|    | 运行。 |
| 其他 | -   |

### 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      | 70,847,459.38 | 100.00%      | 39,689.28 | 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 | 30,328,314.26 | 100.00%      | 501,291,000.00 | 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  | 信达证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会的指定媒介 | 2023-03-14 |
| 2  | 信达证券股份有限公司资产管理业务分管领导变更公告 | 中国证监会的指定媒介 | 2023-03-15 |
| 3  | 信达证券股份有限公司关于完成工商变更登记的公告  | 中国证监会的指定媒介 | 2023-03-30 |
| 4  | 信达证券股份有限公司关于旗下           | 中国证监会的指定媒介 | 2023-03-31 |

|   |   |            |            |
|---|---|------------|------------|
|   | 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（2023年第一季度）的公告          |            |            |
| 5 | 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在直销渠道开展认申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会的指定媒介 | 2023-05-09 |
| 6 | 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直销作为销售渠道的公告       | 中国证监会的指定媒介 | 2023-05-09 |

## §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              | 2023/01/01-2023/06/30  | 14,783,165.78 | 0.00 | 0.00       | 14,783,165.78 | 29.71% |
| 产品特有风险  |                |                        |               |      |            |               |        |
| <p>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：</p> <p>（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。</p> |                |                        |               |      |            |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023/04/20 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财咨道信息技术有限公司为销售机构的公告

2023/05/09 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上海联泰基金销售有限公司为销售机构的公告

2023/05/16 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北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告

2023/05/19 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北京度小满基金销售有限公司为销售机构的公告

2023/05/26 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奕丰基金销售有限公司为销售机构的公告

2023/06/14 关于信达证券股份有限公司旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告

2023/06/26 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珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告

## §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、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

### 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](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  
二〇二三年八月三十一日