

---

# 信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2022年第2季度报告

### 2022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

报告送出日期:2022年07月21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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年07月20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04月01日起至2022年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信达添利三个月持有债券
基金主代码	970054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年09月15日
报告期末基金份额总额	49,642,576.31份
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。
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

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。信达添利三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“信达添利三个月持有债券”。

### § 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04月01日 - 2022年06月30日）
1. 本期已实现收益	824,894.97
2. 本期利润	781,004.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0119
4. 期末基金资产净值	50,801,532.29
5. 期末基金份额净值	1.0233

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	1.14%	0.04%	1.61%	0.14%	-0.47%	-0.10%
过去六个月	1.77%	0.05%	0.78%	0.15%	0.99%	-0.10%
自基金合同生效起至今	3.09%	0.05%	2.03%	0.13%	1.06%	-0.08%

### 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



### 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	2021-09-15	-	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

					<p>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。</p>
唐国磊	本基金的基金经理、基金经理	2022-01-06	-	6	<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。自2022年1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、信达信利六个月持</p>

					有期债券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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年第二季度，债券市场方面，受疫情、地缘政治冲突等因素影响，经济指标4月下行，5月、6月回暖，货币政策中性偏松，资金面偏宽松，R007季度均值1.85%，低于央行7天逆回购利率25BP，利率债收益率短端下行，中长端小幅上行，1年期国债收益率下行18BP，3年、5年、7年、10年国债收益率分别上行3.4BP、8.0BP、2.3BP、3.3BP，信用债收益率整体下行，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16.8BP、18.95BP、23.01BP、23.7BP、21.44BP。

2022年第二季度，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5月通胀超市场预期，创40年来新高，美联储6月议息会议加息75BP，美联储预计2022年年底联邦基金目标利率达到3.4%，年内还有165BP左右加息空间，或制约央行货币政策放松空间，压制全球风险资产；全国疫情防控形势向好发展，复工复产稳步推进，6月中采制造业PMI、非制造业商务活动指数分别达到50.2、54.7，分别较5月回升0.6、6.9个百分点，均站上50以上的扩张区间，经济温和复苏；国务院常务会议、全国稳定经济大盘等各种会议，推出一系列财政、金融、产业等政策，稳经济、保市场主体、保就业；而且，疫情防控政策也积极根据形势调整，国家卫健委发布第九版新冠肺炎防控方案，缩短隔离期限，工信部宣布取消行程卡“星号”标识，疫情防控政策更加侧重经济增长，上述因素均可能驱动债券市场收益率上行。但疫情仍有反复，并存在长尾效应，在地产板块总体低迷和出口中期放缓压制下，经济修复程度或将有限；同时资金面整体偏宽松，限制收益率上行空间。综上，管理人预计债券市场收益率将在上述多空因素交织中，区间震荡，管理人将采取中短久期策略，并在信用风险可控的前提下进行信用挖掘，坚持票息策略。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，信达添利三个月持有债券基金份额净值为1.0233元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.14%，同期业绩比较基准收益率为1.61%。

#### 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	59,067,425.90	92.58
	其中：债券	59,067,425.90	92.58
	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	4,200,810.79	6.58
	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	471,586.98	0.74
8	其他资产	64,037.88	0.10
9	合计	63,803,861.55	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	2,751,433.15	5.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,051,671.51	19.79
5	企业短期融资券	19,123,882.37	37.64
6	中期票据	27,140,438.87	53.42
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,067,425.90	116.27

## 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	102101996	21株洲云龙MTN002	50,000	5,337,445.21	10.51

2	101776004	17渝惠通MTN001	50,000	5,264,681.10	10.36
3	102000483	20武清国资MTN001	50,000	5,084,330.96	10.01
4	163489	20临城01	50,000	5,031,269.59	9.90
5	152473	20西咸03	50,000	5,020,401.92	9.88

## 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。

### 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	8,296.15
2	应收证券清算款	5,781.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49,960.03
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	64,037.88

**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	72,364,591.04
报告期期间基金总申购份额	9,009,906.72
减：报告期期间基金总赎回份额	31,731,921.45
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	49,642,576.31

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	17,000.00
报告期期间买入/申购总份额	7,412,532.12
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	7,429,532.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	14.97

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2022-04-01	7,412,532.12	7,500,000.00	-
合计			7,412,532.12	7,500,000.00	

注：申购金额大于等于500万元，申购费为1000元/笔。

## § 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 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.2.1 报告期内期重要信息公告情况

2022/4/2 关于信达证券股份有限公司使用自有资金申购信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划的公告

2022/4/20 信达证券股份有限公司资产管理业务分管领导变更公告

2022/5/13 信达证券股份有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理相关销售业务的公告

#### 8.2.2 其他

本报告期内，管理人及其高级管理人员收到监管措施，具体情况如下：

2022 年 4 月 14 日，北京证监局下发《关于对信达证券股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》（〔2022〕69 号），指出管理人在开展 ABS 业务过程中未建立有效的约束制衡机制，ABS 业务开展环节违规，风险管理缺位，部分 ABS 项目存续期信息披露不完整。公司投行业务合规人员配备不足、薪酬管理不健全，投行业务内部控制有效性不足，对同类业务未执行统一标准，合规检查和利益冲突审查不规范。对公司采取责令改正的行政监管措施。

2022 年 4 月 27 日,北京证监局对信达证券时任直接分管投行业务的高级管理人员、信达证券总经理祝瑞敏采取监管谈话的行政监管措施《关于对祝瑞敏采取出具监管谈话监管措施的决定》(〔2022〕77 号)。

2022 年 6 月 2 日,中国证监会《关于对信达证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(行政监管措施〔2022〕27 号),指出管理人存在:未完成香港控股平台的设立。返程参股公司建信国贸(厦门)私募基金管理有限公司未完成清理。未按照《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》(以下简称《境外办法》)的规定修改境外子公司的公司章程。此外,《境外办法》给予了长达 3 年的整改时限,但你公司在整改时限内工作进展缓慢,对相关监管承诺事项的作出和执行较为随意,对监管相关规定的落实明显不够到位。现责令公司改正,并于收到本决定之日起 3 个月内向北京证监局提交整改报告。

2022 年 6 月 2 日,中国证监会下发《关于对祝瑞敏、吴立光采取监管谈话措施的决定》(〔2022〕28 号),祝瑞敏作为公司分管境外子公司的高级管理人员,吴立光作为公司合规负责人,对此违规行为负有领导责任。中国证监会决定对祝瑞敏、吴立光采取监管谈话的行政监管措施。

针对上述监管措施,管理人进行了积极全面的整改,并在吸取教训的基础上,认真梳理各个业务流程,不断加强合规管理和内部控制,努力降低各类风险隐患。上述监管措施不会对管理人的正常经营和财务状况造成重大不利影响。

## §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、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达添利三个月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07月21日