

# 达诚腾益债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：达诚基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.11 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	达诚腾益债券型证券投资基金	
基金简称	达诚腾益债券	
基金主代码	017045	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 14 日	
基金管理人	达诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	914,342,167.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	达诚腾益债券 A	达诚腾益债券 C
下属分级基金的交易代码	017045	017046
报告期末下属分级基金的份额总额	99,054,286.58 份	815,287,880.55 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金债券的投资比例不低于基金资产的 80%，对股票等权益类资产（含存托凭证）、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的投资比例不超过基金资产的 20%。在此约束下，本基金基于风险平价理论寻找股债的相对价值，从而实现股债轮动配置。
业绩比较基准	中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	达诚基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	丁险峰
	联系电话	021-60581280
	电子邮箱	dingxf@integrity-funds.com
客户服务电话	021-60581258	010-60836588
传真	021-60581234	010-60834004
注册地址	上海市虹口区东大名路 1089 号 29 层 2903 单元	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	上海市虹口区东大名路 1089 号 29	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中

	层 2903 单元	信证券大厦 5 层
邮政编码	200080	100125
法定代表人	宋宜农	张佑君

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.integrity-funds.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区东大名路 1089 号 29 层 2903 单元

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信中证投资服务有限责任公司	广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	达诚腾益债券 A	达诚腾益债券 C
本期已实现收益	2,320,833.96	30,179,030.70
本期利润	8,907,432.47	37,135,695.54
加权平均基金份 额本期利润	0.0472	0.0363
本期加权平均净 值利润率	4.50%	3.44%
本期基金份额净 值增长率	4.08%	3.78%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	5,745,349.00	42,326,837.13
期末可供分配基 金份额利润	0.0580	0.0519

期末基金资产净值	107,046,518.98	876,024,966.12
期末基金份额净值	1.0807	1.0745
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.07%	7.45%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3. 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

达诚腾益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.28%	0.07%	-0.11%	0.06%	0.39%	0.01%
过去三个月	1.57%	0.12%	0.49%	0.12%	1.08%	0.00%
过去六个月	4.08%	0.13%	1.44%	0.12%	2.64%	0.01%
过去一年	7.39%	0.10%	1.73%	0.10%	5.66%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.07%	0.10%	2.17%	0.09%	5.90%	0.01%

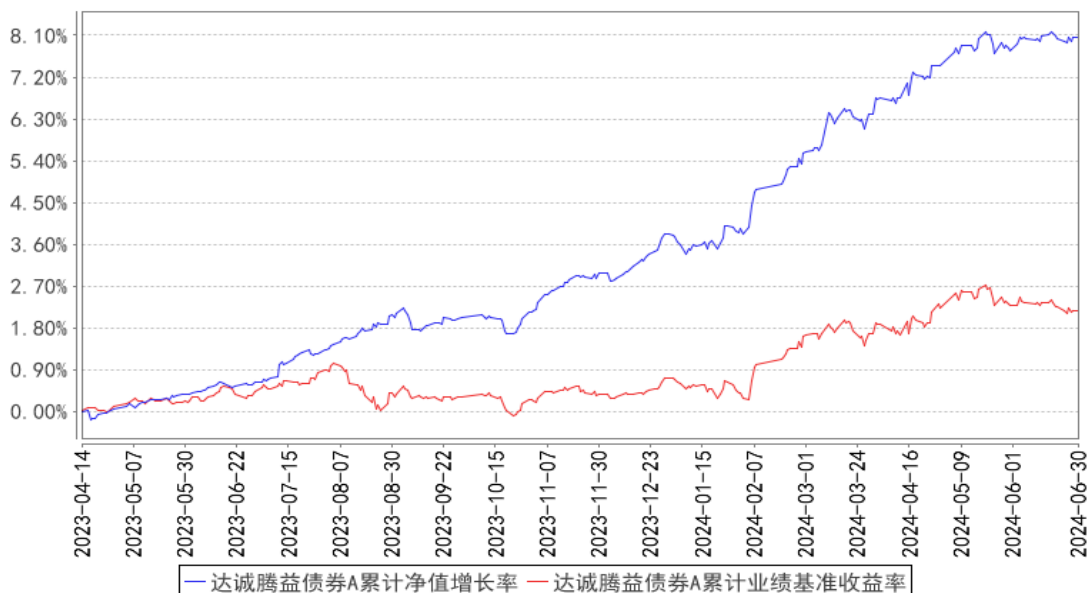
达诚腾益债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.25%	0.07%	-0.11%	0.06%	0.36%	0.01%
过去三个月	1.48%	0.12%	0.49%	0.12%	0.99%	0.00%
过去六个月	3.78%	0.13%	1.44%	0.12%	2.34%	0.01%
过去一年	6.87%	0.10%	1.73%	0.10%	5.14%	0.00%
自基金合同生效起	7.45%	0.09%	2.17%	0.09%	5.28%	0.00%

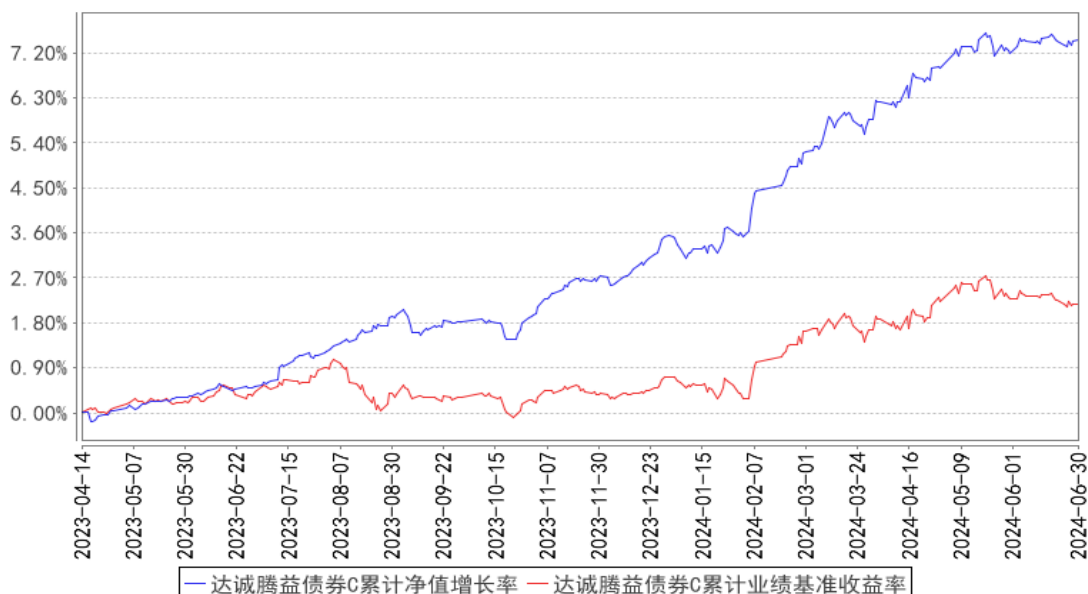
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

达诚腾益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



达诚腾益债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

达诚基金管理有限公司（以下简称“达诚基金”）经中国证监会证监许可[2019]1127 号文批准，于 2019 年 8 月 5 日注册成立，是由五位资深专业人士发起设立的自然人控股公募基金管理公司。公司注册地和主动办公所在地均为上海市虹口区，注册资本为 10990 万元人民币，经营范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证券监督管理委员会许可的其他业务。

截至报告期末，达诚基金旗下管理 8 只公开募集证券投资基金，具体包括达诚成长先锋混合型证券投资基金、达诚策略先锋混合型证券投资基金、达诚宜创精选混合型证券投资基金、达诚价值先锋灵活配置混合型证券投资基金、达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、达诚腾益债券型证券投资基金、达诚致益债券型发起式证券投资基金、达诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。同时，达诚基金还管理多个私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王栋	本基金的基金经理	2023 年 4 月 14 日	-	12 年	王栋先生，硕士。拥有 16 年金融行业从业经验，曾任中国民生银行深圳分行金融同业业务业务经理；平安银行总行资管部固收投资投资经理；平安理财有限责任公司固收投资投资经理。现任达诚基金管理有限公司固收投资部部门总监。
陈佶	本基金的基金经理	2023 年 4 月 14 日	-	9 年	陈佶先生，硕士。拥有 10 年证券相关行业经验，曾任永赢基金管理有限公司交易员、交易主管；华宝证券有限责任公司交易主管。现任达诚基金管理有限公司基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，未损害基金份额持有人利益。本基金投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，建立了健全、有效的公平交易制度体系，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等各业务环节。基金管理人通过完善各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异以及分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内，不同时间窗口下同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易中成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。未发现不公平交易和利益输送的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从宏观经济来看，经济新旧动能转换仍是背景，总需求待提振的同时地产、债务的尾部风险仍需要消化，除此之外地缘因素以及外围大选的影响也存在不确定性，因此在当前时点难言经济有快速的改善，但整体呈回升向好的趋势。从内部看，宏观政策持续发力，货币政策大力配合，政策的效应逐步显现，经济对于房地产的依赖降低，新兴生产力加快培育；从外部看，全球经济稳步复苏，经济恢复整体好于预期，这也推动了国内出口的超预期好转。

PMI 方面，一季度前两个月制造业 PMI 处于收缩区间，3、4 月官方制造业数据重回扩张区间，除季节性因素外，内外需同步改善是主因。供给端生产加快带动制造业整体上行、生产活动扩张；需求端扩张幅度收窄，4 月新订单及外需均较 3 月有所回落但仍处于扩张区间，大中小型企业差

距明显缩窄，大企业需求端回落幅度大，而中小型企业景气度提升主要由生产扩张带动。5 月数据转为收缩，除价格和从业人员指数环比上行外，其他均走弱，下行主要是生产和新出口订单降幅较大所致，同时也是由于五一节假日和南方连续且集中降雨等极端天气的有关。6 月数据与前月持平，需求问题依然是制约国内生产-消费循环有序运转的重要因素，中小型企业的景气度继续回升，但大型企业有所下行，生产端整体仍呈现扩张态势，供给驱动的特征较为鲜明。

通胀方面，一季度 CPI 整体偏弱，2 月由于春节因素小幅超预期，尽管春节因素带来的食品分项环比提升，但受供给充裕影响，多数分项上升幅度不及此前春节所在月季节性；PPI 方面，中上游除了油价和能源需求支撑的石油开采和煤炭板块之外，其余分项多数走弱。二季度开始数据整体改善但有所分化，商品市场显著上涨带动 PPI 环比改善，CPI 回升动能弱化或指向居民实际需求仍然有限。从结构来看，4 月 CPI 中食品价格环比回落速度变慢，能源和服务价格环比上升，核心 CPI 环比开始缓步提升，而 5 月食品价格继续提升，环比转为持平，但受非食品价格拖累，核心 CPI 环比显著弱于季节性；食品项受南方暴雨等因素影响，猪肉、鸡蛋等价格上涨明显，非食品项环比读数波动加大，今年来看 2、4 月环比显著强于季节性，3、5 月环比显著弱于季节性。PPI 方面，同比增速持续收窄主要是国内政策力度增大带动宏观预期回暖的影响，同时还有有色金属等国际商品价格上涨带来的提振，但基建及地产等需求改善力度暂时有限，房地产政策放开后，具体的政策影响可能还需要后续的数据验证。

债券市场方面，由于经济仍处于缓慢复苏，且货币供给充裕与资产供给的错配，一季度利率债、信用债整体均持续下行，信用债利差在 3 月中下旬受季末因素影响，出现了小幅回调；二季度债市行情延续，各期限、评级利率进一步下行，各期限利差均达到或接近历史极低水平，4 月末市场出于对超长期国债的发行计划博弈以及监管对于长期利率风险的提示后，出现了短暂的回调，但随后利率继续下探，并在 6 月不断创下新低。2024 年上半年，产业债净融资较好，地方政府债、政金债偏弱，整体新增供给同比减少，主要由于去年底新增的再融资债有一半在今年使用，同时受地方政府投资项目审批偏慢影响，导致地方政府债发行进度较往年明显放缓，同时证金债发行同比下降 48%，都对利率债形成拖累。

权益市场方面，春节前 2635 的政策底已经明显，除非发生极端事件，否则市场再回到低点的可能性微乎其微，但未来股票市场难有大行情，大概率会持续震荡。同时从上市公司盈利来看，2024 年企业盈利同比弹性或较低，当下企业净利润同比基本见底，但看不到向上的弹性修复。再从估值来看，2024 年估值弹性同样或较低，M1 同比与万得全 A 的估值大体同步，在 M1 没有持续回升时，难言估值提升。当下来看，监管趋严的迹象较多（如金融数据“防空转”、“挤水分”等），大盘股或是更好的选择。

2024 年上半年，达诚腾益债券依旧以中长久期信用债为主要配置方向，以中长期城投债为配置底仓，并通过银行金融债和银行二级资本债的波段交易为组合带来了不错的收益，维持了中性的杠杆水平。同时考虑到宏观基本面的逐步向好，货币和财政政策的继续支持，以及不断修复的房地产市场，也适当提高了权益组合的仓位，增强产品弹性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末达诚腾益债券 A 基金份额净值为 1.0807 元，本报告期份额净值增长率为 4.08%；达诚腾益债券 C 基金份额净值为 1.0745 元，本报告期份额净值增长率为 3.78%，同期业绩比较基准增长率为 1.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从历史来看，近五年的三季度利率走势均呈现了“先下后上”的季节性规律，其定价的背景是 7-8 月由于需求以及天气的因素往往处于经济的季节性“淡季”，而后通常会出现“金九银十”的旺季，工业品的需求出现回暖，产业政策也会继续加码，宏观政策同样持续助力巩固和增强经济回升向好态势。

展望下半年，首先基建和投资可能提速。上半年专项债发行相对滞后，目前地方政府专项债项目已筛选完成，同时地方债和专项债也开始加速发行，后续财政支出将加力推动基建投资增速。其次消费或将持续恢复增长态势。上半年消费品以旧换新政策持续显效，主要电商平台家电以旧换新销售额增长超 80%，家电、通讯器材消费对整体社零的贡献度实现由负转正，预计后期将进一步提升；同时今年以来各假期出游人数同比显著增长，未来伴随着暑期、中秋、国庆的到来，出游人数也将继续提升，或带动消费持续增长。除此之外，出口有望延续增长趋势。上半年外需改善带动出口增速好于预期，全球贸易景气度回升在下半年也将延续，出口有望保持平稳增长。

通胀方面，猪肉价格或将持续转好推动食品价格进一步上涨，节假日出行也将带动服务消费价格保持上涨态势，因此 CPI 涨幅可能逐步扩大。商品方面，夏季用电需求高峰会带动煤炭价格上行，原油消费旺季也将为国际油价提供支撑，在全球制造业生产持续好转的背景下，PPI 降幅有望继续收窄。

整体来看，上半年宏观经济缓慢复苏的同时，债券市场本身供给不足+“资产荒”下资金涌入非银，推动了债券收益率的持续下行。下半年考虑到仍处在资产荒的状态，资金面偏宽松且非银负债相对稳定，在经济数据没有明显超预期情况下，后期信用利差有望进一步压缩；与此同时，信用风险可控的大环境虽没有改变，但下沉的性价比不高，通过拉长久期获取资本利得的策略，或仍将高于票息的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会由公司总经理、督察长、基金运营部的分管高管、基金投资部门的分管领导、基金运营部负责人、风险与合规管理部负责人组成。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，香港联合交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对达诚腾益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复

核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由达诚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关达诚腾益债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：达诚腾益债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	68,058,013.93	113,684,716.63
结算备付金		63,885.09	63,258.80
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	960,591,585.63	1,782,815,321.63
其中：股票投资		101,571,006.88	73,156,938.39
基金投资		-	-
债券投资		859,020,578.75	1,709,658,383.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	48,072,619.20
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		900,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,141,494.77	209,193,312.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-

资产总计		1,030,754,979.42	2,153,829,228.30
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		30,008,049.84	27,983,539.37
应付清算款		-	-
应付赎回款		16,648,011.92	92,091,944.99
应付管理人报酬		499,209.66	882,415.88
应付托管费		83,201.63	147,069.33
应付销售服务费		270,954.76	385,638.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		52,584.87	114,622.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	121,481.64	221,342.00
负债合计		47,683,494.32	121,826,573.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	914,342,167.13	1,961,299,970.44
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	68,729,317.97	70,702,684.68
净资产合计		983,071,485.10	2,032,002,655.12
负债和净资产总计		1,030,754,979.42	2,153,829,228.30

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 914,342,167.13 份，其中达诚腾益债券 A 基金份额总额 99,054,286.58 份，基金份额净值 1.0807 元；达诚腾益债券 C 基金份额总额 815,287,880.55 份，基金份额净值 1.0745 元。

## 6.2 利润表

会计主体：达诚腾益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年4月14日（基金 合同生效日）至2023年6 月30日
<b>一、营业总收入</b>		53,886,443.49	3,215,386.24
1. 利息收入		534,576.14	177,316.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	522,504.93	177,316.19
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		12,071.21	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,838,896.32	2,852,531.42
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,348,974.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	42,550,951.39	2,852,531.42
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,636,918.95	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	13,543,263.35	91,906.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	2,969,707.68	93,632.15
<b>减：二、营业总支出</b>		7,843,315.48	831,699.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,822,783.51	482,016.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	637,130.60	80,336.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,872,969.88	122,218.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,341,262.19	87,924.36
其中：卖出回购金融资产支出		1,341,262.19	87,924.36
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		46,143.16	8,193.53
8. 其他费用	6.4.7.23	123,026.14	51,011.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		46,043,128.01	2,383,686.46
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		46,043,128.01	2,383,686.46
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		46,043,128.01	2,383,686.46



### 6.3 净资产变动表

会计主体：达诚腾益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,961,299,970.44	70,702,684.68	2,032,002,655.12
二、本期期初净资产	1,961,299,970.44	70,702,684.68	2,032,002,655.12
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,046,957,803.31	-1,973,366.71	-1,048,931,170.02
(一)、综合收益总额	-	46,043,128.01	46,043,128.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-1,046,957,803.31	-48,016,494.72	-1,094,974,298.03
其中：1. 基金申购款	4,127,744,248.57	208,047,161.83	4,335,791,410.40
2. 基金赎回款	-5,174,702,051.88	-256,063,656.55	-5,430,765,708.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	914,342,167.13	68,729,317.97	983,071,485.10
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	202,388,555.28	-	202,388,555.28
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	276,927,637.78	2,750,555.02	279,678,192.80
(一)、综合收益总额	-	2,383,686.46	2,383,686.46
(二)、本期基金份额交易产生的净资产	276,927,637.78	366,868.56	277,294,506.34

产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,181,303,888.42	4,251,266.81	1,185,555,155.23
2. 基金赎回 款	-904,376,250.64	-3,884,398.25	-908,260,648.89
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动(净资产减少以 “-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	479,316,193.06	2,750,555.02	482,066,748.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

李宇龙

田中甲

徐毅翔

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

达诚腾益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2471号《关于准予达诚腾益债券型证券投资基金注册的批复》核准,由达诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《达诚腾益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 202,388,444.65 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0245 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《达诚腾益债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 202,388,555.28 份基金份额,其中认购资金利息折合 110.63 份基金份额。本基金的基金管理人为达诚基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《达诚腾益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购基金份额时收取认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认/申购基金份额时不收取认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎

回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置不同的基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《达诚腾益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券(含可分离型可转换债券)、可交换债券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股票(包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、国债期货、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产(含存托凭证)、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券比例合计不超过基金资产的 20%。每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《达诚腾益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计

估计一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	67,449,932.75
等于：本金	67,422,501.32
加：应计利息	27,431.43
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	608,081.18
等于：本金	608,035.18
加：应计利息	46.00
减：坏账准备	-
合计	68,058,013.93

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		103,792,649.64	-	101,571,006.88	-2,221,642.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	171,731,874.58	3,221,862.14	179,391,762.14	4,438,025.42
	银行间市场	642,090,398.47	11,235,916.61	679,628,816.61	26,302,501.53
	合计	813,822,273.05	14,457,778.75	859,020,578.75	30,740,526.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		917,614,922.69	14,457,778.75	960,591,585.63	28,518,884.19

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,755.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	7,755.50
应付利息	-
预提费用	113,726.14
合计	121,481.64

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 达诚腾益债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	423,791,731.26	423,791,731.26
本期申购	395,434,646.67	395,434,646.67
本期赎回（以“-”号填列）	-720,172,091.35	-720,172,091.35
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	99,054,286.58	99,054,286.58

## 达诚腾益债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,537,508,239.18	1,537,508,239.18
本期申购	3,732,309,601.90	3,732,309,601.90
本期赎回（以“-”号填列）	-4,454,529,960.53	-4,454,529,960.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	815,287,880.55	815,287,880.55

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 达诚腾益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,539,516.29	5,694,121.14	16,233,637.43
本期期初	10,539,516.29	5,694,121.14	16,233,637.43
本期利润	2,320,833.96	6,586,598.51	8,907,432.47
本期基金份额交易产生的变动数	-7,115,001.25	-10,033,836.25	-17,148,837.50
其中：基金申购款	12,892,921.19	10,064,313.44	22,957,234.63
基金赎回款	-20,007,922.44	-20,098,149.69	-40,106,072.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,745,349.00	2,246,883.40	7,992,232.40

## 达诚腾益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,914,221.47	20,554,825.78	54,469,047.25
本期期初	33,914,221.47	20,554,825.78	54,469,047.25
本期利润	30,179,030.70	6,956,664.84	37,135,695.54
本期基金份额交易产生的变动数	-21,766,415.04	-9,101,242.18	-30,867,657.22
其中：基金申购款	104,551,037.45	80,538,889.75	185,089,927.20
基金赎回款	-126,317,452.49	-89,640,131.93	-215,957,584.42



本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,326,837.13	18,410,248.44	60,737,085.57

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
活期存款利息收入			500,535.24
定期存款利息收入			-
其他存款利息收入			21,343.40
结算备付金利息收入			626.29
其他			-
合计			522,504.93

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-7,348,974.02
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-7,348,974.02

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		370,148,502.71
减：卖出股票成本总额		376,701,308.81
减：交易费用		796,167.92
买卖股票差价收入		-7,348,974.02

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	23,630,439.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	18,920,511.44
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	42,550,951.39

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	990,245,302.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	954,776,892.23
减：应计利息总额	16,531,167.18
减：交易费用	16,732.03
买卖债券差价收入	18,920,511.44

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,636,918.95
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	1,636,918.95

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	13,543,263.35
股票投资	2,598,869.26
债券投资	10,944,394.09
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	13,543,263.35

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	2,969,707.68
合计	2,969,707.68

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,026.14

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
达诚基金管理有限公司	基金管理人

中信证券股份有限公司	基金托管人
宋宜农	基金管理人的股东
章月平	基金管理人的股东
赵楠	基金管理人的股东
徐蔓青	基金管理人的股东
李峻	基金管理人的股东
李宇龙	基金管理人的股东

注：1. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年4月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中信证券股份有限公司	772,665,010.75	100.00	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年4月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
中信证券股份有限公司	664,511,090.00	100.00	581,519,873.29	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年4月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
中信证券股份有限 公司	10,481,300,000.00	100.00	857,500,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券股份有 限公司	627,489.17	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年4月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券股份有 限公司	16,367.88	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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年4月14日（基金合 同生效日）至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,822,783.51	482,016.46
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,760,164.77	183,652.70
应支付基金管理人的净管理费	2,062,618.74	298,363.76

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。日管理人报酬的计算方法为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年实际天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	637,130.60	80,336.09

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年实际天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	达诚腾益债券 A	达诚腾益债券 C	合计
达诚基金管理有限公司	-	93.83	93.83
中信证券股份有限公司	-	1,266,552.93	1,266,552.93
合计	-	1,266,646.76	1,266,646.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	达诚腾益债券 A	达诚腾益债券 C	合计
达诚基金管理有限公司	-	10.61	10.61
中信证券股份有限公司	-	100,842.90	100,842.90
合计	-	100,853.51	100,853.51

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35% 年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给达诚基金，再由达诚基金计算并按代销中约定的支付频率支付给各基金销售机构。销售服务费的计算方法为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.35% ÷ 当年实际天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

达诚腾益债券 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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 (%)
中信证券股份有限公司	-	-	29,999,900.00	7.07893

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年4月14日(基金合同生效日)至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	608,081.18	21,343.40	20,766,600.13	5,323.83

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。



#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,008,049.84 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
2123016	21 阳光财险	2024 年 7 月 4 日	106.65	316,000	33,700,156.72
合计				316,000	33,700,156.72

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常投资管理过程中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。本基金在银行间市场进行的交易均通过银行间同业拆借中心的前台系统达成，并由中央结算公司和上海清算所完成资金和证券的交收清算；本基金在交易所进行的交易均由中国证券登记结算有限责任公司完成证券和资金的交收清算，因此违约风险发生的可能性较小。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行。本基金在进入银行间同业市场交易前，根据交易对手的信用级别，将交易对手进行了分类，并根据不同的交易对手类别设置了不同的交易额度。交易对手的信用评级会进行定期和不定期复评，并根据交易对手资信情况的动态变化随时调整，以此来控制相应的违约风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,198,018.03
合计	-	5,198,018.03

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	655,870,079.88	1,386,946,687.55
AAA 以下	142,431,498.87	158,295,769.41
未评级	60,719,000.00	159,217,908.25

合计	859,020,578.75	1,704,460,365.21
----	----------------	------------------

注：未评级债券为中期票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，使得基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外（如有），本期末本基金的其他资产均能及时变现。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	68,058,013.93	-	-	-	68,058,013.93
结算备付金	63,885.09	-	-	-	63,885.09
交易性金融资产	205,266,133.37	546,315,242.11	107,439,203.27	101,571,006.88	960,591,585.63
应收申购款	-	-	-	1,141,494.77	1,141,494.77
应收清算款	-	-	-	900,000.00	900,000.00
资产总计	273,388,032.39	546,315,242.11	107,439,203.27	103,612,501.65	1,030,754,979.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,648,011.92	16,648,011.92
应付管理人报酬	-	-	-	499,209.66	499,209.66
应付托管费	-	-	-	83,201.63	83,201.63
卖出回购金融资产款	30,008,049.84	-	-	-	30,008,049.84
应付销售服务费	-	-	-	270,954.76	270,954.76
应交税费	-	-	-	52,584.87	52,584.87
其他负债	-	-	-	121,481.64	121,481.64
负债总计	30,008,049.84	-	-	17,675,444.48	47,683,494.32
利率敏感度缺口	243,379,982.55	546,315,242.11	107,439,203.27	85,937,057.17	983,071,485.10
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	113,684,716.63	-	-	-	113,684,716.63
结算备付金	63,258.80	-	-	-	63,258.80
交易性金融资产	248,109,204.16	1,230,900,043.59	230,649,135.49	73,156,938.39	1,782,815,321.63
买入返售金融资产	48,072,619.20	-	-	-	48,072,619.20
应收申购款	-	-	-	209,193,312.04	209,193,312.04
资产总计	409,929,798.79	1,230,900,043.59	230,649,135.49	282,350,250.43	2,153,829,228.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	92,091,944.99	92,091,944.99

应付管理人报酬	-	-	-	882,415.88	882,415.88
应付托管费	-	-	-	147,069.33	147,069.33
卖出回购金融资产款	27,983,539.37	-	-	-	27,983,539.37
应付销售服务费	-	-	-	385,638.72	385,638.72
应交税费	-	-	-	114,622.89	114,622.89
其他负债	-	-	-	221,342.00	221,342.00
负债总计	27,983,539.37	-	-	93,843,033.81	121,826,573.18
利率敏感度缺口	381,946,259.42	1,230,900,043.59	230,649,135.49	188,507,216.62	2,032,002,655.12

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率曲线平行变动，除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降25个基点	4,869,257.32	10,803,721.06
市场利率上升25个基点	-4,869,257.32	-10,803,721.06	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金本报告期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	101,571,006.88	10.33	73,156,938.39	3.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	101,571,006.88	10.33	73,156,938.39	3.60

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,204,813.06	3,459,431.07
沪深 300 指数下降 5%	-5,204,813.06	-3,459,431.07	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	101,571,006.88	73,156,938.39
第二层次	859,020,578.75	1,709,658,383.24
第三层次	-	-
合计	960,591,585.63	1,782,815,321.63

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	101,571,006.88	9.85
	其中：股票	101,571,006.88	9.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	859,020,578.75	83.34
	其中：债券	859,020,578.75	83.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	68,121,899.02	6.61
8	其他各项资产	2,041,494.77	0.20
9	合计	1,030,754,979.42	100.00

注：1. 本基金本报告期末未持有港股通股票。

2. 本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,398,222.00	0.14
B	采矿业	6,609,885.41	0.67
C	制造业	59,490,472.31	6.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,489,152.00	0.35
E	建筑业	1,107,903.00	0.11
F	批发和零售业	607,336.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,758,333.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,547,202.36	0.56
J	金融业	18,269,717.80	1.86
K	房地产业	639,926.00	0.07
L	租赁和商务服务业	1,305,197.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	638,198.00	0.06
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	312,818.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	396,644.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	101,571,006.88	10.33

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。



## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,600	5,282,604.00	0.54
2	600036	招商银行	67,000	2,290,730.00	0.23
3	601318	中国平安	54,200	2,241,712.00	0.23
4	300308	中际旭创	16,240	2,239,171.20	0.23
5	300750	宁德时代	11,400	2,052,342.00	0.21
6	000333	美的集团	27,400	1,767,300.00	0.18
7	600900	长江电力	53,400	1,544,328.00	0.16
8	601899	紫金矿业	85,000	1,493,450.00	0.15
9	601166	兴业银行	79,600	1,402,552.00	0.14
10	000858	五粮液	9,400	1,203,576.00	0.12
11	601328	交通银行	152,800	1,141,416.00	0.12
12	601398	工商银行	198,800	1,133,160.00	0.12
13	002594	比亚迪	4,100	1,026,025.00	0.10
14	000651	格力电器	26,000	1,019,720.00	0.10
15	601088	中国神华	20,100	891,837.00	0.09
16	600887	伊利股份	34,300	886,312.00	0.09
17	600276	恒瑞医药	21,700	834,582.00	0.08
18	002475	立讯精密	20,800	817,648.00	0.08
19	601288	农业银行	183,000	797,880.00	0.08
20	000725	京东方 A	188,000	768,920.00	0.08
21	300760	迈瑞医疗	2,600	756,366.00	0.08
22	601816	京沪高铁	129,600	695,952.00	0.07
23	600309	万华化学	8,600	695,396.00	0.07
24	601857	中国石油	66,300	684,216.00	0.07
25	002415	海康威视	22,100	683,111.00	0.07
26	600028	中国石化	103,500	654,120.00	0.07
27	601225	陕西煤业	24,533	632,215.41	0.06
28	002463	沪电股份	17,000	620,500.00	0.06
29	300059	东方财富	56,800	599,808.00	0.06
30	600690	海尔智家	20,800	590,304.00	0.06
31	000568	泸州老窖	4,100	588,309.00	0.06
32	601668	中国建筑	108,400	575,604.00	0.06
33	300498	温氏股份	28,800	570,816.00	0.06
34	002714	牧原股份	12,800	558,080.00	0.06
35	601988	中国银行	120,600	557,172.00	0.06
36	601985	中国核电	51,900	553,254.00	0.06
37	600489	中金黄金	36,200	535,760.00	0.05
38	600809	山西汾酒	2,500	527,200.00	0.05
39	600941	中国移动	4,900	526,750.00	0.05
40	601919	中远海控	34,000	526,660.00	0.05

41	601728	中国电信	85,500	525,825.00	0.05
42	600150	中国船舶	12,800	521,088.00	0.05
43	600919	江苏银行	69,000	512,670.00	0.05
44	600000	浦发银行	62,200	511,906.00	0.05
45	600016	民生银行	134,300	508,997.00	0.05
46	688256	寒武纪	2,550	506,608.50	0.05
47	002028	思源电气	7,500	501,750.00	0.05
48	601169	北京银行	85,900	501,656.00	0.05
49	601601	中国太保	17,900	498,694.00	0.05
50	000338	潍柴动力	30,700	498,568.00	0.05
51	601766	中国中车	64,700	485,897.00	0.05
52	600406	国电南瑞	19,200	479,232.00	0.05
53	002142	宁波银行	21,700	478,702.00	0.05
54	000001	平安银行	46,800	475,020.00	0.05
55	300124	汇川技术	9,200	471,960.00	0.05
56	600031	三一重工	28,600	471,900.00	0.05
57	600066	宇通客车	17,900	461,820.00	0.05
58	002422	科伦药业	15,000	454,950.00	0.05
59	002371	北方华创	1,400	447,846.00	0.05
60	688169	石头科技	1,136	445,993.60	0.05
61	600050	中国联通	94,200	442,740.00	0.05
62	601138	工业富联	16,100	441,140.00	0.04
63	601168	西部矿业	24,400	437,980.00	0.04
64	002340	格林美	67,200	428,064.00	0.04
65	300274	阳光电源	6,860	425,525.80	0.04
66	000063	中兴通讯	15,200	425,144.00	0.04
67	000792	盐湖股份	24,200	422,290.00	0.04
68	000933	神火股份	20,600	416,738.00	0.04
69	601058	赛轮轮胎	29,700	415,800.00	0.04
70	600487	亨通光电	26,200	413,174.00	0.04
71	600660	福耀玻璃	8,600	411,940.00	0.04
72	002352	顺丰控股	11,500	410,435.00	0.04
73	601077	渝农商行	80,600	404,612.00	0.04
74	688981	中芯国际	8,730	402,453.00	0.04
75	000988	华工科技	13,300	398,069.00	0.04
76	601229	上海银行	54,700	397,122.00	0.04
77	600418	江淮汽车	24,800	392,832.00	0.04
78	002384	东山精密	18,700	387,090.00	0.04
79	002230	科大讯飞	8,600	369,370.00	0.04
80	600160	巨化股份	15,200	366,776.00	0.04
81	601012	隆基绿能	26,000	364,520.00	0.04
82	600089	特变电工	26,200	363,394.00	0.04
83	000807	云铝股份	26,600	359,366.00	0.04

84	603501	韦尔股份	3,600	357,732.00	0.04
85	601390	中国中铁	54,700	356,644.00	0.04
86	002966	苏州银行	47,400	355,500.00	0.04
87	601233	桐昆股份	22,100	352,716.00	0.04
88	002625	光启技术	19,900	345,265.00	0.04
89	000100	TCL 科技	78,700	339,984.00	0.03
90	600104	上汽集团	24,500	339,570.00	0.03
91	000630	铜陵有色	93,700	338,257.00	0.03
92	600157	永泰能源	284,100	335,238.00	0.03
93	600988	赤峰黄金	20,400	333,336.00	0.03
94	000423	东阿阿胶	5,300	331,780.00	0.03
95	000400	许继电气	9,600	330,336.00	0.03
96	000975	银泰黄金	20,100	327,429.00	0.03
97	600096	云天化	16,600	322,372.00	0.03
98	002156	通富微电	14,300	320,177.00	0.03
99	002273	水晶光电	18,700	317,526.00	0.03
100	300418	昆仑万维	9,800	315,952.00	0.03
101	601128	常熟银行	41,140	311,429.80	0.03
102	600905	三峡能源	71,400	311,304.00	0.03
103	002078	太阳纸业	22,100	308,295.00	0.03
104	600161	天坛生物	12,480	304,512.00	0.03
105	600027	华电国际	43,300	300,502.00	0.03
106	601888	中国中免	4,800	299,952.00	0.03
107	002532	天山铝业	36,800	298,448.00	0.03
108	603259	药明康德	7,600	297,844.00	0.03
109	600372	中航机载	24,800	296,856.00	0.03
110	601555	东吴证券	50,200	296,180.00	0.03
111	600585	海螺水泥	12,500	294,875.00	0.03
112	000625	长安汽车	21,700	291,431.00	0.03
113	300866	安克创新	4,080	290,536.80	0.03
114	603288	海天味业	8,400	289,548.00	0.03
115	600048	保利发展	32,900	288,204.00	0.03
116	600885	宏发股份	10,400	287,872.00	0.03
117	002353	杰瑞股份	8,200	287,656.00	0.03
118	600482	中国动力	14,700	286,356.00	0.03
119	601688	华泰证券	23,100	286,209.00	0.03
120	002138	顺络电子	10,300	282,838.00	0.03
121	002223	鱼跃医疗	7,500	282,000.00	0.03
122	600352	浙江龙盛	32,600	280,034.00	0.03
123	002027	分众传媒	45,800	277,548.00	0.03
124	300832	新产业	4,100	276,504.00	0.03
125	600642	申能股份	31,300	276,379.00	0.03
126	002185	华天科技	33,900	276,285.00	0.03

127	603986	兆易创新	2,800	267,736.00	0.03
128	601108	财通证券	40,300	266,383.00	0.03
129	300003	乐普医疗	17,900	265,636.00	0.03
130	600765	中航重机	12,900	263,160.00	0.03
131	600415	小商品城	35,000	259,700.00	0.03
132	002600	领益智造	35,900	255,608.00	0.03
133	600497	驰宏锌锗	46,700	249,378.00	0.03
134	600436	片仔癀	1,200	248,604.00	0.03
135	600060	海信视像	10,000	247,400.00	0.03
136	300136	信维通信	12,600	246,708.00	0.03
137	601628	中国人寿	7,900	245,295.00	0.02
138	688012	中微公司	1,729	244,238.54	0.02
139	300017	网宿科技	30,800	243,320.00	0.02
140	000932	华菱钢铁	54,600	241,878.00	0.02
141	000683	远兴能源	34,900	241,159.00	0.02
142	600109	国金证券	31,900	240,845.00	0.02
143	600348	华阳股份	24,000	239,040.00	0.02
144	000783	长江证券	49,300	238,119.00	0.02
145	002465	海格通信	22,600	234,136.00	0.02
146	603160	汇顶科技	3,400	233,750.00	0.02
147	600879	航天电子	29,500	229,215.00	0.02
148	688777	中控技术	6,012	226,652.40	0.02
149	002409	雅克科技	3,600	226,476.00	0.02
150	002304	洋河股份	2,800	226,072.00	0.02
151	002444	巨星科技	9,100	224,770.00	0.02
152	603596	伯特利	5,720	222,508.00	0.02
153	300012	华测检测	22,000	221,320.00	0.02
154	600298	安琪酵母	7,900	220,647.00	0.02
155	689009	九号公司	5,958	219,313.98	0.02
156	600536	中国软件	7,300	218,416.00	0.02
157	002008	大族激光	10,500	218,400.00	0.02
158	600839	四川长虹	48,100	215,969.00	0.02
159	000960	锡业股份	13,900	215,311.00	0.02
160	000066	中国长城	24,300	212,625.00	0.02
161	002797	第一创业	41,700	212,253.00	0.02
162	688099	晶晨股份	3,558	211,060.56	0.02
163	000002	万 科 A	30,400	210,672.00	0.02
164	002294	信立泰	7,900	210,377.00	0.02
165	300015	爱尔眼科	20,300	209,496.00	0.02
166	601577	长沙银行	25,600	209,408.00	0.02
167	601990	南京证券	27,100	208,128.00	0.02
168	002738	中矿资源	7,700	206,360.00	0.02
169	002739	万达电影	17,000	205,530.00	0.02

170	600141	兴发集团	10,400	198,432.00	0.02
171	688009	中国通号	32,907	197,442.00	0.02
172	600862	中航高科	10,500	197,190.00	0.02
173	000728	国元证券	32,500	196,950.00	0.02
174	601997	贵阳银行	37,300	196,571.00	0.02
175	300699	光威复材	7,900	196,157.00	0.02
176	000021	深科技	12,900	195,048.00	0.02
177	603338	浙江鼎力	3,200	193,344.00	0.02
178	000938	紫光股份	8,600	192,210.00	0.02
179	300014	亿纬锂能	4,800	191,616.00	0.02
180	600549	厦门钨业	11,100	191,475.00	0.02
181	300144	宋城演艺	23,800	191,114.00	0.02
182	600521	华海药业	11,100	189,255.00	0.02
183	300724	捷佳伟创	3,500	189,035.00	0.02
184	300073	当升科技	5,500	188,705.00	0.02
185	000703	恒逸石化	26,500	187,885.00	0.02
186	600699	均胜电子	12,600	186,732.00	0.02
187	000831	中国稀土	7,300	185,055.00	0.02
188	603589	口子窖	4,700	184,193.00	0.02
189	300474	景嘉微	2,900	183,367.00	0.02
190	300146	汤臣倍健	13,500	182,925.00	0.02
191	603939	益丰药房	7,440	182,652.00	0.02
192	600111	北方稀土	10,500	180,600.00	0.02
193	002407	多氟多	14,700	179,781.00	0.02
194	300285	国瓷材料	10,000	178,500.00	0.02
195	600704	物产中大	40,800	177,072.00	0.02
196	601966	玲珑轮胎	9,600	176,352.00	0.02
197	600170	上海建工	81,700	175,655.00	0.02
198	605358	立昂微	7,500	173,550.00	0.02
199	600153	建发股份	19,200	171,456.00	0.02
200	600118	中国卫星	7,700	171,171.00	0.02
201	300058	蓝色光标	31,300	170,272.00	0.02
202	000591	太阳能	35,700	168,147.00	0.02
203	002050	三花智控	8,800	167,904.00	0.02
204	000738	航发控制	8,300	166,581.00	0.02
205	002385	大北农	42,700	164,395.00	0.02
206	600486	扬农化工	2,900	163,705.00	0.02
207	000729	燕京啤酒	18,500	163,355.00	0.02
208	000519	中兵红箭	11,100	162,837.00	0.02
209	600143	金发科技	24,600	162,606.00	0.02
210	000623	吉林敖东	12,100	162,140.00	0.02
211	000636	风华高科	12,300	160,638.00	0.02
212	300604	长川科技	5,900	160,303.00	0.02

213	002372	伟星新材	10,300	158,826.00	0.02
214	002025	航天电器	3,400	157,692.00	0.02
215	600705	中航产融	70,100	155,622.00	0.02
216	600392	盛和资源	18,000	155,160.00	0.02
217	600516	方大炭素	35,900	154,729.00	0.02
218	000629	钒钛股份	61,300	153,250.00	0.02
219	600837	海通证券	17,900	153,224.00	0.02
220	600499	科达制造	18,000	151,740.00	0.02
221	300383	光环新网	17,900	151,255.00	0.02
222	600909	华安证券	35,700	150,297.00	0.02
223	300088	长信科技	31,700	148,990.00	0.02
224	002049	紫光国微	2,800	147,280.00	0.01
225	000060	中金岭南	34,700	147,128.00	0.01
226	600166	福田汽车	65,000	146,250.00	0.01
227	002430	杭氧股份	6,500	144,625.00	0.01
228	300395	菲利华	4,700	144,525.00	0.01
229	000997	新大陆	10,300	143,273.00	0.01
230	300568	星源材质	17,300	141,860.00	0.01
231	002439	启明星辰	8,200	141,532.00	0.01
232	600325	华发股份	21,700	141,050.00	0.01
233	601636	旗滨集团	21,700	139,965.00	0.01
234	002466	天齐锂业	4,600	137,586.00	0.01
235	002460	赣锋锂业	4,800	137,520.00	0.01
236	002850	科达利	1,800	137,484.00	0.01
237	600563	法拉电子	1,800	137,124.00	0.01
238	300390	天华新能	7,900	135,722.00	0.01
239	000998	隆平高科	13,800	135,654.00	0.01
240	603077	和邦生物	81,700	134,805.00	0.01
241	002299	圣农发展	9,800	133,672.00	0.01
242	688772	珠海冠宇	8,958	133,474.20	0.01
243	002624	完美世界	17,300	131,480.00	0.01
244	002497	雅化集团	14,700	131,124.00	0.01
245	002507	涪陵榨菜	10,500	128,625.00	0.01
246	600655	豫园股份	24,600	126,690.00	0.01
247	002131	利欧股份	88,300	126,269.00	0.01
248	603688	石英股份	4,250	125,842.50	0.01
249	603885	吉祥航空	11,400	125,286.00	0.01
250	002065	东华软件	27,400	123,848.00	0.01
251	002203	海亮股份	15,400	122,892.00	0.01
252	300595	欧普康视	7,800	122,304.00	0.01
253	600399	抚顺特钢	21,500	121,045.00	0.01
254	600859	王府井	10,300	120,922.00	0.01
255	002368	太极股份	5,300	119,515.00	0.01

256	300676	华大基因	3,400	119,034.00	0.01
257	002568	百润股份	7,000	117,810.00	0.01
258	002080	中材科技	9,100	117,390.00	0.01
259	603799	华友钴业	5,300	117,289.00	0.01
260	000893	亚钾国际	7,000	113,120.00	0.01
261	688002	睿创微纳	4,031	112,747.07	0.01
262	002240	盛新锂能	8,300	111,386.00	0.01
263	688390	固德威	1,952	109,546.24	0.01
264	688536	思瑞浦	1,115	109,058.15	0.01
265	002268	电科网安	7,500	106,725.00	0.01
266	688385	复旦微电	3,393	106,472.34	0.01
267	603882	金城医学	3,800	103,322.00	0.01
268	600271	航天信息	13,900	102,304.00	0.01
269	603737	三棵树	2,800	101,556.00	0.01
270	002271	东方雨虹	8,100	99,954.00	0.01
271	688567	孚能科技	10,287	98,755.20	0.01
272	688220	翱捷科技	2,554	95,672.84	0.01
273	600570	恒生电子	5,300	93,598.00	0.01
274	601211	国泰君安	6,900	93,495.00	0.01
275	603444	吉比特	500	89,005.00	0.01
276	002092	ST 中泰	23,200	88,160.00	0.01
277	688111	金山办公	381	86,677.50	0.01
278	300438	鹏辉能源	4,600	84,364.00	0.01
279	688521	芯原股份	3,103	83,005.25	0.01
280	600438	通威股份	3,800	72,618.00	0.01
281	002129	TCL 中环	3,400	29,410.00	0.00

## 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(%)
1	600519	贵州茅台	17,360,347.00	0.85
2	002371	北方华创	15,346,435.00	0.76
3	300760	迈瑞医疗	7,466,521.00	0.37
4	000651	格力电器	7,280,781.00	0.36
5	601318	中国平安	6,581,370.00	0.32
6	600036	招商银行	5,920,940.00	0.29
7	688169	石头科技	5,859,983.21	0.29
8	300750	宁德时代	5,851,721.80	0.29
9	000858	五粮液	5,616,606.00	0.28
10	600418	江淮汽车	5,278,448.00	0.26
11	600887	伊利股份	5,121,671.00	0.25

12	002230	科大讯飞	4,778,767.00	0.24
13	000568	泸州老窖	4,722,773.00	0.23
14	002714	牧原股份	4,424,597.20	0.22
15	000333	美的集团	4,403,292.00	0.22
16	002352	顺丰控股	4,383,397.64	0.22
17	688256	寒武纪	4,107,539.48	0.20
18	600900	长江电力	3,757,603.00	0.18
19	300059	东方财富	3,670,473.00	0.18
20	300308	中际旭创	3,663,717.00	0.18

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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(%)
1	600519	贵州茅台	14,895,439.00	0.73
2	002371	北方华创	14,427,864.75	0.71
3	000651	格力电器	7,066,688.00	0.35
4	300760	迈瑞医疗	7,048,696.00	0.35
5	601318	中国平安	5,829,178.00	0.29
6	300750	宁德时代	5,702,149.00	0.28
7	688169	石头科技	5,558,905.92	0.27
8	600036	招商银行	5,222,941.00	0.26
9	000858	五粮液	5,099,319.00	0.25
10	600418	江淮汽车	5,041,477.00	0.25
11	600887	伊利股份	4,789,036.00	0.24
12	002230	科大讯飞	4,346,592.00	0.21
13	000568	泸州老窖	4,302,966.00	0.21
14	002714	牧原股份	4,197,228.00	0.21
15	002352	顺丰控股	4,165,257.00	0.20
16	688256	寒武纪	3,950,639.22	0.19
17	000333	美的集团	3,723,410.00	0.18
18	002028	思源电气	3,615,532.00	0.18
19	601899	紫金矿业	3,307,995.00	0.16
20	300059	东方财富	3,290,883.00	0.16

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	402,516,508.04
卖出股票收入（成交）总额	370,148,502.71



## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	223,163,115.94	22.70
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	242,781,771.98	24.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	184,347,975.02	18.75
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	208,727,715.81	21.23
10	合计	859,020,578.75	87.38

## 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	2123016	21 阳光财险	750,000	79,984,549.18	8.14
2	2028052	20 恒丰银行永续债	600,000	64,098,196.72	6.52
3	102383043	23 泰达投资 MTN005	500,000	55,474,016.39	5.64
4	242380023	23 徽商银行永续债 01	500,000	54,302,486.34	5.52
5	232380014	23 天津银行二级资本债 01	500,000	54,207,054.79	5.51

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.11 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券发行主体没有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。

#### 7.11.2 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

无。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	900,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,141,494.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,041,494.77

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
达诚腾益 债券 A	1,082	91,547.40	46,511,479.00	46.96	52,542,807.58	53.04
达诚腾益 债券 C	10,312	79,062.05	83,410,789.06	10.23	731,877,091.49	89.77
合计	11,250	81,274.86	129,922,268.06	14.21	784,419,899.07	85.79

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），  
 户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	达诚腾益债券 A	138,822.93	0.14015
	达诚腾益债券 C	198.64	0.00002
	合计	139,021.57	0.01520

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	达诚腾益债券 A	0~10
	达诚腾益债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经 理持有本开 放式基金	达诚腾益债券 A	0
	达诚腾益债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	达诚腾益债券 A	达诚腾益债券 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 14 日) 基金份额总额	200,068,454.89	2,320,100.39
本报告期期初基金份额总额	423,791,731.26	1,537,508,239.18
本报告期基金总申购份额	395,434,646.67	3,732,309,601.90
减：本报告期基金总赎回份额	720,172,091.35	4,454,529,960.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,054,286.58	815,287,880.55

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金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

本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或行政处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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 (%)	
中信证券股份有限公司	3	772,665,010.75	100.00	627,489.17	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	
	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 (%)
中信证券股份有限公司	664,511,090.00	100.00	10,481,300,000.00	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	达诚基金腾益债券型 2023 年第 4 季度报告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 16 日
2	达诚基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2024 年 1 月 16 日
3	达诚基金关于新增度小满为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024 年 1 月 22 日
4	达诚基金关于新增方德保险为代销机	基金管理人的官方网	2024 年 2 月 5 日

	构并参加其费率优惠活动的公告	站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	
5	达诚基金关于新增国金证券为旗下基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024 年 3 月 22 日
6	达诚基金腾益债券型证券投资基金 2023 年年报	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
7	达诚基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024 年 3 月 29 日
8	达诚基金腾益债券型证券投资基金 2024 年 1 季报	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
9	达诚基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024 年 4 月 22 日
10	达诚基金关于新增上海陆金所为代销机构并参加优惠活动的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2024 年 6 月 4 日
11	达诚基金关于新增中泰证券为基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中证报、上海证券报	2024 年 6 月 6 日
12	达诚基金腾益债券型证券投资基金 6 月临时更新产品资料概要	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
13	达诚基金新增长城证券为代销机构并参加优惠活动的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予达诚腾益债券型证券投资基金募集注册文件
- (2) 达诚腾益债券型证券投资基金基金合同
- (3) 达诚腾益债券型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人网站 [www.integrity-funds.com](http://www.integrity-funds.com) 或客服电话 021-60581258。

达诚基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日