

# 信澳月月盈 30 天持有期债券型证券投资基金

## 2025 年第 3 季度报告

### 2025 年 9 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年十月二十七日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 9 月 19 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳月月盈 30 天持有期债券	
基金主代码	025206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 19 日	
报告期末基金份额总额	164,449,388.31 份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、固定收益类品种投资策略等。	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+一年期定期存款利率（税后）×15%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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、股票型基金。	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信澳月月盈 30 天持有期债券 A	信澳月月盈 30 天持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	025206	025207
报告期末下属分级基金的份额总额	8.75 份	164,449,379.56 份

§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	
	(2025 年 9 月 19 日（基金合同生效日）-2025 年 9 月 30 日)	
	信澳月月盈 30 天持有期债券 A	信澳月月盈 30 天持有期债券 C
1.本期已实现收益	-	54,401.45
2.本期利润	-0.01	27,630.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0030	0.0002
4.期末基金资产净值	9.99	188,006,371.12
5.期末基金份额净值	1.1417	1.1432

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

信澳月月盈30天持有期债券A

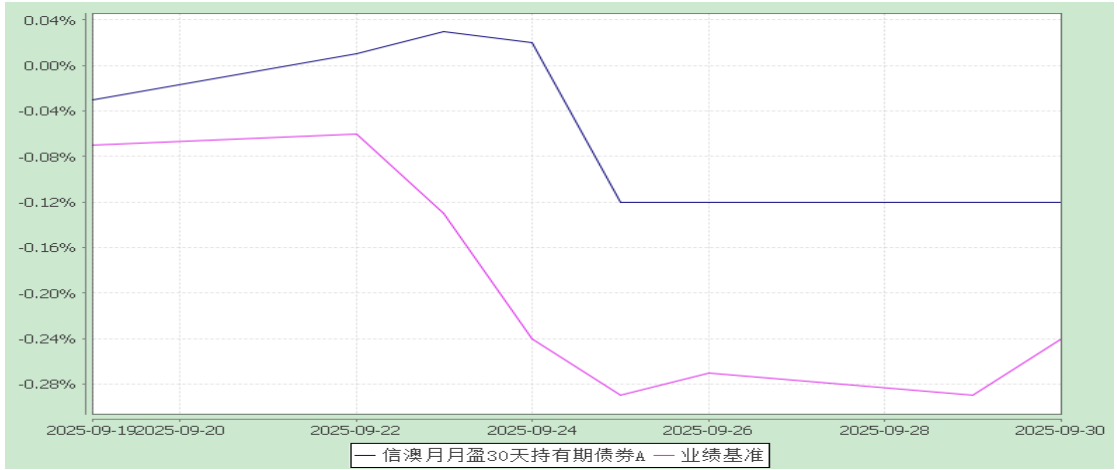
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	-0.12%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.12%	-0.01%

信澳月月盈30天持有期债券C

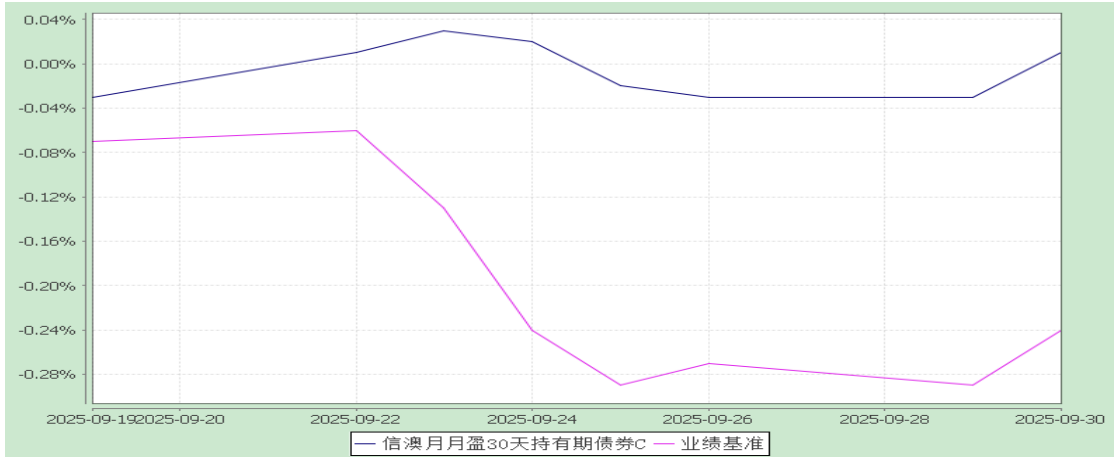
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	0.01%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.25%	-0.03%

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

信澳月月盈 30 天持有期债券 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2025 年 9 月 19 日至 2025 年 9 月 30 日)



信澳月月盈 30 天持有期债券 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2025 年 9 月 19 日至 2025 年 9 月 30 日)



注：本基金由信达月月盈 30 天持有期债券型集合资产管理计划变更而来，基金合同生效日为 2025 年 9 月 19 日。根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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		
宋加旺	本基金的基金经理，固收首席投资官	2025-09-19	-	17 年	天津大学技术经济及管理硕士研究生。2005 年 4 月至 2007 年 7 月于大公国际资信评估有限公司任信用分析师；2007 年 7 月至 2008 年 6 月于国民信托有限公司任高级信托经理；2008 年 6 月至 2015 年 6 月于国泰基金管理有限公司历任研究员、投资经理助理、投资经理；2015

					年 9 月至 2020 年 10 月于建信养老金管理有限公司任投资管理部副总经理；2020 年 11 月至 2022 年 7 月于泰达宏利基金管理有限公司任总经理助理、投资总监（固定收益）、基金经理。2022 年 7 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任固收首席投资官、基金经理。信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳鑫泰 6 个月持有期债券基金基金经理（2024 年 7 月 26 日起至今）、信澳月月盈 30 天持有期债券基金基金经理(2025 年 9 月 19 日起至今)、信澳丰睿 6 个月持有期债券基金基金经理（2025 年 9 月 24 日至今）。
赵琳婧	本基金的基金经理	2025-09-19	-	16 年	硕士。历任光大永明资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，泓德基金管理有限公司基金经理，招商信诺资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2023 年 4 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳汇享三个月定期开放债券基金基金经理（2023 年 6 月 7 日起至今）、信澳慧管家货币基金基金经理(2023 年 8 月 18 日起至今)、信澳悦享利率债基金基金经理（2023 年 12 月 7 日起至今）、信澳中债 0-3 年政策性金融债指数基金基金经理（2024 年 5 月 29 日起至今）、信澳稳悦 60 天滚动持有债券基金基金经理（2024 年 12 月 10 日起至今）、信澳鑫怡债券基金基金经理（2025 年 3 月 18 日起至今）、信澳月月盈 30 天持有期债券基金基金经理(2025 年 9 月 19 日起至今)。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

#### 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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的

基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，外部环境更趋复杂严峻，世界经济增长动能减弱，贸易壁垒增多，主要经济体经济表现有所分化，通胀走势和货币政策调整存在不确定性。美联储 9 月如期降息 25BP，美元走贬。我国经济运行稳中有进，但仍面临国内需求不足、物价低位运行等困难和挑战，出口保持较强韧性，但生产、投资、消费读数都继续走弱，地产销售持续低迷，供给端在反内卷政策陆续实施后也有所收缩。9 月 PMI 较 8 月环比好转，但整体仍是底部震荡特征。

货币市场方面，央行连续放量续作买断式逆回购，在央行呵护下，资金面稳中偏宽。三季度资金中枢下行趋势略有放缓，资金波动有所加大，主要扰动因素来自于地方债发行及北交所“打新”造成短期的资金锁定效应。M1 增速继续提升，存款活化程度进一步提高，随着权益市场持续赚钱效应，存款搬家效应显现。

债券市场方面，随着国际地缘局势缓和、“反内卷”行情带来的通胀抬升预期、以及“雅江工程”、“九三阅兵”等事件影响，7-8 月股、商等风险资产表现强劲，风险偏好压制下债市明显走弱。9 月以来，《公开募集证券投资基金销售费用管理规定（征求意见稿）》引发债基赎回压力，

进一步加剧了债市情绪扰动；权益市场涨势虽有所放缓，但投资者对于风险偏好压制的担忧仍存。三季度，在债市持续走弱的背景下，信用债收益率同步震荡上行。

四季度，产品将定位中短信用债投资策略，专注于跟踪资金面的波动，以短信用债作为底仓，逆势寻找信用债波段操作机会。以高胜率和具有性价比的赔率交易为产品增厚收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.1417 元，份额累计净值为 1.1417 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-0.12%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1432 元，份额累计净值为 1.1432 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §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	185,532,486.79	98.00
	其中：债券	185,532,486.79	98.00
	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	3,253,828.80	1.72
8	其他资产	530,506.50	0.28
9	合计	189,316,822.09	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

### 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

本基金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	11,622,942.58	6.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,894,331.51	11.11
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	90,048,857.63	47.90
5	企业短期融资券	22,135,133.15	11.77
6	中期票据	40,831,221.92	21.72
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	185,532,486.79	98.68

### 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	115206	23 江东 03	200,000	13,170,655.45	7.01
2	012581724	25 太原钢铁 SCP001	120,000	12,032,952.33	6.40
3	019785	25 国债 13	116,000	11,622,942.58	6.18
4	115461	23 银河 Y2	100,000	10,452,450.96	5.56
5	115483	23 国君 Y1	100,000	10,441,880.55	5.55

### 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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 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

本基金未参与投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金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

本基金未参与投资国债期货。

## 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报告期内被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 本基金投资的前十名股票中,投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金本报告期末无股票投资。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,406.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,937.90
6	其他应收款	504,161.82

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	530,506.50

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳月月盈30天持有期债券A	信澳月月盈30天持有期债券C
基金合同生效日基金份额总额	-	176,624,017.49
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	8.75	1,210,727.26
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	13,385,365.19
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	8.75	164,449,379.56

### §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

基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人报告期末未运用固有资金投资本基金。

### §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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳月月盈 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳月月盈 30 天持有期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；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年十月二十七日