

达诚腾益债券型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 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	9
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
§ 5 托管人报告	13
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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.11 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 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	213,252,462.01 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	10,104,465.71 份	203,147,996.30 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	杨军智
	联系电话	021-60581280	010-60834299
	电子邮箱	dingxf@integrity-funds.com	yjz@citics.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 层 2903 单元	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 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(2025 年 1 月 1 日-2025 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	1,153,854.68	8,241,524.71
本期利润	-321,014.87	-524,224.02
加权平均基金份 额本期利润	-0.0084	-0.0019
本期加权平均净 值利润率	-0.76%	-0.17%
本期基金份额净 值增长率	0.39%	0.17%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,214,659.28	22,201,249.47
期末可供分配基 金份额利润	0.1202	0.1093
期末基金资产净 值	11,319,124.99	225,349,245.77
期末基金份额净	1.1202	1.1093

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	12.02%	10.93%

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

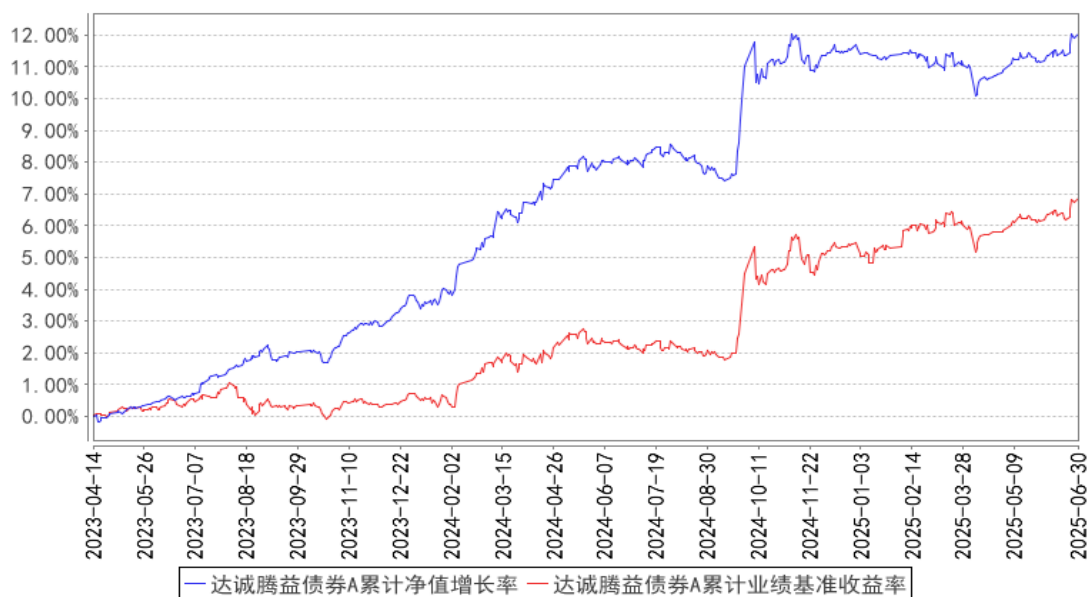
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.77%	0.12%	0.68%	0.12%	0.09%	0.00%
过去三个月	0.95%	0.14%	0.93%	0.13%	0.02%	0.01%
过去六个月	0.39%	0.12%	1.46%	0.13%	-1.07%	-0.01%
过去一年	3.66%	0.18%	4.60%	0.17%	-0.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.02%	0.14%	6.86%	0.13%	5.16%	0.01%

达诚腾益债券 C

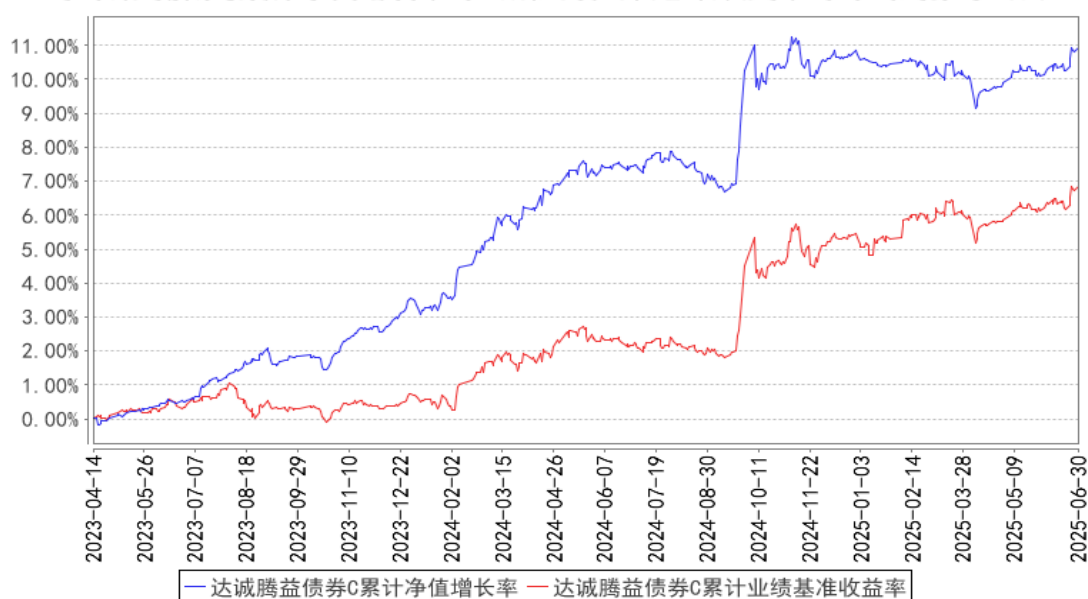
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.74%	0.12%	0.68%	0.12%	0.06%	0.00%
过去三个月	0.82%	0.14%	0.93%	0.13%	-0.11%	0.01%
过去六个月	0.17%	0.12%	1.46%	0.13%	-1.29%	-0.01%
过去一年	3.24%	0.18%	4.60%	0.17%	-1.36%	0.01%
自基金合同生效起至今	10.93%	0.14%	6.86%	0.13%	4.07%	0.01%

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

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 10490 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 9 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、达诚添利利率债债券型证券投资基金。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		
陈佑	本基金的基金经理	2023 年 4 月 14 日	-	10 年	陈佑先生，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。
陈染	本基金的基金经理	2025 年 2 月 13 日	-	6 年	陈染女士，硕士。拥有 9 年金融行业从业经验，曾任广发银行战略客户部客户经理、广发银行资产管理部投资经理；广银理财有限责任公司集中交易部交易员；达诚基金管理有限公司研究部研究员。现任达诚基金管理有限公司基金经理。
王栋	本基金的基金经理	2023 年 4 月 14 日	2025 年 2 月 13 日	13 年	王栋先生，硕士。拥有 17 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门总监。

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遵规守信情况的说明

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

上半年，对等关税、地缘冲突、国内基本面修复情况等因素共同影响着股债市场。宏观经济整体呈现“稳中有增、结构分化”的特征，政策托底效应逐步显现，经济在消费回暖、基建托底及出口结构优化的支撑下保持韧性，但物价低迷、地产调整及外部风险仍构成挑战。一季度生产端工业与服务业协同扩张，新能源汽车、工业机器人等新质生产力相关产品产量实现两位数增长，反映产业升级成效，同时数字经济对服务业的带动作用同样显著。二季度关税效应使得外部环境逐步恶化，制造业 PMI 也重新落入收缩区间，反映出制造业发展面临的压力与挑战在加剧，增长动能有所减弱，新订单需求后劲不足，消费者购买力与企业投资意愿受到多种因素制约，整体形势面临挑战。

通胀方面，今年以来 CPI 同比在 0 附近波动，PPI 同比持续为负，且已经连续 30 多个月为负了，这也显示内需不足和工业通缩压力，预计下半年核心 CPI 通胀或逐季小幅改善，但全年均值仍处 0 区间。若三季度 CPI 仍在 0 附近，央行可能通过降准降息引导实际利率下行，推动债券收益率曲线“牛平”。同时输入性通胀的风险有限，全球大宗商品价格受债务杠杆乏力和需求疲软制

约，预计维持震荡下行。原油价格虽然因近期中东战事的升级快速上涨，但若稳定在 80 美元/桶以下，输入性通胀对市场的压制较小。

消费数据是上半年最大的亮点，数据在政策驱动下超预期反弹，以旧换新政策带动家电、通讯器材等升级类商品销售增长，各节假日出行同比增长明显，带动旅游、文娱消费快速增长，消费结构向服务化升级趋势明显。但居民收入增长乏力仍是长期制约，财产性收入改善尚未形成规模效应，消费内生动力仍需强化。

进出口与就业方面，出口韧性犹存，市场结构加速调整，受关税影响，对美出口同比下降 34.5%，但对欧盟、东盟出口分别增长 12%和 14.8%，市场多元化策略成效显著；进口端下降主要受国内需求疲软及大宗商品价格下跌影响，铁矿砂、原油等进口量同比下降，反映经济转型期传统行业需求收缩。就业端尽管政府设定城镇调查失业率目标为 5.5%，但劳动密集度下降和灵活就业占比上升，显示就业质量改善有限，若下半年失业率超预期攀升，可能加剧市场对内需疲软的担忧，推动资金向利率债避险。

债券市场方面，上半年呈现出较为复杂的走势，不同类型债券表现各异，整体呈现“先扬后抑再修复”的波动态势。1 月初受汇率因素制约，央行暂停国债买入，市场资金面紧张，导致短债回调，长债震荡，但债市表现仍好于权益市场。春节前后 DeepSeek 的横空出世让资金投资科技板块的热情迅速升温，同时临近“两会”，政策的预期同样推动权益行情延续，债券资金回流股市也导致利率加速回调，直到一季度末央行态度边际呵护，债券下跌趋势才趋于平缓。随着 4 月到来的中美“对等关税”宣布，短短几周内美中美关税水平经历了“过山车”，直接带动债市利率冲击新低后反弹，虽然短期内的局势缓和以及历史最低位的收益率均使得债券收益率突破的动力不足，但 5 月的降息、降准，则直接引导资金利率在年内首次低于 OMO 政策利率，债券也重回下行趋势。

权益市场方面，经历了元旦之后的大跌，逐渐企稳，尤其是春节前后市场加速上涨，科技创新带动了科技板块的投资热情迅速升温，也成为春季行情主要的推手之一，之后临近“两会”，政策的预期使得权益市场行情延续。与此同时，股债跷跷板效应尤为突出，在风险偏好增强，股票收益预期变高的情况下，原本投资于债券的资金流入股市，推动股市进一步上涨。4 月初中美“对等关税”的影响让 A 股经历了历史上最严重的下跌，但伴随着恐慌情绪的释放市场也很快回归理性，短短几周后美中美关税水平经历了“过山车”，外围的缓和叠加国内双降政策的落地，股市也逐步修复并冲击年内新高，市场情绪高涨。

2025 年上半年，达诚腾益债券前期以降久期和杠杆为主，同时降低了中长期银行二级资本债和城投债的持仓比例，久期和杠杆均达到了成立以来的最低位置，直到 3 月底资金面缓和后才逐步提升久期和杠杆，并在央行宣布双降后再次提升久期，保持组合票息的同时增强组合的弹性。

股票方面前期仓位相对较低，相对较好的避开了关税初期的影响，并在降息、降准后逐步进行了加仓，在政策的推动下整体仓位也来到了历史高位，顺势而为。整个上半年，产品整体运作稳定，净值稳中有升。

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 1.1202 元，本报告期份额净值增长率为 0.39%；达诚腾益债券 C 基金份额净值为 1.1093 元，本报告期份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准增长率为 1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，从宏观经济层面而言，虽然上半年 GDP 同比增速或达到 5.4%，但下半年面临出口回落、消费补贴效应减弱等压力，预计增速逐步放缓，同时经济放缓可能促使央行通过降准、降息等工具稳定增长，直接压低债券收益率。

其次是今年以来 CPI 同比一直在 0 附近波动，PPI 则同比持续为负，且已经连续 30 个月为负了，这也显示内需不足和工业通缩压力，虽然下半年核心 CPI 通胀或逐季小幅改善，但全年均值仍可能处在 0 区间，通胀压力不大。

第三是货币政策层面，二季度货币政策委员会的例会纪要中，虽然删除“择机降准降息”的表述，叠加重申“资金防空转”的要求，但整体政策仍将维持宽松基调，维持当前的流动性状态使得债券利率没有大幅调整的趋势。

第四是房地产行业持续疲软，1-5 月的房地产开发投资增速同比是-10.7%，继续向下，且跌幅扩大，数据依旧走弱，地产融资起不来，信贷需求不足，利率就没有大幅上行的空间。

所以对于债券而言，年内仍不看空。宏观经济预期决定了利率大致的方向，货币政策导向则给了债券支撑，虽然短期内货币宽松博弈空间相对有限，一定程度或演绎利好出尽的行情，同时中美关税政策仍在缓和窗口，降低了贸易摩擦对经济增长的不确定性，一定程度或削弱债市的“避险溢价”，加大利率波动和上行风险。但是宏观数据的疲软以及资金面的宽松预期都将为债市提供强有力的支持，利率大幅上行的概率较小，因此年内债券的胜率依旧较高。

对于股票来说，双降通常会影响到市场流动性和资金成本，宽松的货币政策可以降低企业融资成本，提高盈利预期，从而推动股价上涨，尤其是对利率敏感的行业。科技创新再贷款额度扩大至 8000 亿元，以及服务消费与养老再贷款工具，可以满足科技型企业及设备更新领域激增的融资需求。同时中美关税博弈迎来实质性缓和，缓解了贸易摩擦对出口链的压制，一定程度提振经济增长预期，叠加货币政策与财政政策、产业政策形成合力，有助于提升市场对“经济软着陆”的信心，保险资金入市和汇金增持也为股市提供长期支撑，市场风险偏好回升，均可能对股市构成

一定利好。因此在内部政策提振外加外部矛盾缓和的前提下，股票市场也将迎来结构性的机会。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	764,825.34	3,129,912.19
结算备付金		64,660.49	64,466.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	257,730,851.64	567,160,152.36
其中：股票投资		42,278,955.69	39,035,652.12
基金投资		-	-
债券投资		215,451,895.95	528,124,500.24
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		20,126,870.54	1,035,145.74
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		278,687,208.01	571,389,676.38
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
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		38,111,443.23	50,019,143.70
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,455,151.72	7,355,582.13
应付管理人报酬		113,535.74	285,087.51
应付托管费		18,922.62	47,514.59
应付销售服务费		62,867.52	144,909.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,038.28	24,593.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	241,878.14	231,340.54
负债合计		42,018,837.25	58,108,170.97
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	213,252,462.01	463,003,807.96
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,415,908.75	50,277,697.45
净资产合计		236,668,370.76	513,281,505.41
负债和净资产总计		278,687,208.01	571,389,676.38

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 213,252,462.01 份，其中达诚腾益债券 A 基金份额总额 10,104,465.71 份，基金份额净值 1.1202 元；达诚腾益债券 C 基金份额总额 203,147,996.30 份，基金份额净值 1.1093 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,569,941.85	53,886,443.49
1. 利息收入		39,589.48	534,576.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,468.26	522,504.93
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		26,121.22	12,071.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,770,194.03	36,838,896.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,046,324.61	-7,348,974.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,408,148.94	42,550,951.39
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	408,369.70	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	-10,240,618.28	13,543,263.35
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	776.62	2,969,707.68
减：二、营业总支出		2,415,180.74	7,843,315.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,032,602.84	3,822,783.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	172,100.50	637,130.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	528,842.58	1,872,969.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		556,571.85	1,341,262.19
其中：卖出回购金融资产支出		556,571.85	1,341,262.19
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		11,843.42	46,143.16
8. 其他费用	6.4.7.23	113,219.55	123,026.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-845,238.89	46,043,128.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-845,238.89	46,043,128.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-845,238.89	46,043,128.01

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	463,003,807.96	50,277,697.45	513,281,505.41
二、本期期初净资产	463,003,807.96	50,277,697.45	513,281,505.41
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-249,751,345.95	-26,861,788.70	-276,613,134.65
(一)、综合收益总额	-	-845,238.89	-845,238.89
(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)	-249,751,345.95	-26,016,549.81	-275,767,895.76
其中：1. 基金申购款	69,704,117.20	7,325,644.26	77,029,761.46
2. 基金赎回款	-319,455,463.15	-33,342,194.07	-352,797,657.22
(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	213,252,462.01	23,415,908.75	236,668,370.76
项目	上年度可比期间		
	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	-1,046,957,803.31	-48,016,494.72	-1,094,974,298.03

产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)			
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

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

基金管理人负责人

田中甲

主管会计工作负责人

徐毅翔

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 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	758,589.99
等于：本金	758,400.04
加：应计利息	189.95
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	6,235.35
等于：本金	6,234.89
加：应计利息	0.46
减：坏账准备	-
合计	764,825.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	41,719,361.43	-	42,278,955.69	559,594.26

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,063,244.66	158,713.42	9,243,313.42	21,355.34
	银行间市场	201,502,116.28	2,368,582.53	206,208,582.53	2,337,883.72
	合计	210,565,360.94	2,527,295.95	215,451,895.95	2,359,239.06
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		252,284,722.37	2,527,295.95	257,730,851.64	2,918,833.32

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 2025 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	16,906.59
其中：交易所市场	-
银行间市场	16,906.59
应付利息	-
预提费用	223,519.55
其他应付款	1,452.00
合计	241,878.14

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,358,842.58	63,358,842.58
本期申购	1,355,597.03	1,355,597.03
本期赎回（以“-”号填列）	-54,609,973.90	-54,609,973.90
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	10,104,465.71	10,104,465.71

达诚腾益债券 C

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	399,644,965.38	399,644,965.38
本期申购	68,348,520.17	68,348,520.17
本期赎回（以“-”号填列）	-264,845,489.25	-264,845,489.25
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	203,147,996.30	203,147,996.30

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	7,025,915.82	317,659.57	7,343,575.39
本期期初	7,025,915.82	317,659.57	7,343,575.39
本期利润	1,153,854.68	-1,474,869.55	-321,014.87
本期基金份额交易产生的变动数	-6,731,164.86	923,263.62	-5,807,901.24
其中：基金申购款	168,041.91	-14,825.28	153,216.63
基金赎回款	-6,899,206.77	938,088.90	-5,961,117.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,448,605.64	-233,946.36	1,214,659.28

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	40,981,620.94	1,952,501.12	42,934,122.06
本期期初	40,981,620.94	1,952,501.12	42,934,122.06
本期利润	8,241,524.71	-8,765,748.73	-524,224.02
本期基金份额交易产生的变动数	-22,267,070.13	2,058,421.56	-20,208,648.57
其中：基金申购款	7,938,476.46	-766,048.83	7,172,427.63
基金赎回款	-30,205,546.59	2,824,470.39	-27,381,076.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,956,075.52	-4,754,826.05	22,201,249.47

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	12,228.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,045.35
结算备付金利息收入	194.40
其他	-
合计	13,468.26

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,046,324.61
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	-1,046,324.61

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	83,226,503.80
减：卖出股票成本总额	84,140,243.71
减：交易费用	132,584.70
买卖股票差价收入	-1,046,324.61

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,767,226.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,640,922.13
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	12,408,148.94

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	468,322,797.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	453,402,635.87
减：应计利息总额	8,270,993.73
减：交易费用	8,246.11
买卖债券差价收入	6,640,922.13

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	408,369.70
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	408,369.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,240,618.28
股票投资	-663,570.19
债券投资	-9,577,048.09
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	-10,240,618.28

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	776.62
合计	776.62

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
开户费	400.00
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	113,219.55

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、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构、证券经纪服务商
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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	171,273,621.27	100.00	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	30,048,000.00	100.00	664,511,090.00	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	197,680,000.00	100.00	10,481,300,000.00	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 2025年1月1日至2025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	80,799.73	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,032,602.84	3,822,783.51
其中：应支付销售机构的客户维护 费	469,033.81	1,760,164.77
应支付基金管理人的净管理费	563,569.03	2,062,618.74

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,100.50	637,130.60

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	38.67	38.67
中信证券股份有限公司	-	369,377.49	369,377.49
合计	-	369,416.16	369,416.16
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	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

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	6,235.35	1,045.35	608,081.18	21,343.40

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（2025 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 2025 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 38,111,443.23 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
102381799	23 西咸新发 MTN002	2025 年 7 月 1 日	102.56	100,000	10,256,389.04
102383043	23 泰达投资 MTN005	2025 年 7 月 1 日	108.48	100,000	10,848,342.47
102482015	24 云建投 MTN010	2025 年 7 月 1 日	101.37	100,000	10,137,472.88
200212	20 国开 12	2025 年 7 月 1 日	103.29	95,000	9,812,648.90
合计				395,000	41,054,853.29

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	50,373,280.55	60,039,449.85
合计	50,373,280.55	60,039,449.85

注：未评级债券为短期融资券。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	39,003,284.65	227,277,231.22
AAA 以下	17,889,169.86	100,741,773.97
未评级	108,186,160.89	140,066,045.20
合计	165,078,615.40	468,085,050.39

注：未评级债券为国债、政策性金融债和中期票据。

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 2025 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	764,825.34	-	-	-	764,825.34
结算备付金	64,660.49	-	-	-	64,660.49
交易性金融资产	103,713,023.29	80,886,753.15	30,852,119.51	42,278,955.69	257,730,851.64
应收申购款	-	-	-	20,126,870.54	20,126,870.54
资产总计	104,542,509.12	80,886,753.15	30,852,119.51	62,405,826.23	278,687,208.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,455,151.72	3,455,151.72
应付管理人报酬	-	-	-	113,535.74	113,535.74
应付托管费	-	-	-	18,922.62	18,922.62
卖出回购金融资产款	38,111,443.23	-	-	-	38,111,443.23
应付销售服务费	-	-	-	62,867.52	62,867.52
应交税费	-	-	-	15,038.28	15,038.28
其他负债	-	-	-	241,878.14	241,878.14
负债总计	38,111,443.23	-	-	3,907,394.02	42,018,837.25
利率敏感度缺口	66,431,065.89	80,886,753.15	30,852,119.51	58,498,432.21	236,668,370.76
上年度末 2024 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	3,129,912.19	-	-	-	3,129,912.19
结算备付金	64,466.09	-	-	-	64,466.09
交易性金融资产	255,300,236.14	251,694,696.98	21,129,567.12	39,035,652.12	567,160,152.36
应收申购款	-	-	-	1,035,145.74	1,035,145.74
资产总计	258,494,614.42	251,694,696.98	21,129,567.12	40,070,797.86	571,389,676.38
负债					

应付赎回款	-	-	-	7,355,582.13	7,355,582.13
应付管理人报酬	-	-	-	285,087.51	285,087.51
应付托管费	-	-	-	47,514.59	47,514.59
卖出回购金融资产款	50,019,143.70	-	-	-	50,019,143.70
应付销售服务费	-	-	-	144,909.05	144,909.05
应交税费	-	-	-	24,593.45	24,593.45
其他负债	-	-	-	231,340.54	231,340.54
负债总计	50,019,143.70	-	-	8,089,027.27	58,108,170.97
利率敏感度缺口	208,475,470.72	251,694,696.98	21,129,567.12	31,981,770.59	513,281,505.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,828,340.82	2,327,479.44
	市场利率上升 25 个基点	-1,828,340.82	-2,327,479.44

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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	42,278,955.69	17.86	39,035,652.12	7.61
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	42,278,955.69	17.86	39,035,652.12	7.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,246,149.26	2,096,262.38
	沪深 300 指数下降 5%	-2,246,149.26	-2,096,262.38

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	42,278,955.69	39,035,652.12
第二层次	215,451,895.95	528,124,500.24
第三层次	-	-
合计	257,730,851.64	567,160,152.36

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 2025 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	42,278,955.69	15.17
	其中：股票	42,278,955.69	15.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	215,451,895.95	77.31
	其中：债券	215,451,895.95	77.31
	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	829,485.83	0.30
8	其他各项资产	20,126,870.54	7.22
9	合计	278,687,208.01	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	363,908.00	0.15
B	采矿业	1,760,482.00	0.74
C	制造业	24,362,508.61	10.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,113,426.00	0.47
E	建筑业	309,822.00	0.13
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	504,091.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,693,358.38	1.56
J	金融业	8,796,463.90	3.72
K	房地产业	256,120.00	0.11
L	租赁和商务服务业	547,969.80	0.23
M	科学研究和技术服务业	447,528.00	0.19
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	-	-
S	综合	123,278.00	0.05
	合计	42,278,955.69	17.86

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	1,200	1,691,424.00	0.71
2	300750	宁德时代	4,700	1,185,434.00	0.50
3	601318	XD 中国平	17,800	987,544.00	0.42
4	600036	招商银行	20,300	932,785.00	0.39
5	000333	美的集团	9,000	649,800.00	0.27
6	600900	长江电力	21,200	638,968.00	0.27
7	601166	兴业银行	25,400	592,836.00	0.25
8	002594	比亚迪	1,700	564,247.00	0.24
9	300059	东方财富	23,900	552,807.00	0.23
10	601899	紫金矿业	27,800	542,100.00	0.23
11	601398	工商银行	57,500	436,425.00	0.18
12	000858	五 粮 液	3,600	428,040.00	0.18
13	600276	恒瑞医药	8,200	425,580.00	0.18
14	000651	格力电器	8,500	381,820.00	0.16
15	000988	华工科技	7,600	357,276.00	0.15
16	600887	伊利股份	12,200	340,136.00	0.14
17	600919	江苏银行	27,800	331,932.00	0.14
18	601328	交通银行	38,600	308,800.00	0.13
19	601288	农业银行	52,300	307,524.00	0.13
20	300339	润和软件	6,000	304,980.00	0.13
21	601816	京沪高铁	52,900	304,175.00	0.13
22	600988	赤峰黄金	12,200	303,536.00	0.13
23	603259	药明康德	4,300	299,065.00	0.13
24	002966	苏州银行	33,900	297,642.00	0.13
25	688981	中芯国际	3,283	289,462.11	0.12
26	002475	立讯精密	8,200	284,458.00	0.12
27	601456	国联民生	27,000	279,450.00	0.12
28	688256	寒武纪	458	275,487.00	0.12
29	600839	四川长虹	28,200	274,104.00	0.12
30	688521	芯原股份	2,813	271,454.50	0.11
31	600000	浦发银行	19,400	269,272.00	0.11
32	002371	北方华创	600	265,326.00	0.11
33	300124	汇川技术	3,900	251,823.00	0.11
34	000725	京东方 A	62,800	250,572.00	0.11
35	002340	格林美	39,000	247,650.00	0.10
36	300760	迈瑞医疗	1,100	247,225.00	0.10
37	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.10
38	601088	中国神华	5,700	231,078.00	0.10
39	600157	永泰能源	171,400	229,676.00	0.10
40	600487	亨通光电	15,000	229,500.00	0.10
41	301236	软通动力	4,200	229,488.00	0.10
42	689009	九号公司	3,856	228,159.52	0.10
43	002797	第一创业	31,800	225,144.00	0.10

44	000066	中国长城	14,900	220,520.00	0.09
45	002465	海格通信	15,600	217,464.00	0.09
46	688777	中控技术	4,825	216,690.75	0.09
47	601728	中国电信	27,800	215,450.00	0.09
48	600096	云天化	9,800	215,306.00	0.09
49	000997	新大陆	6,600	213,708.00	0.09
50	600536	中国软件	4,500	210,465.00	0.09
51	600879	航天电子	19,900	208,353.00	0.09
52	601168	西部矿业	12,500	207,875.00	0.09
53	601577	长沙银行	20,900	207,746.00	0.09
54	601668	中国建筑	36,000	207,720.00	0.09
55	002156	通富微电	8,100	207,522.00	0.09
56	601601	中国太保	5,500	206,305.00	0.09
57	000001	平安银行	16,900	203,983.00	0.09
58	002273	水晶光电	10,200	203,694.00	0.09
59	002714	牧原股份	4,800	201,648.00	0.09
60	601127	赛力斯	1,500	201,480.00	0.09
61	601988	中国银行	35,700	200,634.00	0.08
62	300017	网宿科技	18,700	200,464.00	0.08
63	002352	顺丰控股	4,100	199,916.00	0.08
64	600885	宏发股份	8,960	199,897.60	0.08
65	300395	菲利华	3,900	199,290.00	0.08
66	600352	浙江龙盛	19,500	198,120.00	0.08
67	002185	华天科技	19,600	197,960.00	0.08
68	601108	财通证券	24,700	195,377.00	0.08
69	000831	中国稀土	5,400	195,048.00	0.08
70	600031	三一重工	10,800	193,860.00	0.08
71	600016	民生银行	40,800	193,800.00	0.08
72	688002	睿创微纳	2,752	191,869.44	0.08
73	603501	豪威集团	1,500	191,475.00	0.08
74	600941	中国移动	1,700	191,335.00	0.08
75	002294	信立泰	4,000	189,320.00	0.08
76	300502	新易盛	1,460	185,449.20	0.08
77	600309	万华化学	3,400	184,484.00	0.08
78	601857	中国石油	21,500	183,825.00	0.08
79	688122	西部超导	3,542	183,758.96	0.08
80	002415	海康威视	6,600	183,018.00	0.08
81	000063	中兴通讯	5,600	181,944.00	0.08
82	688008	澜起科技	2,206	180,892.00	0.08
83	601128	常熟银行	24,470	180,343.90	0.08
84	002532	天山铝业	21,700	180,327.00	0.08
85	688120	华海清科	1,062	179,159.40	0.08
86	688099	晶晨股份	2,520	178,945.20	0.08

87	000423	东阿阿胶	3,400	177,820.00	0.08
88	002595	豪迈科技	3,000	177,660.00	0.08
89	002281	光迅科技	3,600	177,552.00	0.08
90	002138	顺络电子	6,300	177,156.00	0.07
91	300308	中际旭创	1,200	175,032.00	0.07
92	000783	长江证券	25,100	173,943.00	0.07
93	002078	太阳纸业	12,900	173,634.00	0.07
94	600109	国金证券	19,700	172,769.00	0.07
95	688072	拓荆科技	1,113	171,079.23	0.07
96	002738	中矿资源	5,300	170,448.00	0.07
97	300058	蓝色光标	25,980	170,428.80	0.07
98	600862	中航高科	6,500	169,520.00	0.07
99	603596	伯特利	3,200	168,608.00	0.07
100	600143	金发科技	16,200	167,022.00	0.07
101	601169	北京银行	24,400	166,652.00	0.07
102	300136	信维通信	7,400	165,760.00	0.07
103	600660	福耀玻璃	2,900	165,329.00	0.07
104	600298	安琪酵母	4,700	165,299.00	0.07
105	002065	东华软件	17,200	165,120.00	0.07
106	688047	龙芯中科	1,231	164,203.09	0.07
107	002223	鱼跃医疗	4,600	163,760.00	0.07
108	600580	卧龙电驱	8,280	163,695.60	0.07
109	600690	海尔智家	6,600	163,548.00	0.07
110	300054	鼎龙股份	5,700	163,476.00	0.07
111	300274	阳光电源	2,400	162,648.00	0.07
112	600873	梅花生物	15,200	162,488.00	0.07
113	300498	温氏股份	9,500	162,260.00	0.07
114	002353	杰瑞股份	4,600	161,000.00	0.07
115	601012	隆基绿能	10,600	159,212.00	0.07
116	600809	山西汾酒	900	158,751.00	0.07
117	300383	光环新网	11,100	158,730.00	0.07
118	002850	科达利	1,400	158,438.00	0.07
119	002230	科大讯飞	3,300	158,004.00	0.07
120	601615	明阳智能	13,700	157,413.00	0.07
121	688012	中微公司	863	157,324.90	0.07
122	002085	万丰奥威	9,900	157,311.00	0.07
123	000728	国元证券	19,800	156,222.00	0.07
124	002008	大族激光	6,400	155,968.00	0.07
125	002142	宁波银行	5,700	155,952.00	0.07
126	601766	中国中车	22,000	154,880.00	0.07
127	600406	国电南瑞	6,900	154,629.00	0.07
128	688111	金山办公	549	153,747.45	0.06
129	601229	上海银行	14,300	151,723.00	0.06

130	600895	张江高科	5,900	151,630.00	0.06
131	601688	华泰证券	8,500	151,385.00	0.06
132	603160	汇顶科技	2,100	149,163.00	0.06
133	600050	中国联通	27,900	148,986.00	0.06
134	300012	华测检测	12,700	148,463.00	0.06
135	300604	长川科技	3,300	148,203.00	0.06
136	600028	中国石化	26,200	147,768.00	0.06
137	000568	泸州老窖	1,300	147,420.00	0.06
138	600549	厦门钨业	7,000	146,440.00	0.06
139	000932	华菱钢铁	33,200	146,080.00	0.06
140	601225	陕西煤业	7,500	144,300.00	0.06
141	000100	TCL 科技	32,800	142,024.00	0.06
142	000338	潍柴动力	9,200	141,496.00	0.06
143	600153	建发股份	13,600	141,032.00	0.06
144	600060	海信视像	6,100	140,422.00	0.06
145	300699	光威复材	4,400	139,348.00	0.06
146	603986	兆易创新	1,100	139,183.00	0.06
147	601665	齐鲁银行	22,000	139,040.00	0.06
148	300474	景嘉微	1,900	138,700.00	0.06
149	002444	巨星科技	5,400	137,754.00	0.06
150	300037	新宙邦	3,900	137,280.00	0.06
150	601997	贵阳银行	22,000	137,280.00	0.06
151	000729	燕京啤酒	10,600	137,058.00	0.06
152	601985	中国核电	14,700	137,004.00	0.06
153	601233	桐昆股份	12,900	136,740.00	0.06
154	601990	南京证券	16,900	136,552.00	0.06
155	601138	工业富联	6,300	134,694.00	0.06
156	300001	特锐德	5,600	134,232.00	0.06
157	000878	云南铜业	10,500	133,560.00	0.06
158	000021	深科技	7,100	133,054.00	0.06
159	002027	分众传媒	18,200	132,860.00	0.06
160	600699	均胜电子	7,600	132,544.00	0.06
161	002410	广联达	9,700	130,077.00	0.05
162	600150	中国船舶	3,900	126,906.00	0.05
163	603019	中科曙光	1,800	126,720.00	0.05
164	688249	晶合集成	6,221	126,099.67	0.05
165	600104	上汽集团	7,800	125,190.00	0.05
166	603288	海天味业	3,200	124,512.00	0.05
167	000738	航发控制	6,000	124,500.00	0.05
168	600909	XD 华安证	21,300	124,179.00	0.05
169	600673	东阳光	10,600	123,278.00	0.05
170	600765	中航重机	7,300	123,224.00	0.05
171	600398	海澜之家	17,700	123,192.00	0.05

172	600497	驰宏锌锗	23,100	122,199.00	0.05
173	603179	新泉股份	2,600	122,122.00	0.05
174	000623	吉林敖东	7,200	122,040.00	0.05
175	600141	兴发集团	5,900	121,127.00	0.05
176	000400	许继电气	5,500	119,735.00	0.05
177	688188	柏楚电子	878	115,597.48	0.05
178	002409	雅克科技	2,100	114,849.00	0.05
179	300724	捷佳伟创	2,100	114,030.00	0.05
180	601628	中国人寿	2,700	111,213.00	0.05
181	000625	长安汽车	8,700	111,012.00	0.05
182	000039	中集集团	14,100	110,826.00	0.05
183	600529	山东药玻	5,000	110,700.00	0.05
184	000792	盐湖股份	6,400	109,312.00	0.05
185	300033	同花顺	400	109,204.00	0.05
186	600563	法拉电子	1,000	109,090.00	0.05
187	600905	三峡能源	25,300	107,778.00	0.05
188	600089	特变电工	8,900	106,177.00	0.04
189	600048	保利发展	12,900	104,490.00	0.04
190	601888	中国中免	1,700	103,649.00	0.04
191	002050	三花智控	3,900	102,882.00	0.04
192	601390	中国中铁	18,200	102,102.00	0.04
193	688017	绿的谐波	801	100,036.89	0.04
194	600436	片仔癀	500	100,005.00	0.04
195	000938	紫光股份	4,100	98,359.00	0.04
196	002241	歌尔股份	3,900	90,948.00	0.04
197	603338	浙江鼎力	1,900	90,060.00	0.04

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	2,832,963.00	0.55
2	300750	宁德时代	2,340,450.00	0.46
3	601318	XD 中国平	2,010,988.00	0.39
4	600036	招商银行	1,903,717.00	0.37
5	000333	美的集团	1,278,956.00	0.25
6	600900	长江电力	1,256,115.00	0.24
7	601166	兴业银行	1,131,269.00	0.22
8	600418	江淮汽车	1,124,458.00	0.22
9	300059	东方财富	1,041,873.00	0.20
10	601899	紫金矿业	1,035,503.00	0.20
11	002625	光启技术	1,004,297.00	0.20
12	002594	比亚迪	938,005.00	0.18

13	601398	工商银行	885,582.00	0.17
14	000858	五 粮 液	873,391.00	0.17
15	688256	寒武纪	868,698.03	0.17
16	600276	恒瑞医药	737,049.00	0.14
17	002384	东山精密	705,716.00	0.14
18	002475	立讯精密	704,148.00	0.14
19	000651	格力电器	690,024.00	0.13
20	688981	中芯国际	680,529.79	0.13

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	3,298,759.00	0.64
2	300750	宁德时代	1,946,067.00	0.38
3	601318	XD 中国平	1,899,943.00	0.37
4	600036	招商银行	1,811,336.00	0.35
5	600418	江淮汽车	1,532,189.00	0.30
6	002625	光启技术	1,313,907.00	0.26
7	000333	美的集团	1,229,916.00	0.24
8	600900	长江电力	1,137,155.00	0.22
9	601166	兴业银行	1,037,876.00	0.20
10	688256	寒武纪	1,012,574.08	0.20
11	002384	东山精密	986,202.00	0.19
12	601899	紫金矿业	964,787.00	0.19
13	601398	工商银行	897,600.00	0.17
14	300059	东方财富	820,340.00	0.16
15	000858	五 粮 液	789,386.00	0.15
16	300308	中际旭创	711,098.00	0.14
17	601328	交通银行	697,332.00	0.14
18	002594	比亚迪	695,188.00	0.14
19	000651	格力电器	694,290.00	0.14
20	600276	恒瑞医药	666,150.00	0.13

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	88,047,117.47
卖出股票收入（成交）总额	83,226,503.80

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	20,741,735.95	8.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,209,400.00	17.41
	其中：政策性金融债	30,768,591.78	13.00
4	企业债券	9,243,313.42	3.91
5	企业短期融资券	50,373,280.55	21.28
6	中期票据	67,076,594.80	28.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	26,807,571.23	11.33
10	合计	215,451,895.95	91.04

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	200212	20 国开 12	200,000	20,658,208.22	8.73
2	102383043	23 泰达投资 MTN005	100,000	10,848,342.47	4.58
3	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	100,000	10,805,071.23	4.57
4	232380014	23 天津银行二级资本债 01	100,000	10,724,410.96	4.53
5	2400006	24 特别国债 06	100,000	10,664,320.65	4.51

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司出现在报告编制日前一

年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,126,870.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,126,870.54

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 (%)
达诚腾益 债券 A	463	21,823.90	-	-	10,104,465.71	100.00
达诚腾益 债券 C	5,097	39,856.39	25,393,799.91	12.50	177,754,196.39	87.50
合计	5,499	38,780.23	25,393,799.91	11.91	187,858,662.10	88.09

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	9.38	0.00009
	达诚腾益债券 C	84,237.89	0.04147
	合计	84,247.27	0.03951

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
	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	63,358,842.58	399,644,965.38
本报告期基金总申购份额	1,355,597.03	68,348,520.17
减：本报告期基金总赎回份额	54,609,973.90	264,845,489.25

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,104,465.71	203,147,996.30

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，本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 2 月 28 日，本基金管理人发布《达诚基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，聘请张力先生担任本基金管理人副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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安永华明会计师事务所（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	171,273,621. 27	100.00	80,799.73	100.00	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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	30,048,000.00	100.00	197,680,000.00	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 2024 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	2025 年 1 月 22 日
2	达诚基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报	2025 年 1 月 22 日
3	达诚基金腾益债券基金经理变更公告	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	2025 年 2 月 15 日
4	达诚基金腾益债券产品资料概要更新	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 15 日
5	达诚基金腾益债券招募说明书更新	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 15 日
6	达诚基金腾益债券招募说明书及产品资料概要更新提示性公告	证券时报	2025 年 2 月 15 日
7	达诚腾益债券型证券投资基金 2024 年度报告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 31 日
8	达诚基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报	2025 年 3 月 31 日
9	达诚基金关于新增万联证券为旗下开放式基金代销机构并参加其费率优惠	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电	2025 年 4 月 9 日

	活动的公告	子披露网站、上海证券报、证券时报	
10	达诚腾益债券型证券投资基金 2025 年一季度报告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2025 年 4 月 22 日
11	达诚基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
12	达诚基金关于新增华创证券为旗下开放式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	2025 年 5 月 9 日
13	达诚基金关于新增中邮证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构的公告	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	2025 年 6 月 19 日
14	2025 年度定期更新产品资料概要	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网	2025 年 6 月 27 日
15	2025 年度定期更新产品招募说明书	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网	2025 年 6 月 27 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 或客服电话 021-60581258。

达诚基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日