

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 17 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 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债	
基金主代码	013964	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 22 日	
报告期末基金份额总额	439,191,069.72 份	
投资目标	本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金主要投资于短期债券，并控制投资组合久期，力求在承担较低风险和保持组合较好流动性的前提下，实现基金资产的稳健增值。本基金主要投资策略有固定收益类资产投资策略、衍生产品投资策略等。	
业绩比较基准	中债综合财富（1 年以下）指数收益率×85%+一年期定期存款基准利率（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，但低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	达诚基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C
下属分级基金的交易代码	013964	013965
报告期末下属分级基金的份额总额	325,176,883.89 份	114,014,185.83 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A	达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C
1. 本期已实现收益	2,153,829.01	691,872.89
2. 本期利润	1,648,921.14	515,238.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0048	0.0042
4. 期末基金资产净值	359,949,152.89	125,316,032.57
5. 期末基金份额净值	1.1069	1.0991

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；

3.2 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

达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 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
过去三个月	0.43%	0.01%	0.38%	0.01%	0.05%	0.00%
过去六个月	1.01%	0.01%	0.84%	0.01%	0.17%	0.00%
过去一年	1.61%	0.01%	1.60%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三年	7.77%	0.02%	5.90%	0.01%	1.87%	0.01%
自基金合同生效起至今	13.32%	0.02%	9.12%	0.01%	4.20%	0.01%

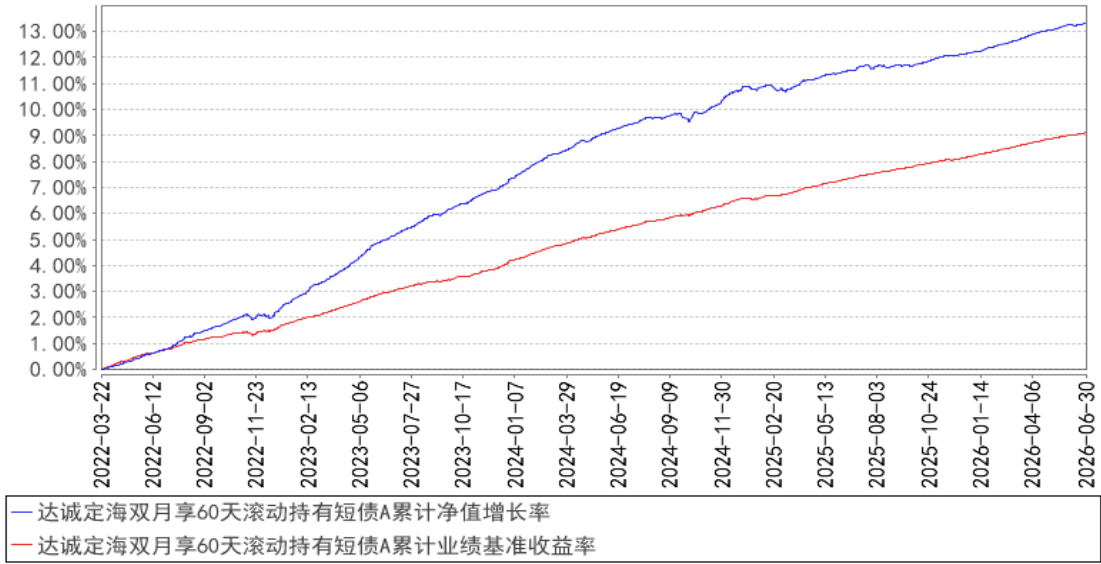
达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C

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
过去三个月	0.38%	0.01%	0.38%	0.01%	0.00%	0.00%

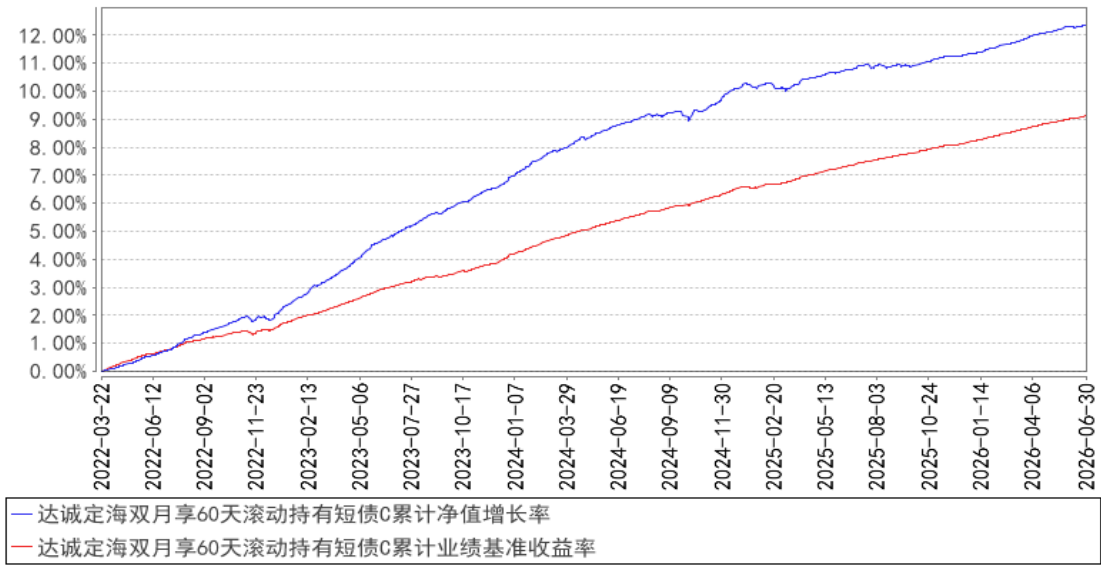
过去六个月	0.91%	0.01%	0.84%	0.01%	0.07%	0.00%
过去一年	1.40%	0.01%	1.60%	0.01%	-0.20%	0.00%
过去三年	7.13%	0.02%	5.90%	0.01%	1.23%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.36%	0.02%	9.12%	0.01%	3.24%	0.01%

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

达诚定海双月享60天滚动持有短债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



达诚定海双月享60天滚动持有短债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		
何盼盼	本基金的基金经理	2025 年 10 月 15 日	-	3 年	何盼盼女士，硕士。拥有 14 年金融相关行业从业经验，曾任平安利顺货币经纪有限责任公司货币经纪人；嘉兴银行股份有限公司金融市场部资管中心投资经理、资产管理部投资经理。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，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度，全球经济延续温和复苏态势，但增长动能较一季度有所走弱。海外方面，美以伊冲突推动全球通胀再度走高，全球能源贸易格局加速重构，主要央行维持谨慎观望态度。国内方面，二季度经济走势整体平稳，高技术产业保持较快增长，出口延续高景气，但投资和消费两大内需指标同步走弱。

债券市场方面，2026 年上半年债市走出超预期上涨行情。二季度债市交易信心逐步恢复，基金从一季度的票息防守策略转向快速追涨长端利率债。10 年期国债收益率进一步下行，最低一度下探至 1.70% 附近。市场整体在流动性宽松、经济温和复苏、供需错位等因素作用下，呈现“长端领涨、短端稳健”的“牛平”特征。信用债方面，中长久期及二永类利率品种迎来补涨，整体表现优于短端品种。

报告期内，本基金紧密围绕“严格控制风险、实现资产长期稳健增值”的投资目标，基于对宏观经济走势、货币政策取向及债券市场运行节奏的判断，采取了以下投资策略：

1. 久期管理方面。本基金根据资金面变化和市场利率走势，在短端利率下行阶段适度拉长组合久期至中短期限，以获取收益率下行带来的资本利得；在 6 月资金面边际收紧、短端利率上行期间，及时缩短组合久期，降低利率波动对组合净值的冲击。通过灵活的久期管理，较好地控制了组合的利率风险敞口。

2. 杠杆策略方面。报告期内，本基金在 4 月至 5 月资金面持续宽松期间，适度维持一定的杠杆水平，利用资金成本与债券收益率之间的套息空间增厚组合收益。进入 6 月后，随着资金利率向政策利率回归、DR001 和 DR007 稳定处于政策利率上方，本基金适度降低了组合杠杆水平，以防范资金面波动带来的流动性风险。

3. 流动性管理方面。报告期内，本基金密切跟踪资金面变化和机构行为变化，在 6 月资金面收紧、部分短债基金遭遇赎回压力期间，本基金凭借充裕的流动性储备较好地平稳度过了市场波动，未出现流动性压力。

4. 风险控制方面。本基金坚持中高等级信用债为主的配置方向，严格规避信用下沉风险。在

信用债投资中，重点选择 AA+及以上评级的短期品种，分散化配置以降低个券集中度风险。在利率风险管理上，坚持短久期运作，将组合久期控制在合理范围内，降低利率波动对组合净值的冲击。在流动性风险管理上，保持高流动性资产占比，确保组合在极端市场环境下的抗风险能力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 A 基金份额净值为 1.1069 元，本报告期份额净值增长率为 0.43%；达诚定海双月享 60 天滚动持有短债 C 基金份额净值为 1.0991 元，本报告期份额净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准增长率为 0.38%。

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	508,845,178.79	97.96
	其中：债券	508,845,178.79	97.96
	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	9,941,253.90	1.91
8	其他资产	656,028.00	0.13
9	合计	519,442,460.69	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。

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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,298,871.23	8.30
	其中：政策性金融债	30,246,986.30	6.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	121,098,293.69	24.96
6	中期票据	276,059,516.12	56.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,335,009.97	0.28
9	其他	70,053,487.78	14.44
10	合计	508,845,178.79	104.86

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	102481669	24 安瑞科控 MTN001	300,000	30,324,650.96	6.25
2	260401	26 农发 01	300,000	30,246,986.30	6.23
3	102483555	24 景国资 MTN003	200,000	20,942,141.37	4.32
4	2123016	21 阳光财险	200,000	20,732,356.16	4.27
5	102383336	23 津城建 MTN015	200,000	20,704,602.74	4.27

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金以套期保值为主要目的，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，规避利率风险以达到降低投资组合的整体风险的目的。制定国债期货套期保值策略时，基金管理人通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并根据基金现券资产利率风险敞口采用流动性好、交易活跃的期货合约。持仓规模上，根据不同期货品种的波动和久期等，大概测算组合安全边界和对冲力度，并根据市场利率水平决定持仓交易高低。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					1,887.38
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行、阳光财产保险股份有限公司和中国工商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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	656,028.00
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	656,028.00

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	达诚定海双月享 60 天滚动 持有短债 A	达诚定海双月享 60 天滚动 持有短债 C
报告期期初基金份额总额	359,784,951.37	127,433,784.35
报告期期间基金总申购份额	21,766,943.78	6,459,912.00
减:报告期期间基金总赎回份额	56,375,011.26	19,879,510.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	325,176,883.89	114,014,185.83

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。

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金募集注册文件
- (2) 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同
- (3) 达诚定海双月享 60 天滚动持有短债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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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

2026 年 7 月 21 日