

# 中融益海 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月25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2022年4月26日起至2022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	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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
§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	14
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 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45
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	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	48
§9 开放式基金份额变动	48

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	49
<b>10.1 基金份额持有人大会决议</b> .....	49
<b>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</b> .....	49
<b>10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼</b> .....	49
<b>10.4 基金投资策略的改变</b> .....	49
<b>10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况</b> .....	49
<b>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</b> .....	49
<b>10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况</b> .....	49
<b>10.8 其他重大事件</b> .....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	52
<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</b> .....	52
<b>11.2 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	52
<b>§12 备查文件目录</b> .....	52
<b>12.1 备查文件目录</b> .....	52
<b>12.2 存放地点</b> .....	52
<b>12.3 查阅方式</b> .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金	
基金简称	中融益海30天滚动持有短债	
基金主代码	014655	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年04月26日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,500,379.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融益海30天滚动持有短债A	中融益海30天滚动持有短债C
下属分级基金的交易代码	014655	014656
报告期末下属分级基金的份额总额	12,994,095.46份	34,506,284.13份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的基础上，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、大类资产配置策略</li> <li>2、债券投资策略</li> <li>3、资产支持证券投资策略</li> <li>4、证券公司短期公司债券投资策略</li> <li>5、国债期货投资策略</li> <li>6、信用衍生品投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

### 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		中融基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云	顾洪峰
	联系电话	010-56517000	010-65169885
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	4008308003
传真		010-56517001	010-65169555
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层	北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦
邮政编码		100011	100053
法定代表人		王瑶	王凯

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层

### § 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 (2022年04月26日(基金合同生效日)-2022年06月30日)	
	中融益海30天滚动持有短债A	中融益海30天滚动持有短债C
本期已实现收益	130,855.49	506,009.94
本期利润	114,370.02	458,779.15
加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0034
本期加权平均净值利润率	0.37%	0.34%
本期基金份额净值增长率	0.36%	0.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	47,096.21	106,678.48
期末可供分配基金份额利润	0.0036	0.0031
期末基金资产净值	13,041,191.67	34,612,962.61
期末基金份额净值	1.0036	1.0031
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.36%	0.31%

注：1、所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

中融益海30天滚动持有短债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	0.10%	0.01%	0.15%	0.01%	-0.05%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.36%	0.02%	0.42%	0.01%	-0.06%	0.01%

中融益海30天滚动持有短债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	0.08%	0.01%	0.15%	0.01%	-0.07%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.31%	0.02%	0.42%	0.01%	-0.11%	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

中融益海30天滚动持有短债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年04月26日-2022年06月30日)





中融益海30天滚动持有短债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年04月26日-2022年06月30日)



注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末仍在建仓期内。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

## § 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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2022年6月30日，中融基金管理有限公司共管理78只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证银行指数证券投资基金(LOF)、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、

中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金、中融优势产业混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金、中融成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
韩正宇	中融日日盈交易型货币市场基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。	2022-04-26	-	5	韩正宇先生，中国国籍，毕业于美国罗格斯新泽西州立大学金融分析专业，研究生、硕士学历，具有基金从业资格，证券从业年限5年。2015年7月至2017年5月中国光大银行资产负债管理部流动性管理处流动性管理岗；2017年5月至2020年5月中国人保资产管理有限公司公募基金事业部固定收益交易员、基金经理助理。2020年5月加入中融基金，现任绝对收益部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%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

上半年面对疫情等超预期因素冲击，我国经济新的下行压力有所加大。随着我国疫情形势好转，经济逐渐步入复苏轨道。基建投资持续发力，制造业投资二季度以来亦有所修复，但房地产投资未现明确拐点。出口仍为经济重要支撑，消费疫后出现边际改善。PPI保持回落态势，CPI继续温和抬升。政策层面，稳健货币政策加大实施力度，保持流动性合理充裕。积极财政政策靠前发力、精准发力，大规模留抵退税落地，专项债发行节奏加快。

债券市场方面，一季度债券收益率先下后上，随后进入震荡行情；二季度短端收益率明显下行，长端整体呈现震荡行情。上半年1年期国开债收益率下行30bp至2.02%，5年期国开债收益率上行1bp至2.79%，10年期国开债收益率下行3bp至3.05%。1年期高等级中短期票据收益率下行33bp至2.42%，3年期高等级中短期票据收益率上行4bp至2.95%，5年期高等级中短期票据收益率上行6bp至3.33%。

本基金根据市场情况逐步建仓，动态调整杠杆水平，保持充足流动性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融益海30天滚动持有短债A基金份额净值为1.0036元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为0.42%；截至报告期末中融益海30天滚动持有短债C基金份额净值为1.0031元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为0.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，房地产销售受断贷风波影响短期预计难有大幅改善，房地产投资或继续承压；基建投资仍是稳住经济大盘的重要抓手；制造业投资短期或出现反复，7月份制造业PMI落入收缩区间。出口韧性或难保持，消费修复或仍缓慢。下半年通胀可能还不会成为政策的制约因素。稳就业、稳物价政策目标下，流动性有望继续保持合理充裕。短期债市主要矛盾可能在于政策的边际变化，下半年行情的快速演变或在于资金面的趋势性变化，需要密切跟踪把握潜在交易性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及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。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### § 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中融益海30天滚动持有短债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，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	15,709,876.31
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	45,508,297.88
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		45,508,297.88
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		-
债权投资		-
其中：债券投资		-

资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		48.05
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		61,218,222.24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>
<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		13,482,497.75
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		13,311.65
应付托管费		3,327.91
应付销售服务费		10,289.61
应付投资顾问费		-
应交税费		1,497.46
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.4	53,143.58
负债合计		13,564,067.96
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.5	47,500,379.59
其他综合收益		-

未分配利润	6.4.7.6	153,774.69
净资产合计		47,654,154.28
负债和净资产总计		61,218,222.24

注：（1）报告截止日2022年06月30日，基金份额总额47,500,379.59份，其中A类基金份额的份额总额为12,994,095.46份，份额净值1.0036；C类基金份额的份额总额为34,506,284.13份，份额净值1.0031。

（2）本基金合同于2022年04月26日生效，无上年度可比期末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年04月26日（基金合同 生效日）至2022年06月30 日
<b>一、营业总收入</b>		805,954.72
1. 利息收入		70,178.61
其中：存款利息收入	6.4.7.7	51,094.65
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		19,083.96
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		799,492.37
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.8	799,492.37
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-



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）	6.4.7.9	-63,716.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、营业总支出</b>		232,805.55
1. 管理人报酬		59,944.05
2. 托管费		14,986.02
3. 销售服务费		48,823.10
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		73,660.31
其中：卖出回购金融资产支出		73,660.31
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		180.07
8. 其他费用	6.4.7.10	35,212.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		573,149.17
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		573,149.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		573,149.17

注：本基金合同于2022年4月26日生效，本期财务报表的实际编制期间为2022年4月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	263,836,065. 10	-	-	263,836,065. 10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	263,836,065. 10	-	-	263,836,065. 10
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-216,335,68 5.51	-	153,774.69	-216,181,91 0.82
(一)、综合收益总额	-	-	573,149.17	573,149.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-216,335,68 5.51	-	-419,374.48	-216,755,05 9.99
其中：1. 基金申购款	6,458,876.64	-	15,055.07	6,473,931.71
2. 基金赎回款	-222,794,56 2.15	-	-434,429.55	-223,228,99 1.70
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	47,500,379.5 9	-	153,774.69	47,654,154.2 8

注：本基金合同于2022年4月26日生效，本期财务报表的实际编制期间为2022年4月26日(基金合同生效日)至2022年6月30日，无上年度可比期间数据。

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：

王瑶

曹健

李克

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

中融益海30天滚动持有短债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[2021] 3945号文《关于准予中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》批准,由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2022年04月26日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金募集期为自2022年4月7日至2022年4月22日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金263,780,286.15元,折合263,780,286.15份中融益海30天滚动持有短债基金份额(其中:A类基金份额为45,219,703.89份;C类基金份额为218,560,582.26份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币55,778.95元,折合55,778.95份中融益海30天滚动持有短债基金份额(其中:A类基金份额为8,924.95份;C类基金份额为46,854.00份),以上收到的实收基金共计人民币263,836,065.10元,折合263,836,065.10份中融益海30天滚动持有短债基金份额(其中:A类基金份额为45,228,628.84份;C类基金份额为218,607,436.26份),有效认购户数为1,453户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金业绩比较基准为:中债综合财富(1年以下)指数收益率 $\times$ 80%+一年期定期存款基准利率(税后) $\times$ 20%。

## 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、应用指南、解释以及其他相关规定（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3号《半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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即自每年1月1日起至12月31日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### ① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### a) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于

整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基

金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(6) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；



(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金C类基金份额的销售服务费按《基金合同》约定的方法进行计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资，则最短持有期按照份额对应的原确认日计算，不以红利再投资确认日重新计算。

(2) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之

附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、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》、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》、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》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民

共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	638,587.99
等于：本金	638,459.55
加：应计利息	128.44
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	15,071,288.32
等于：本金	15,070,596.64
加：应计利息	691.68
减：坏账准备	-
合计	15,709,876.31

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	27,995,617.22	230,656.06	28,165,207.46	-61,065.82
	银行间市场	17,158,250.44	187,490.42	17,343,090.42	-2,650.44
	合计	45,153,867.66	418,146.48	45,508,297.88	-63,716.26

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	45,153,867.66	418,146.48	45,508,297.88	-63,716.26

### 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

注：无。

### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06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	18,331.58
其中：交易所市场	-
银行间市场	18,331.58
应付利息	-
预提费用	34,812.00
合计	53,143.58

### 6.4.7.5 实收基金

#### 6.4.7.5.1 中融益海30天滚动持有短债A

金额单位：人民币元

项目 (中融益海30天滚动持有短债 A)	本期 2022年04月26日(基金合同生效日)至2022年06月30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	45,228,628.84	45,228,628.84
本期申购	696,227.91	696,227.91

本期赎回（以“-”号填列）	-32,930,761.29	-32,930,761.29
本期末	12,994,095.46	12,994,095.46

#### 6.4.7.5.2 中融益海30天滚动持有短债C

金额单位：人民币元

项目 (中融益海30天滚动持有短债C)	本期 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	218,607,436.26	218,607,436.26
本期申购	5,762,648.73	5,762,648.73
本期赎回（以“-”号填列）	-189,863,800.86	-189,863,800.86
本期末	34,506,284.13	34,506,284.13

注：1、本基金募集期为自2022年4月7日至2022年4月22日，中融益海30天滚动持有短债A类首次募集的有效净认购资金为人民币45,219,703.89元，折合基金份额为45,219,703.89份；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币8,924.95元，折合基金份额8,924.95份。以上收到的实收认购款共计人民币45,228,628.84元，折合中融益海30天滚动持有短债A类基金份额45,228,628.84份。中融益海30天滚动持有短债C类首次募集的有效净认购资金为人民币218,560,582.26元，折合基金份额218,560,582.26份；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币46,854.00元，折合基金份额46,854.00份。以上收到的实收认购款共计人民币218,607,436.26元，折合中融益海30天滚动持有短债C类基金份额218,607,436.26份。

2、申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转出份额及金额。

#### 6.4.7.6 未分配利润

##### 6.4.7.6.1 中融益海30天滚动持有短债A

单位：人民币元

项目 (中融益海30天滚动持有短债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
> 基金合同生效日	-	-	-
本期利润	130,855.49	-16,485.47	114,370.02

本期基金份额交易产生的变动数	-69,669.38	2,395.57	-67,273.81
其中：基金申购款	1,237.13	-13.81	1,223.32
基金赎回款	-70,906.51	2,409.38	-68,497.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,186.11	-14,089.90	47,096.21

## 6.4.7.6.2 中融益海30天滚动持有短债C

单位：人民币元

项目 (中融益海30天滚动持有短债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
> 基金合同生效日	-	-	-
本期利润	506,009.94	-47,230.79	458,779.15
本期基金份额交易产生的变动数	-361,930.18	9,829.51	-352,100.67
其中：基金申购款	17,857.14	-4,025.39	13,831.75
基金赎回款	-379,787.32	13,854.90	-365,932.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	144,079.76	-37,401.28	106,678.48

## 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
活期存款利息收入	8,784.06
定期存款利息收入	31,000.00
其他存款利息收入	11,310.59
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	51,094.65
----	-----------

#### 6.4.7.8 债券投资收益

##### 6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年 06月30日
债券投资收益——利息收入	640,032.11
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	159,460.26
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	799,492.37

##### 6.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	609,018,489.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	604,232,034.07
减：应计利息总额	4,530,351.94
减：交易费用	96,643.08
买卖债券差价收入	159,460.26

#### 6.4.7.9 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----



	2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-63,716.26
——股票投资	-
——债券投资	-63,716.26
——资产支持证券投资	-
——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	-63,716.26

#### 6.4.7.10 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
审计费用	5,412.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
信息披露费	26,400.00
帐户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	35,212.00

#### 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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

**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
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发银行股份有限公司	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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**

注：无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**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
----	----

	2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	59,944.05
其中：支付销售机构的客户维护费	23,926.07

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.20%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

③本基金基金合同于2022年04月26日生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,986.02

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.05%/当年天数。

②本基金基金合同于2022年04月26日生效，无上年度可比期间。

#### 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 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融益海30天滚动持有短债A	中融益海30天滚动持有短债C	合计
中融基金管理有限公司	0.00	86.22	86.22
合计	-	86.22	86.22

注：①支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.20%/当年天数。

②本基金基金合同于2022年04月26日生效，无上年度可比期间。

#### 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

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

##### 6.4.10.4.2 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

注：无。

#### 6.4.10.5 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 2022年04月26日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	638,587.99	8,784.06

注：1、本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

2、本基金合同自2022年4月26日起生效，无上年度同期可比数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

注：无。

**6.4.12 期末（2022年06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**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：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2022年06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是5,320,437.26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
200003	20付息国债03	2022-07-01	100.92	36,000	3,633,120.00
210008	21付息国债08	2022-07-01	100.81	20,000	2,016,200.00
合计				56,000	5,649,320.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截止本报告期末2022年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额8,162,060.49元，于2022年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：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**

本基金在日常经营活动中涉及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实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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的发行人出现违约、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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过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。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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 2022年06月30日
AAA	23,244,583.04
AAA以下	9,131,668.26
未评级	1,023,515.62
合计	33,399,766.92

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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随时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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本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中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。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 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,709,876.31	-	-	-	15,709,876.31
交易性金融资产	40,258,807.57	5,249,490.31	-	-	45,508,297.88
应收申购款	-	-	-	48.05	48.05
资产总计	55,968,683.88	5,249,490.31	-	48.05	61,218,222.24
负债					



卖出回购金融资产款	13,482,538.56	-	-	-	13,482,538.56
应付管理人报酬	-	-	-	13,311.65	13,311.65
应付托管费	-	-	-	3,327.91	3,327.91
应付销售服务费	-	-	-	10,289.61	10,289.61
应交税费	-	-	-	1,497.46	1,497.46
其他负债	-	-	-	53,143.58	53,143.58
负债总计	13,482,538.56	-	-	81,570.21	13,564,108.77
利率敏感度缺口	42,486,145.32	5,249,490.31	-	-81,522.16	47,654,113.47

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	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他变量不变；	
假设	其他市场变量保持不变；	
假设	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
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 2022年06月30日
	市场利率下降25个基点	90,666.08
	市场利率上升25个基点	-90,267.26

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于报告期末，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值可参考的公允价值发生的变动。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，因此无重大其他价格风险。

##### 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 2022年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	45,508,297.88	95.50
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	45,508,297.88	95.50

#### 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**

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	-
第二层次	45,508,297.88
第三层次	-
合计	45,508,297.88

注：本基金合同于2022年04月26日生效，无上年度可比期末数据。

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会将此类证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 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	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,508,297.88	74.34
	其中：债券	45,508,297.88	74.34
	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	15,709,876.31	25.66
8	其他各项资产	48.05	0.00
9	合计	61,218,222.24	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：本基金本报告期无股票累计买入金额。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：本基金本报告期无股票累计卖出金额。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期无股票累计买入、卖出金额。

## 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	12,108,530.96	25.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,211,832.12	63.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,187,934.80	6.69
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,508,297.88	95.50

#### 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	200003	20付息国债03	100,000	10,092,416.44	21.18
2	163494	20兵装02	30,000	3,012,620.38	6.32
3	163513	20中金G3	30,000	3,009,626.79	6.32
4	112970	19鲁机场	25,000	2,567,550.69	5.39
5	101800775	18苏州高新MT N002	20,000	2,164,419.18	4.54

#### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除20中金G3(163513)外其他证券的发行主体本期末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。北京证监局2021年11月03日发布对中国国际金融股份有限公司的处罚(北京证监局[2021]176号)，人行营管部2021年07月19日发布对中国国际金融股份有限公司的处罚(银管罚(2021)19号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选库股票。

### 7.12.3 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	48.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48.05

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.6 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，各比例的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
中融 益海3 0天滚 动持 有短 债A	199	65,296.96	-	0.00%	12,994,095.46	100.0 0%
中融 益海3 0天滚 动持 有短 债C	388	88,933.72	-	0.00%	34,506,284.13	100.0 0%
合计	587	80,920.58	-	0.00%	47,500,379.59	100.0 0%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

### 8.2 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	中融益海30天滚动 持有短债A	103,858.89	0.80%
	中融益海30天滚动 持有短债C	122.99	0.00%
	合计	103,981.88	0.22%

### 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	中融益海30天滚动 持有短债A	0
	中融益海30天滚动 持有短债C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中融益海30天滚动 持有短债A	0~10
	中融益海30天滚动 持有短债C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融益海30天滚动持有 短债A	中融益海30天滚动持有 短债C
基金合同生效日(2022年04月26 日)基金份额总额	45,228,628.84	218,607,436.26
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	696,227.91	5,762,648.73
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	32,930,761.29	189,863,800.86



基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,994,095.46	34,506,284.13

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## § 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，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内基金管理人未有重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本基金本报告期内选聘上会会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	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	佣金	占当期 佣金总 量的比	

	数量		的比例		例	
国海证券	2	-	-	83,368.93	100.00%	新增 2 个交易日。

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于2022年4月26日生效，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国海证券	956,118,703.35	100.00%	530,712,000.00	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	中融基金管理有限公司关于旗下基金执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04

2	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-15
3	中融基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-17
4	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
5	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-24
7	中融基金管理有限公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
8	中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
9	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
10	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-30
11	中融基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-07

12	中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金开放申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-17
13	中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金开放日常赎回、转换业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-23

## § 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

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金之法律意见
- (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) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十日