

中融恒益纯债债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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2023年01月01日起至2023年06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
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
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	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
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	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	48

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.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
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.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融恒益纯债债券型证券投资基金	
基金简称	中融恒益纯债	
基金主代码	012290	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月21日	
基金管理人	国联基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	990,611,124.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融恒益纯债A	中融恒益纯债C
下属分级基金的交易代码	012290	012291
报告期末下属分级基金的份额总额	990,608,632.60份	2,491.51份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在积极控制风险的基础上，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"> 1、大类资产配置策略 2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 久期管理策略 (2) 期限结构配置策略 (3) 债券的类别配置策略 (4) 骑乘策略 (5) 息差策略 (6) 信用债券投资策略 3、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
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		国联基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周妹云	陆志俊
	联系电话	010-56517000	95559
	电子邮箱	zhoumeiyun@gfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95559
传真		010-56517001	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100011	200336
法定代表人		王瑶	任德奇

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	www.gfund.com
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	国联基金管理有限公司	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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	中融恒益纯债A	中融恒益纯债C
本期已实现收益	8,931,712.71	-251.00
本期利润	13,053,821.50	43.05
加权平均基金份额本期利润	0.0176	0.0162
本期加权平均净值利润率	1.73%	1.40%
本期基金份额净值增长率	1.59%	1.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-72,351,353.68	133.04
期末可供分配基金份额利润	-0.0730	0.0534
期末基金资产净值	1,009,295,053.67	2,885.09
期末基金份额净值	1.0189	1.1580
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.44%	19.34%

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

中融恒益纯债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	0.23%	0.05%	0.18%	0.05%	0.05%	0.00%
过去三个月	0.99%	0.04%	0.94%	0.04%	0.05%	0.00%
过去六个月	1.59%	0.03%	1.22%	0.04%	0.37%	-0.01%
过去一年	2.33%	0.03%	1.35%	0.05%	0.98%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.44%	0.03%	3.19%	0.05%	2.25%	-0.02%

中融恒益纯债C

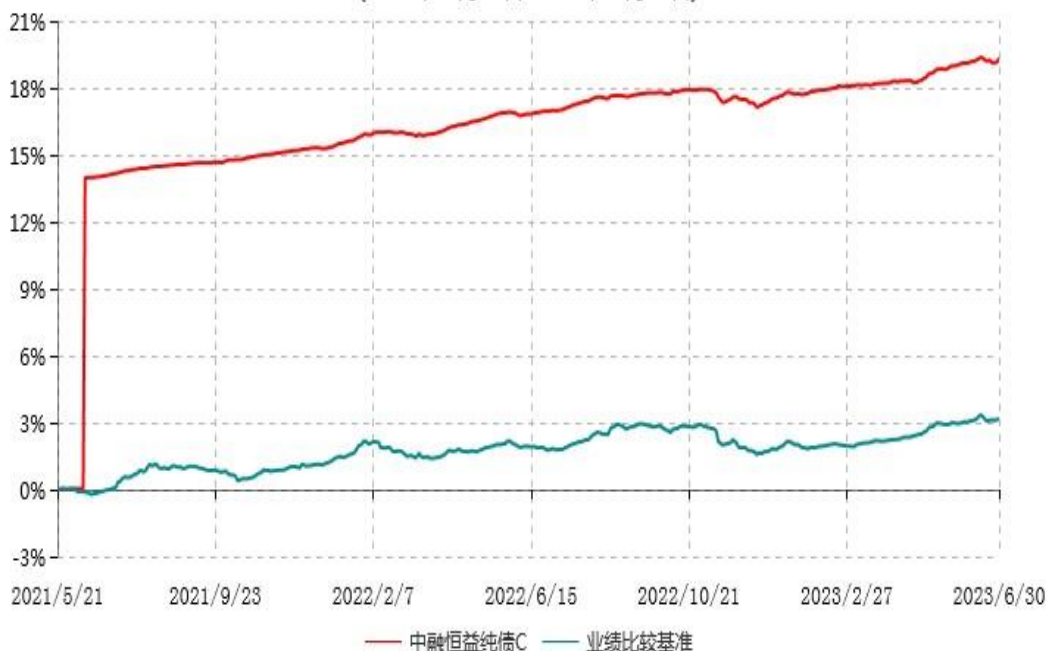
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.05%	0.18%	0.05%	0.02%	0.00%
过去三个月	0.92%	0.04%	0.94%	0.04%	-0.02%	0.00%
过去六个月	1.43%	0.03%	1.22%	0.04%	0.21%	-0.01%
过去一年	2.02%	0.03%	1.35%	0.05%	0.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.34%	0.61%	3.19%	0.05%	16.15%	0.56%

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

中融恒益纯债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
(2021年05月21日-2023年06月30日)



中融恒益纯债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
(2021年05月21日-2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份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2023年6月30日，国联基金管理有限公司共管理82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、中融中债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、中融兴鸿优选一年封闭运作混合型证券投资基金、中融恒通纯债债券型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中融恒润纯债债券型证券投资基金、中融添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、中融消费精选混合型证券投资基金。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石膏蒙	中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、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	2021-05-21	-	7	石膏蒙女士，中国国籍，毕业于北京交通大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限7年。2012年7月至2015年8月，曾任中铁融资担保有限公司财务部财务投资岗。2015年8月加入本公司，现任固收投资部基金经理。

	恒通纯债债券型证券投资基金、中融恒润纯债债券型证券投资基金的基金经理。				
--	-------------------------------------	--	--	--	--

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）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

今年上半年债券收益率先上后下，信用债走势强于利率债，信用利差有所压缩。

今年1-2月份，债券收益率以上行为主，主要原因是随着疫情防控政策放开、地产“三支箭”等政策推出，居民消费半径打开，经济呈现复苏态势。PMI指数重新回到50以上

的扩张区间，消费者信心指数从底部区间持续回升，政策靠前发力，央行召开信贷座谈会要求“各主要银行要合理把握信贷投放节奏，适度靠前发力”，因此1-2月份的信贷和社融同比多增、基建投资保持较高增长水平，经济恢复呈现出不少亮点，经济复苏的宏观走势对债券市场形成压制。此时权益市场表现相对较好，“股债跷跷板”特征显现，债券市场承压。1-2月份的市场机构行为呈现出“大行放贷、中小行买债”的特征，中小行成为这段时间债券市场最主要的买入力量。3月份，随着政府工作报告对于2023年的经济增长目标设定为5%左右，低于市场预期，且要求“不要大干快上”，政策态度存在定力，市场对于强刺激的担忧减弱，同时部分高频数据开始走弱，债券市场收益率走势有所转向，逐步开始缓慢下行。3月份国外发生了一些风险事件，美国SVB银行和瑞士瑞信银行的破产，全球避险情绪升温，对美欧继续加息的政策形成掣肘，人民币汇率压力有所缓解，在一定程度上有利于国内债券收益率下行。二季度，支持债券收益率下行的因素增多，包括：（1）存款利率的下调。2022年开始的存款利率下调，今年城农商陆续跟进，且大行在6月份又开始了新一轮的下调，负债成本的降低客观上有利于债券收益率的下行。（2）经济下行压力加大。二季度开始，多数经济指标开始出现下滑，进出口、投资、工业增加值等数据都有所下行。其中比较严重情况包括：4月份的PMI数据意外回落到50以下，且在二季度均维持在荣枯线以下；地产销售仅在一季度维持了小阳春，二季度销售甚至下滑至低于去年同期水平的情况；居民消费方面也只是因为消费半径打开而有所恢复，但是必选消费下滑、五一人均消费下滑，均反映居民悲观预期和缺乏消费能力。（3）资金价格便宜。个别月份在没有央行投放的情况下，维持了宽松的局面，资金价格同样有利于债市收益率下行。（4）风险偏好的降低。权益市场和商品市场下跌，市场避险情绪升温。在各种因素的综合作用下，债券收益率出现了较为明显的下行，随着6月13日央行公开市场操作意外降息，债券收益率下行至上半年低点，此后随着市场积累的大量止盈盘的止盈需求，市场对于经济疲软的下的刺激政策担忧度提升，债券收益率在低位有所反弹。

整体上来看，利率债方面，1年期国债由2.1%上行至2.33%后下行至1.87%，10年期国债由2.84%上行至2.93%后下行至2.64%，1年期国开由2.23%上行至2.54%后下行至2.09%，10年期国开由2.99%上行至3.1%后下行至2.77%，短端的波动相对更大一些。信用债方面，以短融中票为例，1年期AAA信用债由2.71%上行至2.86%后下行至2.47%，3年期AAA由3.17%上行至3.26%后下行至2.78%。

报告期内，本基金以信用债配置为主，并参与利率债交易，多策略提升产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融恒益纯债A基金份额净值为1.0189元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.59%，同期业绩比较基准收益率为1.22%；截至报告期末中融恒益纯债

C基金份额净值为1.1580元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.43%，同期业绩比较基准收益率为1.22%。

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，对债券市场影响最大的因素是基本面和政策面。目前来看，基本面亮点较少、隐忧较多，生产端好于消费端、基建投资好于地产投资和民间投资、出口受到终端需求的制约，其中比较值得关注的是地产到底能不能起色。目前地产呈现出“淡季更淡”的走势，销量的下滑一再超出市场预期，地产能否在政策的作用下有所起色，不再成为经济的拖累值得持续关注；同样值得关注的是库存周期，经过了一段时间的去库存以后，整体上库存不高，企业能否进入补库存阶段需进一步的观察。政策面上，7月份已经召开了政治局会议，对于经济的定调为“当前经济运行面临新的困难挑战，主要是国内需求不足，一些企业经营困难，重点领域风险隐患较多，外部环境复杂严峻”，表明政策对于经济的重视程度提升；对于宏观经济政策的定调是“加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险”，“要精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备”，意味着逆周期政策要开始发力；对于逆周期政策方向上，着力于消费、投资、减税降费等；对于房地产市场，没有再提“房住不炒”，认为“考虑到我国房地产市场供求关系已经发生深刻变化，过去在市场长期过热阶段陆续出台的政策存在边际优化空间”，表明对房地产的定性有所变化。政治局会议的内容表明政策要开始有所发力。政治局会议以后，央行在2023年下半年工作会议中提到“因城施策精准实施差别化住房信贷政策，继续引导个人住房贷款利率和首付比例下行，更好满足居民刚性和改善性住房需求。指导商业银行依法有序调整存量个人住房贷款利率”。住建部在企业座谈会上说“要继续巩固房地产市场企稳回升态势，大力支持刚性和改善性住房需求，进一步落实好降低购买首套住房首付比例和贷款利率、改善性住房换购税费减免、个人住房贷款“认房不用认贷”等政策措施”，各地住建局也对房地产政策进行优化。在政策发力已经明朗的情况下，后续主要看各类政策对于经济的托举或者改善作用，如果各种逆周期的政策能够改变当前经济下滑的局面，则债券市场可能面临着政策和基本面的双重冲击，债券收益率有可能出现明显上行。如果政策不足以扭转当前经济下滑的局面，则债券短期内可能会被政策的情绪压制，可能会有所上行但是终究会回到基本面定价。在这个阶段，如果货币政策有进一步的宽松，则债券收益率会对宽松的货币政策定价；如果风险偏好能够抬升，债券市场同样会可能受到压制。总体来看，债券市场后续受到政策的影响，可能面临一定的不利局面。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。本基金管理

人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、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，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，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。会计师事务所对估值委员会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。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。2023年2月7日，中融恒益纯债A每10份分配0.350元，中融恒益纯债C每10份分配0.350元。

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

本报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产净值低于5000万的情形。

§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，基金托管人在中融恒益纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，国联基金管理有限公司在中融恒益纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：38,479,771.50元，向C级份额持有人分配利润：97.18元。符合相关法规及基金合同的规定。

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，由国联基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中融恒益纯债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：中融恒益纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	216,813.08	699,120.82
结算备付金		-	-
存出保证金		36.42	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,382,630,055.92	1,163,906,835.05
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,382,630,055.92	1,163,906,835.05
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		-	-
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		1.99	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	4,030.17	-
资产总计		1,382,850,937.58	1,164,605,955.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		373,045,271.95	22,848,107.34
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		248,554.18	290,078.34
应付托管费		82,851.38	96,692.76
应付销售服务费		0.60	0.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		53,426.19	48,058.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	122,894.52	191,070.00
负债合计		373,552,998.82	23,474,007.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	990,611,124.11	1,099,424,942.76
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	18,686,814.65	41,707,005.73
净资产合计		1,009,297,938.76	1,141,131,948.49
负债和净资产总计		1,382,850,937.58	1,164,605,955.87

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额990,611,124.11份，其中A类基金份额的份额总额为990,608,632.60份，份额净值1.0189元；C类基金份额的份额总额为2,491.51份，份额净值1.1580元。

6.2 利润表

会计主体：中融恒益纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		15,850,259.44	21,451,091.31
1.利息收入		407,139.04	10,239.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,233.47	2,172.99
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		364,905.57	8,066.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,320,717.56	21,267,206.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	11,320,717.56	21,267,206.53
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
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	6.4.7.17	4,122,402.84	173,645.49

以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、营业总支出		2,796,394.89	5,014,502.08
1. 管理人报酬		1,148,946.15	1,673,779.62
2. 托管费		382,981.87	557,926.57
3. 销售服务费		4.62	6.81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,154,490.87	2,616,323.34
其中: 卖出回购金融资产支出		1,154,490.87	2,616,323.34
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		22,298.74	46,777.72
8. 其他费用	6.4.7.20	87,672.64	119,688.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,053,864.55	16,436,589.23
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,053,864.55	16,436,589.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,053,864.55	16,436,589.23

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 中融恒益纯债债券型证券投资基金

本报告期: 2023年01月01日至2023年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	1,099,424,942.76	-	41,707,005.73	1,141,131,948.49
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）	1,099,424,942.76	-	41,707,005.73	1,141,131,948.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-108,813,818.65	-	-23,020,191.08	-131,834,009.73
（一）、综合收益总额	-	-	13,053,864.55	13,053,864.55
（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）	-108,813,818.65	-	2,405,813.05	-106,408,005.60
其中：1.基金申购款	1,981,473,192.04	-	18,823,127.99	2,000,296,320.03
2.基金赎回款	-2,090,287,010.69	-	-16,417,314.94	-2,106,704,325.63
（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）	-	-	-38,479,868.68	-38,479,868.68
（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）	990,611,124.11	-	18,686,814.65	1,009,297,938.76
项目	上年度可比期间 2022年01月01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）	1,099,426,085.40	-	17,032,079.28	1,116,458,164.68
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）	1,099,426,085.40	-	17,032,079.28	1,116,458,164.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-672.82	-	16,436,480.63	16,435,807.81
（一）、综合收益总额	-	-	16,436,589.23	16,436,589.23
（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）	-672.82	-	-108.60	-781.42
其中：1.基金申购款	7.18	-	0.79	7.97
2.基金	-680.00	-	-109.39	-789.39

赎回款				
(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)	1,099,425,412.58	-	33,468,559.91	1,132,893,972.49

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

黄庆

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

中融恒益纯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]1372号文《关于准予中融恒益纯债债券型证券投资基金注册的批复》批准,由国联基金管理有限公司(原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《中融恒益纯债债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2021年5月21日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司),基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金募集期为2021年5月17日至2021年5月19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200,013,264.25元,折合200,013,264.25份中融恒益纯债基金份额(其中:A类基金份额为180,006,962.25份;C类基金份额为20,006,302.00份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币7,700.35元,折合7,700.35份中融恒益纯债基金份额(其中:A类基金份额为7,000.35份;C类基金份额为700.00份),以上收到的实收基金共计人民币200,020,964.60元,折合200,020,964.60份中

融恒益纯债基金份额(其中：A类基金份额为180,013,962.60份；C类基金份额为20,007,002.00份)，有效认购户数为321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，本基金在积极控制风险的基础上，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。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（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）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款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）。本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

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《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。

本财务报表以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2023年06月30日的财务状况以及2023年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金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

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 2023年06月30日
活期存款	216,813.08
等于: 本金	216,754.45
加: 应计利息	58.63
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	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-

合计	216,813.08
----	------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-	-	-
	银行间市场	1,364,232,906.61	16,887,055.92	1,382,630,055.92
	合计	1,364,232,906.61	16,887,055.92	1,382,630,055.92
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,364,232,906.61	16,887,055.92	1,382,630,055.92	1,510,093.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	4,030.17
待摊费用	-
合计	4,030.17

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	48,786.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	48,786.10
应付利息	-
预提费用	74,108.42
合计	122,894.52

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中融恒益纯债A

金额单位：人民币元

项目 (中融恒益纯债A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,099,422,046.65	1,099,422,046.65
本期申购	1,981,473,176.64	1,981,473,176.64
本期赎回（以“-”号填列）	-2,090,286,590.69	-2,090,286,590.69
本期末	990,608,632.60	990,608,632.60

6.4.7.7.2 中融恒益纯债C

金额单位：人民币元

项目 (中融恒益纯债C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,896.11	2,896.11
本期申购	15.40	15.40
本期赎回(以“-”号填列)	-420.00	-420.00
本期末	2,491.51	2,491.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中融恒益纯债A

单位：人民币元

项目 (中融恒益纯债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	44,343,574.67	-2,637,080.38	41,706,494.29
本期利润	8,931,712.71	4,122,108.79	13,053,821.50
本期基金份额交易产生的变动数	-87,146,869.56	89,552,746.34	2,405,876.78
其中：基金申购款	-160,132,247.78	178,955,373.47	18,823,125.69
基金赎回款	72,985,378.22	-89,402,627.13	-16,417,248.91
本期已分配利润	-38,479,771.50	-	-38,479,771.50
本期末	-72,351,353.68	91,037,774.75	18,686,421.07

6.4.7.8.2 中融恒益纯债C

单位：人民币元

项目 (中融恒益纯债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	519.29	-7.85	511.44
本期利润	-251.00	294.05	43.05
本期基金份额交易产生的变动数	-38.07	-25.66	-63.73

其中：基金申购款	1.42	0.88	2.30
基金赎回款	-39.49	-26.54	-66.03
本期已分配利润	-97.18	-	-97.18
本期末	133.04	260.54	393.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	42,231.04	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	2.32	
其他	0.11	
合计	42,233.47	

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益——利息收入	11,365,012.72	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-44,295.16	
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	11,320,717.56
----	---------------

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,065,384,276.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,008,555,849.58
减：应计利息总额	56,845,222.01
减：交易费用	27,500.00
买卖债券差价收入	-44,295.16

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	4,122,402.84
——股票投资	-
——债券投资	4,122,402.84
——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	4,122,402.84

6.4.7.18 其他收入

注：无。

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	17,675.43
信息披露费	47,132.99
证券出借违约金	-
汇划手续费	8,294.39
账户维护费	14,100.00
其他	469.83

合计	87,672.64
----	-----------

6.4.7.21 分部报告

无。

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

本基金的基金管理人于2023年8月3日发布了《关于公司法定名称、住所变更的公告》，公司名称由“中融基金管理有限公司”变更为“国联基金管理有限公司”。除以上情况外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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

2023年5月6日，本基金管理人发布《中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》，根据中国证券监督管理委员会证监许可[2023]848号文核准，国联证券股份有限公司依法受让中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）75.5%股权，成为本公司主要股东，无锡市国联发展（集团）有限公司成为本公司实际控制人。本次股权变更后，本公司的注册资本保持不变，本公司的股权结构如下：

国联证券股份有限公司75.5%；上海融晟投资有限公司24.5%。本公司股权变更工商变更登记手续已办理完毕。

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
国联基金管理有限公司（原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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联证券股份有限公司	基金管理人股东（2023年5月5日后）
中融国际信托有限公司	基金管理人股东（2023年5月5日前）
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东

国联（北京）资产管理有限公司（原中融（北京）资产管理有限公司）	基金管理人子公司
---------------------------------	----------

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,148,946.15	1,673,779.62
其中：支付销售机构的客户维护费	16.67	18.10

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×0.30%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	382,981.87	557,926.57

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 \times 0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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 \times 0.30%/当年天数。

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

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

份额单位：份

中融恒益纯债A

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		额的比例
交通银行股份有限公司	-	-	1,099,401,860.38	100.00%

注：（1）除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

（2）对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	216,813.08	42,231.04	548,770.84	2,172.99

注：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。

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

中融恒益纯债A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2023-02-07	2023-02-07	0.350	38,479,771.38	0.12	38,479,771.50	-
合计			0.350	38,479,771.38	0.12	38,479,771.50	-

				1.38		1.50	
--	--	--	--	------	--	------	--

中融恒益纯债C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2023-0 2-07	2023-02-0 7	0.350	89.48	7.70	97.18	-
合计			0.350	89.48	7.70	97.18	-

6.4.12 期末（2023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2023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373,045,271.95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
101901283	19渝水投MTN 001	2023-07-05	104.56	500,000	52,280,000.00
101901411	19广州金控MT N001	2023-07-05	101.96	472,000	48,125,120.00
102101339	21粤电发MTN 001	2023-07-05	103.65	200,000	20,730,000.00
102280446	22厦门市政MT N001	2023-07-05	101.91	364,000	37,095,240.00
210203	21国开03	2023-07-03	103.49	1,000,000	103,490,000.00
210303	21进出03	2023-07-03	101.53	1,000,000	101,530,000.00
230202	23国开02	2023-07-03	101.80	421,000	42,857,800.00

合计				3,957,000	406,108,160.00
----	--	--	--	-----------	----------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	196,317,059.84	-
合计	196,317,059.84	-

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	502,980,033.42	716,155,125.46
AAA以下	273,953,847.28	-
未评级	102,551,619.76	161,138,235.62
合计	879,485,500.46	877,293,361.08

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 2023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	216,813.08	-	-	-	216,813.08
存出保证金	36.42	-	-	-	36.42
交易性金融资产	338,318,297.00	1,044,311,758.92	-	-	1,382,630,055.92
应收申购款	-	-	-	1.99	1.99
其他资产	-	-	-	4,030.17	4,030.17
资产总计	338,535,146.50	1,044,311,758.92	-	4,032.16	1,382,850,937.58
负债					
卖出回购金融资产款	373,045,271.95	-	-	-	373,045,271.95
应付管理人报酬	-	-	-	248,554.18	248,554.18
应付托管费	-	-	-	82,851.38	82,851.38
应付销售服务费	-	-	-	0.60	0.60
应交税费	-	-	-	53,426.19	53,426.19
其他负债	-	-	-	122,894.52	122,894.52
负债总计	373,045,271.95	-	-	507,726.87	373,552,998.82
利率敏感度缺口	-34,510,125.45	1,044,311,758.92	-	-503,694.71	1,009,297,938.76

上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	699,120.82	-	-	-	699,120.82
交易性金融资产	787,253,687.10	376,653,147.95	-	-	1,163,906,835.05
资产总计	787,952,807.92	376,653,147.95	-	-	1,164,605,955.87
负债					
卖出回购金融资产款	22,848,107.34	-	-	-	22,848,107.34
应付管理人报酬	-	-	-	290,078.34	290,078.34
应付托管费	-	-	-	96,692.76	96,692.76
应付销售服务费	-	-	-	0.93	0.93
应交税费	-	-	-	48,058.01	48,058.01
其他负债	-	-	-	191,070.00	191,070.00
负债总计	22,848,107.34	-	-	625,900.04	23,474,007.38
利率敏感度缺口	765,104,700.58	376,653,147.95	-	-625,900.04	1,141,131,948.49

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	6,572,630.66	2,441,287.71
	市场利率上升25个基点	-6,512,226.95	-2,427,275.52

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,382,630,055.92	136.99	1,163,906,835.05	102.00

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	1,382,630,055.92	136.99	1,163,906,835.05	102.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,382,630,055.92	1,163,906,835.05
第三层次	-	-
合计	1,382,630,055.92	1,163,906,835.05

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。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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	1,382,630,055.92	99.98
	其中：债券	1,382,630,055.92	99.98
	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	216,813.08	0.02
8	其他各项资产	4,068.58	0.00
9	合计	1,382,850,937.58	100.00

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

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。

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

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初基金资产净值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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	643,425,918.86	63.75
	其中：政策性金融债	306,827,495.62	30.40
4	企业债券	41,870,501.37	4.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	501,016,575.85	49.64
7	可转债(可交换债)	-	-

8	同业存单	196,317,059.84	19.45
9	其他	-	-
10	合计	1,382,630,055.92	136.99

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	210203	21国开03	1,000,000	103,491,967.21	10.25
2	230202	23国开02	1,000,000	101,803,397.26	10.09
3	210303	21进出03	1,000,000	101,532,131.15	10.06
4	112314062	23江苏银行C D062	1,000,000	98,176,782.79	9.73
5	112397409	23宁波银行C D072	1,000,000	98,140,277.05	9.72

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

本基金在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的发行主体中：

(1) 中国进出口银行：中国银行间市场交易商协会2023年05月09日发布对中国进出口银行启动自律调查。

(2) 宁波银行：宁波银保监局2022年09月08日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬银保监罚决字〔2022〕60号),宁波银保监局2023年01月09日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬银保监罚决字〔2023〕1号)。

(3) 江苏银行：江苏证监局2022年12月05日发布对江苏银行股份有限公司的处罚(江苏证监局[2022]114号),中国银行间市场交易商协会2023年01月18日发布对江苏银行股份有限公司的处罚,央行2023年02月06日发布对江苏银行股份有限公司的处罚(银罚决字〔2023〕1号)。

(4) 重庆银行：重庆证监局2023年03月10日发布对重庆银行股份有限公司的处罚,重庆市通信管理局、四川省通信管理局2023年04月24日发布对重庆银行股份有限公司的处罚。

(5) 广州开发区控股集团有限公司：广州市黄埔区人民政府长岭街道办事处2022年08月22日发布对广州开发区控股集团有限公司的处罚(穗埔长岭综执罚决〔2022〕第0061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。除此之外，本基金投资决策程序均符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

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股票库。

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	36.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1.99
6	其他应收款	4,030.17
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,068.58

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
中融恒益纯债A	105	9,434,367.93	990,588,646.58	100.00%	19,986.02	0.00%
中融恒益纯债C	137	18.19	25.80	1.04%	2,465.71	98.96%
合计	242	4,093,434.40	990,588,672.38	100.00%	22,451.73	0.00%

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	中融恒益纯债A	1.00	0.00%
	中融恒益纯债C	102.00	4.09%
	合计	103.00	0.00%

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融恒益纯债A	中融恒益纯债C
基金合同生效日(2021年05月21日)基金份额总额	180,013,962.60	20,007,002.00
本报告期期初基金份额总额	1,099,422,046.65	2,896.11
本报告期基金总申购份额	1,981,473,176.64	15.40
减：本报告期基金总赎回份额	2,090,286,590.69	420.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	990,608,632.60	2,491.51

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

本基金管理人于2023年1月11日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁卢强先生离任。

公司其他高管人员未变动。

(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

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

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

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
麦高证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

渤海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	599,505.0 0	100.00%	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
麦高证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

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高级 管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-11
2	中融恒益纯债债券型证券投 资基金2023年第一次分红公 告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-07
3	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	2023-02-09
4	关于提高中融恒益纯债债券 型证券投资基金A类份额净 值精度的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-16
5	中融基金管理有限公司关于 中融恒益纯债债券型证券投 资基金基金资产净值连续低 于5000万元的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
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	2023-04-22

7	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	2023-05-06
8	中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-06
9	中融基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为中融恒益纯债债券型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-24
10	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	2023-06-08

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230412-20230630	0.00	990,588,410.10	0.00	990,588,410.10	100.00%
	2	20230101-20230216	1,099,401,860.38	0.00	1,099,401,860.38	0.00	0.00%
	3	20230217-20230411	0.00	148,133.19	148,133.19	0.00	0.00%
	4	20230412-20230418	0.00	990,588,410.10	990,588,410.10	0.00	0.00%
	5	20230217-20230411	0.00	148,133.19	148,133.19	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023年5月6日，本基金管理人发布《中融基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》，本基金管理人的股东变更为国联证券股份有限公司和上海融晟投资有限公司，实际控制人变更为无锡市国联发展（集团）有限公司。

2023年8月3日，本基金管理人发布《关于公司法定名称、住所变更的公告》，本基金管理人名称由“中融基金管理有限公司”变更为“国联基金管理有限公司”。

§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恒益纯债债券型证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《中融恒益纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融恒益纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融恒益纯债债券型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 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：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.glfund.com>

国联基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日