交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 日起至 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 6
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 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 38

7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 39
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 39
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 39
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 40

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 40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 40
7.11 投资组合报告附注 40

§8 基金份额持有人信息 41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 41
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 42

§9 开放式基金份额变动 42

§10 重大事件揭示 42

10.1 基金份额持有人大会决议 42
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 42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 43
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 43
10.8 其他重大事件 44

§11 影响投资者决策的其他重要信息 45

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 45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 45

§12 备查文件目录 46

12.1 备查文件目录 46
12.2 存放地点 46
12.3 查阅方式 46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金	
基金简称	交银丰享收益债券	
基金主代码	519748	
基金运作方式	契约型，本基金在基金合同生效之日起两年（含两年）的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外），封闭期结束后转为开放式运作。	
基金合同生效日	2015 年 1 月 19 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	798,011,341.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银丰享收益债券 A	交银丰享收益债券 C
下属分级基金的交易代码	519746	519748
报告期末下属分级基金的份额总额	750,570,539.41 份	47,440,801.83 份

注：本基金自 2017 年 1 月 20 日起转为开放式运作。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和追求资产稳健增值的基础上,力求获得高于业绩基准的投资收益。
投资策略	封闭期内投资策略：本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，充分利用封闭式运作优势，以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略，获取稳定收益；同时，本基金将严格控制信用风险，在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选个券。 开放期内投资策略：本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定类属资产配置和债券组合久期、期限结构；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选个券。
业绩比较基准	封闭期内业绩比较基准：两年期银行定期存款税后收益率 开放期内业绩比较基准：中债综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风

	险的品种。

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		交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	滕菲菲
	联系电话	（021）61055050	4006800000
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	95558
传真		（021）61055054	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-23 楼	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		袁庆伟	方合英

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	交银丰享收益债券 A	交银丰享收益债券 C
本期已实现收益	19,339,980.62	453,814.07
本期利润	30,470,009.63	733,204.77
加权平均基金份额本期利润	0.0413	0.0177
本期加权平均净值利润率	1.77%	1.52%
本期基金份额净	1.79%	1.59%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,009,473,165.63	7,909,383.37
期末可供分配基金份额利润	1.3449	0.1667
期末基金资产净值	1,764,912,847.69	55,523,514.81
期末基金份额净值	2.3514	1.1704
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	169.99%	49.23%

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，计入费用后的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

交银丰享收益债券 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
过去三个月	0.75%	0.02%	0.62%	0.04%	0.13%	-0.02%
过去六个月	1.79%	0.02%	0.91%	0.04%	0.88%	-0.02%
过去一年	2.42%	0.03%	-0.56%	0.06%	2.98%	-0.03%
过去三年	9.40%	0.05%	5.12%	0.08%	4.28%	-0.03%
过去五年	17.00%	0.04%	8.48%	0.07%	8.52%	-0.03%
过去七年	25.85%	0.04%	10.29%	0.07%	15.56%	-0.03%
自基金合同生效起至今	169.99%	2.03%	12.33%	0.07%	157.66%	1.96%

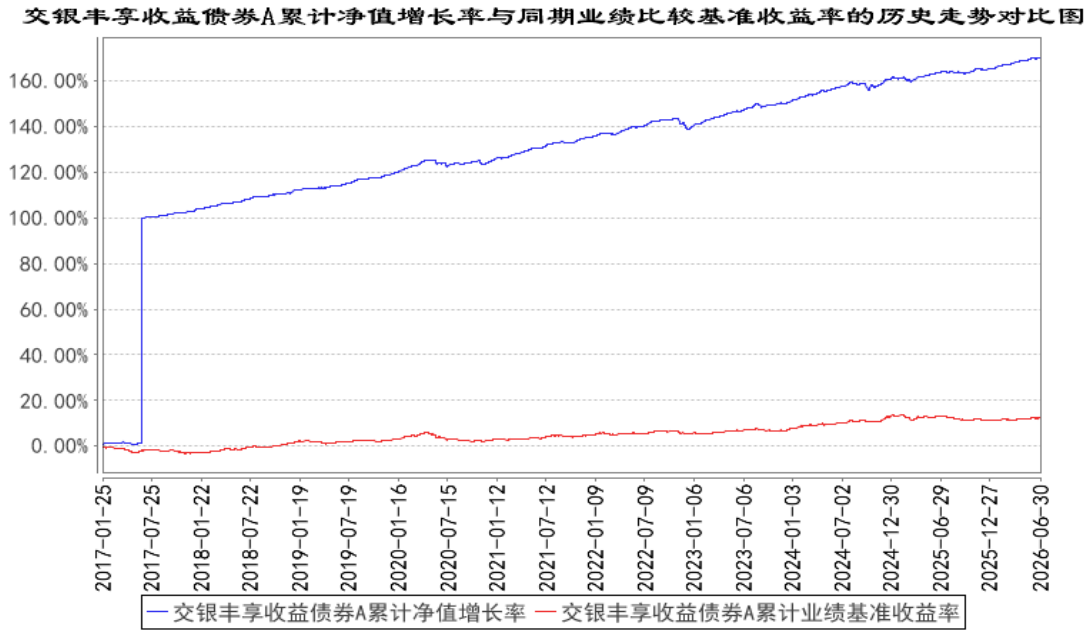
交银丰享收益债券 C

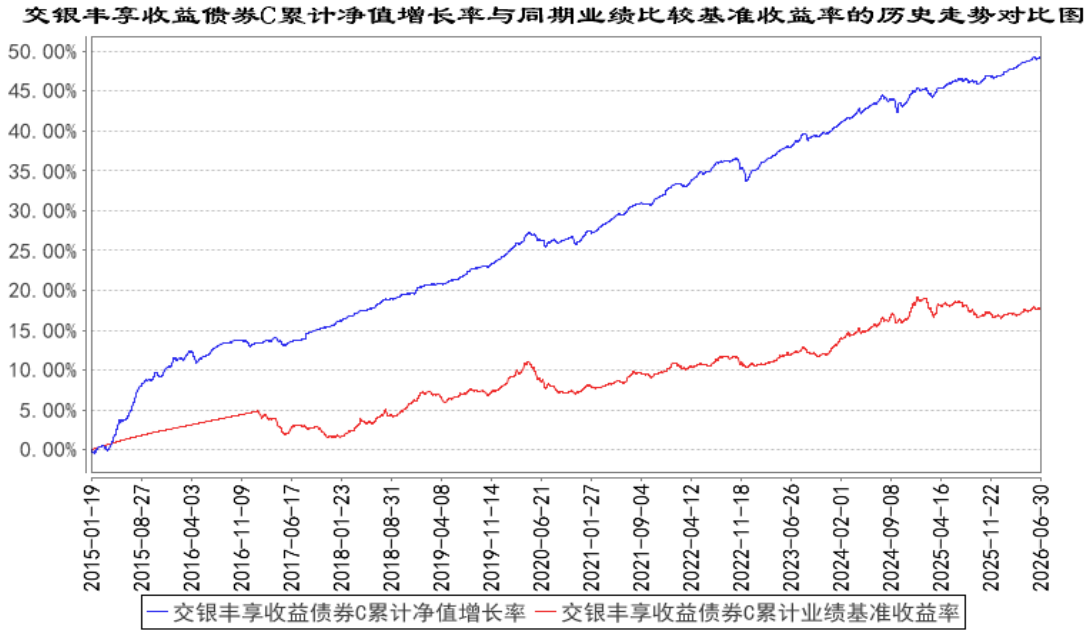
阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①－③	②－④

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.64%	0.02%	0.62%	0.04%	0.02%	-0.02%
过去六个月	1.59%	0.02%	0.91%	0.04%	0.68%	-0.02%
过去一年	2.01%	0.03%	-0.56%	0.06%	2.57%	-0.03%
过去三年	8.08%	0.05%	5.12%	0.08%	2.96%	-0.03%
过去五年	15.09%	0.05%	8.48%	0.07%	6.61%	-0.02%
过去七年	22.81%	0.05%	10.29%	0.07%	12.52%	-0.02%
过去十年	32.80%	0.05%	13.62%	0.07%	19.18%	-0.02%
自基金合同生效起至今	49.23%	0.05%	17.76%	0.06%	31.47%	-0.01%

注：本基金自 2017 年 1 月 20 日起转为开放式运作，本基金的业绩比较基准由“两年期银行定期存款税后收益率”变更为“中债综合全价指数”，3.2.2 同。

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





注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 148 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

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		
黄莹洁	基金经理、固定收益投资助理总监	2015 年 7 月 25 日	-	18 年	硕士。历任中海基金管理有限公司交易员。2012 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任中央交易室交易员。
孙丹	基金经理	2025 年 2	-	11 年	硕士。历任五矿证券有限责任公司交易

妮		月 20 日			员。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任中央交易室交易员、固定收益部研究员/基金经理助理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价

差未出现异常。

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

本报告期内，债券市场收益率整体震荡下行，曲线形态先陡后平。具体来看，年初权益市场开门红压制债市情绪，十年期国债收益率最高上行至 1.90%。随后央行结构性降息、地缘局势紧张及国内 PMI 超预期走弱等因素提振债市情绪，十年国债下破 1.80%。春节后受特朗普关税违宪事件、春节假期出行偏强、楼市新政等影响，债市表现偏弱。三月两会落地后债市反应有限，油价上行带来的通胀预期压制长端，十年期国债维持在 1.80-1.85%窄幅波动，短端则受益于流动性宽松表现较好。四月清明假期后资金转松、美伊停火缓解通胀担忧，叠加社融偏弱，债市边际走强。中旬超长期特别国债发行计划公布，供给扰动有限，收益率下行触及 1.75%，随后止盈情绪及 MLF 缩量推动收益率上行。五月经济数据不及预期叠加央行增量续作 MLF 并加大逆回购投放，中长端表现偏强，十年国债短暂下破 1.70%。六月初资金价格抬升叠加止盈诉求，中短端调整幅度较大；中旬随着公开市场投放增加，长端率先企稳修复；月末央行公告新设隔夜逆回购工具呵护流动性，收益率先下后上。信用债方面，年初信用利差大幅压缩，春节后扰动累积，长端利差走阔。二季度信用债收益率跟随利率债下行，信用利差先压缩后震荡走阔。截至 6 月 30 日，一年期国债收益率较上年末下行 22BP 至 1.12%，十年期国债下行 11BP 至 1.73%，三十年国债下行 3BP 至 2.24%，一年同业存单收益率下行 16BP 至 1.46%。信用债以一、三、五年期 AA+中短期票据为例，收益率分别下行 23BP、31BP、32BP 至 1.53%、1.68%、1.85%。

基金操作方面，组合以中高等级信用债为底仓，根据对宏观经济、货币政策的判断，采取票息策略为主的思路，灵活调节久期与杠杆水平。一季度在流动性平稳环境下，重点布局优质城投债及金融债等品种，适时集中增配了 5 年期以内品种。二季度整体保持 3 年内中高等级信用债为核心配置，在市场调整中择机增加高评级信用债、银行二债和利率债仓位，并综合考虑流动性、利差分位数、绝对收益等因素，适当减持了绝对收益较低品种，保持杠杆操作的有效性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 2026 年下半年，国内经济修复节奏、融资需求变化和流动性环境将成为影响债市的主要因素。基本面方面，经济边际走弱，复苏基础尚不牢固，居民收入和地产周期改善较慢，关注逆周期政策加力节奏。通胀方面，美伊停火后国际油价明显回落，PPI 增速或见顶回落，CPI 维持平

稳，国内通胀环境较为温和。政策方面，上半年财政前置发力，下半年支出有望继续加力提效以托底基建；央行持续完善短端利率调控机制，多次表态货币政策有足够空间，将灵活运用降准降息等工具，预计资金面从宽松转向均衡，但阶段性波动增大。此外，海外地缘局势及权益商品市场的风险偏好变化也将对债市形成扰动。综合来看，下半年债券市场或呈现区间震荡格局。本基金将根据不同资产收益率的动态变化，适时调整组合结构，根据期限利差、流动性预期动态调整组合杠杆率，通过对市场利率的前瞻性判断进行合理有效的久期管理，严格控制信用风险、流动性风险和利率风险，努力为持有人创造稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、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。保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。本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。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金报告期的投

资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	979,005.58	537,652.65
结算备付金		-	2,875,459.16
存出保证金		3,928.99	9,880.08
交易性金融资产	6.4.7.2	2,197,576,822.95	2,119,959,794.05
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,197,576,822.95	2,119,959,794.05
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	-	-
应收清算款		-	19,993,973.22
应收股利		-	-

应收申购款		184,269.95	508,825.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,198,744,027.47	2,143,885,585.10
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		377,064,237.54	398,024,406.58
应付清算款		-	20,005,657.49
应付赎回款		368,186.31	471,043.99
应付管理人报酬		448,906.20	439,039.02
应付托管费		149,635.39	146,346.31
应付销售服务费		19,233.97	11,728.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		129,000.96	103,950.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	128,464.60	208,942.42
负债合计		378,307,664.97	419,411,115.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	798,011,341.24	761,680,083.94
未分配利润	6.4.7.12	1,022,425,021.26	962,794,386.14
净资产合计		1,820,436,362.50	1,724,474,470.08
负债和净资产总计		2,198,744,027.47	2,143,885,585.10

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 798,011,341.24 份，其中交银丰享收益债券 A 基金份额总额 750,570,539.41 份，基金份额净值 2.3514 元；交银丰享收益债券 C 基金份额总额 47,440,801.83 份，基金份额净值 1.1704 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		38,579,922.28	24,826,808.40
1.利息收入		10,439.52	25,439.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,439.52	20,173.36
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		-	5,265.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,148,567.24	29,823,945.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	27,148,567.24	29,823,945.57
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	-	-
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	11,409,419.71	-5,038,997.01
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	11,495.81	16,420.54
减：二、营业总支出		7,376,707.88	7,565,043.54
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,633,252.80	2,603,122.07
2．托管费	6.4.10.2.2	877,750.94	867,707.38
3．销售服务费	6.4.10.2.3	95,501.56	95,698.39
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		3,559,014.63	3,788,487.79
其中：卖出回购金融资产支出		3,559,014.63	3,788,487.79
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		85,586.79	94,895.43
8．其他费用	6.4.7.23	125,601.16	115,132.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,203,214.40	17,261,764.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,203,214.40	17,261,764.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		31,203,214.40	17,261,764.86

6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	761,680,083.94	-	962,794,386.14	1,724,474,470.08
二、本期期初净资产	761,680,083.94	-	962,794,386.14	1,724,474,470.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	36,331,257.30	-	59,630,635.12	95,961,892.42
（一）、综合收益总额	-	-	31,203,214.40	31,203,214.40
（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）	36,331,257.30	-	28,427,420.72	64,758,678.02
其中：1.基金申购款	95,948,666.29	-	43,651,945.44	139,600,611.73
2.基金赎回款	-59,617,408.99	-	-15,224,524.72	-74,841,933.71
（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	798,011,341.24	-	1,022,425,021.26	1,820,436,362.50
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	793,168,146.67	-	971,503,511.01	1,764,671,657.68

二、本期期初净资产	793,168,146.67	-	971,503,511.01	1,764,671,657.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,452,236.61	-	8,905,036.57	-19,547,200.04
（一）、综合收益总额	-	-	17,261,764.86	17,261,764.86
（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）	-28,452,236.61	-	-8,356,728.29	-36,808,964.90
其中：1.基金申购款	77,920,197.89	-	12,856,275.48	90,776,473.37
2.基金赎回款	-106,372,434.50	-	-21,213,003.77	-127,585,438.27
（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	764,715,910.06	-	980,408,547.58	1,745,124,457.64

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：

袁庆伟	周云康	许颖
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

交银施罗德丰享收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[2014]1019 号《关于准予交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金注册的批复》注册，由交银施罗德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《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基

金，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 259,262,547.02 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(2015)第 42 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 259,386,490.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 123,943.93 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额，在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取后端申购费用和赎回费用的，称为 B 类基金份额，在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，赎回时收取短期赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；本基金募集期内仅开放 C 类基金份额的认购；在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作，封闭期结束后转为开放式运作，并可视业务情况择时增开 A 类和 B 类基金份额的申购。根据《关于交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金封闭期结束转为开放式运作并同时增加开通 A 类基金份额暨开放基金日常申购、赎回、定期定额投资业务并参与部分销售机构申购费率优惠活动的公告》的相关规定，本基金封闭期自 2015 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2017 年 1 月 19 日止，自 2017 年 1 月 20 日起转为开放式运作，自该日起开始办理日常申购、赎回业务，并同时增加开通 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中，封闭期内，本基金所投企业债和公司债信用评级需在 AA 级（含）以上。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资（分离交易可转债的纯债部分除外）。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。基金的投资组合比例为投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在封闭期结束转开放的前后三个月内，基金投资不受上述债券资产投资比例限制。本基金在开放期内，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金及应收申购款等。本基金封闭期内投资的业绩比较基准为两年期银行定期存款税后收

益率，转为开放式运作后业绩比较基准为中债综合全价指数。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》以及参考本基金的基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及其允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《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《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《关于资管产品增值税有关问题

的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	979,005.58
等于：本金	978,813.81
加：应计利息	191.77
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	979,005.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 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	240,387,266.30	2,381,266.85	245,153,266.85	2,384,733.70
	银行间市场	1,923,420,279.59	18,373,556.10	1,952,423,556.10	10,629,720.41
	合计	2,163,807,545.89	20,754,822.95	2,197,576,822.95	13,014,454.11
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,163,807,545.89	20,754,822.95	2,197,576,822.95	13,014,454.11

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,789.03
其中：交易所市场	-
银行间市场	34,789.03
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	128,464.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银丰享收益债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	731,427,300.32	731,427,300.32
本期申购	23,830,632.24	23,830,632.24
本期赎回（以“-”号填列）	-4,687,393.15	-4,687,393.15
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	750,570,539.41	750,570,539.41

交银丰享收益债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,252,783.62	30,252,783.62
本期申购	72,118,034.05	72,118,034.05
本期赎回（以“-”号填列）	-54,930,015.84	-54,930,015.84
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	47,440,801.83	47,440,801.83

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

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

交银丰享收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	964,584,733.28	-6,390,909.54	958,193,823.74
本期期初	964,584,733.28	-6,390,909.54	958,193,823.74
本期利润	19,339,980.62	11,130,029.01	30,470,009.63
本期基金份额交易产生的变动数	25,548,451.73	130,023.18	25,678,474.91
其中：基金申购款	31,796,565.59	145,461.27	31,942,026.86
基金赎回款	-6,248,113.86	-15,438.09	-6,263,551.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,009,473,165.63	4,869,142.65	1,014,342,308.28

交银丰享收益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,719,659.98	-119,097.58	4,600,562.40
本期期初	4,719,659.98	-119,097.58	4,600,562.40
本期利润	453,814.07	279,390.70	733,204.77
本期基金份额交易产生的变动数	2,735,909.32	13,036.49	2,748,945.81
其中：基金申购款	11,580,080.78	129,837.80	11,709,918.58
基金赎回款	-8,844,171.46	-116,801.31	-8,960,972.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,909,383.37	173,329.61	8,082,712.98

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,143.56
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	3,136.20
其他	159.76
合计	10,439.52

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	27,243,727.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-95,159.92
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	27,148,567.24

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	775,124,598.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	766,490,289.28
减：应计利息总额	8,714,419.10
减：交易费用	15,050.00
买卖债券差价收入	-95,159.92

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

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	11,409,419.71
股票投资	-
债券投资	11,409,419.71
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	11,409,419.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,495.81
合计	11,495.81

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	22,698.60
债券账户费用	18,600.00
合计	125,601.16

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、关联关系

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

本报告期内上海直源投资管理有限公司已完成工商注销登记。

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
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,633,252.80	2,603,122.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,733.09	35,923.53
应支付基金管理人的净管理费	2,586,519.71	2,567,198.54

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，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×适用费率÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	877,750.94	867,707.38

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，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×适用费率÷当年天数。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银丰享收益债券 A	交银丰享收益债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	2,592.51	2,592.51
交银施罗德基金管理有限公司	-	15,521.29	15,521.29
中信银行股份有限公司	-	495.04	495.04
合计	-	18,608.84	18,608.84
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	交银丰享收益债券 A	交银丰享收益债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	1,684.73	1,684.73
交银施罗德基金管理有限公司	-	1,300.34	1,300.34
中信银行股份有限公司	-	545.23	545.23
合计	-	3,530.30	3,530.30

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金份额对应的基金资产净值约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

交银丰享收益债券 A 类份额日基金销售服务费＝前一日交银丰享收益债券 A 类基金份额对应的资产净值×0.00%÷当年天数；

交银丰享收益债券 C 类份额日基金销售服务费＝前一日交银丰享收益债券 C 类基金份额对应的资产净值×0.40%÷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

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

份额单位：份

交银丰享收益债券 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025年12月31日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
中信银行股份有限公司	719,323,800.71	90.14	719,323,800.71	94.44

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中信银行_活期存款	979,005.58	7,143.56	3,737,238.85	6,780.17

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

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

无。

6.4.12 期末（2026 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 2026 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 377,064,237.54 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
102580304	25 杭金投	2026 年 7 月	101.41	200,000	20,282,623.56

	MTN001	1 日			
102582278	25 岳阳建投 MTN001	2026 年 7 月 1 日	101.39	300,000	30,417,000.00
102584780	25 枣庄矿业 MTN002	2026 年 7 月 1 日	102.01	300,000	30,603,121.64
230413	23 农发 13	2026 年 7 月 1 日	102.11	600,000	61,267,315.07
232400034	24 杭州银行二级资本债 01	2026 年 7 月 1 日	103.26	200,000	20,652,416.44
232400037	24 宁波银行二级资本债 02	2026 年 7 月 1 日	103.11	200,000	20,621,296.44
232480032	24 兴业银行二级资本债 02	2026 年 7 月 1 日	104.19	100,000	10,419,023.56
232480035	24 平安银行二级资本债 01A	2026 年 7 月 1 日	104.10	400,000	41,638,060.27
232480098	24 浦发银行二级资本债 02A	2026 年 7 月 1 日	102.68	200,000	20,535,320.55
232480106	24 建行二级资本债 03BC	2026 年 7 月 1 日	101.85	401,000	40,840,305.32
240204	24 国开 04	2026 年 7 月 1 日	101.43	200,000	20,286,876.71
240210	24 国开 10	2026 年 7 月 1 日	105.02	300,000	31,506,164.38
240215	24 国开 15	2026 年 7 月 1 日	106.10	100,000	10,609,854.79
250220	25 国开 20	2026 年 7 月 1 日	102.22	200,000	20,444,372.60
250410	25 农发 10	2026 年 7 月 1 日	99.94	95,000	9,493,995.48
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.27	200,000	20,253,819.18
合计				3,996,000	409,871,565.99

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

本基金是一只债券型基金，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中，封闭期内，本基金所投企业债和公司债信用评级需在 AA 级（含）以上。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资（分离交易可转债的纯债部分除外）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规风险及审计委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成基金运作的风险管理。督察长直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规风险及审计委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。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，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应措施，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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,072,646.58
合计	-	10,072,646.58

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	422,926,769.35	335,400,599.79
AAA 以下	110,255,245.91	157,766,903.23
未评级	1,664,394,807.69	1,616,719,644.45
合计	2,197,576,822.95	2,109,887,147.47

注：未评级部分包含中期票据、公司债、国债或政策性金融债。

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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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每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，保持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。

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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受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对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	979,005.58	-	-	-	979,005.58
存出保证金	3,928.99	-	-	-	3,928.99
交易性金融资产	333,270,852.50	1,748,057,443.29	116,248,527.16	-	2,197,576,822.95
应收申购款	-	-	-	184,269.95	184,269.95
资产总计	334,253,787.07	1,748,057,443.29	116,248,527.16	184,269.95	2,198,744,027.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	368,186.31	368,186.31
应付管理人报酬	-	-	-	448,906.20	448,906.20
应付托管费	-	-	-	149,635.39	149,635.39
卖出回购金融资产款	377,064,237.54	-	-	-	377,064,237.54
应付销售服务费	-	-	-	19,233.97	19,233.97
应交税费	-	-	-	129,000.96	129,000.96
其他负债	-	-	-	128,464.60	128,464.60

负债总计	377,064,237.54	-	-	1,243,427.43	378,307,664.97
利率敏感度缺口	-42,810,450.47	1,748,057,443.29	116,248,527.16	-1,059,157.48	1,820,436,362.50
上年度末 2025 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	537,652.65	-	-	-	537,652.65
结算备付金	2,875,459.16	-	-	-	2,875,459.16
存出保证金	9,880.08	-	-	-	9,880.08
交易性金融资产	426,342,518.74	1,602,794,963.41	90,822,311.90	-	2,119,959,794.05
应收申购款	1.00	-	-	508,824.94	508,825.94
应收清算款	-	-	-	19,993,973.22	19,993,973.22
资产总计	429,765,511.63	1,602,794,963.41	90,822,311.90	20,502,798.16	2,143,885,585.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	471,043.99	471,043.99
应付管理人报酬	-	-	-	439,039.02	439,039.02
应付托管费	-	-	-	146,346.31	146,346.31
应付清算款	-	-	-	20,005,657.49	20,005,657.49
卖出回购金融资产款	398,024,406.58	-	-	-	398,024,406.58
应付销售服务费	-	-	-	11,728.36	11,728.36
应交税费	-	-	-	103,950.85	103,950.85
其他负债	-	-	-	208,942.42	208,942.42
负债总计	398,024,406.58	-	-	21,386,708.44	419,411,115.02
利率敏感度缺口	31,741,105.05	1,602,794,963.41	90,822,311.90	-883,910.28	1,724,474,470.08

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25 个基点	-13,503,339.73	-11,315,737.63
	市场利率下降 25 个基点	13,686,752.45	11,478,019.96

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，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，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

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,197,576,822.95	2,119,959,794.05
第三层次	-	-
合计	2,197,576,822.95	2,119,959,794.05

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投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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

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

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	2,197,576,822.95	99.95
	其中：债券	2,197,576,822.95	99.95
	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	979,005.58	0.04
8	其他各项资产	188,198.94	0.01
9	合计	2,198,744,027.47	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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	440,651,535.32	24.21
	其中：政策性金融债	174,362,082.18	9.58
4	企业债券	313,728,457.97	17.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,399,502,373.72	76.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	43,694,455.94	2.40
10	合计	2,197,576,822.95	120.72

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	230413	23 农发 13	600,000	61,267,315.07	3.37
2	241314	24 抚州 02	500,000	51,824,150.69	2.85
3	243996	25 昌投 G1	500,000	51,255,282.19	2.82
4	232480106	24 建行二级资本债 03BC	500,000	50,923,073.97	2.80
5	102581773	25 黔晟国资 MTN001A	500,000	50,604,473.97	2.78

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2026 年 06 月 05 日,国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书,给予中国建设银行股份有限公司 70 万元人民币的行政处罚。

2026 年 02 月 14 日,央行公示银罚决字[2026]5 号行政处罚决定书,给予中国建设银行股份有限公司罚没共计 4350.61 万元人民币的行政处罚。

2025 年 10 月 31 日,国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书,给予平安银行股份有限公司罚没共计 1880 万元人民币的行政处罚。

2025 年 09 月 12 日,国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书,给予中国建设银行股份有限公司 290 万元人民币的行政处罚。

2025 年 08 月 01 日,国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书,给予中国农业发展银行 1020 万元人民币的行政处罚。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有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。

7.11.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	3,928.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	184,269.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	188,198.94

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（%）
交银丰享收益债券 A	10,999	68,239.89	719,323,800.71	95.84	31,246,738.70	4.16
交银丰享收益债券 C	623	76,148.96	25,948,199.50	54.70	21,492,602.33	45.30
合计	11,622	68,663.86	745,272,000.21	93.39	52,739,341.03	6.61

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	交银丰享收益债券 A	1,226.35	0.00
	交银丰享收益债券 C	4.50	0.00
	合计	1,230.85	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

无。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银丰享收益债券 A	交银丰享收益债券 C
基金合同生效日（2015 年 1 月 19 日）基金份额总额	-	259,386,490.95
本报告期期初基金份额总额	731,427,300.32	30,252,783.62
本报告期基金总申购份额	23,830,632.24	72,118,034.05
减：本报告期基金总赎回份额	4,687,393.15	54,930,015.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	750,570,539.41	47,440,801.83

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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：本报告期内，张宏良先生不再担任公司董事长（法定代表人），由公司总经理袁庆伟女士代为履行公司董事长（法定代表人）职责。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨

璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经履行适当程序，本基金聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	62,469,720.00	100.00	1,023,000,000.00	100.00	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

2、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 1 月 21 日

2	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
3	交银施罗德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年）	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 3 月 28 日
4	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 4 月 21 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 6 日
6	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
7	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
8	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 12 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2026 年 6 月 13 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

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	2026/1/1-2026/6/30	719,323,800.71	-	-	719,323,800.71	90.14
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

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、中国证监会准予交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金募集注册的文件；

2、《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金托管协议》；

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、关于申请募集注册交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。