

申万菱信天天增货币市场基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司
报告送出日期:2026 年 08 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	4
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 债券回购融资情况	32
7.3 基金投资组合平均剩余期限	33
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	34
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	35
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	35
7.9 投资组合报告附注	35
§ 8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	36
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36

§ 9 开放式基金份额变动	37
§ 10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议	37
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	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	37
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	37
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	38
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	38
10.9 其他重大事件	38
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	39
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	39
§ 12 备查文件目录	39
12.1 备查文件目录	39
12.2 存放地点	39
12.3 查阅方式	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信天天增货币市场基金
基金简称	申万菱信天天增
基金主代码	026122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 月 22 日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	19,086,607,398.28 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要为投资者提供短期现金管理工具，因此本基金最主要的投资策略是在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。具体投资策略详见本基金《基金合同》第十二部分 基金的投资。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万菱信基金管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	王菲萍	王静茹
	联系电话	021-23261188	010-50938589
	电子邮箱	service@swsmu.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		4008808588	4008-058-058
传真		021-23261199	-
注册地址		上海市中山南路 100 号 11 层	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		上海市中山南路 100 号 11 层	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		200010	100033
法定代表人		陈晓升	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.swsmu.com
基金中期报告置备地点	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 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	73,904,026.25
本期利润	73,904,026.25
本期净值收益率	0.3677%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末基金资产净值	19,086,607,398.28
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
累计净值收益率	0.3896%

注：（1）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，固定净值型货币市场基金公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 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	0.1824%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.0951%	0.0007%
过去六个月	0.3677%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.1941%	0.0006%
自基金合同生 效起至今	0.3896%	0.0006%	0.1832%	0.0000%	0.2064%	0.0006%

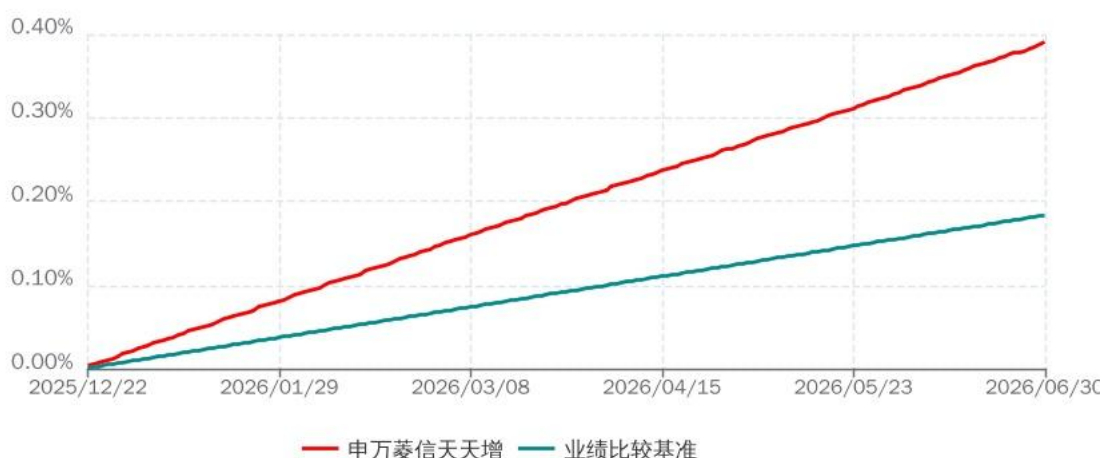
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

- 2、本基金业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。
- 3、业绩比较基准计算过程中日收益率统一四舍五入保留 8 位小数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信天天增货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月22日-2026年06月30日)



注：（1）本基金合同生效日为 2025 年 12 月 22 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。
（2）本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 81 只，资产管理规模 1463.55 亿元，公募产品累计分红 230.27 亿元。（截至 2026 年 6 月 30 日）

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升

投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系（Excellent Strategy & Product）、卓越品牌与客户服务体系（Excellent Branding & Service），提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67%的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33%的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人（QDLP）等业务资格，并全资设立申万菱信（上海）资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构！

（注：基金管理人 与 股东之间实行业务隔离制度）

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		
沈夏	本基金基金经理	2025-12-22	-	10 年	沈夏女士，硕士研究生。2015 年起从事金融相关工作，曾任职于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、新沃基金管理有限公司，2022 年 11 月加入申万菱信基金，曾任申万菱信稳鑫 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，现任申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、申万菱信合利纯债债券型证券投资基金、申万菱信天天增货币市场基金、申万菱信天添利货币市场基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自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关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严

格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

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《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，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；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期，未发生我司旗下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超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年，国内经济整体呈现总量修复、结构分化的特征，维持外需支撑、内需偏弱的格局。经济整体边际改善，但内需偏弱问题凸显，通胀压力阶段性回落，宽信用效果偏弱，稳健的基本面为债券市场提供良好支撑。3 月 PMI 重回荣枯线之上，外需是核心支撑且具备一定持续性。6 月 PMI 回升至 50.3%，主要受益于全球 AI 基建投资带动的出口改善。国内需求整体偏弱，财政资金投放偏慢影响投资，地产市场低位震荡，销售与土地成交走低，社零增速下行、可选消费走弱，市场对内需刺激政策加码预期升温。通胀方面，上半年走势前高后低。一季度受中东地缘冲突影响，原材料价格上涨，推动 3 月 PPI 同比转正。二季度地缘局势缓和，大宗商品价格回落，输入型通胀压力显著缓解。金融层面，实体信贷总量平稳，但结构偏弱。居民加杠杆意愿较低，企业有效融资需求较弱，宽信用传导不及预期。后续重点跟踪内需政策落地、外需持续性、结构性通胀变化及信用修复进度。

货币市场方面，上半年央行持续维持适度宽松的货币政策基调，银行体系流动性整体充裕，资金面整体宽松，当然也有阶段性边际收敛。一季度央行通过 MLF、买断式逆回购等工具精准调节市场资金，推动资金价格渐进下行，DR001 中枢稳定在 1.33%-1.34%，持续低于政策利率，短端资金运行逻辑转向以隔夜利率稳定为核心的新阶段，为经济复苏和利率债市场营造了良好金融环境。二季度宽松格局延续，4-5 月实体融资需求偏弱、信贷投放平缓，叠加结汇支撑，市场资金沉淀，DR001 均值回落至 1.23%-1.28%。为平滑流动性，央行持续开展对冲操作，适度收敛过剩流动性，6 月 DR001 均值回升至 1.39%，资金面边际回归中性。6 月末，央行首次推出银行间隔夜逆回购政策工具，维护流动性的同时，不断完善货币政策工具箱的品种。

同业存单市场方面，2026 年上半年整体收益率中枢震荡下移，在全年宽松流动性环境下呈现阶段性波动走势，性价比相对凸显。一季度，资金面多数时间维持均衡，存单市场表现为供给偏克制、需求偏韧性，1 年期 AAA 存单利率由约 1.60%-1.65% 下行至 1.53%-1.58% 附近，曲线整体偏平，期限利差和信用利差不断压缩。年初高息定存重定价与到期释放出大量低风险资金需求，货币基金和银

行理财现金管理类产品规模受益增长,从而抬升对存单这类较高流动性、较低波动资产的配置需求。二季度收益率整体呈 V 型走势,1 年期 AAA 同业存单收益率区间在 1.43%—1.50%之间波动,季度低点较一季度末进一步下移约 8BP。4 月和 5 月,多重利好共振,市场整体流动性宽裕,存单收益率延续一季度下行趋势;进入 6 月后,伴随季末 MPA 考核、跨半年资金压力上升,以及央行公开市场投放节奏边际趋于中性,DR001 逐步回归政策利率,供需结构有所改变,需求边际下降,存单收益率最高回升至 1.50%。

报告期内,本基金秉承稳健投资原则,谨慎操作,以维持组合流动性为第一要求,以同业存单和活期存款为主要配置资产,整体组合维持中性的杠杆率和久期,并根据市场情况积极参加同业存单的波段交易,以期增厚收益,争取为持有人提供长期稳定的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为 0.3677%,同期业绩基准表现为 0.1736%。

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,国内固收市场预计延续多因素交织、结构分化的运行格局,整体环境温和友好,以票息策略为主、波段交易为辅仍是核心思路。

央行适度宽松的货币政策基调预计延续,流动性整体维持合理充裕。央行运用多种政策工具为市场营造适宜的流动性环境,不排除降准或降息的可能性,新型政策性金融工具的落地亦值得期待。短端利率围绕政策利率平稳运行,大幅收紧概率或较低。实体有效融资需求及宽信用传导偏弱的格局延续,市场资金或将充裕,一定程度利好固收资产。市场策略上,利率债或维持区间震荡;同业存单、短端信用债凭借较高性价比与防御属性,仍是关注核心。信用市场整体风险相对可控,延续结构性分化格局。总体上,债券市场而言下半年或仍处于宏观基本面和货币政策相对有利环境里。后续重点跟踪内需刺激落地节奏、流动性边际变化及海外需求波动,力争把握震荡行情下的波段机会与优质票息资产。

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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。本基金管理人估值委员会成员包括分管基金运营的高级管理人员、督察长、分管基金投资研究的高级管理人员、基金研究部门负责人、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、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、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

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，根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金暂估净收益为基准，为投资者每日计提当日收益。本基金收益每月支付一次，支付方式采用现金红利。

§ 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，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，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

本托管人复核了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、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 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：申万菱信天天增货币市场基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,789,330,295.29	4,386,179,285.79
结算备付金		-	73,688,574.74

存出保证金		29,660.88	-
交易性金融资产	6.4.7.2	15,514,861,196.99	9,913,278,420.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,514,861,196.99	9,913,278,420.50
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	-	4,238,693,073.92
应收清算款		-	417,595.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	64.39
资产总计		20,304,221,153.16	18,612,257,014.59
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		1,200,052,602.74	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,296,796.87	4,237,211.25
应付托管费		859,451.01	853,111.83
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		2,306,572.63	2,703,090.40
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,098,331.63	2,021,701.80
负债合计		1,217,613,754.88	9,815,115.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	19,086,607,398.28	18,602,441,899.31
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		19,086,607,398.28	18,602,441,899.31
负债和净资产总计		20,304,221,153.16	18,612,257,014.59

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 19,086,607,398.28 份。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信天天增货币市场基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		164,640,142.39
1. 利息收入		49,105,451.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	40,153,949.86
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		8,951,501.40
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		115,534,691.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	115,534,691.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	0.01
减：二、营业总支出		90,736,116.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	79,264,313.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,996,977.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		6,295,215.51
其中：卖出回购金融资产支出		6,295,215.51
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		1,430.60
8. 其他费用	6.4.7.19	178,178.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		73,904,026.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,904,026.25
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		73,904,026.25

6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信天天增货币市场基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	18,602,441,899.31	-	18,602,441,899.31
二、本期期初净资产	18,602,441,899.31	-	18,602,441,899.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	484,165,498.97	-	484,165,498.97
（一）、综合收益总额	-	73,904,026.25	73,904,026.25
（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）	484,165,498.97	-	484,165,498.97
其中：1. 基金申购款	292,579,102,612.67	-	292,579,102,612.67
2. 基金赎回款	-292,094,937,113.70	-	-292,094,937,113.70
（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）	-	-73,904,026.25	-73,904,026.25
四、本期期末净资产	19,086,607,398.28	-	19,086,607,398.28

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：

邱春杨	邱春杨	徐越
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

申万菱信天天增货币市场基金(以下简称“本基金”)由申万宏源证券资产管理有限公司旗下的申万宏源天天增货币型集合资产管理计划(以下简称“集合计划”)转型而成。集合计划的变更已经中国证监会 2025 年 10 月 30 日证监许可[2025]2428 号文准予变更注册。申万宏源证券资产管理有限公司已就旗下的集合计划变更管理人为申万菱信基金管理有限公司并转型变更为申万菱信基金管理有限公司旗下公募基金有关事项的议案召开集合计划份额持有人大会，并已于 2025 年 12 月 15 日表决通过了前述议案，持有人大会决议自同日起生效。根据业务实际交接情况与安排，自公告发布日即 2025 年 12 月 22 日起，前述申万宏源证券资产管理有限公司旗下的集合计划的管理人正式变更为申万菱信基金管理有限公司，集合计划正式变更为申万菱信基金管理有限公司旗下公募基金。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金投资于以下金融工具：

- (1) 现金；
- (2) 期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- (3) 期限在 1 个月以内的债券回购；
- (4) 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- (5) 中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于前款第(4)项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级(如有)均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。

对于法律法规及监管机构今后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金持有的企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及逆回购质押品信用评级下降不再符合投资标准的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，中国证监会另有规定的除外。

本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 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。

(d) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 06 月 30 日
活期存款	3,535,124,775.00
等于：本金	3,533,525,553.20
加：应计利息	1,599,221.80
减：坏账准备	-
定期存款	1,254,205,520.29
等于：本金	1,250,000,000.00
加：应计利息	4,205,520.29

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	200,132,916.74
存款期限 3 个月以上	1,054,072,603.55
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,789,330,295.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	15,514,861,196.99	15,518,827,668.77	3,966,471.78	0.0208
	合计	15,514,861,196.99	15,518,827,668.77	3,966,471.78	0.0208
资产支持证券		-	-	-	-
合计		15,514,861,196.99	15,518,827,668.77	3,966,471.78	0.0208

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	104,249.26
其中：交易所市场	-
银行间市场	104,249.26
应付利息	-
预提费用-上清查询费	300.00
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	39,671.58
预提费用-账户维护费	9,000.00
其他应付	1,885,603.42
合计	2,098,331.63

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,602,441,899.31	18,602,441,899.31
本期申购	292,579,102,612.67	292,579,102,612.67
本期赎回（以“-”号填列）	-292,094,937,113.70	-292,094,937,113.70
本期末	19,086,607,398.28	19,086,607,398.28

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	73,904,026.25	-	73,904,026.25
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-73,904,026.25	-	-73,904,026.25
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	33,756,125.64
定期存款利息收入	6,324,103.62
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	73,705.67

其他	14.93
合计	40,153,949.86

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	115,080,628.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	454,063.09
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	115,534,691.12

6.4.7.11.2 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,456,959,380.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,453,906,755.28
减：应计利息总额	2,598,561.66
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	454,063.09

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	0.01
合计	0.01

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户查询费-上清所	600.00
证券账户开户费	200.00
银行汇划费	61,700.00
账户维护费	16,500.00
合计	178,178.95

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

无。

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
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人

申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、基金注册登记机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	100,470,608.76	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	22,961,799,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	79,264,313.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	38,898,771.82

应支付基金管理人的净管理费	40,365,541.31
---------------	---------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.90%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

当以 0.90%/年的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，基金管理人将调整管理费为 0.30%/年，以降低每万份基金暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，基金管理人方可恢复计提 0.90%/年的管理费。基金管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,996,977.95

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

(1) 本基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，销售服务费按前一日基金份额的基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H 为基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

(2) 本基金自 2025 年 12 月 22 日基金合同生效之日起，延续销售服务费 0%的优惠。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	2,825,405.11	16,877.99

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
-	74,300,544.02	-396,517.77	73,904,026.25	-

6.4.12 期末（2026 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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人民币 1,200,052,602.74 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
112503255	25 农业银行 CD255	2026-07-01	99.82	1,000,000	99,821,284.15
112506253	25 交通银行 CD253	2026-07-01	99.48	500,000	49,739,409.68
112603100	26 农业银行 CD100	2026-07-01	99.11	2,500,000	247,779,878.13
112603103	26 农业银行 CD103	2026-07-01	99.82	2,000,000	199,638,380.41
112606108	26 交通银行 CD108	2026-07-01	99.02	3,000,000	297,054,660.62
112610011	26 兴业银行 CD011	2026-07-01	99.90	2,000,000	199,807,971.49
112617009	26 光大银行 CD009	2026-07-01	99.09	2,000,000	198,173,177.94
合计				13,000,000	1,292,014,762.42

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型基金。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，包括债券投资、买入返售金融资产以及银行存款等。与以上金融工具有关的风险以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只货币型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种，本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“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融

工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

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，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,496,475,076.93	9,913,278,420.50
合计	15,496,475,076.93	9,913,278,420.50

6.4.13.2.2 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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-

未评级	18,386,120.06	-
合计	18,386,120.06	-

注：未评级债券均为无信用风险的政策银行债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占净资产的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具

占净资产的比例合计不得低于 30%。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过净资产的 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货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金所持有的资产大部分是流动性良好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具，其余是银行存款，银行存款主要为活期存款及定期存款。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过净资产的 10%，于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过净资产的 10%。除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

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。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过净资产的 20%。于本期末，附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。于本期末，本基金持有的利率敏感性金融工具主要是银行存款、债券投资或买入返售金融资产等。基于本基金产品性质，生息资产占净资产较高比重，因此本基金存在相应的利率风险。

对于固定利率类金融工具，面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险。

对于浮动利率类金融工具，主要面临两方面利率风险：第一，每个付息期间内面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险；第二，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的影响的风险。

本基金管理人主要通过定期对利率水平的预测、调整投资组合的久期等方式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 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,936,953 ,136.33	651,653,5 83.08	200,723,5 75.88	-	-	-	4,789,330 ,295.29
结算备付 金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证 金	29,660.88	-	-	-	-	-	29,660.88
交易性金 融资产	2,746,924 ,478.05	3,828,382 ,639.24	8,939,554 ,079.70	-	-	-	15,514,86 1,196.99
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,683,907 ,275.26	4,480,036 ,222.32	9,140,277 ,655.58	-	-	-	20,304,22 1,153.16
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金 融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购 金融资产	1,200,052 ,602.74	-	-	-	-	-	1,200,052 ,602.74

款							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,296,796.87	12,296,796.87
应付托管费	-	-	-	-	-	859,451.01	859,451.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	2,306,572.63	2,306,572.63
其他负债	-	-	-	-	-	2,098,331.63	2,098,331.63
负债总计	1,200,052,602.74	-	-	-	-	17,561,152.14	1,217,613,754.88
利率敏感度缺口	5,483,854,672.52	4,480,036,222.32	9,140,277,655.58	-	-	-17,561,152.14	19,086,607,398.28
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,386,179,285.79	-	-	-	-	-	4,386,179,285.79
结算备付金	73,688,574.74	-	-	-	-	-	73,688,574.74
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,928,454,870.73	2,541,523,793.90	5,443,299,755.87	-	-	-	9,913,278,420.50
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,238,693,073.92	-	-	-	-	-	4,238,693,073.92
应收清算	-	-	-	-	-	417,595.2	417,595.2

款						5	5
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	64.39	64.39
资产总计	10,627,015,805.18	2,541,523,793.90	5,443,299,755.87	-	-	417,659.64	18,612,257,014.59
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,237,211.25	4,237,211.25
应付托管费	-	-	-	-	-	853,111.83	853,111.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	2,703,090.40	2,703,090.40
其他负债	-	-	-	-	-	2,021,701.80	2,021,701.80
负债总计	-	-	-	-	-	9,815,115.28	9,815,115.28
利率敏感度缺口	10,627,015,805.18	2,541,523,793.90	5,443,299,755.87	-	-	-9,397,455.64	18,602,441,899.31

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 市场利率平行下降 50 个基点	28,190,000.00	14,000,000.00
	2. 市场利率平行上升 50 个基点	-28,040,000.00	-13,950,000.00

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 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到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	15,514,861,196.99	9,913,278,420.50
第三层次	-	-
合计	15,514,861,196.99	9,913,278,420.50

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。对于本基金投资的

证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：无）。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	15,514,861,196.99	76.41
	其中：债券	15,514,861,196.99	76.41
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,789,330,295.29	23.59
4	其他各项资产	29,660.88	0.00
5	合计	20,304,221,153.16	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.14	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,200,052,602.74	6.29

	其中：买断式回购融资	-	-
--	------------	---	---

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

注：本货币市场基金合同约定：本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限(天数)	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	34.48	6.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	40.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.35	6.29

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。

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	18,386,120.06	0.10
	其中：政策性金融债	18,386,120.06	0.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,496,475,076.93	81.19
8	其他	-	-
9	合计	15,514,861,196.99	81.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	112603100	26 农业银行 CD100	3,000,000	297,335,853.75	1.56
2	112606108	26 交通银行 CD108	3,000,000	297,054,660.62	1.56
3	112509166	25 浦发银行 CD166	2,000,000	199,947,539.26	1.05
4	112515168	25 民生银行 CD168	2,000,000	199,938,118.79	1.05
5	112610011	26 兴业银行 CD011	2,000,000	199,807,971.49	1.05
6	112690984	26 宁波银行 CD024	2,000,000	199,806,184.51	1.05
7	112505307	25 建设银行 CD307	2,000,000	199,703,038.62	1.05
8	112603103	26 农业银行 CD103	2,000,000	199,638,380.41	1.05
9	112503289	25 农业银行 CD289	2,000,000	199,476,658.19	1.05
10	112693340	26 青岛农商行 CD012	2,000,000	199,308,773.98	1.04

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0521%
报告期内偏离度的最低值	0.0063%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0246%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益，本基金份额资产净值每日维持在 1.0000 元。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，青岛农村商业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚。

本基金对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.9.3 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	29,660.88
2	应收清算款	—
3	应收利息	—
4	应收申购款	—

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,660.88

7.9.4 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

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
142,614	133,834.04	1,012,764,426.32	5.31%	18,073,842,971.96	94.69%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	其他机构	99,635,299.37	0.52%
2	其他机构	67,270,952.37	0.35%
3	个人	63,431,015.73	0.33%
4	个人	54,991,772.43	0.29%
5	个人	51,820,842.32	0.27%
6	其他机构	51,778,737.09	0.27%
7	个人	47,575,812.09	0.25%
8	个人	45,620,290.60	0.24%
9	个人	42,050,525.96	0.22%
10	个人	41,733,189.32	0.22%

注：申万宏源证券有限公司以非交易过户转入方式提供快取功能，本报告期每日非交易过户转入及赎回份额不列入前十名份额持有人情况。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	16,137.05	0.0001%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 12 月 22 日）基金份额总额	19,923,052,997.06
本报告期期初基金份额总额	18,602,441,899.31
本报告期基金总申购份额	292,579,102,612.67
减：本报告期基金总赎回份额	292,094,937,113.70
本报告期期末基金份额总额	19,086,607,398.28

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无

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、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由上野由喜先生变更为染谷知先生。
- 2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由汪涛先生变更为邱春杨先生。
- 3、本报告期内，经基金管理人董事会决议，同意公司总经理由汪涛先生变更为邱春杨先生。
- 4、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门负责人由朱立元变更为孟凡阔。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请上会会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计服务，未发生改聘会计师事务所事宜。

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，基金管理人无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，基金管理人相关从业人员无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，基金托管人的托管业务部门无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，基金托管人相关从业人员无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	
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、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；5、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。

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		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
申万宏源证券有限公司	100,470,608.76	100.00%	22,961,799,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内，本货币市场基金未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人根据基金合同关于管理费的相关约定，对管理费适用费率进行调整。详见本基金管理人发布的相关公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

基金合同；
招募说明书及其更新；
产品资料概要及其更新；
成立公告；
定期报告；
其他临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日