

交银施罗德活期货币市场基金 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	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	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	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	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
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	41
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	41

7.9 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	45
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.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德活期货币市场基金	
基金简称	交银活期货币	
基金主代码	003042	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	130,601,697,068.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银活期货币 A	交银活期货币 E
下属分级基金的交易代码	003042	003043
报告期末下属分级基金的份额总额	130,442,838,403.97 份	158,858,664.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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		交银施罗德基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	邱珂磊
	联系电话	(021) 61055050	4008-888-108
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95587
传真		(021) 61055054	010-56162085
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）	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层 /18 层，北京市朝阳区光华

		路 10 号中信大厦 82 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	袁庆伟	刘成

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	交银施罗德基金管理有限公司	上海浦东新区世纪大道 8 号 国金中心二期 21-23 楼

§ 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)	
	交银活期货币 A	交银活期货币 E
本期已实现收 益	662,472,752.21	14,775,189.48
本期利润	662,472,752.21	14,775,189.48
本期净值收益 率	0.5071%	0.6261%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末基金资产 净值	130,442,838,403.97	158,858,664.97
期末基金份额 净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
累计净值收益 率	24.3119%	27.2974%

注：1、本基金申购赎回费为零。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、本基金实行销售服务费分类收费方式，分设各类份额。各类份额的管理费、托管费相同，按各类份额对应的销售服务费年费率计提销售服务费。

4、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，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。

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

交银活期货币 A

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	0.2495%	0.0002%	0.0873%	0.0000%	0.1622 %	0.0002 %
过去六个月	0.5071%	0.0002%	0.1736%	0.0000%	0.3335 %	0.0002 %
过去一年	1.0639%	0.0004%	0.3500%	0.0000%	0.7139 %	0.0004 %
过去三年	4.2473%	0.0012%	1.0510%	0.0000%	3.1963 %	0.0012 %
过去五年	8.1658%	0.0015%	1.7510%	0.0000%	6.4148 %	0.0015 %
过去七年	13.0462 %	0.0017%	2.4519%	0.0000%	10.594 3%	0.0017 %
自基金合同生效 起至今	24.3119 %	0.0026%	3.4770%	0.0000%	20.834 9%	0.0026 %

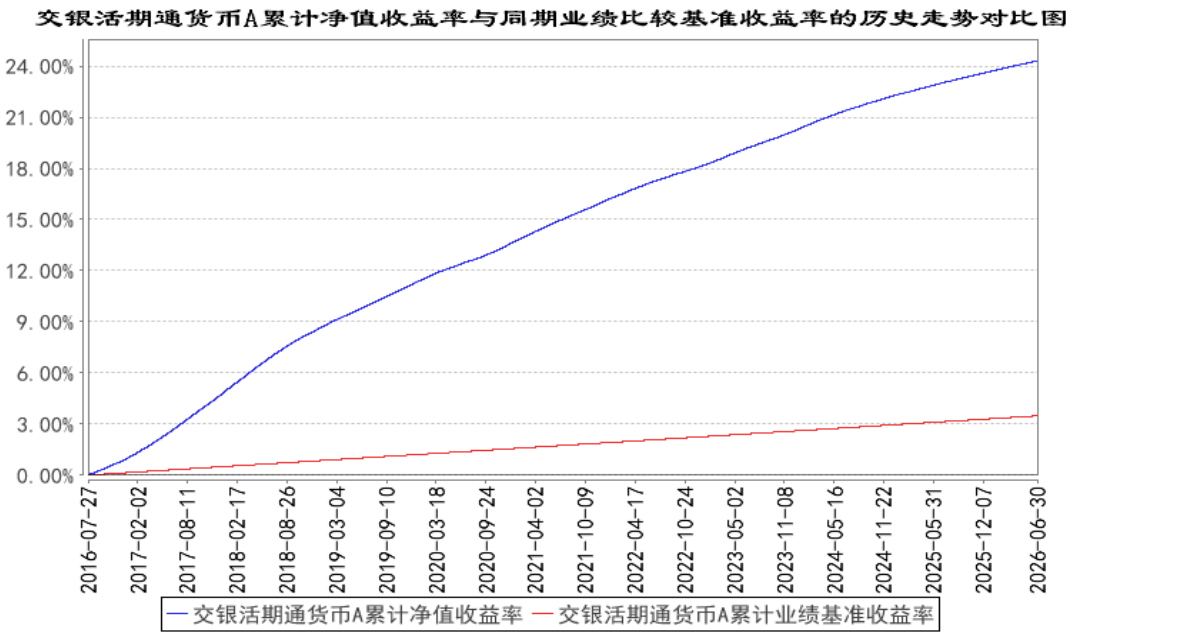
交银活期货币 E

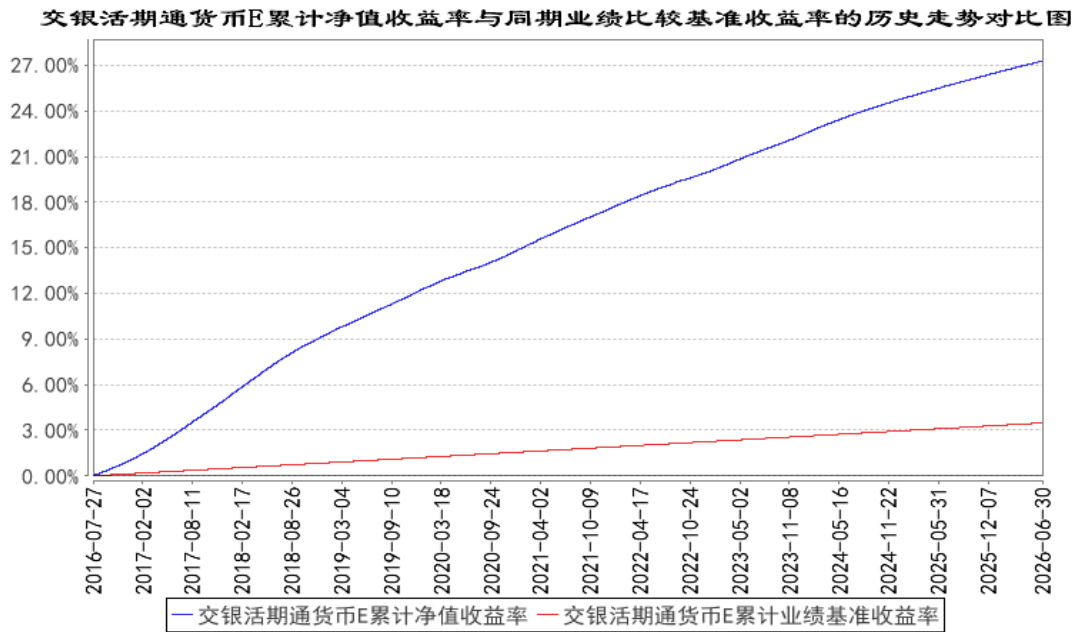
阶段	份额净值 收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.3089%	0.0002%	0.0873%	0.0000%	0.2216 %	0.0002 %

过去六个月	0.6261%	0.0002%	0.1736%	0.0000%	0.4525%	0.0002%
过去一年	1.3057%	0.0004%	0.3500%	0.0000%	0.9557%	0.0004%
过去三年	4.9990%	0.0012%	1.0510%	0.0000%	3.9480%	0.0012%
过去五年	9.4693%	0.0015%	1.7510%	0.0000%	7.7183%	0.0015%
过去七年	14.9594%	0.0017%	2.4519%	0.0000%	12.5075%	0.0017%
自基金合同生效起至今	27.2974%	0.0026%	3.4770%	0.0000%	23.8204%	0.0026%

注： 1、本基金收益分配按日结转份额。
2、本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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





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	2016 年 7 月 27 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。
侯嘉	基金经理	2024 年	-	15 年	学士。历任申银万国证券股份有限公司财

仪	助理	11 月 12 日			富管理中心投资顾问助理。2013 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任中央交易室助理交易员/交易员/高级交易员。
---	----	-----------	--	--	---

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下行，中短端利率下行幅度大于长端，利率曲线陡峭化，信用债表现好于利率债，信用利差压缩。具体来看，1月初，受股市行情、供给担忧扰动，债市情绪承压，10年国债收益率一度上行至1.90%附近。中旬，交易所通知上调两融保证金比例降温股市过热情绪，叠加央行结构性降息落地，长债超跌反弹开启修复行情。2月末至3月初，美伊冲突引发避险情绪，10年国债收益率下行至1.78%以下。3月，受海外地缘政治和通胀预期反复、股市波动并引发“固收+”赎回担忧升温、经济基本面数据向好等因素影响，债市情绪有所压制，10年国债收益率回升至1.82%左右，同时，短端利率在资金面呵护下持续走低，期限利差显著走阔。4月至5月，美伊冲突缓和，经济基本面边际转弱，流动性持续宽松，债市全面走强，10年国债收益率短暂下行突破1.70%。6月中上旬，央行连续回笼资金，市场对资金面预期面临再校准，债市利率上行。6月末，央行加码维稳资金面，并快速启用隔夜逆回购工具平抑跨季波动，市场消除货币政策收紧的担忧，利率修复。截至6月30日，一年国债较上年末下行22BP至1.12%，十年国债下行11BP至1.73%。同业存单方面，一年期AAA同业存单收益率较上年末下行16BP至1.47%。信用债以一、三、五年AA+中短期票据收益为例，较上年末分别下行23BP、31BP、32BP至1.53%、1.68%、1.85%。

基金操作方面，一季度资金面整体保持均衡偏宽松态势，我们视组合流动性和市场情况，新年伊始，即持续匀速地配置了较长期限高评级的同业存单及同业存款等。3月中上旬开始，同业存款监管加强的预期驱动下，存单、存款等短端资产利率开启快速下行通道，并触及近年低位区间，我们判断短期内进一步下行空间或相对有限，配置了中短久期高评级同业存单、逆回购等，等待后续配置机会再做调整。二季度流动性前宽松后收敛，在资金偏松时期，我们持续均衡配置了同业存单及同业存款，随着半年末临近，资金面收敛带动中短端资产利率上行，我们适度增加杠杆加大对同业存单及同业存款的配置力度，并小仓位配置了部分收益较存款存单有一定优势的高等级信用债。

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，我们认为债市或将受国内经济、融资需求、流动性、资产比价等多重因

素共振影响。基本面方面，稳增长政策效应将持续释放，新动能不断壮大、出口延续高景气，但地产仍处于寻底区间，消费修复偏慢，内生动力或难现大幅反弹，经济延续 K 型分化。通胀方面，美以伊冲突反复，威胁全球供应链稳定，通胀压力仍存。能繁母猪存栏已开始去化，猪价有望触底企稳，但居民消费和加杠杆意愿维持低位，预计 CPI 维持平稳，国内通胀环境较为温和，对货币政策的扰动有限。流动性方面，随着利率走廊机制精细化落地，资金面预计将从前期超季节宽松转向均衡，在缴税、政府债发行高峰等时点或出现阶段性波动或有所抬升。政策方面，三季度政策将继续发力，超长期特别国债、地方专项债发行或将提速，四季度，随着政府债供应压力释放完毕，债市供需格局或将再次改善。综上，对于债券市场，我们预计债市或延续震荡态势。我们将根据不同资产收益率的动态变化，适时调整组合结构。同时，根据期限利差、流动性预期动态调整组合久期和杠杆率，并通过对市场利率的前瞻性判断进行合理有效的剩余期限管理，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、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

遵照法律法规及基金合同的约定，本基金每日分配收益，按日结转份额。本基金本报告期内利润分配情况参见 6.4.7.12。

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

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

在本报告期内，本基金托管人在托管交银施罗德活期通货币市场基金过程中，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和基金合同的有关规定，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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：交银施罗德活期通货币市场基金

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	59,564,662,055.99	53,095,870,179.08
结算备付金		2,994,839.62	73,671,370.09
存出保证金		36,747.37	16,914.60
交易性金融资产	6.4.7.2	61,941,646,043.16	75,012,029,534.42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		61,941,646,043.16	75,012,029,534.42
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	6,741,203,389.04	14,660,098,513.34

应收清算款		6,310,727,356.44	149,678,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	8,043,916.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		134,561,270,431.62	142,999,408,428.48
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		3,890,024,766.99	13,941,801,634.64
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,949,967.01	34,279,095.49
应付托管费		5,491,661.16	5,713,182.57
应付销售服务费		26,766,960.30	28,524,749.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		102,814.78	540,756.84
应付利润		3,324,742.41	3,661,870.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	912,450.03	701,868.78
负债合计		3,959,573,362.68	14,015,223,158.33
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	130,601,697,068.94	128,984,185,270.15
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		130,601,697,068.94	128,984,185,270.15
负债和净资产总计		134,561,270,431.62	142,999,408,428.48

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 130,601,697,068.94 份，其中交银活期通货币 A 基金份额总额 130,442,838,403.97 份，基金份额净值 1.0000 元；交银活期通货币 E 基金份额总额 158,858,664.97 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德活期通货币市场基金

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		1,161,613,754.63	961,161,382.89
1. 利息收入		655,136,565.42	469,417,347.80

其中：存款利息收入	6.4.7.13	632,389,442.29	307,300,734.71
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		22,747,123.13	162,116,613.09
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		506,477,189.21	491,744,035.09
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	506,477,189.21	491,744,035.09
资产支持证券投资	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	-	-
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	-	-
减：二、营业总支出		484,365,812.94	320,142,678.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	198,437,777.10	160,485,491.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,072,962.89	26,747,581.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	162,513,741.24	130,550,972.41
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		89,936,043.13	1,416,497.05
其中：卖出回购金融资产支出		89,936,043.13	1,416,497.05
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		148,599.59	731,220.91
8. 其他费用	6.4.7.23	256,688.99	210,914.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		677,247,941.69	641,018,704.11
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		677,247,941.69	641,018,704.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		677,247,941.69	641,018,704.11

6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德活期货币市场基金

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	128,984,185,27 0.15	-	-	128,984,185,270 .15
二、本期期初净资产	128,984,185,27 0.15	-	-	128,984,185,270 .15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,617,511,798. 79	-	-	1,617,511,798.7 9
（一）、综合收益总额	-	-	677,247,941.69	677,247,941.69
（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）	1,617,511,798. 79	-	-	1,617,511,798.7 9
其中：1. 基金申购款	1,150,293,225, 151.84	-	-	1,150,293,225,1 51.84
2. 基金赎回款	- 1,148,675,713, 353.05	-	-	- 1,148,675,713,3 53.05
（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）	-	-	677,247,941.69	-677,247,941.69
四、本期期末净资产	130,601,697,06	-	-	130,601,697,068

资产	8.94			.94
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	128,209,871,94 1.88	-	-	128,209,871,941 .88
二、本期期初净资产	128,209,871,94 1.88	-	-	128,209,871,941 .88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 23,105,867,734 .21	-	-	- 23,105,867,734. 21
(一)、综合收益总额	-	-	641,018,704.11	641,018,704.11
(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)	- 23,105,867,734 .21	-	-	- 23,105,867,734. 21
其中：1. 基金申购款	899,499,336,39 9.61	-	-	899,499,336,399 .61
2. 基金赎回款	- 922,605,204,13 3.82	-	-	- 922,605,204,133 .82
(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)	-	-	- 641,018,704.11	-641,018,704.11
四、本期期末净资产	105,104,004,20 7.67	-	-	105,104,004,207 .67

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

交银施罗德活期通货币市场基金（以下简称“本基金”）系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[2016]1570号《关于准予交银施罗德活期通货币市场基金注册的批复》的准许，由基金管理人交银施罗德基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年7月27日生效，首次设立募集规模为210,080,375.35份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《交银施罗德活期通货币市场基金基金合同》和《交银施罗德活期通货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金根据投资者认（申）购的金额等级，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额等级。本基金A类、E类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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

6.4.6.1 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、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》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	9,056,147,972.98
等于：本金	9,043,925,834.10
加：应计利息	12,222,138.88
减：坏账准备	-
定期存款	50,508,514,083.01
等于：本金	50,350,000,000.00
加：应计利息	158,514,083.01
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	2,000,602,777.77
存款期限 1-3 个月	7,504,473,055.82
存款期限 3 个月以上	41,003,438,249.42
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	59,564,662,055.99

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			
		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	153,615,646.18	153,160,931.50	-454,714.68	-0.0003
	银行间市场	61,788,030,396.98	61,806,943,821.89	18,913,424.91	0.0145
	合计	61,941,646,043.16	61,960,104,753.39	18,458,710.23	0.0141
资产支持证券		-	-	-	-
合计		61,941,646,043.16	61,960,104,753.39	18,458,710.23	0.0141

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	6,741,203,389.04	-
合计	6,741,203,389.04	-

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	794,054.09
其中：交易所市场	-
银行间市场	794,054.09
应付利息	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	912,450.03

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银活期货币 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	128,815,770,848.04	128,815,770,848.04
本期申购	1,144,483,211,674.51	1,144,483,211,674.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,142,856,144,118.58	-1,142,856,144,118.58
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	130,442,838,403.97	130,442,838,403.97

交银活期货币 E

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	168,414,422.11	168,414,422.11
本期申购	5,810,013,477.33	5,810,013,477.33
本期赎回（以“-”号填列）	-5,819,569,234.47	-5,819,569,234.47
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	158,858,664.97	158,858,664.97

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

交银活期货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	662,472,752.21	-	662,472,752.21
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	-662,472,752.21	-	-662,472,752.21
本期末	-	-	-

交银活期货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	14,775,189.48	-	14,775,189.48
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	-14,775,189.48	-	-14,775,189.48
本期末	-	-	-

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	180,067,341.47
定期存款利息收入	452,054,072.51
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	78,209.27
其他	189,819.04
合计	632,389,442.29

6.4.7.14 股票投资收益

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	486,707,877.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,769,312.19
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	506,477,189.21

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	71,667,492,883.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	71,437,624,791.04
减：应计利息总额	210,098,780.73
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	19,769,312.19

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

无。

6.4.7.21 其他收入

无。

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	132,418.05
债券账户费用	18,600.00
其他	-3,425.00
合计	256,688.99

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	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	198,437,777.10	160,485,491.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,912,229.72	72,586,321.17
应支付基金管理人的净管理费	105,525,547.38	87,899,170.63

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	33,072,962.89	26,747,581.94

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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		
	交银活期货币 A	交银活期货币 E	合计
交通银行股份有限公司	17,245.08	2,436.83	19,681.91
交银施罗德基金管理有限公司	9,317,788.89	1,190.66	9,318,979.55
合计	9,335,033.97	3,627.49	9,338,661.46
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	交银活期货币 A	交银活期货币 E	合计
交通银行股份有限公司	19,877.44	710.89	20,588.33
交银施罗德基金管理有限公司	10,112,047.36	73,936.27	10,185,983.63
中信建投股份有限公司	82.20	-	82.20
合计	10,132,007.00	74,647.16	10,206,654.16

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：

交银活期货币 A 类份额日基金销售服务费=前一日交银活期货币 A 类基金份额对应的资产净值×0.25%÷当年天数；

交银活期货币 E 类份额日基金销售服务费=前一日交银活期货币 E 类基金份额对应的资产净值×0.01%÷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 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

份额单位：份

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	交银活期货币 A	交银活期货币 E
基金合同生效日（ 2016 年 7 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	交银活期货币 A	交银活期货币 E
基金合同生效日（ 2016 年 7 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	2, 005, 419. 84
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	2, 005, 419. 84
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0. 00%

注：1、如果本报告期间发生转换入、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业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

无。

6. 4. 10. 5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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
交通银行_活期存款	29,223.82	2,683,744.60	411,038.33	523,141.26

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

单位：人民币元

交银活期货币 A				
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
662,809,076.65	-	-336,324.44	662,472,752.21	-
交银活期货币 E				
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
14,775,993.12	-	-803.64	14,775,189.48	-

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 3,890,024,766.99 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
09250402	25 农发清发 02	2026 年 7 月 1 日	100.57	1,000,000	100,569,607.89
09250409	25 农发清发 09	2026 年 7 月 1 日	99.88	4,200,000	419,495,850.27
112502263	25 工商银行 CD263	2026 年 7 月 1 日	99.61	1,000,000	99,612,778.77

112504058	25 中国银行 CD058	2026 年 7 月 1 日	99.75	3,000,000	299,252,222.28
112504061	25 中国银行 CD061	2026 年 7 月 1 日	99.65	3,000,000	298,961,122.83
112504063	25 中国银行 CD063	2026 年 7 月 1 日	99.64	979,000	97,547,621.46
112515192	25 民生银行 CD192	2026 年 7 月 1 日	99.84	3,000,000	299,508,651.82
112604010	26 中国银行 CD010	2026 年 7 月 1 日	98.71	3,000,000	296,132,277.49
160213	16 国开 13	2026 年 7 月 1 日	102.83	100,000	10,283,038.68
190209	19 国开 09	2026 年 7 月 1 日	103.31	800,000	82,647,961.92
210408	21 农发 08	2026 年 7 月 1 日	102.81	2,000,000	205,620,025.34
230207	23 国开 07	2026 年 7 月 1 日	102.23	800,000	81,782,655.13
230409	23 农发 09	2026 年 7 月 1 日	100.35	2,500,000	250,876,854.69
240204	24 国开 04	2026 年 7 月 1 日	101.38	500,000	50,691,145.59
240214	24 国开 14	2026 年 7 月 1 日	100.57	1,740,000	174,983,244.90
240217	24 国开 17	2026 年 7 月 1 日	99.29	600,000	59,574,616.74
240303	24 进出 03	2026 年 7 月 1 日	100.90	1,500,000	151,348,271.78
240312	24 进出 12	2026 年 7 月 1 日	101.26	800,000	81,006,914.49
250409	25 农发 09	2026 年 7 月 1 日	100.05	4,400,000	440,233,736.36
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.22	5,700,000	576,933,032.78
合计				40,619,000	4,077,061,631.21

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

本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。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，力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益，谋求基金资产的长期稳定增长。

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同责任，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。本基金的银行存款通过本基金的托管人存放在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；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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不得投资于信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且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的净资产的 10%。

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	270,595,396.92	4,610,303,262.17
合计	270,595,396.92	4,610,303,262.17

注：未评级部分包含国债、政策性金融债或短期融资券。

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

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	57,058,328,567.79	60,404,446,140.53
合计	57,058,328,567.79	60,404,446,140.53

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	1,839,196,260.10	3,615,615,365.15
AAA 以下	-	-
未评级	2,773,525,818.35	6,381,664,766.57
合计	4,612,722,078.45	9,997,280,131.72

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。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基金资产净值的 20%。

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同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》、《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基金资产净值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；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基金资产净值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 10%。

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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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 2026 年 6 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	18,092,688,807.24	14,436,057,583.99	27,035,915,664.76	-	-	-	59,564,662,055.99
结算备付金	2,994,839.62	-	-	-	-	-	2,994,839.62
存出保证金	36,747.37	-	-	-	-	-	36,747.37
交易性金融资产	3,460,675,839.42	15,235,970,218.97	43,244,999,984.77	-	-	-	61,941,646,043.16
买入返售金融资产	6,741,203,389.04	-	-	-	-	-	6,741,203,389.04
应收清算款	-	-	-	-	-	6,310,727,356.44	6,310,727,356.44

资产总计	28,297,599,622.69	29,672,027,802.96	70,280,915,649.53	-	-	6,310,727,356.44	134,561,270,431.62
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,949,967.01	32,949,967.01
应付托管费	-	-	-	-	-	5,491,661.16	5,491,661.16
卖出回购金融资产款	3,890,024,766.99	-	-	-	-	-	3,890,024,766.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,766,960.30	26,766,960.30
应付利润	-	-	-	-	-	3,324,742.41	3,324,742.41
应交税费	-	-	-	-	-	102,814.78	102,814.78
其他负债	-	-	-	-	-	912,450.03	912,450.03
负债总计	3,890,024,766.99	-	-	-	-	69,548,595.69	3,959,573,362.68
利率敏感度缺口	24,407,574,855.70	29,672,027,802.96	70,280,915,649.53	-	-	6,241,178,760.75	130,601,697,068.94
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	7,913,443,108.42	12,436,009,237.06	32,746,417,833.60	-	-	-	53,095,870,179.08
结算备付金	73,671,370.09	-	-	-	-	-	73,671,370.09
存出保证金	16,914.60	-	-	-	-	-	16,914.60
交易性金融资产	6,964,027,023.35	23,648,044,032.02	44,399,958,479.05	-	-	-	75,012,029,534.42
买入返售金融资产	14,660,098,513.34	-	-	-	-	-	14,660,098,513.34
应收申购款	-	-	-	-	-	8,043,916.95	8,043,916.95
应收清算款	-	-	-	-	-	149,678,000.00	149,678,000.00
资产总计	29,611,256,929.80	36,084,053,269.08	77,146,376,312.65	-	-	157,721,916.95	142,999,408,428.48
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,279,095.49	34,279,095.49
应付托管费	-	-	-	-	-	5,713,182.57	5,713,182.57
卖出回购金融	13,941,801,6	-	-	-	-	-	13,941,801,6

资产款	34.64						34.64
应付销售服务费						28,524,749.52	28,524,749.52
应付利润						3,661,870.49	3,661,870.49
应交税费						540,756.84	540,756.84
其他负债						701,868.78	701,868.78
负债总计	13,941,801.634.64					73,421,523.69	14,015,223.158.33
利率敏感度缺口	15,669,455.295.16	36,084,053.269.08	77,146,376.312.65			84,300,393.26	128,984,185,270.15

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	-73,947,132.80	-77,850,198.73
	市场利率下降 25 个基点	74,192,931.52	78,085,267.39

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。

6.4.13.4.3.1 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	61,941,646,043.16	75,012,029,534.42
第三层次	-	-
合计	61,941,646,043.16	75,012,029,534.42

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。 本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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	固定收益投资	61,941,646,043.16	46.03
	其中：债券	61,941,646,043.16	46.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,741,203,389.04	5.01
	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	59,567,656,895.61	44.27
4	其他各项资产	6,310,764,103.81	4.69
5	合计	134,561,270,431.62	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.84	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的 比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,890,024,766.99	2.98
	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银行间市场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

本基金本报告期内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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

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	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	26.11	2.98
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.42	-
3	60 天（含）—90 天	9.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.05	-
4	90 天（含）—120 天	2.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	52.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		102.86	2.98

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

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	4,367,388,480.24	3.34
	其中：政策性金融债	2,692,080,861.56	2.06
4	企业债券	51,080,572.63	0.04
5	企业短期融资券	270,595,396.92	0.21
6	中期票据	194,253,025.58	0.15
7	同业存单	57,058,328,567.79	43.69
8	其他	-	-
9	合计	61,941,646,043.16	47.43
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	609,894,087.29	0.47

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112515323	25 民生银行 CD323	10,000,000	993,648,385.98	0.76
2	112696634	26 长沙银行 CD104	6,000,000	596,329,373.05	0.46
3	112614091	26 江苏银行 CD091	6,000,000	592,197,421.61	0.45
4	250431	25 农发 31	5,700,000	576,933,032.78	0.44
5	112585191	25 深圳农商 银行 CD092	5,000,000	499,006,570.23	0.38
6	112519346	25 恒丰银行 CD346	5,000,000	498,909,631.58	0.38
7	112697042	26 长沙银行 CD110	5,000,000	498,486,335.91	0.38
8	112694942	26 宁波银行 CD128	5,000,000	497,741,970.94	0.38
9	112603085	26 农业银行 CD085	5,000,000	497,679,465.94	0.38
10	112603108	26 农业银行 CD108	5,000,000	497,293,475.21	0.38

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	0.0370%
报告期内偏离度的最低值	0.0074%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0223%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

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

无。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

7.9.2 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：

2025 年 12 月 31 日，国家金融监督管理总局宁波监管局公示行政处罚决定书，给予中国民生银行股份有限公司 220 万元人民币的行政处罚。

2025 年 12 月 31 日，央行深圳市分行公示深人银罚[2025]80 号行政处罚决定书，给予深圳农村商业银行股份有限公司 1284.4 万元人民币的行政处罚。

2025 年 11 月 25 日，央行宁波市分行公示甬银罚决字[2025]18 号行政处罚决定书，给予宁波银行股份有限公司 98.8 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，给予中国民生银行股份有限公司 5865 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，给予中国农业银行股份有限公司罚没共计 2720 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，给予中国民生银行股份有限公司 590 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，给予恒丰银行股份有限公司 6150 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。

7.9.3 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	36,747.37
2	应收清算款	6,310,727,356.44
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	6,310,764,103.81

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

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 (%)
交银活 期通货 币 A	19,029,278	6,854.85	2,217,528.25	0.00	130,440,620,875.72	100.00
交银活 期通货 币 E	12,726	12,483.00	64,742,690.05	40.75	94,115,974.92	59.25
合计	19,042,004	6,858.61	66,960,218.30	0.05	130,534,736,850.64	99.95

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	保险类机构	41,225,075.32	0.03
2	个人	14,077,434.70	0.01
3	其他机构	11,066,309.59	0.01
4	个人	10,191,443.98	0.01
5	个人	9,507,568.27	0.01
6	个人	9,302,731.36	0.01
7	个人	8,801,049.57	0.01
8	个人	8,530,775.68	0.01
9	个人	8,290,231.90	0.01
10	个人	8,081,973.30	0.01

8.3 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	交银活期货币 A	1,305,215.95	0.00
	交银活期货币 E	26,364.82	0.02
	合计	1,331,580.77	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	交银活期货币 A	0~10
	交银活期货币 E	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	交银活期货币 A	—
	交银活期货币 E	—
	合计	—

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银活期货币 A	交银活期货币 E
基金合同生效日（2016 年 7 月 27 日）基金份额总额	70,925.35	210,009,450.00
本报告期期初基金份额总额	128,815,770,848.04	168,414,422.11
本报告期基金总申购份额	1,144,483,211,674.51	5,810,013,477.33
减：本报告期基金总赎回份额	1,142,856,144,118.58	5,819,569,234.47
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	130,442,838,403.97	158,858,664.97

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：自 2026 年 1 月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

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，本基金聘请安永华明会计师事务所（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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
国泰海通 证券	2	—	—	—	—	—

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 (%)
国泰海 通证券	360,744,90 0.00	100.00	24,022,381,0 00.00	100.00	—	—

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 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

10.9 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	交银施罗德活期通货币市场基金 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	交银施罗德活期通货币市场基金 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	交银施罗德活期通货币市场基金 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	交银施罗德活期通货币市场基金（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
6	交银施罗德活期通货币市场基金（E 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	交银施罗德活期通货币市场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

8	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
无。

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活期货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德活期货币市场基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德活期货币市场基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德活期货币市场基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德活期货币市场基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德活期货币市场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。