

交银施罗德天利宝货币市场基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 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.....	12
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.....	13
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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 债券回购融资情况.....	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按实际利率计算账面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.....	48
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.....	48
7.8 期末按实际利率计算的账面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.....	49
7.9 投资组合报告附注.....	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§ 9 开放式基金份额变动.....	52
§ 10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
10.9 其他重大事件.....	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德天利宝货币市场基金	
基金简称	交银天利宝货币	
基金主代码	002889	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 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	7,160,809,586.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E
下属分级基金的交 易代码	002889	002890
报告期末下属分级 基金的份额总额	3,492,933,964.29 份	3,667,875,621.84 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	王晚婷
	联系电话	(021) 61055050
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.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 21-22 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	阮红	朱鹤新
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告备置地点	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 21-22 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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E
本期已实现收益	35,307,179.30	30,396,242.01
本期利润	35,307,179.30	30,396,242.01
本期净值收益率	1.0850%	1.2053%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	期末基金资产净值	3,492,933,964.29
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(2022 年 6 月 30 日)	
	累计净值收益率	18.2055%

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，分设两类基金份额：A 类基金份额和 E 类基金份额。

A 类基金份额与 E 类基金份额的管理费、托管费相同，A 类基金份额按照 0.25% 的年费率计提销售服务费，E 类基金份额按照 0.01% 的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时，A 类基金份

额与分类前基金连续计算，E 类基金份额按新设基金计算；

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

交银天利宝货币 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
过去一个月	0.1604%	0.0009%	0.0288%	0.0000%	0.1316%	0.0009%
过去三个月	0.5189%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.4316%	0.0006%
过去六个月	1.0850%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.9114%	0.0006%
过去一年	2.3015%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.9515%	0.0009%
过去三年	7.3056%	0.0015%	1.0510%	0.0000%	6.2546%	0.0015%
自基金合同生效起至今	18.2055%	0.0030%	1.9955%	0.0000%	16.2100%	0.0030%

交银天利宝货币 E

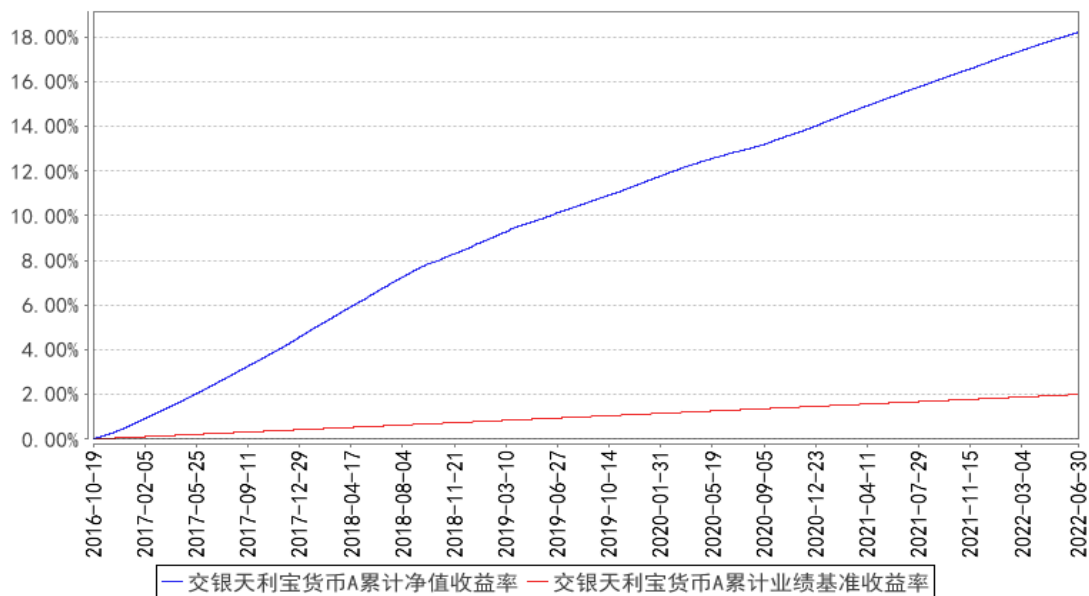
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1801%	0.0009%	0.0288%	0.0000%	0.1513%	0.0009%

过去三个月	0.5790%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.4917%	0.0006%
过去六个月	1.2053%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.0317%	0.0006%
过去一年	2.5471%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	2.1971%	0.0009%
过去三年	8.0793%	0.0015%	1.0510%	0.0000%	7.0283%	0.0015%
自基金合同生效起至今	19.8238%	0.0030%	1.9955%	0.0000%	17.8283%	0.0030%

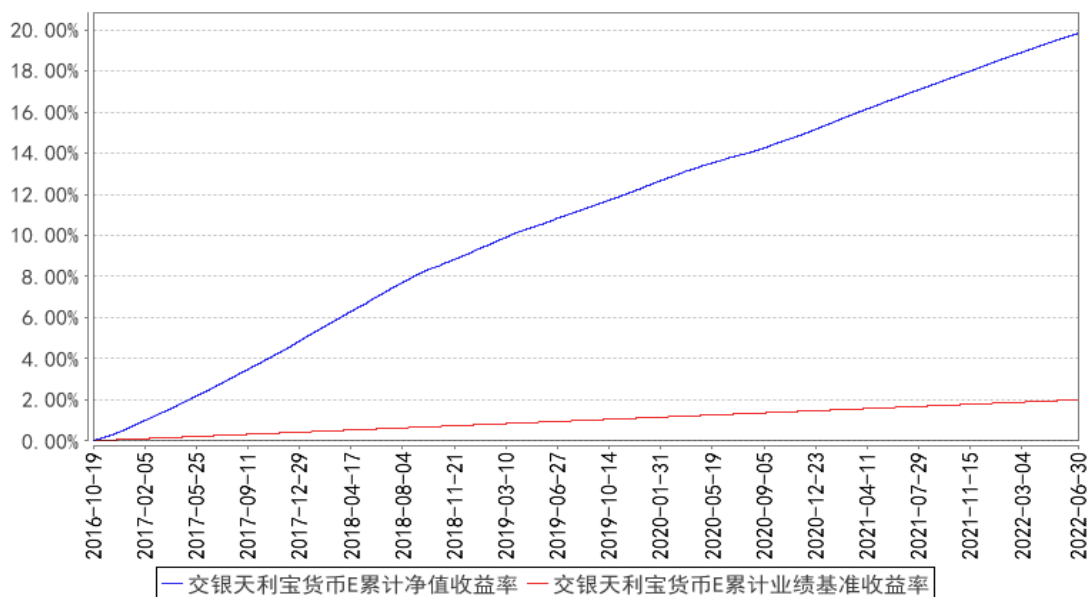
注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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

交银天利宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银天利宝货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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（香港）有限公司和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 112 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	交银丰享收益债券、交银活期通货	2016 年 10 月 19 日	-	14 年	黄莹洁女士，香港大学工商管理硕士、北京大学经济学、管理学双学士。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

	币、交银天利宝货币、交银裕隆纯债债券、交银天益宝货币、交银境尚收益债券、交银稳鑫短债债券、交银稳利中短债债券、交银中高等级信用债债券的基金经理				交易室交易员。2015 年 7 月 25 日至 2018 年 3 月 18 日担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月 27 日至 2019 年 8 月 2 日担任交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德现金宝货币市场基金的基金经理。2016 年 12 月 7 日至 2019 年 8 月 2 日担任交银施罗德天鑫宝货币市场基金的基金经理。2015 年 12 月 29 日至 2019 年 10 月 23 日担任交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月 27 日至 2020 年 7 月 27 日担任转型前的交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

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

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，债券短端得益于宽松的流动性环境，收益下行明显，长端则整体呈震荡格局，期限利差明显走阔。一月中旬央行宣布降息 10bp，随后进一步释放宽松信号，在信贷偏弱的悲观预期下，长端收益率震荡下行 10bp。春节期间国内消费数据表现疲弱，但海外再通胀交易升温，节后受到海外流动性收紧、金融数据开门红大超预期，以及部分城市地产政策松绑的影响，债市连续调整并回吐前期涨幅。进入三月，受俄乌局势紧张，股票市场大幅调整加剧理财赎回压力，债券亦受到波及，十年国债收益率最高上行至 2.85% 附近。此后虽然面临开年经济数据表现亮眼、美联储加息落地，以及中美利差持续收窄，但在国内疫情扩散和政策呵护预期下，长端收益率基本维持区间震荡格局。四月、五月受到国内疫情冲击的影响，国常会提出要加大货币政策实施力度，市场下修二季度经济增速预期，债市情绪高涨驱动长端十年期国债利率下行至低点 2.7%。之后随着上海宣布全面复工复产，收益率快速调整并回吐前期涨幅，此后债市面临美联储加息、中美利率曲线全面倒挂，以及国内股市反弹等利空因素，但在国内经济弱复苏和资金面宽松下，长端收益率基本维持震荡格局。截止 2022 年 6 月 30 日，一年国债较去年底下行 29bp 至 1.95%，十年国债则小幅上行 4bp 至 2.82%。

基金操作方面，各季度初由于资金面宽松、货币市场工具收益率大幅下行，组合操作以适当降低杠杆，配置短期逆回购为主。进入季末时点，短端资产利率有所回升，我们认为货币市场工具收益性价比提高，具备了较好的配置价值，我们视组合流动性和市场情况，增配了高评级的同业存单、同业存款等，适当增加了组合的久期，提高了组合静态收益，同时视资金利率和资产收

益的利差情况适当运用杠杆以增厚组合收益。

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 2022 年下半年，国内基本面回暖和流动性的边际变化将成为影响债市的主要因素。经济在疫情扰动后有望步入复苏阶段，伴随猪价企稳上行，叠加海外大宗商品供需格局偏紧，国内通胀压力将有所抬升。政策方面，货币政策更注重重信用发力，财政政策延续加力提效保市场主体，在专项债发行接近尾声后，下半年财政或仍有增量加码政策。流动性预计保持合理充裕。近期债券市场走出新一波的上涨行情，从绝对收益相对利差性角度看，性价比都在逐渐降低，我们认为收益率继续突破向下的空间有限，但在流动性宽松的支持下，调整空间有限，后续或继续呈现震荡格局。本基金仍将适当增加逆回购配置，小幅降低组合的剩余期限，后续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，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会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其适用性的情况后，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。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。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，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

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 6.4.7.10。

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，对交银施罗德天利宝货币市场基金 2022 年上半年的投资运作，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天利宝货币市场基金的投资运作、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 2022 年中期报告中的财务指标、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：交银施罗德天利宝货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	2,572,093,820.56	1,790,707,426.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,192,965,090.07	3,012,610,823.86
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,902,792,976.59	2,807,698,023.86
资产支持证券投资		290,172,113.48	204,912,800.00
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	1,510,399,090.00	345,000,757.50
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,187,151.60	1,216,957.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	8,700,820.71
资产总计		8,289,645,152.23	5,158,236,785.96
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		1,126,239,714.99	656,139,071.93
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		897,770.70	593,690.34
应付托管费		299,256.86	197,896.80
应付销售服务费		742,588.54	632,984.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		158,334.93	101,933.16
应付利润		286,636.41	309,045.41
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	211,263.67	311,890.50
负债合计		1,128,835,566.10	658,286,512.49
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	7,160,809,586.13	4,499,950,273.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		7,160,809,586.13	4,499,950,273.47
负债和净资产总计		8,289,645,152.23	5,158,236,785.96

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 7,160,809,586.13 份，其中交银天利宝货币 A 基金份额总额 3,492,933,964.29 份，基金份额净值 1.0000 元。交银天利宝货币 E 基金份额总额 3,667,875,621.84 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德天利宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		83,197,588.04	56,215,133.99
1. 利息收入		38,413,864.69	55,812,957.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,539,616.00	21,169,177.65
债券利息收入		-	26,278,845.43
资产支持证券利息收入		-	1,394,717.61
买入返售金融资产收入		6,874,248.69	6,970,216.90
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,783,723.35	402,176.40
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	41,806,862.74	402,176.40
资产支持证券投资	6.4.7.16	2,976,860.61	-
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		17,494,166.73	10,449,235.41
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	4,345,727.82	2,599,723.88
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1,448,575.86	866,574.65
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	4,189,685.72	2,942,995.04
4. 投资顾问费	6. 4. 10. 2. 1. 1	-	-
5. 利息支出		7,292,396.83	3,879,766.04
其中：卖出回购金融资产支出		7,292,396.83	3,879,766.04
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		57,957.85	36,752.98
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	159,822.65	123,422.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,703,421.31	45,765,898.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,703,421.31	45,765,898.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		65,703,421.31	45,765,898.58

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德天利宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	4,499,950,273.47	-	-	4,499,950,273.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金	4,499,950,273.47	-	-	4,499,950,273.47

净值)				
三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	2,660,859,312.66	-	-	2,660,859,312.66
（一）、综 合收益总 额	-	-	65,703,421.31	65,703,421.31
（二）、本 期基金份 额交易产 生的基金 净值变动 数 （净值减 少以“-” 号填列）	2,660,859,312.66	-	-	2,660,859,312.66
其中：1. 基金申购 款	9,626,780,616.03	-	-	9,626,780,616.03
2. 基金赎回 款	- 6,965,921,303.37	-	-	-6,965,921,303.37
（三）、本 期向基金 份额持有 人分配利 润产生的 基金净值 变动（净 值减少以 “-”号填 列）	-	-	-65,703,421.31	-65,703,421.31
（四）、其 他综合收 益结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产（基金 净值）	7,160,809,586.13	-	-	7,160,809,586.13
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	2,581,446,913.12	-	-	2,581,446,913.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,581,446,913.12	-	-	2,581,446,913.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,159,914,312.23	-	-	1,159,914,312.23
（一）、综合收益总额	-	-	45,765,898.58	45,765,898.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,159,914,312.23	-	-	1,159,914,312.23
其中：1. 基金申购款	7,757,566,707.47	-	-	7,757,566,707.47
2. 基金赎回款	- 6,597,652,395.24	-	-	-6,597,652,395.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-45,765,898.58	-45,765,898.58

“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,741,361,225.35	-	-	3,741,361,225.35

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：

<u>谢卫</u>	<u>谢卫</u>	<u>单江</u>
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

交银施罗德天利宝货币市场基金(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[2016]1106号《关于准予交银施罗德天利宝货币市场基金注册的批复》，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《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 500,013,273.00 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(2016)第 1270 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》于 2016 年 10 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,103,275.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 90,002.90 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《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》和《交银施罗德天利宝货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 E 类基金份额。销售服务费率为 0.25% 的基金份额，称为 A 类基金份额；销售服务费率为 0.01% 基金份额，称为 E 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率。投资者可自行选择认购的基金份额类别，除非基金管理人在未来另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》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)。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》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

本基金 2022 年上半年度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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策变更,详见 6.4.5.1;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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

1. 会计政策变更的性质、内容和原因
 - (a) 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

(2) 金融负债

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

(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每

日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 1,790,707,426.45 元、345,000,757.50 元、8,700,820.71 元和 1,216,957.44 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 1,795,321,677.09 元、345,116,894.62 元、0.00 元和 1,216,957.44 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,012,610,823.86 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,016,581,256.81 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、应付交易费用和应付利息，金额分别为 656,139,071.93 元、593,690.34 元、197,896.80 元、632,984.35 元、309,045.41 元、64,841.47 元和 47,749.03 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 656,186,820.96 元、593,690.34 元、197,896.80 元、632,984.35 元、309,045.41 元、64,841.47 元和 0.00 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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》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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	881,981.59
等于：本金	881,844.30
加：应计利息	137.29
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	2,571,211,838.97
等于：本金	2,560,000,000.00
加：应计利息	11,211,838.97
减：坏账准备	-
合计	2,572,093,820.56

注：本基金持有的其他存款，均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 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	-	-	-	-
	银行间市场	3,902,792,976.59	3,905,654,076.69	2,861,100.10	0.0400
	合计	3,902,792,976.59	3,905,654,076.69	2,861,100.10	0.0400
	资产支持证券	290,172,113.48	290,637,313.48	465,200.00	0.0065
	合计	4,192,965,090.07	4,196,291,390.17	3,326,300.10	0.0465

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 2022 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	1,510,399,090.00	-
合计	1,510,399,090.00	-

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 2022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	107,744.12
其中：交易所市场	-
银行间市场	107,744.12
应付利息	-
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	211,263.67

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银天利宝货币 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,978,731,801.30	2,978,731,801.30
本期申购	5,510,214,802.62	5,510,214,802.62
本期赎回（以“-”号填列）	-4,996,012,639.63	-4,996,012,639.63
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	3,492,933,964.29	3,492,933,964.29

交银天利宝货币 E

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,521,218,472.17	1,521,218,472.17

本期申购	4,116,565,813.41	4,116,565,813.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,969,908,663.74	-1,969,908,663.74
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	3,667,875,621.84	3,667,875,621.84

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

交银天利宝货币 A

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	35,307,179.30	-	35,307,179.30
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	-35,307,179.30	-	-35,307,179.30
本期末	-	-	-

交银天利宝货币 E

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	30,396,242.01	-	30,396,242.01
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	-30,396,242.01	-	-30,396,242.01
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	6,716.31
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	31,532,899.69
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	31,539,616.00

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	41,806,862.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	41,806,862.74

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,269,669,520.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,260,000,000.00
减：应计利息总额	9,669,520.55
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,976,860.61
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,976,860.61

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	35,139,890.01
减：卖出资产支持证券成本总额	33,995,000.00
减：应计利息总额	1,144,890.01
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	0.00

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	47,003.10
债券账户费用	18,600.00
合计	159,822.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
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
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,345,727.82	2,599,723.88
其中：支付销售机构的客户维护费	271,655.54	34,099.36

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,448,575.86	866,574.65

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E	合计
交通银行	78,075.24	4,583.51	82,658.75
交银施罗德基金公司	3,717,552.25	82,077.21	3,799,629.46

合计	3,795,627.49	86,660.72	3,882,288.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E	合计
交通银行	71,619.69	3,686.58	75,306.27
交银施罗德基金公司	2,603,938.65	43,597.02	2,647,535.67
合计	2,675,558.34	47,283.60	2,722,841.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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。A 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E
基金合同生效日（2016 年 10 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	145,255,595.88
报告期间申购/买入总份额	466,651.20	456,134,560.62
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	466,651.20	601,390,156.50
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	8.40%
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E
基金合同生效日（2016 年 10 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	583,603,765.06
报告期内申购/买入总份额	-	7,643,140.75
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	350,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	241,246,905.81
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.45%

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

份额单位：份

交银天利宝货币 E

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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 (%)
交银施罗德资产管理有 限公司	100,580,768.03	1.40	79,607,019.30	1.77

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	881,981.59	6,716.31	703,650.94	3,011.08

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

交银天利宝货币 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
35,377,075.20	-	-69,895.90	35,307,179.30	-
交银天利宝货币 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
30,348,755.11	-	47,486.90	30,396,242.01	-

6.4.12 期末(2022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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
183961	辰悦9A1	2022年6月13日	1个月内(含)	资产支持证券未上市	100.00	100.00	250,000	25,000,000.00	25,000,000.00	-
135313	惠津10A1	2022年6月16日	1-6个月(含)	资产支持证券未上市	100.00	100.00	360,000	36,000,000.00	36,000,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定。

2、受限期指自该证券实际取得之日起的流通受限期限。

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 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1126239714.99 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
012280143	22 厦国贸 SCP002	2022 年 7 月 1 日	101.08	500,000	50,542,189.28
012280550	22 厦国贸 SCP005	2022 年 7 月 1 日	100.76	12,000	1,209,165.55
012280598	22 建发 SCP003	2022 年 7 月 1 日	100.74	500,000	50,369,064.00
012281245	22 厦国贸 控 SCP003	2022 年 7 月 1 日	100.65	400,000	40,258,558.87
012281689	22 中建六 局 SCP003	2022 年 7 月 1 日	100.34	200,000	20,067,962.62
042280252	22 中航租 赁 CP002	2022 年 7 月 1 日	100.16	500,000	50,082,000.80
042280286	22 苏广播 CP001	2022 年 7 月 1 日	100.05	800,000	80,043,630.90
112215106	22 民生银 行 CD106	2022 年 7 月 1 日	99.44	1,000,000	99,441,416.13
112221094	22 渤海银 行 CD094	2022 年 7 月 1 日	99.43	2,000,000	198,851,554.75
112221224	22 渤海银 行 CD224	2022 年 7 月 1 日	99.04	1,000,000	99,035,333.24
112280718	22 台州银 行 CD010	2022 年 7 月 1 日	99.05	1,000,000	99,048,159.60
112291579	22 广西北 部湾银行 CD032	2022 年 7 月 1 日	99.82	748,000	74,662,478.70
170212	17 国开 12	2022 年 7 月 1 日	103.70	100,000	10,370,104.19
210216	21 国开 16	2022 年 7 月 1 日	101.54	1,689,000	171,502,427.03
210306	21 进出 06	2022 年 7 月 1 日	101.78	800,000	81,421,395.61
210308	21 进出 08	2022 年 7 月	101.25	700,000	70,876,047.44

		1 日			
229924	22 贴现国 债 24	2022 年 7 月 1 日	99.23	400,000	39,693,529.34
合计				12,349,000	1,237,475,018.05

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

本基金为货币市场基金，属于低风险合理稳定收益品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和债券基金。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审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，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审核及风险管理委员会为核心的，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。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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。本基金的活期银行

存款存放在本基金的托管人中信银行股份有限公司，协议存款存放在哈尔滨银行股份有限公司、桂林银行股份有限公司、澳门国际银行广州分行、江苏江南农村商业银行股份有限公司、郑州银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、天津银行股份有限公司、创兴银行有限公司、中信百信银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、吉林银行股份有限公司、南洋商业银行股份有限公司，因而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%。

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债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	90,183,971.64	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,169,014,639.48	529,643,875.70
合计	1,259,198,611.12	529,643,875.70

注：未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期融资券和企业超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	254,123,157.86	204,912,800.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	254,123,157.86	204,912,800.00

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,571,469,816.13	2,278,054,148.16
合计	2,571,469,816.13	2,278,054,148.16

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	61,754,445.15	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,370,104.19	-
合计	72,124,549.34	-

注：未评级部分为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	36,048,955.62	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	36,048,955.62	-

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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,126,239,714.99 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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(所有者权益)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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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 2022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							
银行存款	263,254,369.79	1,316,438,095.22	992,401,355.55	-	-	-	2,572,093,820.56
交易性金融资产	219,621,904.43	827,633,952.21	3,145,709,233.43	-	-	-	4,192,965,090.07
买入返售金融资产	1,510,399,090.00	-	-	-	-	-	1,510,399,090.00
应收申购款	-	-	-	-	-	14,187,151.60	14,187,151.60
资产总计	1,993,275,364.22	2,144,072,047.43	4,138,110,588.98	-	-	14,187,151.60	8,289,645,152.23
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	897,770.70	897,770.70
应付托管费	-	-	-	-	-	299,256.86	299,256.86
卖出回购金融资产款	1,126,239,714.99	-	-	-	-	-	1,126,239,714.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	742,588.54	742,588.54
应付利润	-	-	-	-	-	286,636.41	286,636.41
应交税费	-	-	-	-	-	158,334.93	158,334.93
其他负债	-	-	-	-	-	211,263.67	211,263.67
负债总计	1,126,239,714.99	-	-	-	-	2,595,851.11	1,128,835,566.10
利率敏感度缺口	867,035,649.23	2,144,072,047.43	4,138,110,588.98	-	-	11,591,300.49	7,160,809,586.13
上年度末 2021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							
银行存款	707,426,455	1,115,000,000.00	675,000,000.00	-	-	-	1,790,707,426.45
交易性金融资产	20,001,848.10	1,324,540,516.00	1,668,068,459.76	-	-	-	3,012,610,823.86
买入返售金融资产	345,000,757.50	-	-	-	-	-	345,000,757.50
应收申购款	-	-	-	-	-	1,216,957.44	1,216,957.44
其他资产	-	-	-	-	-	8,700,820.71	8,700,820.71
资产总计	365,710,032.05	2,439,540,516.00	2,343,068,459.76	-	-	9,917,778.15	5,158,236,785.96
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	593,690.34	593,690.34
应付托管费	-	-	-	-	-	197,896.80	197,896.80
卖出回购金融资产款	656,139,071.93	-	-	-	-	-	656,139,071.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	632,984.35	632,984.35
应付利润	-	-	-	-	-	309,045.	309,045.41

						41	
应交税费	-	-	-	-	-	101,933.16	101,933.16
其他负债	-	-	-	-	-	311,890.50	311,890.50
负债总计	656,139,071.93	-	-	-	-	2,147,440.56	658,286,512.49
利率敏感度缺口	290,429,039.88	2,439,540,516.00	2,343,068,459.76	-	-	7,770,337.59	4,499,950,273.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

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		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-3,801,516.22	-2,737,924.33
	市场利率下降 25 个基点	3,810,310.65	2,744,080.88

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。”常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	4,192,965,090.07	3,012,610,823.86
第三层次	-	-
合计	4,192,965,090.07	3,012,610,823.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	4,192,965,090.07	50.58
	其中：债券	3,902,792,976.59	47.08
	资产支持证 券	290,172,113.48	3.50
2	买入返售金融资产	1,510,399,090.00	18.22
	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	2,572,093,820.56	31.03
4	其他各项资产	14,187,151.60	0.17
5	合计	8,289,645,152.23	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	12.67	
	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	1,126,239,714.99	15.73
	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

注：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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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	27.80	15.73
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	45.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	115.23	15.73

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	39,693,529.34	0.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	345,441,004.11	4.82
	其中：政策性金融债	345,441,004.11	4.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	884,434,181.86	12.35
6	中期票据	61,754,445.15	0.86

7	同业存单	2,571,469,816.13	35.91
8	其他	-	-
9	合计	3,902,792,976.59	54.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面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)	按实际利率计算的 账面价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112221094	22 渤海银行 CD094	2,000,000	198,851,554.75	2.78
2	112296271	22 大华银行 CD005	2,000,000	198,716,065.27	2.78
3	112281725	22 广西北部湾银行 CD245	2,000,000	198,029,506.00	2.77
4	210216	21 国开 16	1,800,000	182,773,456.87	2.55
5	112280209	22 华融湘江银行 CD115	1,600,000	158,516,217.60	2.21
6	112280023	22 华融湘江银行 CD113	1,500,000	148,630,763.34	2.08
7	112281647	22 南洋商业银行 CD044	1,200,000	118,817,703.60	1.66
8	012281809	22 平安租赁 SCP005	1,000,000	100,236,360.22	1.40
9	112292844	22 德意志银行 CD003	1,000,000	99,673,941.57	1.39
10	112293385	22 星展银行 CD014	1,000,000	99,633,099.23	1.39

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0796%
报告期内偏离度的最低值	0.0220%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0529%

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 期末按实际利率计算的账面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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	按实际利率计算的 账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	183104	21 电 4A1	700,000	70,900,679.45	0.99
2	193688	嘉诚 3 优	500,000	48,274,354.08	0.67
3	GM000R	惠沣 10A1	360,000	36,028,721.10	0.50
4	136784	徐矿 27A	270,000	27,398,090.96	0.38
5	183961	辰悦 9A1	250,000	25,024,219.18	0.35
6	193281	永乐 6 优	240,000	24,345,095.01	0.34
7	183712	嘉诚 5 优	230,000	23,128,119.45	0.32
8	193775	辰悦 8A1	110,000	11,024,736.44	0.15
9	135056	徐矿 31A	100,000	10,066,279.45	0.14
10	183773	西租 03A1	70,000	7,018,226.85	0.10

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：

2021 年 10 月 22 日，国家外汇管理局天津市分局公示津汇检罚（2021）10 号行政处罚决定书，给予渤海银行 1856 万元人民币罚款的行政处罚，并没收违法所得 175.39 万元。

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）28 号行政处罚决定书，给予渤海银行 360 万元人民币罚款的行政处罚。

2021 年 9 月 15 日，广西银保监局公示桂银保监罚决字（2021）28 号行政处罚决定书，给予

广西北部湾银行股份有限公司 50 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）8 号行政处罚决定书，给予国家开发银行罚款 440 万元。

2021 年 9 月 14 日，湖南银保监局公示湘银保监罚决字（2021）43 号行政处罚决定书，给予华融湘江银行股份有限公司 120 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 2 月 22 日，上海银保监局公示沪银保监罚决字（2022）8 号行政处罚决定书，给予南洋商业银行(中国)有限公司 185 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 3 月 7 日，央行上海分行公示上海银罚字（2022）20 号行政处罚决定书，给予星展银行(中国)有限公司 203.6 万元人民币罚款的行政处罚。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	14,187,151.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,187,151.60

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
交银天利宝货币 A	419,971	8,317.08	33,411,333.39	0.96	3,459,522,630.90	99.04
交银天利宝货币 E	131	27,999,050.55	3,627,833,096.41	98.91	40,042,525.43	1.09
合计	420,102	17,045.41	3,661,244,429.80	51.13	3,499,565,156.33	48.87

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	206,857,329.86	2.89
2	银行类机构	133,322,325.46	1.86
3	银行类机构	121,575,730.61	1.70
4	银行类机构	101,265,859.97	1.41
5	其他机构	101,106,350.56	1.41
6	基金类机构	100,580,768.03	1.40
7	银行类机构	100,391,669.61	1.40
8	银行类机构	100,338,959.88	1.40
9	银行类机构	100,300,215.33	1.40
10	其他机构	100,265,798.76	1.40

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	交银天利宝货币 A	623,581.26	0.02
	交银天利宝货币 E	0.00	0.00
	合计	623,581.26	0.01

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	交银天利宝货币 A	0~10
	交银天利宝货币 E	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有	交银天利宝货币 A	0~10

本开放式基金	交银天利宝货币 E	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银天利宝货币 A	交银天利宝货币 E
基金合同生效日 (2016 年 10 月 19 日) 基金份额总额	13,275.90	500,090,000.00
本报告期初基金 份额总额	2,978,731,801.30	1,521,218,472.17
本报告期基金总申 购份额	5,510,214,802.62	4,116,565,813.41
减：本报告期基金 总赎回份额	4,996,012,639.63	1,969,908,663.74
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	3,492,933,964.29	3,667,875,621.84

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。

§ 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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

新时代证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、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；

3、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	交银施罗德基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台销售旗下部分基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 01 月 06 日
2	交银施罗德天利宝货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 01 月 21 日
3	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德天利宝货币市场基金于 2022 年“春节”假期前暂停及节后恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）并限制大额业务的公告	证券时报、公司网站	2022 年 01 月 26 日
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 03 月 04 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2022 年 03 月 04 日
6	交银施罗德天利宝货币市场基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 03 月 30 日
7	交银施罗德天利宝货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 04 月 21 日
8	交银施罗德基金管理有限公司关于增加银河证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 04 月 21 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于	证券时报、公司网站	2022 年 04 月 28 日

	交银施罗德天利宝货币市场基金于 2022 年“劳动节”假期前调整大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告		
--	--	--	--

§ 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天利宝货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德天利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德天利宝货币市场基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德天利宝货币市场基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德天利宝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天利宝货币市场基金在指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。

