嘉合货币市场基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 13
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遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
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 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 47
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 债券回购融资情况 47
7.3 基金投资组合平均剩余期限 48
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 49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
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 49
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 50
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 51
7.9 投资组合报告附注 51
§8 基金份额持有人信息 52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
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 53

§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 53
10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
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 54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 55
10.9 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
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 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57
12.1 备查文件目录 58
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合货币市场基金	
基金简称	嘉合货币	
基金主代码	001232	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年05月06日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,594,309,752.60份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合货币A	嘉合货币B
下属分级基金的交易代码	001232	001233
报告期末下属分级基金的份额总额	253,923,319.78份	11,340,386,432.82份

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前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、债券筛选策略；3、现金流管理策略；4、其他金融工具的投资策略
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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		嘉合基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔为中	郭明
	联系电话	021-60168288	（010）66105799
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-0603-299	95588
传真	021-65015077	（010）66105798
注册地址	上海市虹口区广纪路738号1幢329室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200082	100140
法定代表人	魏超	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A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01月01日-2026年06月30日)	
	嘉合货币A	嘉合货币B
本期已实现收益	1,551,668.12	66,595,794.54
本期利润	1,551,668.12	66,595,794.54
本期净值收益率	0.5786%	0.6989%
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	253,923,319.78	11,340,386,432.82
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06月30日)	
累计净值收益率	30.4245%	33.9710%

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。

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配是每日结转份额。

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

嘉合货币A

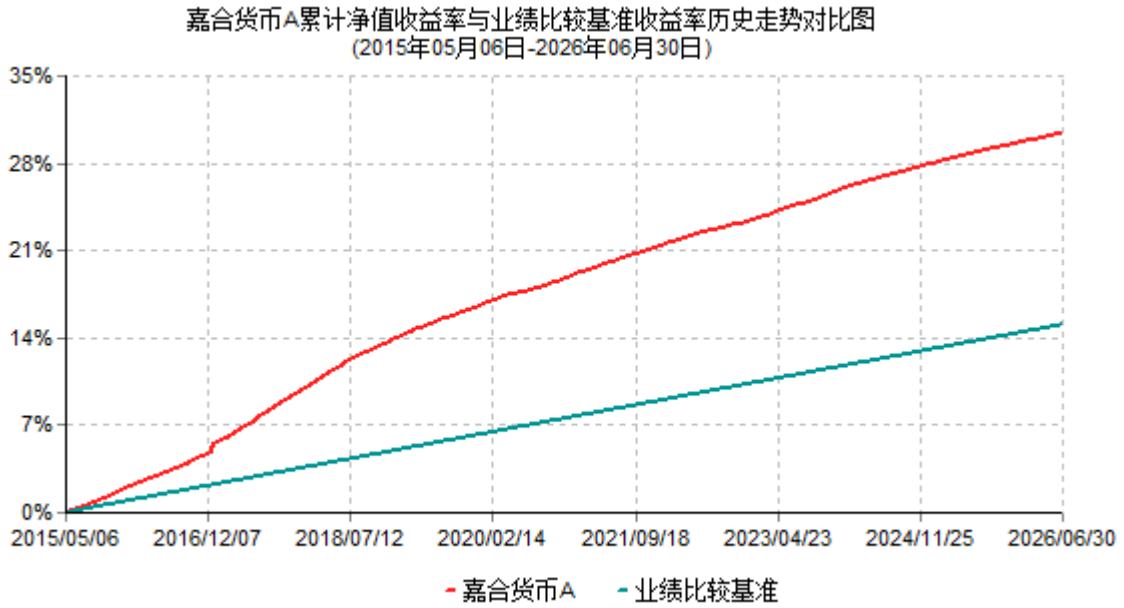
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2998%	0.0025%	0.3366%	0.0000%	-0.0368%	0.0025%
过去六个月	0.5786%	0.0029%	0.6695%	0.0000%	-0.0909%	0.0029%
过去一年	1.2501%	0.0033%	1.3500%	0.0000%	-0.0999%	0.0033%
过去三年	4.6556%	0.0029%	4.0537%	0.0000%	0.6019%	0.0029%
过去五年	8.4903%	0.0036%	6.7537%	0.0000%	1.7366%	0.0036%
过去七年	13.0496%	0.0038%	9.4574%	0.0000%	3.5922%	0.0038%
过去十年	26.1994%	0.0064%	13.5074%	0.0000%	12.6920%	0.0064%
自基金合同生效起至今	30.4245%	0.0064%	15.0682%	0.0000%	15.3563%	0.0064%

嘉合货币B

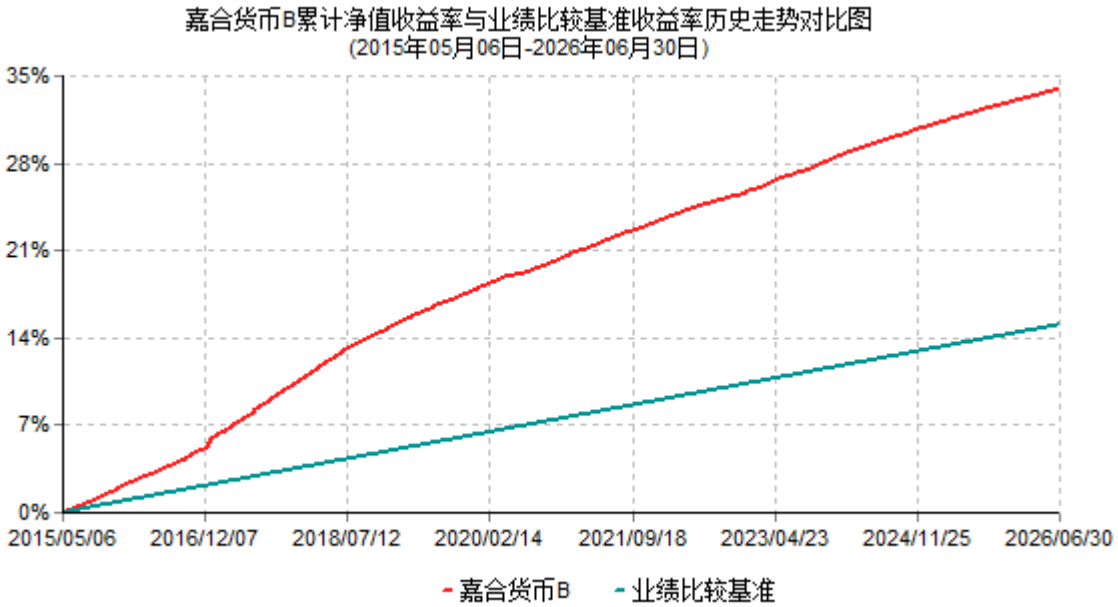
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.3602%	0.0025%	0.3366%	0.0000%	0.0236%	0.0025%
过去六个月	0.6989%	0.0029%	0.6695%	0.0000%	0.0294%	0.0029%
过去一年	1.4937%	0.0033%	1.3500%	0.0000%	0.1437%	0.0033%
过去三年	5.4126%	0.0029%	4.0537%	0.0000%	1.3589%	0.0029%
过去五年	9.8009%	0.0036%	6.7537%	0.0000%	3.0472%	0.0036%
过去七年	14.9662%	0.0038%	9.4574%	0.0000%	5.5088%	0.0038%
过去十年	29.2647%	0.0064%	13.5074%	0.0000%	15.7573%	0.0064%
自基金合同生效起至今	33.9710%	0.0064%	15.0682%	0.0000%	18.9028%	0.0064%

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：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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

嘉合基金管理有限公司（以下简称"嘉合基金"或"公司"）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年08月08日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2026年06月30日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2026年06月30日，嘉合基金旗下共管理24只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉

合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金及嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季慧娟	嘉合货币市场基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。	2015-07-08	-	19年	上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士。曾任华宝信托有限责任公司交易员，德邦基金管理有限公司债券交易员兼研究员，中欧基金管理有限公司债券交易员。2014年加入嘉合基金管理有限公司。
于启明	固定收益公募投资部总监，嘉合货币市场基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合	2016-01-29	-	19年	上海财经大学经济学硕士，厦门大学经济学学士。曾任宝盈货币市场证券投资基金基金经理和宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理。2015年加入嘉合基金管理有限公司。

	磐恒债券型证券投资基金的基金经理。				
叶平	嘉合货币市场基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金的基金经理。	2022-02-14	-	9年	南京大学国民经济学硕士。2017年5月进入嘉合基金管理有限公司工作。

注：1、季慧娟、于启明、叶平的"任职日期"为公告确定的聘任日期。
2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有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

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，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未超过该证券当日成交量的5%。

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

上半年国内生产总值69.57万亿元，同比增长4.7%，其中一季度增长5.0%，二季度增长4.3%，二季度增速有所放缓。从生产端看，中国经济仍保持增长。高技术制造业增加值同比增长13.3%，规模以上工业企业利润同比增长18.7%。但从需求端看，经济运行压力较为明显，上半年社会消费平零售总额同比增速只有1.3%，是近年来的最低水平。

固定资产投资同比下降5.7%，全面低迷，其中房地产开发投资下降18%成为最大拖累。上半年经济呈现外强内弱，K型分化的明显特征。上半年出口14.73万亿元，增长13.4%，但内需消费复苏偏弱。AI、半导体等新兴产业高速扩张，房地产和传统基建继续下行，上游资源品和高端技术领域利润集中，中下游传统制造和消费行业盈利疲软。

上半年，央行综合运用逆回购、中期借贷便利、国债买卖等多种货币政策工具，保持流动性充裕。1月，央行下调结构性货币政策工具利率0.25%。6月17日央行行长在陆家嘴论坛上宣布，完善短端利率调控机制，将临时正、逆回购的操作利率区间宽度由70个基点收窄至50个基点，后续将适时增设隔夜逆回购操作工具。6月29日隔夜逆回购操作落地，央行进一步丰富了工具箱。上半年人民币结汇助力流动性宽松，4月央行缩量操作，隔夜利率从极度宽松收敛至政策利率附近。

债券市场：一季度，债券市场走势有所分化。受通胀预期、经济数据超预期等影响，10年、30年国债收益率先下后上并持续高位震荡。30-10年期限利差明显走阔，反映出市场对超长债的承接能力有所弱化。中短债券收益率则在年初小幅上行后，在配置力量和资金宽松的推动下，收益率持续下行，利差明显压缩。二季度，债券收益率整体震荡下行。4月初配置资金强劲叠加经济数据不及预期，债券收益率快速下行。美伊冲突引发通胀预期使得收益率小幅上行。4-5月资金价格持续低位，因此各期限收益率随之下行。央行调整投放节奏后，资金价格上扬带动中短债收益率上行，收益率曲线呈现平坦化。随着央行维稳资金面后，收益率有所下行。

报告期内，我们根据产品负债情况和研判市场走势，积极在资产相对高点进行配置，挖掘交易性机会，精细操作争取在低票息的市场环境下为投资人创造更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5786%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末嘉合货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6989%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美伊冲突的反复不断或为常态，油价存在长尾风险，美联储货币政策不确定性增加。国内7月的政治局会议坚持稳中求进工作总基调，加快推动新旧动能转换，重提加大逆周期调节力度。财政政策中“充分发挥各项存量政策效能，及时谋划出台务实管用的增量政策”侧重于存量政策，稳增长政策预计维持托而不举。货币政策延续适度宽松，“综合运用并适时调整货币政策工具”更添货币政策灵活度。降息受制于银行净息差约束，实施节奏较谨慎，但若下半年经济数据压力显现，货币政策仍具备适度调整的空间。

展望下半年，经济基本面短期内难以出现根本性变化，新旧动能持续转换，外贸和高新科技生产继续发挥引擎作用支撑生产端，但固定资产投资羸弱以及房地产链条影响下，对总需求形成拖累。以旧换新补贴政策的缺位及非AI行业就业、收入预期悲观下，消费复苏也受到制约。K型经济发展模式下，高科技产业和出口经济结构不能有效改善银行信贷，资产荒逻辑延续，因此对债券市场形成支撑，关注下半年政府发债加速期。目前债券市场主要问题在于中短资产的各类利差极致收窄，安全边际有限，未来仍然关注资金价格是否下行带动收益率曲线。我们预计债券市场可能依旧处窄幅震荡的区间，收益率曲线下限受制于资金价格，收益率曲线上行受限于贷款需求，需关注宽松政策预期差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员具有丰富的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、修订本基金管理人管理的基金的估值政策、程序和技术，确保基金估值的公允与合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金本报告期内累计收益分配金额：货币A级1,551,668.12元，货币B级66,595,794.54元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无需要说明的相关情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存

在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本基金的管理人--嘉合基金管理有限公司在嘉合货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对嘉合基金管理有限公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：嘉合货币市场基金

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	635,989,128.65	466,598,022.83
结算备付金		894,142.29	52,221.45
存出保证金		82,494.55	24,897.80
交易性金融资产	6.4.7.2	6,845,558,354.29	5,642,315,709.32
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,845,558,354.29	5,642,315,709.32
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	4,114,864,449.41	2,831,197,293.32
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	250,000,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,597,388,569.19	9,190,188,144.72
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,931,923.34	2,506,831.18
应付托管费		482,980.85	759,645.80
应付销售服务费		146,260.77	143,672.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		197,097.60	302,266.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	320,554.03	398,158.53
负债合计		3,078,816.59	4,110,574.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	11,594,309,752.60	9,186,077,570.51
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		11,594,309,752.60	9,186,077,570.51
负债和净资产总计		11,597,388,569.19	9,190,188,144.72

注：报告截止日2026年6月30日，嘉合货币A份额净值1.0000元，基金份额总额253,923,319.78份，嘉合货币B份额净值1.0000元，基金份额总额11,340,386,432.82份，总份额合计11,594,309,752.60份。

6.2 利润表

会计主体：嘉合货币市场基金

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	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		85,675,453.88	87,270,047.46
1.利息收入		28,842,400.15	33,289,169.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,583,901.25	4,206,967.38
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		22,258,498.90	29,082,202.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		56,833,053.73	53,980,878.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	56,833,053.73	53,980,878.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.17	-	-

以“-”号填列）			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		17,527,991.22	19,867,602.44
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	12,511,388.78	13,875,474.76
2.托管费	6.4.10.2.2	3,497,895.31	4,204,689.30
3.销售服务费	6.4.10.2.3	807,147.13	634,402.02
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		451,311.32	901,821.26
其中：卖出回购金融资产支出		451,311.32	901,821.26
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		108,176.05	99,659.87
8.其他费用	6.4.7.20	152,072.63	151,555.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,147,462.66	67,402,445.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,147,462.66	67,402,445.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,147,462.66	67,402,445.02

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉合货币市场基金

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	9,186,077,570.51	-	9,186,077,570.51
二、本期期初净资产	9,186,077,570.51	-	9,186,077,570.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,408,232,182.09	-	2,408,232,182.09
（一）、综合收益总额	-	68,147,462.66	68,147,462.66
（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）	2,408,232,182.09	-	2,408,232,182.09
其中：1.基金申购款	51,544,898,021.74	-	51,544,898,021.74
2.基金赎回款	-49,136,665,839.65	-	-49,136,665,839.65
（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）	-	-68,147,462.66	-68,147,462.66
四、本期期末净资产	11,594,309,752.60	-	11,594,309,752.60

项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	10,303,489,602.54	-	10,303,489,602.54
二、本期期初净资产	10,303,489,602.54	-	10,303,489,602.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-1,056,874,013.63	-	-1,056,874,013.63

填列）			
（一）、综合收益总额	-	67,402,445.02	67,402,445.02
（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）	-1,056,874,013.63	-	-1,056,874,013.63
其中：1.基金申购款	11,743,387,072.41	-	11,743,387,072.41
2.基金赎回款	-12,800,261,086.04	-	-12,800,261,086.04
（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）	-	-67,402,445.02	-67,402,445.02
四、本期期末净资产	9,246,615,588.91	-	9,246,615,588.91

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:

魏超	沈珂	蔡文婷
————————	————————	————————
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

嘉合货币市场基金(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")《关于准予嘉合货币市场基金注册的批复》(证监许可[2015]571号文)批准，由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《嘉合货币市场基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月6日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币1,036,220,642.42元。上述募集资金已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合货币市场基金基金合同》和《嘉合货币市场基金招募说明书》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、资产支持证券及法律法规或中国证监会、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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金现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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失 (包括利息和股利收入) 计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失 (包括利息费用) 计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投

资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

1)本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3)基金“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

4)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

5)本基金每日进行收益支付，并只采用红利再投资的方式。若当日已实现收益大于零时，则增加投资者基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资者基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零，若当日已实现收益小于零时，不缩减投资人基金份额，待其后累计收益大于零时，即增加投资人基金份额；若投资人赎回基金份额，其收益将结清；

6)当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；

7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]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》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) 本基金管理人运营本基金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。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入, 自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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	635,989,128.65
等于：本金	635,741,096.64
加：应计利息	248,032.01
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	635,989,128.65

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	214,442,314.47	214,091,835.62	-350,478.85	-0.0030
	银行间市场	6,631,116,039.82	6,636,004,961.63	4,888,921.81	0.0422
	合计	6,845,558,354.29	6,850,096,797.25	4,538,442.96	0.0391
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,845,558,354.29	6,850,096,797.25	4,538,442.96	0.0391

注： 于6月30日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

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

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	4,114,864,449.41	-
合计	4,114,864,449.41	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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	212,375.08
其中：交易所市场	-
银行间市场	212,375.08
应付利息	-
预提费用	108,178.95
合计	320,554.03

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 嘉合货币A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合货币A)	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	352,709,949.75	352,709,949.75
本期申购	1,047,831,078.94	1,047,831,078.94
本期赎回（以“-”号填列）	-1,146,617,708.91	-1,146,617,708.91

本期末	253,923,319.78	253,923,319.78

6.4.7.7.2 嘉合货币B

金额单位：人民币元

项目 (嘉合货币B)	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	8,833,367,620.76	8,833,367,620.76
本期申购	50,497,066,942.80	50,497,066,942.80
本期赎回（以“-”号填列）	-47,990,048,130.74	-47,990,048,130.74
本期末	11,340,386,432.82	11,340,386,432.82

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 嘉合货币A

单位：人民币元

项目 (嘉合货币A)	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	1,551,668.12	-	1,551,668.12
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	-1,551,668.12	-	-1,551,668.12
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 嘉合货币B

单位：人民币元

项目 (嘉合货币B)	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	66,595,794.54	-	66,595,794.54
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	-66,595,794.54	-	-66,595,794.54
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	6,484,194.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,892.12
其他	97,814.80
合计	6,583,901.25

注：其他为结算保证金利息收入及应收申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	39,225,605.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,607,447.87
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	56,833,053.73

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	16,457,991,585.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,282,690,526.75
减：应计利息总额	157,695,361.18
减：交易费用	-1,750.00
买卖债券差价收入	17,607,447.87

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 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	-
汇划手续费	34,293.68
中债登	9,000.00
上清所	9,000.00
其他费用	600.00
合计	152,072.63

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

本基金本报告不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。

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
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均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	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,511,388.78	13,875,474.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,775,961.12	981,249.30
应支付基金管理人的净管理费	10,735,427.66	12,894,225.46

注：根据本基金管理人于2026年03月27日发布的《嘉合基金管理有限公司关于嘉合货币市场基金降低管理费率、托管费率并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自2026年03月30日起，本基金的管理费率由0.33%年费率下降至0.20%年费率。

支付基金管理人嘉合基金的基金管理费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

自2026年01月01日至2026年03月29日，基金管理费计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数

自2026年03月30日至2026年6月30日，基金管理费计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/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01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,497,895.31	4,204,689.30

注：根据本基金管理人于2026年03月27日发布的《嘉合基金管理有限公司关于嘉合货币市场基金降低管理费率、托管费率并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自2026年03月30日起，本基金的托管费率由0.10%年费率下降至0.05%年费率。

支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

自2026年01月01日至2026年03月29日，基金托管费计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

自2026年03月30日至2026年6月30日，基金托管费计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合货币A	嘉合货币B	合计
嘉合基金管理有限公司	880.53	240,947.22	241,827.75
合计	880.53	240,947.22	241,827.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合货币A	嘉合货币B	合计
嘉合基金管理有限公司	4,990.14	298,765.44	303,755.58
合计	4,990.14	298,765.44	303,755.58

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日嘉合货币A类份额基金资产净值0.25%和前一日嘉合货币B类份额基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

嘉合货币A日基金销售服务费=前一日A类基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数

嘉合货币B日基金销售服务费=前一日B类基金资产净值 × 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	635,989,128.65	6,484,194.33	434,585,444.39	3,244,637.36

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2026年6月30日的相关余额为人民币894,142.29元。（2025年6月30日：人民币3,043,492.55元）

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

嘉合货币A

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
1,551,668.12	-	-	1,551,668.12	-

嘉合货币B

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
66,595,794.54	-	-	66,595,794.54	-

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年6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金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险管理与财务和内控委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，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。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大，且本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10% 。

本基金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证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,483,650,485.91	2,177,377,580.29
合计	1,483,650,485.91	2,177,377,580.29

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券、地方政府债等非信用债券投资。

2、未评级债券为短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,996,461,571.09	2,295,283,571.15
合计	2,996,461,571.09	2,295,283,571.15

注：1、未评级为无信用评级的同业存单。

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	上年度末

	2026年06月30日	2025年12月31日
AAA	1,925,241,129.88	644,529,984.51
AAA以下	10,239,019.41	-
未评级	429,966,148.00	525,124,573.37
合计	2,365,446,297.29	1,169,654,557.88

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券、地方政府债等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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，以保障基金持有人利益。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，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，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。同时，本基金通过现金流管理策略，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。

本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》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，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本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超过基金资产净值的10%。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于银行存款、同业存单、短期债券、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”(参见附注6.4.4.5)对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。

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	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

日							
资产							
货币资金	635,989,128.65	-	-	-	-	-	635,989,128.65
结算备付金	894,142.29	-	-	-	-	-	894,142.29
存出保证金	82,494.55	-	-	-	-	-	82,494.55
交易性金融资产	3,039,815,094.01	2,150,938,099.09	1,654,805,161.19	-	-	-	6,845,558,354.29
买入返售金融资产	4,114,864,449.41	-	-	-	-	-	4,114,864,449.41
资产总计	7,791,645,308.91	2,150,938,099.09	1,654,805,161.19	-	-	-	11,597,388,569.19
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,931,923.34	1,931,923.34
应付托管费	-	-	-	-	-	482,980.85	482,980.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	146,260.77	146,260.77
应交税费	-	-	-	-	-	197,097.60	197,097.60
其他负债	-	-	-	-	-	320,554.03	320,554.03
负债总计	-	-	-	-	-	3,078,816.59	3,078,816.59
利率敏感度缺口	7,791,645,308.91	2,150,938,099.09	1,654,805,161.19	-	-	-3,078,816.59	11,594,309,752.60
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	466,598,022.83	-	-	-	-	-	466,598,022.83

结算备付金	52,221.45	-	-	-	-	-	52,221.45
存出保证金	24,897.80	-	-	-	-	-	24,897.80
交易性金融资产	920,356,912.09	3,138,200,168.70	1,583,758,628.53	-	-	-	5,642,315,709.32
买入返售金融资产	2,831,197,293.32	-	-	-	-	-	2,831,197,293.32
应收申购款	-	-	-	-	-	250,000,000.00	250,000,000.00
资产总计	4,218,229,347.49	3,138,200,168.70	1,583,758,628.53	-	-	250,000,000.00	9,190,188,144.72
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,506,831.18	2,506,831.18
应付托管费	-	-	-	-	-	759,645.80	759,645.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	143,672.35	143,672.35
应交税费	-	-	-	-	-	302,266.35	302,266.35
其他负债	-	-	-	-	-	398,158.53	398,158.53
负债总计	-	-	-	-	-	4,110,574.21	4,110,574.21
利率敏感度缺口	4,218,229,347.49	3,138,200,168.70	1,583,758,628.53	-	-	245,889,425.79	9,186,077,570.51

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整	
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
	市场利率平行下降25个基点	3,240,252.48	3,090,469.44
	市场利率平行上升25个基点	-3,240,252.48	-3,090,469.44

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，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由基金所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金主要投资于交易所和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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	6,845,558,354.29	59.04	-	-
交易性金融资产－贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,845,558,354.29	59.04	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金未持有对其他价格敏感的金融资产与金融负债，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析（2025年12月31日：同）。

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	6,845,558,354.29	5,642,315,709.32
第三层次	-	-
合计	6,845,558,354.29	5,642,315,709.32

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。

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6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6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	6,845,558,354.29	59.03
	其中：债券	6,845,558,354.29	59.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,114,864,449.41	35.48
	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	636,883,270.94	5.49
4	其他各项资产	82,494.55	0.00
5	合计	11,597,388,569.19	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	0.75	
	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	-	-
	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

本报告期内本货币市场基金不存在债券正回购的资金余额超过资产净值20%的情况。

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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

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	67.20	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	0.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.09	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	13.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.03	-

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

本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	951,070,453.91	8.20
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	214,442,314.47	1.85
5	企业短期融资券	1,483,650,485.91	12.80
6	中期票据	1,199,933,528.91	10.35
7	同业存单	2,996,461,571.09	25.84
8	地方政府债	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,845,558,354.29	59.04
11	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	212380008	23交行债01	4,800,000	490,759,264.29	4.23
2	212300003	23江苏银行债02	3,900,000	398,962,108.70	3.44
3	112504038	25中国银行CD038	3,000,000	299,854,544.25	2.59
4	112504042	25中国银行CD042	3,000,000	299,830,330.24	2.59
5	112608024	26中信银行CD024	3,000,000	299,764,210.63	2.59
6	112618013	26华夏银行CD013	3,000,000	299,737,042.17	2.59
7	112610068	26兴业银行CD068	3,000,000	299,708,145.29	2.58
8	112505315	25建设银行CD315	3,000,000	299,591,541.07	2.58
9	112510256	25兴业银行CD256	3,000,000	299,510,417.75	2.58
10	112603103	26农业银行CD103	3,000,000	299,422,029.96	2.58

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	0.0945%
报告期内偏离度的最低值	0.0342%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0590%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内，本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日计提损益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。中国银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局或其派出机构、中国证券监督管理委员会派出机构的处罚。

注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的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	82,494.55
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	82,494.55

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
嘉合货币A	9,965	25,481.52	42,488,696.29	16.73%	211,434,623.49	83.27%
嘉合货币B	59	192,209,939.54	11,340,386,432.82	100.00%	0.00	0.00%
合计	10,024	1,156,655.00	11,382,875,129.11	98.18%	211,434,623.49	1.82%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B级比例分母为各自级别的份额，合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	银行类机构	1,626,386,618.79	14.03%
2	券商类机构	838,936,950.28	7.24%
3	银行类机构	542,701,250.46	4.68%
4	保险类机构	513,958,735.01	4.43%
5	银行类机构	507,799,101.76	4.38%
6	银行类机构	501,873,420.90	4.33%
7	券商类机构	501,683,613.84	4.33%
8	银行类机构	500,587,896.24	4.32%
9	券商类机构	405,763,537.05	3.50%
10	银行类机构	401,403,007.07	3.46%

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	嘉合货币A	1,430.66	0.00%
	嘉合货币B	-	0.00%
	合计	1,430.66	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉合货币A	0~10
	嘉合货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合货币A	0
	嘉合货币B	0
	合计	0

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合货币A	嘉合货币B
基金合同生效日(2015年05月06日)基金份额总额	568,321.28	1,035,652,321.14
本报告期期初基金份额总额	352,709,949.75	8,833,367,620.76
本报告期基金总申购份额	1,047,831,078.94	50,497,066,942.80
减：本报告期基金总赎回份额	1,146,617,708.91	47,990,048,130.74
本报告期期末基金份额总额	253,923,319.78	11,340,386,432.82

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产相关的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2016年12月28日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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，本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，本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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。

2、本基金的基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，并选用其交易席位供基金买卖证券专用。基金管理人根据上述标准评价并确定合作的证券公司，与证券公司签订证券交易单元租用协议。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1,465,165,066.49	100.00%	568,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过0.5%。

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	嘉合基金管理有限公司旗下	《上海证券报》、《中国证	2026-01-22

	基金2025年第4季度报告提示性公告	券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	
2	嘉合货币市场基金2025年第4季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	关于嘉合货币市场基金2026年春节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-10
4	嘉合基金管理有限公司关于嘉合货币市场基金降低管理费率、托管费率并相应修订基金合同和托管协议的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
5	嘉合货币市场基金基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
6	嘉合货币市场基金托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
7	嘉合货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
8	嘉合货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
9	嘉合货币市场基金招募说明书（更新）（2026年第1号）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
10	关于嘉合货币市场基金2026年清明节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	嘉合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年度）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	嘉合基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2026-03-31
13	嘉合货币市场基金2025年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31

14	嘉合基金管理有限公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2026-04-22
15	嘉合货币市场基金2026年第1季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
16	关于嘉合货币市场基金2026年劳动节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-27
17	2025年度嘉合基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
18	关于嘉合货币市场基金2026年端午节前暂停申购、转换转入及定投业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-15
19	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-19
20	嘉合货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30
21	嘉合货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30
22	嘉合货币市场基金招募说明书（更新）（2026年第2号）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

一、中国证监会准予嘉合货币市场基金募集注册的文件

二、《嘉合货币市场基金基金合同》

三、《嘉合货币市场基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件和营业执照

六、基金托管人业务资格批件和营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日