

前海开源现金增利货币市场基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 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，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	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	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 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	40
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	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42

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	43
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	43
§ 9	开放式基金份额变动	44
§ 10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	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	48
§ 12	备查文件目录	48
12.1	备查文件目录	48
12.2	存放地点	48
12.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源现金增利货币市场基金		
基金简称	前海开源货币		
基金主代码	001870		
基金运作方式	契约型普通开放式		
基金合同生效日	2015 年 09 月 29 日		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	8,287,325,897.71 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
下属分级基金的交易代码	001870	001871	004210
报告期末下属分级基金的份额总额	62,664,735.41 份	8,134,097,340.25 份	90,563,822.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	<p>本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、短期资金市场状况等因素的分析，综合判断未来短期利率变动，评估各类投资品种的流动性和风险收益特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。</p> <p>2、利率预期策略</p> <p>通过对通货膨胀、GDP、货币供应量、国际利率水平、金融监管政策取向等跟踪分析，形成对基本面的宏观研判。同时，结合微观层面研究，主要考察指标包括：央行公开市场操作、主要机构投资者的短期投资倾向、债券供给、回购抵押数量等，合理预期货币市场利率曲线动态变化，动态配置货币资产。</p> <p>3、期限配置策略</p> <p>根据利率预期分析，动态确定并控制投资组合平均剩余期限在 120 天以内。当市场利率看涨时，适度缩短投资组合平均剩余期限，即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种，降低组合整体净值损失风险；当市场看跌时，则相对延长投资组合平均剩余期限，增持较长剩余期限的投资品种，获取超额收益。</p> <p>4、流动性管理策略</p>

	<p>本基金作为现金管理工具，必须具备较高的流动性。基金管理人在密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素基础上，对投资组合的现金比例进行优化管理。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下，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、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。</p> <p>5、收益增强策略</p> <p>通过分析各类投资品种的相对收益、利差变化、市场容量、信用等级情况、流动性风险、信用风险等因素来确定配置比例和期限组合，寻找具有投资价值的投资品种，增持相对低估、价格将上升的，能给组合带来相对较高回报的类属；减持相对高估、价格将下降的，给组合带来相对较低回报的类属，借以取得较高的总回报。</p>
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其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		前海开源基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	陆志俊
	联系电话	0755-88601888	95559
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001-666-998	95559
传真		0755-83181169	021-62701216
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		518040	200336
法定代表人		李强	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	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	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206

§ 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（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
本期已实现收益	380,607.47	94,992,100.72	364,478.50
本期利润	380,607.47	94,992,100.72	364,478.50
本期净值收益率	0.9009%	1.0209%	0.9028%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
期末基金资产净值	62,664,735.41	8,134,097,340.25	90,563,822.05
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
累计净值收益率	20.3092%	22.5711%	16.8043%

注：① 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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 本基金的利润分配方式是“每日分配、按日支付”。

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

前海开源货币 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	0.1570%	0.0044%	0.1125%	0.0000%	0.0445%	0.0044%
过去三个月	0.4459%	0.0031%	0.3413%	0.0000%	0.1046%	0.0031%
过去六个月	0.9009%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	0.2221%	0.0023%
过去一年	1.6023%	0.0026%	1.3688%	0.0000%	0.2335%	0.0026%
过去三年	5.6596%	0.0024%	4.1063%	0.0000%	1.5533%	0.0024%
自基金合同生效起至今	20.3092%	0.0029%	10.6200%	0.0000%	9.6892%	0.0029%

前海开源货币 B

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	0.1765%	0.0044%	0.1125%	0.0000%	0.0640%	0.0044%
过去三个月	0.5058%	0.0031%	0.3413%	0.0000%	0.1645%	0.0031%

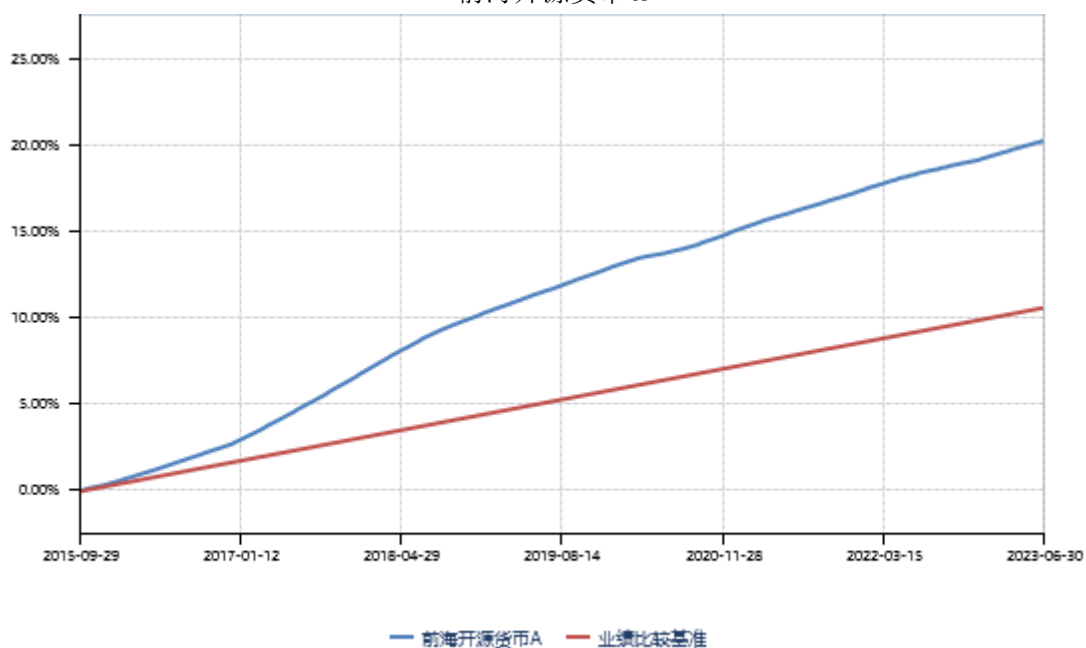
过去六个月	1.0209%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	0.3421%	0.0023%
过去一年	1.8466%	0.0026%	1.3688%	0.0000%	0.4778%	0.0026%
过去三年	6.4228%	0.0024%	4.1063%	0.0000%	2.3165%	0.0024%
自基金合同生效起至今	22.5711%	0.0029%	10.6200%	0.0000%	11.9511%	0.0029%

前海开源货币 E

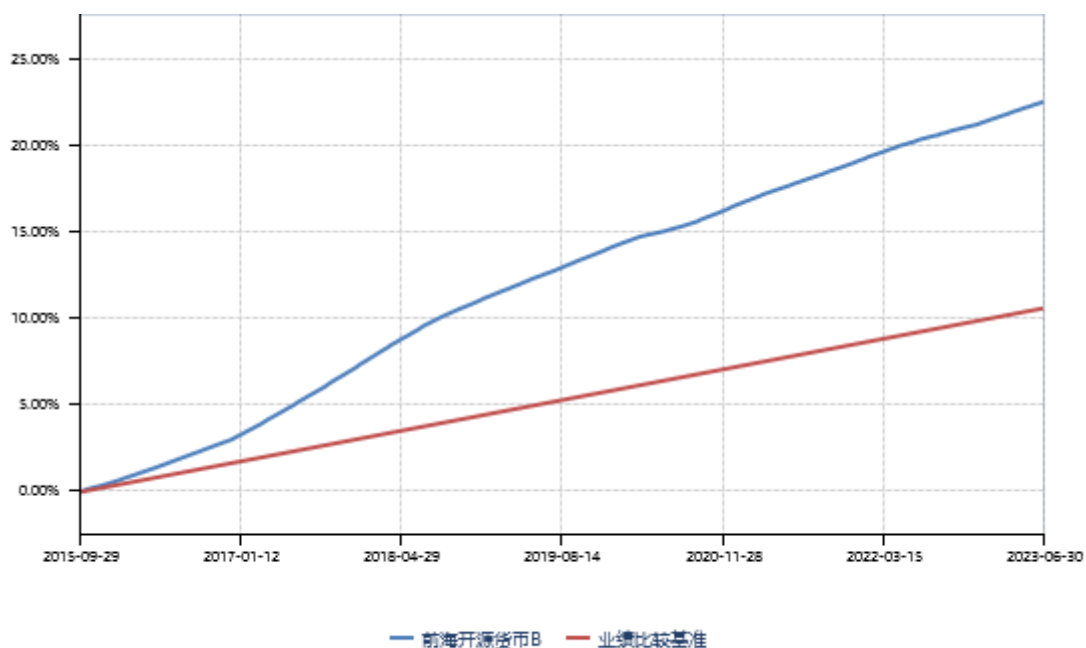
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1572%	0.0044%	0.1125%	0.0000%	0.0447%	0.0044%
过去三个月	0.4461%	0.0031%	0.3413%	0.0000%	0.1048%	0.0031%
过去六个月	0.9028%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	0.2240%	0.0023%
过去一年	1.6042%	0.0026%	1.3688%	0.0000%	0.2354%	0.0026%
过去三年	5.6572%	0.0024%	4.1063%	0.0000%	1.5509%	0.0024%
自基金合同生效起至今	16.8043%	0.0031%	8.8388%	0.0000%	7.9655%	0.0031%

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

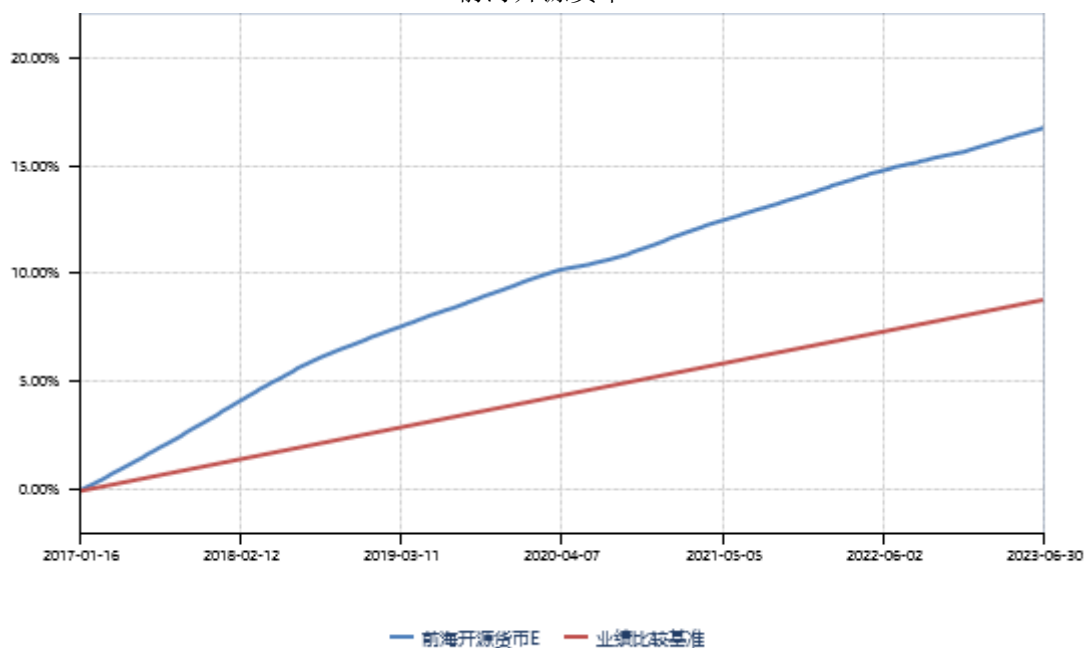
前海开源货币 A



前海开源货币 B



前海开源货币 E



注：本基金自 2017 年 1 月 13 日起，增加 E 类基金份额并设置对应基金代码；2017 年 1 月 13 日、2017 年 1 月 14 日、2017 年 1 月 15 日 E 类基金份额为零。前海开源货币 E 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较起始日为 2017 年 1 月 16 日。

§ 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

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司—前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 1121 亿元。

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		
刘静	本基金的基金经理、公司董事总经理	2015 年 09 月 29 日	-	21 年	刘静女士，经济学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理，2014 年 1 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司董事总经理。
林悦	本基金的基金经理	2019 年 07 月 29 日	-	9 年	林悦先生，应用经济学硕士。2014 年至 2016 年任汇添富基金管理有限公司投资研究总部债券交易员，2016 年 9 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司固收现金团队基金经理。
张艳琳	本基金的基金经理助理	2021 年 03 月 16 日	-	8 年	张艳琳女士，上海财经大学硕士研究生。2015 年 7 月至 2015 年 12

					月任上海红御投资管理有限公司融资助理，2016年1月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理助理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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。本报告期内基金管理人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成交量的 5%的情况。

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

1 月份，由于疫情快速过峰后消费强劲反弹，地产数据亦有较好的表现，市场对经济的预期较为乐观，债市走弱。春节后，尽管数据仍较好，但由于基本已在预期内，债市迎来了一波较为强劲

的反弹。2月下旬，资本新规出台，对信贷的风险权重进行了一定程度的下调，市场对信贷投放及经济刺激政策的乐观预期升温，加上月末资金紧，且《货币政策执行报告》没有再提“灵活适度”，债市迎来了一波较为显著的回调。3月初，由于《政府工作报告》将年内经济增长目标定为5%左右，市场对经济刺激政策的乐观预期降温，加上降准后市场对资金面的预期改善，债券收益率顶部确立，高等级信用策略开始有超额收益。尽管3月数据较好，但4月因高频数据走弱，债市开启了一轮较为强劲的趋势性行情，长久期高等级信用债领涨。5月份，债市大涨后进入宽幅震荡，由于资金转松，且前期长久期品种大涨后期限利差已压缩至极限，短端表现明显好于长端。6月上旬，在地产强刺激政策被证伪后，债市开启了一轮新的上涨，并在OMO降息后上涨加速。之后由于经济数据不及预期，市场焦点转向宽信用，债市陷入调整。6月20日，因LPR下调幅度并未超过10BP，债市止跌回升。整个上半年来看，高等级信用债表现好于利率债，高等级信用策略在2季度获得显著的超额收益。

上半年，债券市场收益率呈现先上后下的态势，10年期国债到期收益率由1月初的2.82%上行至2月下旬的2.92%后，一路震荡下行至6月底的2.64%。3个月和1年期的存单分别从去年底的2.14%、2.42%上行至二月底和三月初的2.52%、2.75%高点后，一路震荡下行至降准前的2.02%和2.26%，降准后快速反弹至2.23%和2.38%，最终收在2.15%和2.31%，上半年整体分别上行1.1bp和下行11.5bp。

本基金一季度初对资金面持中性偏谨慎的态度，二季度对资金面预期开始转为乐观。整个报告期内，组合平均剩余期限大部分时间保持在中性略低水平，并保持良好的流动性，季末时点提升至偏高水平。组合配置主要以不跨季的短融和存单为主，季末月开始逐步配置3-6m的存单、存款，以提高组合静态收益。整个报告期内，本产品以持有高等级高流动性存单为主，严格控制信用风险和流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9009%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%；截至报告期末前海开源货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.0209%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%；截至报告期末前海开源货币E基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9028%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，因融资需求偏弱，社融增速可能延续低位运行，货币政策有望保持宽松，债市整体

风险不大。随着地方债供给后置和按揭贷款早偿率下降，社融增速下滑的趋势可能在三季度有所缓解，但中期维度内存款降息、地产和出口偏弱仍将维持一段时间，货币环境大幅度收紧的条件并不成熟。组合将继续重视票息收益，以中短久期的高评级同业存单为主，并适时调整组合杠杆，在控制流动性风险的前提下力争提高组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

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，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》，本基金每日将各级基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

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，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，基金托管人在前海开源现金增利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，前海开源基金管理有限公司在前海开源现金增利货币市场基金投资运作、基金资

产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由前海开源基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关前海开源现金增利货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：前海开源现金增利货币市场基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	407,989,516.50	1,760,212,560.64
结算备付金		-	-
存出保证金		11,123.98	26,585.78
交易性金融资产	6.4.7.2	5,588,327,737.82	3,717,212,478.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,568,289,962.48	3,717,212,478.74
资产支持证券投资		20,037,775.34	-
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	2,647,917,195.29	1,886,645,869.21
应收清算款		-	12,557,680.31
应收股利		-	-
应收申购款		62,821,261.48	405,075,245.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,707,066,835.07	7,781,730,419.99
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 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		415,542,656.92	295,259,373.03
应付清算款		-	40,580,297.80
应付赎回款		0.10	7,007.80
应付管理人报酬		2,169,045.86	1,269,000.30
应付托管费		607,332.81	355,320.11
应付销售服务费		104,943.91	61,055.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		121,734.22	15,241.09
应付利润		581,889.83	475,982.89
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	613,333.71	482,875.91
负债合计		419,740,937.36	338,506,154.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	8,287,325,897.71	7,443,224,265.58
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		8,287,325,897.71	7,443,224,265.58
负债和净资产总计		8,707,066,835.07	7,781,730,419.99

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源货币基金份额总额 8,287,325,897.71 份，其中，前海开源货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 62,664,735.41 份；前海开源货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 8,134,097,340.25 份；前海开源货币 E 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 90,563,822.05 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源现金增利货币市场基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		112,975,100.03	115,504,773.43
1. 利息收入		54,617,891.57	47,755,727.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,681,533.03	14,246,268.94
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		37,936,358.54	33,509,458.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		58,357,208.46	67,749,045.61
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	58,154,901.68	66,762,551.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	202,306.78	986,494.36
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（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
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		17,237,913.34	18,445,087.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,123,673.59	12,093,350.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,394,628.55	3,386,138.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	582,924.91	559,549.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		941,312.22	2,166,721.52
其中：卖出回购金融资产支出		941,312.22	2,166,721.52
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		31,110.25	51,433.24
8. 其他费用	6.4.7.20	164,263.82	187,894.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		95,737,186.69	97,059,686.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		95,737,186.69	97,059,686.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		95,737,186.69	97,059,686.01

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源现金增利货币市场基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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)	7,443,224,265.58	-	-	7,443,224,265.58
二、本期期初净资产(基金净值)	7,443,224,265.58	-	-	7,443,224,265.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	844,101,632.13	-	-	844,101,632.13
(一)、综合收益总额	-	-	95,737,186.69	95,737,186.69
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动	844,101,632.13	-	-	844,101,632.13

数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	49,241,571,612.03	-	-	49,241,571,612.03
2. 基金赎回款	-48,397,469,979.90	-	-	-48,397,469,979.90
(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)	-	-	-95,737,186.69	-95,737,186.69
四、本期期末净资产(基金净值)	8,287,325,897.71	-	-	8,287,325,897.71
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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)	8,414,857,189.86	-	-	8,414,857,189.86
二、本期期初净资产(基金净值)	8,414,857,189.86	-	-	8,414,857,189.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,063,278,782.25	-	-	4,063,278,782.25
(一)、综合收益总额	-	-	97,059,686.01	97,059,686.01
(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)	4,063,278,782.25	-	-	4,063,278,782.25
其中: 1. 基金申购款	56,587,461,071.50	-	-	56,587,461,071.50
2. 基金赎回款	-52,524,182,289.25	-	-	-52,524,182,289.25
(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)	-	-	-97,059,686.01	-97,059,686.01
四、本期期末净资产(基金净值)	12,478,135,972.11	-	-	12,478,135,972.11

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:

秦亚峰

何璁

傅智

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

前海开源现金增利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

中国证监会”)证监许可[2015]2080号《关于准予前海开源现金增利货币市场基金注册的批复》核准,由前海开源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《前海开源现金增利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 2,076,267,084.22 元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]02230059 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》于 2015 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,076,277,239.93 份,其中认购资金利息折合 10,155.71 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》,本基金根据投资人单笔认购/申购本基金的金额、单个账户中持有本基金份额的数量或投资人申购本基金的其他不同条件,分别设置 A 类基金份额和 B 类基金份额。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别,并根据其持有的基金份额数额成为某一类别的基金份额持有人,不同基金份额类别之间不得互相转换,但依据基金合同或招募说明书约定因认购、申购、赎回、基金转换等交易及收益结转份额而发生基金份额自动升级或者降级的除外。根据《关于前海开源现金增利货币市场基金增加 E 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》和更新后的《前海开源现金增利货币市场基金招募说明书》,自 2017 年 1 月 13 日起本基金增加 E 类基金份额。E 类基金份额与 A 类基金份额适用相同的管理费率、托管费率和销售服务费率,其单笔申购申请最低限额为人民币 0.01 元,单笔赎回申请最低限额为 0.01 份。E 类基金份额不进行基金份额升降级。投资者需通过本基金的基金管理人指定的销售平台办理 E 类基金份额的申购、赎回等业务。各类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)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,以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(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、《资产管理产品相关会计处理规定》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》、《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他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本报告期末的财务状况以及本报告期间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

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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 2018 年 1 月 1 日起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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	6,687,224.24
等于：本金	6,680,102.81
加：应计利息	7,121.43
定期存款	401,302,292.26
等于：本金	400,000,000.00
加：应计利息	1,302,292.26
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	401,302,292.26
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
合计	407,989,516.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	按实际利率计算的	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)

		账面价值			
债券	交易所市场	10,107,475.70	10,111,926.03	4,450.33	0.0001
	银行间市场	5,558,182,486.78	5,560,315,572.71	2,133,085.93	0.0257
	合计	5,568,289,962.48	5,570,427,498.74	2,137,536.26	0.0258
资产支持证券		20,037,775.34	20,037,775.34	-	-
合计		5,588,327,737.82	5,590,465,274.08	2,137,536.26	0.0258

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。

6.4.7.4 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 2023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	2,647,917,195.29	-
合计	2,647,917,195.29	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	331,327.09
其中：交易所市场	-
银行间市场	331,327.09
应付利息	-
预提费用	282,006.62
合计	613,333.71

6.4.7.7 实收基金

前海开源货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,512,252.71	48,512,252.71
本期申购	115,571,129.38	115,571,129.38
本期赎回（以“-”号填列）	-101,418,646.68	-101,418,646.68
本期末	62,664,735.41	62,664,735.41

前海开源货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,391,789,380.48	7,391,789,380.48
本期申购	48,813,763,435.82	48,813,763,435.82
本期赎回（以“-”号填列）	-48,071,455,476.05	-48,071,455,476.05
本期末	8,134,097,340.25	8,134,097,340.25

前海开源货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,922,632.39	2,922,632.39
本期申购	312,237,046.83	312,237,046.83
本期赎回（以“-”号填列）	-224,595,857.17	-224,595,857.17
本期末	90,563,822.05	90,563,822.05

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

前海开源货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	380,607.47	-	380,607.47
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	-380,607.47	-	-380,607.47
本期末	-	-	-

前海开源货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	94,992,100.72	-	94,992,100.72
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	-94,992,100.72	-	-94,992,100.72
本期末	-	-	-

前海开源货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	364,478.50	-	364,478.50
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	-364,478.50	-	-364,478.50
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	36,470.18
定期存款利息收入	16,644,931.21
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	131.64
合计	16,681,533.03

6.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

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 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益--利息收入	47,171,226.61
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	10,983,675.07
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	58,154,901.68

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,789,946,639.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,661,707,745.00
减：应计利息总额	117,250,219.89
减：交易费用	5,000.00
买卖债券差价收入	10,983,675.07

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06 月30日
资产支持证券投资收益--利息收入	202,306.78
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	202,306.78

6.4.7.13.2 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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	20,136,486.58
减：卖出资产支持证券成本总额	20,000,000.00
减：应计利息总额	136,486.58
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	60,499.25
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	25,607.23
账户维护费	18,000.00
其他	649.97
合计	164,263.82

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

本报告期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
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金销售机构、基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,123,673.59	12,093,350.34
其中：支付销售机构的客户维护费	1,396,866.88	1,474,552.93

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/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
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,394,628.55	3,386,138.10

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.07% 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×0.07%/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			
	2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	前海开源货币 A	前海开源货 币 B	前海开源货 币 E	合计
前海开源基金	9,171.45	296,806.44	650.04	306,627.93
交通银行	3,490.69	1,348.49	-	4,839.18
开源证券	305.33	274.00	-	579.33
合计	12,967.47	298,428.93	650.04	312,046.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	前海开源货币 A	前海开源货 币 B	前海开源货 币 E	合计
交通银行	4,488.71	6,501.27	0.00	10,989.98
开源证券	357.40	0.00	0.12	357.52
前海开源基金	15,893.99	283,403.38	845.86	300,143.23

合计	20,740.10	289,904.65	845.98	311,490.73
----	-----------	------------	--------	------------

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，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。前海开源货币 A 类基金份额、前海开源货币 B 类基金份额和前海开源货币 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01% 和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日对应类别基金资产净值 × 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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	49,802,891.30	40,755,324.38	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	10,190,912.60	10,194,594.11	-	-	100,000,000.00	6,441.78

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

前海开源货币 B

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2015 年 09 月 29 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	98,796,455.23	126,421,823.77
报告期间申购/买入总份额	120,695,495.62	806,053,594.56
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	219,491,950.85	452,663,680.06
报告期末持有的基金份额	-	479,811,738.27
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	-	3.87%

注: 期间申购/买入总份额含红利再投、基金转换入和强制调增份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出和强制调减份额。

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

前海开源货币 B

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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
深圳市和合 投信资产管 理合伙企业 (有限合伙)	10,782,299.90	0.13%	10,673,403.06	0.14%
交通银行	710,006,122.14	8.73%	700,480,198.45	9.48%

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
交通银行	6,687,224.24	36,470.18	2,114,801.38	56,347.84

注: 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管, 按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金因投资本基金托管人交通银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 66,664.26 元(2022 年上半年度: 1,303,992.68 元)。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有 500,000.00 张托管人交通银行的同业存单，账面价值为人民币 49,666,713.70 元，占基金资产净值的比例为 0.60%(于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交通银行的同业存单)。

6.4.11 利润分配情况

前海开源货币 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
379,317.30	-	1,290.17	380,607.47	-

前海开源货币 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
94,893,156.71	-	98,944.01	94,992,100.72	-

前海开源货币 E

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
358,805.74	-	5,672.76	364,478.50	-

6.4.12 期末 2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
180908	至信 17 优	2023 年 05 月 10 日	1-6 个月(含)	资产支持证券未上市	100.00	100.32	100,000	10,000,000.00	10,031,857.53	-
199948	至信 18 优	2023 年 06 月 20 日	1 个月内(含)	资产支持证券未上市	100.00	100.06	100,000	10,000,000.00	10,005,917.81	-

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 2023 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 415,542,656.92 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
200207	20 国开 07	2023 年 07 月 03 日	102.80	700,000	71,963,153.06
200313	20 进出 13	2023 年 07 月 03 日	103.01	700,000	72,107,642.00
210322	21 进出 22	2023 年 07 月 03 日	102.08	500,000	51,040,036.58
220023	22 付息国债 23	2023 年 07 月 03 日	101.11	1,000,000	101,113,356.76
220216	22 国开 16	2023 年 07 月 03 日	101.02	1,000,000	101,023,350.40
220308	22 进出 08	2023 年 07 月 03 日	101.16	200,000	20,231,709.15
220408	22 农发 08	2023 年 07 月 03 日	101.30	200,000	20,259,500.08
239912	23 贴现国债 12	2023 年 07 月 03 日	99.69	100,000	9,968,807.04
合计				4,400,000	447,707,555.07

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具, 属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上, 力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以监察及风险控制委员会、督察长、

风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，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；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；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监察稽核部和风险管理团队负责，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。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与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，不投资于信用等级在 AA+ 级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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,681,307,245.46	580,149,633.86
合计	1,681,307,245.46	580,149,633.86

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,691,871,885.38	3,004,732,613.50
合计	3,691,871,885.38	3,004,732,613.50

注：同业存单信用评级取自第三方评级机构的评级。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	195,110,831.64	132,330,231.38
合计	195,110,831.64	132,330,231.38

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	10,000,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

注：资产支持证券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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%。

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》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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金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%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。

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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	407,989,516.50	-	-	-	407,989,516.50
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	11,123.98	-	-	-	11,123.98

交易性金融资产	5,588,327,737.82	-	-	-	-5,588,327,737.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,647,917,195.29	-	-	-	-2,647,917,195.29
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	62,821,261.48	62,821,261.48
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,644,245,573.59	-	-	62,821,261.48	8,707,066,835.07
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	415,542,656.92	-	-	-	415,542,656.92
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	0.10	0.10
应付管理人报酬	-	-	-	2,169,045.86	2,169,045.86
应付托管费	-	-	-	607,332.81	607,332.81
应付销售服务费	-	-	-	104,943.91	104,943.91
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	121,734.22	121,734.22
应付利润	-	-	-	581,889.83	581,889.83
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	613,333.71	613,333.71
负债总计	415,542,656.92	-	-	4,198,280.44	419,740,937.36
利率敏感度缺口	8,228,702,916.67	-	-	58,622,981.04	8,287,325,897.71
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,760,212,560.64	-	-	-	-1,760,212,560.64
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	26,585.78	-	-	-	-26,585.78
交易性金融资产	3,717,212,478.74	-	-	-	-3,717,212,478.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,886,645,869.21	-	-	-	-1,886,645,869.21
应收清算款	-	-	-	12,557,680.31	12,557,680.31
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	405,075,245.31	405,075,245.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产总计	7,364,097,494.37	-	-417,632,925.62	7,781,730,419.99
负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	295,259,373.03	-	-	295,259,373.03
应付清算款	-	-	40,580,297.80	40,580,297.80
应付赎回款	-	-	7,007.80	7,007.80
应付管理人报酬	-	-	1,269,000.30	1,269,000.30
应付托管费	-	-	355,320.11	355,320.11
应付销售服务费	-	-	61,055.48	61,055.48
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	15,241.09	15,241.09
应付利润	-	-	475,982.89	475,982.89
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	482,875.91	482,875.91
负债总计	295,259,373.03	-	43,246,781.38	338,506,154.41
利率敏感度缺口	7,068,838,121.34	-	-374,386,144.24	7,443,224,265.58

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者予以分类。

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(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	市场利率增加 0.25%	-2,769,621.78	-1,993,659.58
市场利率减少 0.25%	2,773,034.86	1,996,052.62	

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化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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 2023 年 06 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	5,588,327,737.82	3,717,212,478.74
第三层次	-	-
合计	5,588,327,737.82	3,717,212,478.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

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	5,588,327,737.82	64.18
	其中：债券	5,568,289,962.48	63.95
	资产支持证券	20,037,775.34	0.23
2	买入返售金融资产	2,647,917,195.29	30.41
	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	407,989,516.50	4.69
4	其他各项资产	62,832,385.46	0.72
5	合计	8,707,066,835.07	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	1.07	
	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	415,542,656.92	5.01
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

无。

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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

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	37.76	5.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	19.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	26.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	15.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	5.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.31	5.01

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	121,189,639.50	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	336,625,391.27	4.06
	其中：政策性金融债	336,625,391.27	4.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,418,603,046.33	17.12
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,691,871,885.38	44.55
8	其他	-	-
9	合计	5,568,289,962.48	67.19
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	占基金资产净值比例（%）
1	112311096	23 平安银行 CD096	3,000,000	298,390,336.04	3.60
2	112305137	23 建设银行 CD137	2,300,000	228,863,365.20	2.76
3	012381236	23 电网 SCP005	2,000,000	201,020,355.67	2.43
4	112399543	23 重庆银行 CD059	2,000,000	199,353,587.83	2.41
5	112393313	23 徽商银行 CD014	2,000,000	199,307,683.66	2.40
6	112303106	23 农业银行 CD106	2,000,000	199,234,813.71	2.40
7	112380235	23 广州银行 CD026	2,000,000	199,098,983.53	2.40
8	112209151	22 浦发银行 CD151	2,000,000	199,025,708.16	2.40
9	112395182	23 重庆农村商行 CD017	2,000,000	199,024,136.56	2.40
10	112303134	23 农业银行 CD134	2,000,000	198,941,279.15	2.40

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	0.0681%
报告期内偏离度的最低值	-0.0050%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0199%

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

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	180908	至信 17 优	100,000	10,031,857.53	0.12
2	199948	至信 18 优	100,000	10,005,917.81	0.12

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

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，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

7.9.2 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的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	11,123.98
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	62,821,261.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	62,832,385.46

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
前海开源货币 A	13,027	4,810.37	31,503,051.26	50.27%	31,161,684.15	49.73%
前海开源货币 B	66	123,243,899.09	8,119,015,973.57	99.81%	15,081,366.68	0.19%
前海开源	29,296	3,091.34	1,121.72	0.00%	90,562,700.3	100.00%

货币 E					3	
合计	42,389	195,506.52	8,150,520,146.55	98.35%	136,805,751.16	1.65%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	1,004,793,189.23	12.12%
2	基金类机构	999,999,000.00	12.07%
3	银行类机构	811,390,672.26	9.79%
4	银行类机构	710,006,122.14	8.57%
5	基金类机构	500,153,793.69	6.04%
6	券商类机构	500,026,235.75	6.03%
7	券商类机构	477,604,033.41	5.76%
8	基金类机构	400,000,000.00	4.83%
9	银行类机构	306,310,660.19	3.70%
10	保险类机构	270,353,480.98	3.26%

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	前海开源货币 A	2,126,212.01	3.3930%
	前海开源货币 B	0.00	0.0000%
	前海开源货币 E	32,396.68	0.0358%
	合计	2,158,608.69	0.0260%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	前海开源货币 A	10~50
	前海开源货币 B	0
	前海开源货币 E	0~10

	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源货币 A	0~10
	前海开源货币 B	0
	前海开源货币 E	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
基金合同生效日（2015 年 09 月 29 日） 基金份额总额	34,070,939.93	2,042,206,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	48,512,252.71	7,391,789,380.48	2,922,632.39
本报告期基金总申购份额	115,571,129.38	48,813,763,435.82	312,237,046.83
减：本报告期基金总赎回份额	101,418,646.68	48,071,455,476.05	224,595,857.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	62,664,735.41	8,134,097,340.25	90,563,822.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有

关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	1,101,436.00	0.84%	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	129,952,547.01	99.16%	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2023年01月19日
2	前海开源现金增利货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
3	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2023年02月08日
4	前海开源现金增利货币市场基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
5	前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
6	前海开源现金增利货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月22日
7	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2023年04月27日
8	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月04日
9	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月15日
10	关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023年06月08日
11	关于前海开源现金增利货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2023年06月20日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230331-20230	1,099,601,916	3,505,526,918	2,898,966,739	1,706,162,095	20.59%

	403	.00	.16	.01	.15	
产品特有风险						
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>						

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) 中国证券监督管理委员会批准前海开源现金增利货币市场基金设立的文件
- (2) 《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》
- (3) 《前海开源现金增利货币市场基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源现金增利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

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司

2023 年 08 月 31 日