

新疆前海联合海盈货币市场基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:新疆前海联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

报告送出日期:2022 年 03 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月25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。

本年度报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2021年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 债券回购融资情况.....	44
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
8.8 期末按摊余成本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.....	47
8.9 投资组合报告附注.....	47
§ 9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
9.4 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.....	49
§ 10 开放式基金份额变动	50
§ 11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议.....	50
11.2 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.....	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4 基金投资策略的改变.....	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
11.9 其他重大事件.....	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	56
12.1 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.....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§ 13 备查文件目录	56
13.1 备查文件目录.....	56
13.2 存放地点.....	57
13.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合海盈货币市场基金	
基金简称	新疆前海联合海盈货币	
基金主代码	002247	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 24 日	
基金管理人	新疆前海联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	3,561,087,198.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
下属分级基金的交易代码	002247	002248
报告期末下属分级基金的份 额总额	9,998,456.51 份	3,551,088,742.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对货币市场利率走势的预判，采取利率策略、信用策略、久期管理策略、债券回购策略等积极投资策略，在满足基金流动性需求并严格控制风险的前提下，减少基金资产净值波动，力争获取超越比较基准的投资收益。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、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		新疆前海联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	邱张斌	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95588
传真		0755-82780000	010-66105798
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区桂湾四路 197	北京市西城区复兴门内大街

	号前海华润金融中心 T1 栋 第 28 和 29 层	55 号
邮政编码	518057	100140
法定代表人	吴昱村	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.qh1hfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号 赛特广场 5 层
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市南山区桂湾四路 197 号前 海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年		2020 年		2019 年	
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
本期已实现收益	600,447.17	108,281,387.61	833,758.20	120,953,124.95	940,405.91	141,217,896.28
本期利润	600,447.17	108,281,387.61	833,758.20	120,953,124.95	940,405.91	141,217,896.28
本期净值收益率	2.1948%	2.4518%	2.0939%	2.3497%	2.5513%	2.8082%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末基金资产净值	9,998,456.51	3,551,088,742.25	45,294,919.86	10,250,572,338.62	41,588,638.57	7,086,251,845.99
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.000	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
累计净值收益率	17.9216%	19.7170%	15.3890%	16.8520%	13.0224%	14.1694%

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、本基金收益分配方式是按日结转份额。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

新疆前海联合海盈货币 A 净值表现

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	0.5286%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.4392%	0.0007%
过去六个月	1.0393%	0.0008%	0.1789%	0.0000%	0.8604%	0.0008%
过去一年	2.1948%	0.0009%	0.3549%	0.0000%	1.8399%	0.0009%
过去三年	6.9966%	0.0014%	1.0656%	0.0000%	5.9310%	0.0014%
过去五年	15.1109%	0.0025%	1.7753%	0.0000%	13.3356%	0.0025%
自基金合同生效起至今	17.9216%	0.0030%	2.1389%	0.0000%	15.7827%	0.0030%

新疆前海联合海盈货币 B 净值表现

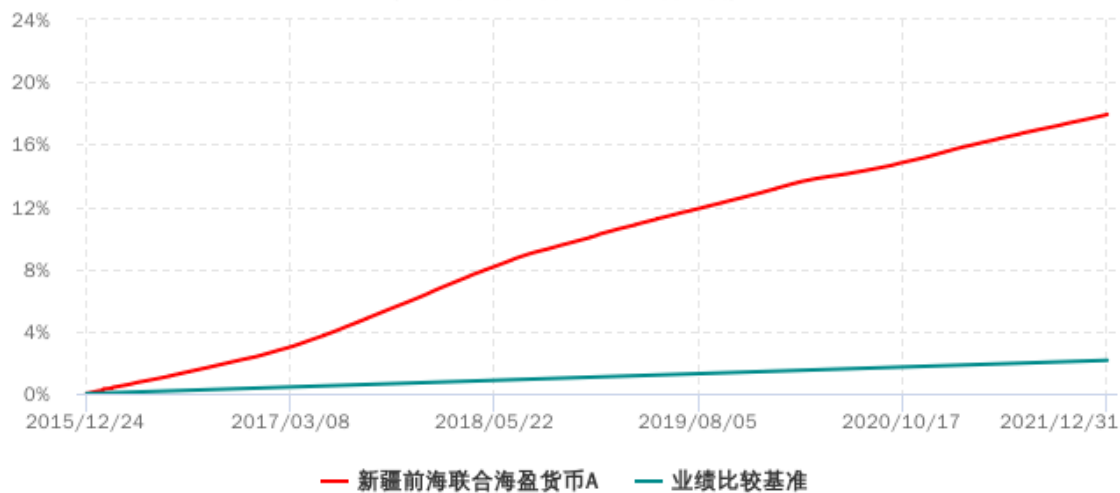
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5923%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.5029%	0.0007%
过去六个月	1.1675%	0.0008%	0.1789%	0.0000%	0.9886%	0.0008%
过去一年	2.4518%	0.0009%	0.3549%	0.0000%	2.0969%	0.0009%
过去三年	7.8038%	0.0014%	1.0656%	0.0000%	6.7382%	0.0014%
过去五年	16.5654%	0.0025%	1.7753%	0.0000%	14.7901%	0.0025%
自基金合同生效起至今	19.7170%	0.0030%	2.1389%	0.0000%	17.5781%	0.0030%

注:1、本基金业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

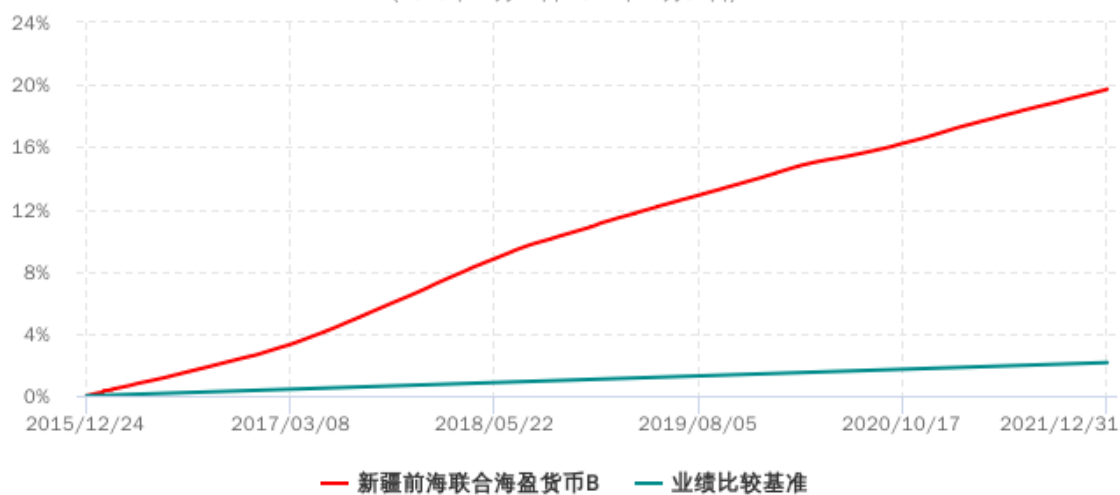
2、本基金收益分配方式是按日结转份额。

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

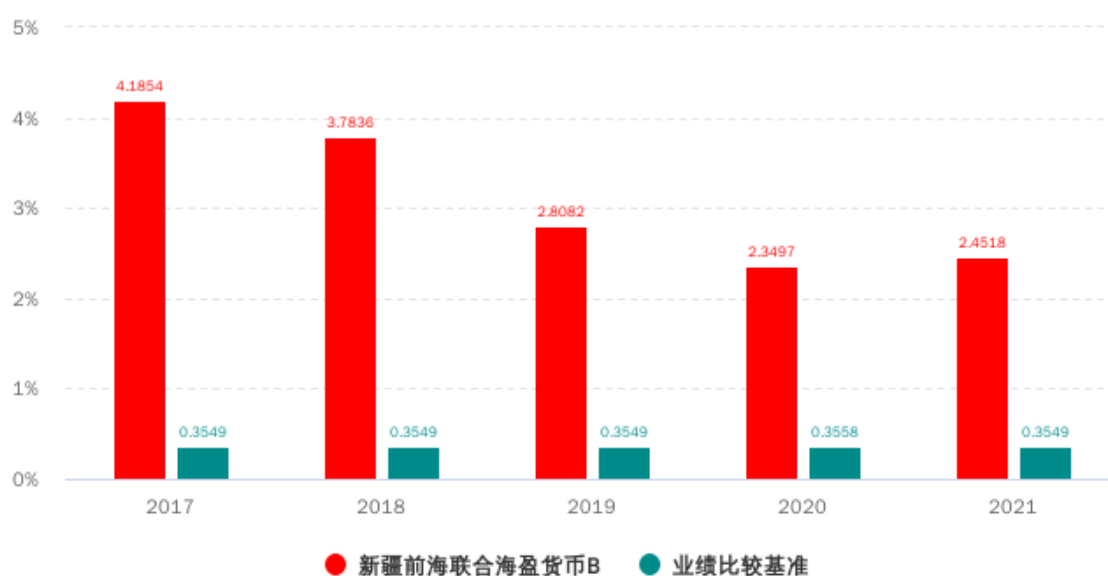
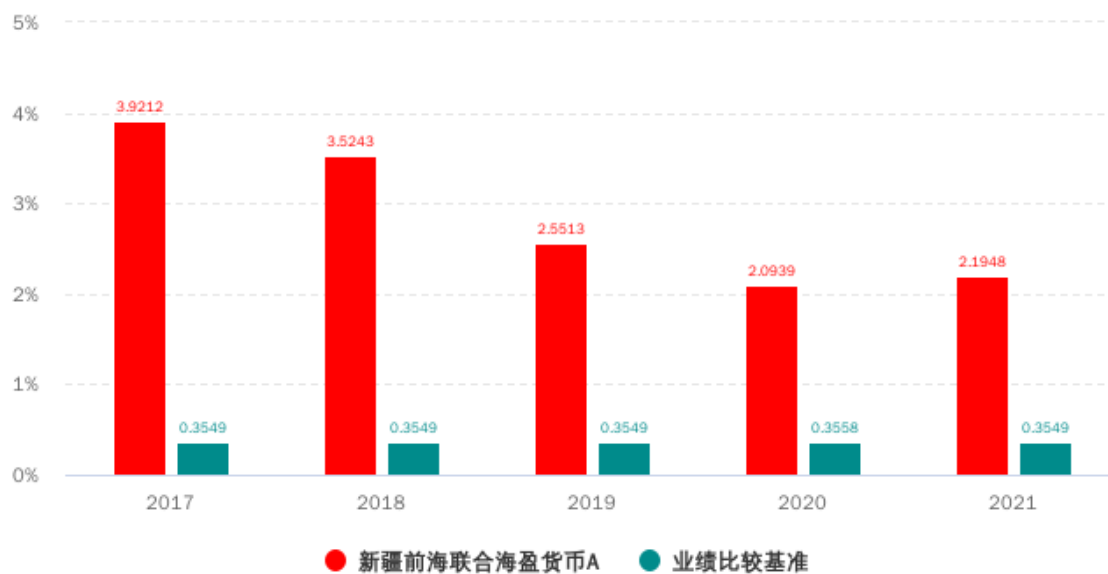
新疆前海联合海盈货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月24日-2021年12月31日)



新疆前海联合海盈货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月24日-2021年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

新疆前海联合海盈货币 A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021	602,885.71	-	-2,438.54	600,447.17	-
2020	833,574.15	-	184.05	833,758.20	-
2019	958,364.85	-	-17,958.94	940,405.91	-
合计	2,394,824.7	-	-20,213.43	2,374,611.2	-

	1			8	
--	---	--	--	---	--

新疆前海联合海盈货币 B

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021	108,769,192.31	-	-487,804.70	108,281,387.61	-
2020	120,714,368.85	-	238,756.10	120,953,124.95	-
2019	143,092,754.56	-	-1,874,858.28	141,217,896.28	-
合计	372,576,315.72	-	-2,123,906.88	370,452,408.84	-

§ 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

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 2 亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理 32 只开放式基金，包括 2 只货币市场基金、15 只债券型基金、13 只混合型基金、1 只指数型基金和 1 只基金中基金（FOF），另管理 3 只专户理财产品，管理资产总规模超过 309 亿元人民币。

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		
曾婷婷	本基金的基金经理	2016-09-05	-	10 年	曾婷婷女士，北京大学 MBA，CPA，10 年证券基金投资研究经验。曾任安永会计师事务所深圳分所高级审计、第一创业证券研究所合规经理、华润元大基金管理有限公司固定收益部研究员、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理（自 2017 年 7 月 3 日

				<p>至 2021 年 5 月 17 日)、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 7 月 5 日至 2021 年 5 月 17 日)、新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 24 日至 2021 年 12 月 10 日)、新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 26 日至 2021 年 12 月 22 日)、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理(自 2016 年 9 月 5 日至 2022 年 3 月 4 日)、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 24 日至 2022 年 3 月 4 日)和新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 26 日至 2022 年 3 月 4 日)。曾婷婷女士已于 2022 年 3 月离职。</p>	
张文	本基金的基金经理	2021-05-18	-	9 年	<p>张文先生, 硕士, 9 年证券投资基金投资研究经验。曾任中山证券有限责任公司固定收益部交易员、第一创业证券股份有限公司资产管理部高级交易经理、深圳慈曜资产管理有限公司交易管理部交易主管、新疆前海联合基金管理有限公司基金经理助理、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 20 日至 2021 年 9 月 14 日)和新疆前海联合泓旭纯债 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 1 月 5 日)。现任新疆前海联合泓元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2020</p>

					<p>年 10 月 28 日起任职)、新疆前海联合淳安纯债 3 年定期开放债券型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 10 月 28 日起任职)、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 10 月 29 日起任职)、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理 (自 2020 年 12 月 1 日起任职)、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2021 年 5 月 18 日起任职)、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理 (自 2022 年 3 月 5 日起任职) 和新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2022 年 3 月 5 日起任职)。</p>
张雅洁	本基金的基金经理 (已离任)	2015-12-24	2021-02-09	11 年	<p>张雅洁女士, 悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士, 11 年证券基金投资研究经验。2013 年 6 月至 2015 年 9 月在博时基金从事固定收益研究和投资工作, 曾担任博时上证企债 30ETF 等基金的基金经理助理, 2010 年 2 月至 2013 年 5 月在融通基金从事信用债研究工作。</p>

				<p>2015年9月加入前海联合基金，2021年8月离职。曾任新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金经理（自2018年4月10日至2021年5月18日）、新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理（自2020年5月21日至2021年5月18日）、新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金经理（自2020年8月13日至2021年5月18日）、新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金（后转型为新疆前海联合添鑫3个月定期开放债券型证券投资基金）基金经理（自2016年10月18日至2019年9月24日）、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的基金经理（自2016年11月11日至2019年9月22日）、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理（自2015年12月24日至2021年2月8日）、新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年12月7日至2021年3月4日）、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金基金经理（自2019年5月23日至2021年3月4日）、新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年8月14日至2021年3月4日）、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金经理（自2018年9月6日至2021年3月4日）、新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金经理（自2019年1月10日至2021年</p>
--	--	--	--	--

					2月8日)和新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自2021年4月20日至2021年5月18日)。
--	--	--	--	--	---

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”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、曾婷婷已于2022年3月5日起离任本基金基金经理职务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，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，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 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》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个业务环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

4.3.3 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公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

2021 年债市围绕经济基本面的主线进行。上半年同比基数低，经济数据较为亮眼，但下半年开始经济有所下滑，全年看经济数据前高后低。出口在全年表现出很强的韧性，是贡献全年经济的重要因素。房地产政策收紧，房地产投资大幅下滑，基建乏力，制造业投资改善有限，导致固定资产投资增速大幅下滑。社消在上半年有所改善，但在疫情反复冲击下，下半年较为萎靡。

PPI 持续走高，CPI 受猪价拖累上行幅度有限，通胀对货币政策暂无影响。基本面下行压力较大，资金面在 1 月末有超预期收紧，但全年资金面宽松，特殊时点有所波动。货币政策中性偏松，7 月、12 月分别下调金融机构存款准备金率，1 年 LPR 也小幅下调。

美国经济有所恢复，通胀上升，美联储开始进行 taper，但因中美货币政策有错位，对国内整体影响有限。

房地产企业政策收紧导致房地产企业的流动性较为紧张，从而引发市场上房企债券的信用风险。4 季度房地产信贷策略有放松，但对房地产政策更多是前期的纠偏，并非转向。

2021 年基本面以及货币政策偏友好，债券市场震荡走出了一波小牛行情，5 年国开和 10 年国开分别下行了 41bp、45bp 至 2.78%、3.08%。Shibor3M 下行 26bp 至 2.5%。

报告期内，本基金持仓主要以同业存单、中短期存款为主，在资金紧张时点，通过逆回购来增加超额收益。本基金维持了较好的静态收益，远超业绩比较基准，同时流动性未出现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求以及大额赎回申请。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末新疆前海联合海盈货币 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 2.1948%，同期业绩比较基准收益率为 0.3549%；截至报告期末新疆前海联合海盈货币 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 2.4518%，同期业绩比较基准收益率为 0.3549%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议要求 2022 年稳字当头、稳中求进，政策发力适当靠前，稳增长成为 2022 年宏观经济的首要任务。高质量发展是稳增长的前提。

当前我国经济发展面临需求收缩，供给冲击，预期转弱三重压力。房地产投资、基建投资、制造业投资、社零等数据仍然偏弱，随着海外经济恢复，出口也面临一定下行压力。

政策发力要适当靠前，一方面需要提前稳定市场预期，另一方面美联储加息前的时间窗

口较为有限，货币政策加码的时间有所限制。实体经济整体融资需求疲弱，宽信用需要货币政策配合，在宽信用没有实质宽下去之前，货币政策整体偏松。

预计一季度基本面和货币面在对债市而言较为友好，二季度开始需要持续跟踪经济基本面情况、实体融资需求以及海外的加息步伐，从而判断货币政策是否有进一步宽松空间。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人对公司内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定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。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，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（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定,本基金的收益分配采取“每日分配、按日支付”的方式,即根据每日基金收益情况,以每万份基金单位收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,并每日以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益 108,881,834.78 元,实际分配收益 108,881,834.78 元。

4.9 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

无。

§ 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——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合海盈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,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字(2022)第 441A004148 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新疆前海联合海盈货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了新疆前海联合海盈货币市场基金(以下简称“新疆前海联合海盈货币基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了新疆前海

	联合海盈货币基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新疆前海联合海盈货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	新疆前海联合海盈货币基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的管理层对其他信息负责。其他信息包括新疆前海联合海盈货币基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新疆前海联合海盈货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算新疆前海联合海盈货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督新疆前海联合海盈货币基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风

	<p>险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能对新疆前海联合海盈货币基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致新疆前海联合海盈货币基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	致同会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	邢向宗 罗寿华
会计师事务所的地址	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
审计报告日期	2022-03-28

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合海盈货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,299,071,400.63	2,445,146,721.64
结算备付金		-	476,728.01
存出保证金		23,211.48	46,490.46
交易性金融资产	7.4.7.2	857,401,716.63	3,711,502,998.04
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		857,401,716.63	3,701,502,998.04
资产支持证券投资		-	10,000,000.00
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,399,875,489.80	4,090,207,337.83
应收证券清算款		-	30,785,203.92
应收利息	7.4.7.5	7,517,707.75	21,524,838.57
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	106,973.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,563,890,026.29	10,299,797,292.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	5,031.48
应付管理人报酬		213,125.01	631,546.46
应付托管费		71,041.69	210,515.48
应付销售服务费		2,261.94	9,258.51
应付交易费用	7.4.7.7	70,190.94	89,714.26
应交税费		-	815.67
应付利息		-	-
应付利润		327,907.95	818,151.19
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,118,300.00	2,165,000.75
负债合计		2,802,827.53	3,930,033.80
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,561,087,198.76	10,295,867,258.48
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,561,087,198.76	10,295,867,258.48
负债和所有者权益总计		3,563,890,026.29	10,299,797,292.28

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,561,087,198.76 份。其中新疆前海联合海盈货币 A 基金份额净值 1 元，基金份额总额 9,998,456.51 份；新疆前海联合海盈货币 B 基金份额净值 1 元，基金份额总额 3,551,088,742.25 份。

7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合海盈货币市场基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至
-----	-----	---------------------------------------	---------------------------

		日	2020 年 12 月 31 日
一、收入		119,314,566.49	137,595,213.01
1. 利息收入		117,187,681.16	134,192,480.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,106,455.13	45,172,319.16
债券利息收入		45,193,101.15	53,022,768.79
资产支持证券利息收入		80,462.08	101,726.11
买入返售金融资产收入		37,807,662.80	35,895,666.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,126,885.33	3,402,732.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,126,885.36	3,402,684.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-0.03	47.73
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		10,432,731.71	15,808,329.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,722,169.09	7,879,152.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,240,723.14	2,626,384.19
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	67,791.39	99,256.20
4. 交易费用	7.4.7.19	42,450.00	117,445.01
5. 利息支出		1,112,853.84	4,782,090.32
其中：卖出回购金融资产支出		1,112,853.84	4,782,090.32
6. 税金及附加		289.80	752.59
7. 其他费用	7.4.7.20	246,454.45	303,248.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		108,881,834.78	121,786,883.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		108,881,834.78	121,786,883.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合海盈货币市场基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,295,867,258.48	-	10,295,867,258.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,881,834.78	108,881,834.78
三、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）	-6,734,780,059.72	-	-6,734,780,059.72
其中：1. 基金申购款	14,283,702,901.61	-	14,283,702,901.61
2. 基金赎回款	-21,018,482,961.33	-	-21,018,482,961.33
四、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）	-	-108,881,834.78	-108,881,834.78
五、期末所有者权益（基金净值）	3,561,087,198.76	-	3,561,087,198.76
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,127,840,484.56	-	7,127,840,484.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	121,786,883.15	121,786,883.15
三、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）	3,168,026,773.92	-	3,168,026,773.92
其中：1. 基金申购款	20,186,700,287.24	-	20,186,700,287.24
2. 基金赎回款	-17,018,673,513.32	-	-17,018,673,513.32
四、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）	-	-121,786,883.15	-121,786,883.15

五、期末所有者权益 (基金净值)	10,295,867,258.48	-	10,295,867,258.48
---------------------	-------------------	---	-------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

吴昱村	吴昱村	陈艳
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新疆前海联合海盈货币市场基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2800号《关于准予新疆前海联合海盈货币市场基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联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》、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》和《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书》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 13,411,070,976.88 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(2015)第 1401 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》于 2015 年 12 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 13,413,997,659.56 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,926,682.68 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联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。

本基金分设 A 类和 B 类两类基金份额,两类基金份额分别设置基金代码,按照不同的费率计提销售服务费,并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。本基金根据投资者首次申购的最低金额是否不低于 500 万元进行不同级别基金份额的判断和处理。投资者可自行选择申购的基金份额等级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合海盈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,通知存款,期限在一年以内(含一年)的银行存款,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的同业存单,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的非金融企业债务融资工具,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:活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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》、《基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为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当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合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,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格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偏离度绝对值达到或超过 0.25%时,基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施,使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应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,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 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 类和 B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资或资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，下一工作日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	4,071,400.63	5,146,721.64
定期存款	1,295,000,000.00	2,440,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	210,000,000.00	900,000,000.00
存款期限 1-3 个月	555,000,000.00	600,000,000.00
存款期限 3 个月以上	530,000,000.00	940,000,000.00
其他存款	-	-
合计	1,299,071,400.63	2,445,146,721.64

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)	
债券	交易所市场	3,000,731.70	3,000,600.00	-131.70	0.0000
	银行间市场	854,400,984.93	855,031,000.00	630,015.07	0.0177

	合计	857,401,716.63	858,031,600.00	629,883.37	0.0177
资产支持证券		-	-	-	-
	合计	857,401,716.63	858,031,600.00	629,883.37	0.0177
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	92,901,781.38	92,877,707.70	-24,073.68	-0.0002
	银行间市场	3,608,601,216.66	3,610,884,400.00	2,283,183.34	0.0222
	合计	3,701,502,998.04	3,703,762,107.70	2,259,109.66	0.0219
资产支持证券		10,000,000.00	10,025,000.00	25,000.00	0.0002
	合计	3,711,502,998.04	3,713,787,107.70	2,284,109.66	0.0221

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,399,875,489.80	-
合计	1,399,875,489.80	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	105,000,000.00	-
银行间市场	3,985,207,337.83	-
合计	4,090,207,337.83	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	538.98	1,610.92
应收定期存款利息	2,738,794.22	5,515,632.46
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	235.95
应收债券利息	4,159,795.88	13,673,499.07
应收资产支持证券利息	-	29,036.71
应收买入返售证券利息	618,567.23	2,304,800.47
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	11.44	22.99
合计	7,517,707.75	21,524,838.57

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	70,190.94	89,714.26
合计	70,190.94	89,714.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.75
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	187,300.00	234,000.00
其他应付	1,931,000.00	1,931,000.00
合计	2,118,300.00	2,165,000.75

7.4.7.9 实收基金

新疆前海联合海盈货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,294,919.86	45,294,919.86
本期申购	137,773,792.02	137,773,792.02
本期赎回（以“-”号填列）	-173,070,255.37	-173,070,255.37
本期末	9,998,456.51	9,998,456.51

新疆前海联合海盈货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,250,572,338.62	10,250,572,338.62
本期申购	14,145,929,109.59	14,145,929,109.59
本期赎回（以“-”号填列）	-20,845,412,705.96	-20,845,412,705.96
本期末	3,551,088,742.25	3,551,088,742.25

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

新疆前海联合海盈货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	600,447.17	-	600,447.17
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	-600,447.17	-	-600,447.17
本期末	-	-	-

新疆前海联合海盈货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	108,281,387.61	-	108,281,387.61
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	-108,281,387.61	-	-108,281,387.61
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,461.61	39,362.28
定期存款利息收入	34,077,853.43	45,097,292.64
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	5,769.24	34,810.86
其他	370.85	853.38
合计	34,106,455.13	45,172,319.16

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,126,885.36	3,402,684.56
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	2,126,885.36	3,402,684.56

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券 (、债转股及债券 到期兑付) 成交总额	11,626,899,480.01	15,899,205,746.71
减: 卖出债券 (、债转股及 债券到期兑付) 成本总额	11,572,357,709.46	15,818,167,622.01
减: 应收利息总额	52,414,885.19	77,635,440.14
买卖债券差价收入	2,126,885.36	3,402,684.56

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	10,001,925.27	11,532,100.50
减：卖出资产支持证券成本 总额	10,000,000.00	11,438,358.78
减：应收利息总额	1,925.30	93,693.99
资产支持证券投资收益	-0.03	47.73

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
----	--	--

交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	42,450.00	117,445.01
合计	42,450.00	117,445.01

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	105,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	60,794.45	41,048.86
账户维护费	35,660.00	36,000.00
其他	-	1,200.00
律师费用	-	-
合计	246,454.45	303,248.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、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
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
凯信恒有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,722,169.09	7,879,152.69
其中：支付销售机构的客户维护费	156,158.75	73,930.52

注：支付基金管理人新疆前海联合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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,240,723.14	2,626,384.19

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	63,392.81	-	63,392.81
合计	63,392.81	-	63,392.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	合计

新疆前海联合基金 管理有限公司	87,739.99	-	87,739. 99
合计	87,739.99	-	87,739. 99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构；B 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：
日销售服务费 = 前一日 A 类基金份额的基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

新疆前海联合海盈货币 A

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2015 年 12 月 24 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	260.04	100,000.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	100,260.04	-
报告期末持有的基金份额	0.00	100,000.00
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	0.0000%	0.0010%

新疆前海联合海盈货币 B

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2015 年 12 月 24 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,005,888.65	-
报告期间申购/买入总份额	46,744,800.82	8,005,888.65
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	16,030,461.67	-
报告期末持有的基金份额	38,720,227.80	8,005,888.65
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	1.0873%	0.0778%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、本基金管理人投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
无。

7.4.10.5 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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	4,071,400.63	22,461.61	5,146,721.64	39,362.28

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明
无。

7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金
新疆前海联合海盈货币 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
602,885.71	-	-2,438.54	600,447.17	-

新疆前海联合海盈货币 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
108,769,192.31	-	-487,804.70	108,281,387.61	-

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，主要投资于各类货币市场工具，其预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、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。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。

7.4.13.2 信用风险

7.4.13.2.1 信用风险披露

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国工商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。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。

7.4.13.2.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	145,003,762.03
A-1 以下	-	-
未评级	153,038,986.31	163,610,440.82
合计	153,038,986.31	308,614,202.85

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债。

7.4.13.2.3 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	10,000,000.00
A-1 以下	-	-
AAA	-	0.00
未评级	-	-
合计	-	10,000,000.00

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	674,346,710.81	2,982,180,518.17
合计	674,346,710.81	2,982,180,518.17

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	10,064,625.26
AAA 以下	-	-

未评级	30,016,019.51	400,643,651.76
合计	30,016,019.51	410,708,277.02

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.7 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金投资组合中现金、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低

于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

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%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	6 个月 以内	6 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,299,071,400.63	-	-	-	-	1,299,071,400.63
存出保证金	23,211.48	-	-	-	-	23,211.48
交易性金融资产	758,811,899.69	98,589,816.94	-	-	-	857,401,716.63
买入返售金融资产	1,399,875,489.80	-	-	-	-	1,399,875,489.80

应收利息	-	-	-	-	7,517,707.75	7,517,707.75
应收申购款	-	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	3,457,782,001.60	98,589,816.94	-	-	7,518,207.75	3,563,890,026.29
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	213,125.01	213,125.01
应付托管费	-	-	-	-	71,041.69	71,041.69
应付销售服务费	-	-	-	-	2,261.94	2,261.94
应付交易费用	-	-	-	-	70,190.94	70,190.94
应付利润	-	-	-	-	327,907.95	327,907.95
其他负债	-	-	-	-	2,118,300.00	2,118,300.00
负债总计	-	-	-	-	2,802,827.53	2,802,827.53
利率敏感度缺口	3,457,782,001.60	98,589,816.94	-	-	4,715,380.22	3,561,087,198.76
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,405,146,721.64	40,000,000.00	-	-	-	2,445,146,721.64
结算备付金	476,728.01	-	-	-	-	476,728.01
存出保证金	46,490.46	-	-	-	-	46,490.46
交易性金融资产	3,397,888,626.91	313,614,371.13	-	-	-	3,711,502,998.04
买入返售金融资产	4,090,207,337.83	-	-	-	-	4,090,207,337.83
应收证券清算款	-	-	-	-	30,785,203.92	30,785,203.92
应收利息	-	-	-	-	21,524,83	21,524,83

					8.57	838.57
应收申购款	-	-	-	-	106,973.81	106,973.81
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,893,765,904.85	353,614,371.13	-	-	52,417,016.30	10,299,797,292.28
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	5,031.48	5,031.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	631,546.46	631,546.46
应付托管费	-	-	-	-	210,515.48	210,515.48
应付销售服务费	-	-	-	-	9,258.51	9,258.51
应付交易费用	-	-	-	-	89,714.26	89,714.26
应交税费	-	-	-	-	815.67	815.67
应付利润	-	-	-	-	818,151.19	818,151.19
其他负债	-	-	-	-	2,165,000.75	2,165,000.75
负债总计	-	-	-	-	3,930,033.80	3,930,033.80
利率敏感度缺口	9,893,765,904.85	353,614,371.13	-	-	48,486,982.50	10,295,867,258.48

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。

7.4.13.4.1.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点		563,193.81
2. 市场利率上升 25 个基点		-562,171.98	-1,898,056.48

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第二层次的余额为 857,401,716.63 元，无属于第一或第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第二层次 3,711,502,998.04 元，无第一或第三层次）。

(ii) 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股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2020 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《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”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他

重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	857,401,716.63	24.06
	其中：债券	857,401,716.63	24.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,399,875,489.80	39.28
	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	1,299,071,400.63	36.45
4	其他各项资产	7,541,419.23	0.21
5	合计	3,563,890,026.29	100.00

8.2 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	1.39	
	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个交易日融资余额占基金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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2021-01-11	23.40	海盈货币基金于 1 月 5 日至 1 月 8 日发生巨额赎回，连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上，属于被动超标情景。	2021 年 1 月 12 日债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例已调回至低于 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

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。

8.3.2 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	51.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	21.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.87	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	73,037,931.53	2.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,017,074.29	3.09
	其中：政策性金融债	110,017,074.29	3.09
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	674,346,710 .81	18.94
8	其他	-	-
9	合计	857,401,716 .63	24.08
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	112174183	21 宁波银行 CD322	1,000,000	99,653,9 18.74	2.80
2	112116150	21 上海银行 CD150	1,000,000	99,611,2 22.16	2.80
3	112108043	21 中信银行 CD043	1,000,000	99,518,4 14.97	2.79
4	112176353	21 广州农村 商业银行 CD151	900,000	88,928,2 04.05	2.50
5	210201	21 国开 01	800,000	80,001,0 54.78	2.25
6	210001	21 付息国债 01	500,000	50,011,9 92.50	1.40
7	112109191	21 浦发银行 CD191	500,000	49,443,1 70.66	1.39
8	112111149	21 平安银行 CD149	500,000	49,310,7 00.03	1.38
9	112109222	21 浦发银行 CD222	500,000	49,279,1 16.91	1.38
10	190303	19 进出 03	300,000	30,016,0 19.51	0.84

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	0.0539%
报告期内偏离度的最低值	-0.0139%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0216%

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

本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

8.8 期末按摊余成本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。

8.9 投资组合报告附注**8.9.1 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和折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明**1.21 国开 01 发债主体受监管处罚情况：**

2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日，国家开发银行大连市分行、海南省分行、陕西省分行以及广西壮族自治区分行由于擅自提供对外担保；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规行为，被当地外汇管理局、银保监局、人行等监管机构处以罚款合计 4530.91 万元，并没收违法所得 1102.66 万元。

基金管理人经审慎分析，认为国家开发银行资产规模大，经营情况良好，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对国家开发银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于国家开发银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对国家开发银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

2.19 进出 03 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日，中国进出口银行新疆维吾尔自治区分行、天津分行、海南省分行、福建省分行等 4 家分支机构由于未有效监督贷款资金用途，信贷资金未按约定用途使用，严重违反审慎经营规则；贷款“三查”不到位等违法违规事由，被当地银保监局处以罚款合 190 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日，根据银保监罚决字〔2021〕31 号，因违规投资企业股权；个别高管人员未经核准实际履职；监管数据漏报错报等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国进出口银行被银保监会处以罚款 7345.6 万元。

基金管理人经审慎分析，认为中国进出口银行资产规模大，经营情况良好，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，上述事项对中国进出口银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于中国进出口银行的决策程序说明：基于中国进出口银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国进出口银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析,认为上述事项对中国进出口银行经营和价值应不会构成重大影响,对基金运作无影响。

3.21 中信银行 CD043 发债主体受监管处罚情况:

2021 年 3 月 17 日,根据银保监罚决字(2021)5 号,因客户信息保护体制机制不健全;柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施,乱象整治自查不力等违法违规事由,依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则以及《中华人民共和国商业银行法》第七十三条,中信银行被银保监会处以 450 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析,认为中信银行资产规模大,经营情况良好,且中信银行主体评级为市场最高的 AAA 评级,实力很强,上述事项对中信银行自身信用基本面影响很小,对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于中信银行的决策程序说明:基于中信银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于中信银行,其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析,认为该事项对中信银行经营和价值应不会构成重大影响,对基金运作无影响。

8.9.3 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	23,211.48
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,517,707.75
4	应收申购款	500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,541,419.23

8.9.4 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,分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
新疆前海联合海盈货币 A	20,769	481.41	430,426.41	4.30%	9,568,030.10	95.70%
新疆前海联合海盈	63	56,366.487.97	3,551,088,742.25	100.00%	-	-

货币 B						
合计	20,832	170,943.13	3,551,519,168.66	99.73%	9,568,030.10	0.27%

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。

9.2 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）	占上市总份额比例（%）
1	银行类机构	547,806,026.06	15.38%
2	其他机构	400,000,000.00	11.23%
3	银行类机构	205,280,068.93	5.76%
4	券商类机构	200,120,514.72	5.62%
5	基金类机构	200,035,536.95	5.62%
6	其他机构	200,000,000.00	5.62%
7	保险类机构	100,326,397.74	2.82%
8	保险类机构	100,060,257.38	2.81%
9	信托类机构	100,053,916.70	2.81%
10	基金类机构	100,025,366.32	2.81%

注：持有人类别包括银行类机构、保险类机构、券商类机构、信托类机构、基金类机构、其他机构、个人。

9.3 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	新疆前海联合海盈货币 A	1,048,996.77	10.4916%
	新疆前海联合海盈货币 B	-	-
	合计	1,048,996.77	0.0295%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金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）。

9.4 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	新疆前海联合海盈货币 A	10~50
	新疆前海联合海盈货币 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基	新疆前海联合	0~10

金	海盈货币 A	
	新疆前海联合海盈货币 B	-
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
基金合同生效日（2015 年 12 月 24 日）基金份额总额	1,071,131.75	13,412,926,527.81
本报告期期初基金份额总额	45,294,919.86	10,250,572,338.62
本报告期基金总申购份额	137,773,792.02	14,145,929,109.59
减：本报告期基金总赎回份额	173,070,255.37	20,845,412,705.96
本报告期期末基金份额总额	9,998,456.51	3,551,088,742.25

注：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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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、以下为基金管理人变动信息：

王晓耕女士自 2021 年 4 月 15 日起不再担任公司总经理职务，张永任先生自 2021 年 4 月 15 日起代为履行公司总经理职责；吴昱村先生自 2021 年 5 月 26 日起担任公司总经理，张永任先生不再代为履行总经理职责；邹文庆先生自 2021 年 6 月 21 日起担任公司总经理助理；周明先生自 2021 年 8 月 10 日起离任公司总经理助理职务。

经 2021 年 4 月 12 日召开的公司股东会 2021 年第 1 次临时会议与会股东一致审议通过，段军山先生接替孙学致先生担任公司独立董事。

经 2021 年 4 月 17 日召开的公司股东会 2021 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，王晓耕女士辞去公司第二届董事会董事职务。

经 2021 年 5 月 28 日召开的公司股东会 2021 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，聘任吴昱村先生担任公司第二届董事会董事。

经 2021 年 6 月 28 日召开的公司股东会 2021 年定期会议与会股东一致审议通过，乔宗利先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由孙莉女士担任公司第二届董事会董事。经 2021 年 7 月 16 日召开的公司第二届董事会 2021 年第 10 次临时会议与会董事一致审议通过，孙莉女士担任公司第二届董事会副董事长。

经公司 2021 年职工大会的三分之二以上（含）职工推举，杨丝喃女士自 2021 年 8 月 4 日起，接替赵伟先生担任公司第二届职工监事。

2、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

因业务开展需要，经本公司董事会 2021 年第 3 次临时会议审议通过并经全体独立董事同意，本基金自 2021 年 5 月 28 日起，改聘致同会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已通知基金托管人或经基金托管人同意。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 25,000.00 元。

11.6 管理人、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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

公司						
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、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《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第2点规定执行；

（2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2、本报告期内，新增交易单元：五矿证券，退租交易单元：无。

11.7.2 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		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
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

五矿 证券 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券 股份 有限 公司	934,5 92,37 6.20	98.83%	156,1 00,00 0.00	100.00%	-	-	-	-
华创 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券 股份 有限 公司	11,05 5,924 .80	1.17%	-	-	-	-	-	-
华金 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

11.9 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	前海联合海盈货币基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-01-22
2	前海联合海盈货币基金 2021 年春节假期前暂停非直销渠道大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-02-06
3	前海联合海盈货币市场基金基金经理变更公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-02-09
4	前海联合基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销柜台首次申购及追加申购单笔最低金额的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-02-27
5	关于前海联合基金网上交易平台暂停快速赎回服务的提示	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-09
6	关于前海联合基金网上交易平台暂停快速赎回服务的提示	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-12
7	关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-20
8	关于前海联合基金网上交易平台暂停快速赎回服务的提示	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-21
9	前海联合海盈货币市场基金 2020 年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-31
10	前海联合海盈货币基金 2021 年清明节假期前暂停非直销渠道大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-31
11	关于前海联合基金网上交易平台暂停快速赎回服务的提示	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-04-09
12	关于前海联合基金网上交易	证券时报、中国证监会基金	2021-04-30

	平台暂停快速赎回服务的提示	电子披露网站及基金管理人网站	
13	前海联合海盈货币基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-04-22
14	前海联合海盈货币基金 2021 年劳动节假期前暂停非直销渠道大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-04-28
15	前海联合海盈货币基金基金经理变更公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-05-18
16	前海联合基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告（一）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-06-01
17	前海联合海盈货币基金 2021 年端午节假期前暂停非直销渠道大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-06-09
18	前海联合海盈货币市场基金 2021 年第二季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-07-21
19	前海联合海盈货币市场基金 2021 年中期报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-08-30
20	前海联合海盈货币市场基金 2021 年中秋节假期前暂停非直销渠道大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-09-15
21	前海联合海盈货币市场基金 2021 年国庆节假期前暂停非直销渠道大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-09-28
22	前海联合海盈货币市场基金 2021 年第三季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-10-27
23	前海联合海盈货币市场基金 2022 年元旦假期前暂停非直销渠道大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-12-29

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210624-20210628; 20210922-20210928	104,239 ,120.86	712,581 ,324.88	816,820 ,445.74	0.00	0.00%
	2	20210511-20210511; 20210518-20210518; 20210524-20210622	0.00	909,393 ,597.34	909,393 ,597.34	0.00	0.00%
	3	20210326-20210401; 20210428-20210629; 20210702-20210708; 20210726-20210803; 20210817-20211228	1,024,7 26,439. 55	23,079, 586.51	500,000 ,000.00	547,806 ,026.06	15.38%
	4	20211029-20211118	0.00	509,998 ,744.37	509,998 ,744.37	0.00	0.00%
	5	20210629-20210629	1,500,5 61,137. 16	1,000,8 44,366. 91	2,501,4 05,504. 07	0.00	0.00%
	6	20210101-20210107	2,800,3 89,366. 63	601,728 ,761.58	3,402,1 18,128. 21	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：报告期内申购份额包含红利再投资份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合海盈货币市场基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合海盈货币市场基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

13.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司
二〇二二年三月三十日