

新疆前海联合汇盈货币市场基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月26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2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1. 1 重要提示	1
1. 2 目录	2
§ 2 基金简介	5
2. 1 基金基本情况	5
2. 2 基金产品说明	5
2. 3 基金管理人和基金托管人	5
2. 4 信息披露方式	6
2. 5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3. 1 主要会计数据和财务指标	6
3. 2 基金净值表现	7
3. 3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4. 1 基金管理人及基金经理情况	8
4. 2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4. 3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4. 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14

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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 债券回购融资情况	36
7.3 基金投资组合平均剩余期限	36
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	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37
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	37
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	38
7.9 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	42
10.9 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合汇盈货币市场基金	
基金简称	前海联合汇盈货币	
基金主代码	004699	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 05 月 25 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,206,731.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合汇盈货币 A	前海联合汇盈货币 B
下属分级基金的交易代码	004699	004700
报告期末下属分级基金的份额总额	2,192,373.33 份	14,357.71 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹文庆(代履职)
	联系电话	0755-82780666
	电子邮箱	service@qhlfund.com
客户服务电话	400-640-0099	95580
传真	0755-82780000	010-86353609
注册地址	新疆乌鲁木齐经济技	北京市西城区金融大

	术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	街 3 号
办公地址	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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518057	100808
法定代表人	邹文庆（代履职）	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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（2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日）	
	前海联合汇盈货币 A	前海联合汇盈货币 B
本期已实现收益	8,945.18	73.37
本期利润	8,945.18	73.37
本期净值收益率	0.3899%	0.5136%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末基金资产净值	2,192,373.33	14,357.71
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
累计净值收益率	17.7997%	20.1242%

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

前海联合汇盈货币 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
过去一个月	0.0544%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.0252%	0.0001%
过去三个月	0.1733%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.0848%	0.0002%
过去六个月	0.3899%	0.0004%	0.1760%	0.0000%	0.2139%	0.0004%
过去一年	0.7982%	0.0003%	0.3549%	0.0000%	0.4433%	0.0003%
过去三年	3.3046%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	2.2390%	0.0010%
自基金合同生效起至今	17.7997%	0.0035%	2.8768%	0.0000%	14.9229%	0.0035%

前海联合汇盈货币 B 净值表现

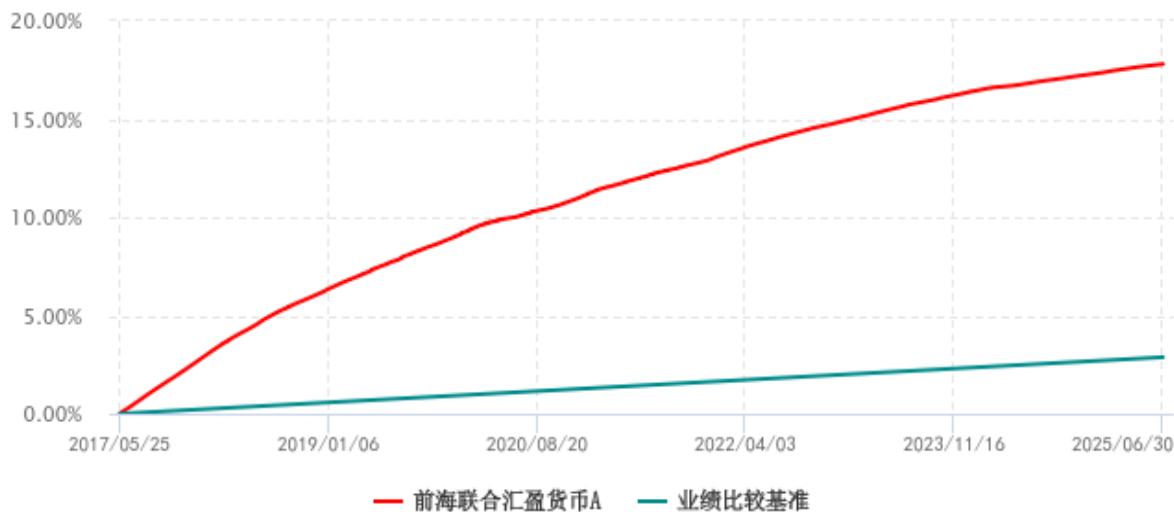
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0749%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.0457%	0.0001%
过去三个月	0.2357%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.1472%	0.0002%
过去六个月	0.5136%	0.0004%	0.1760%	0.0000%	0.3376%	0.0004%
过去一年	1.0494%	0.0003%	0.3549%	0.0000%	0.6945%	0.0003%
过去三年	4.0628%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	2.9972%	0.0010%
自基金合同生效起至今	20.1242%	0.0035%	2.8768%	0.0000%	17.2474%	0.0035%

注：1、本基金业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

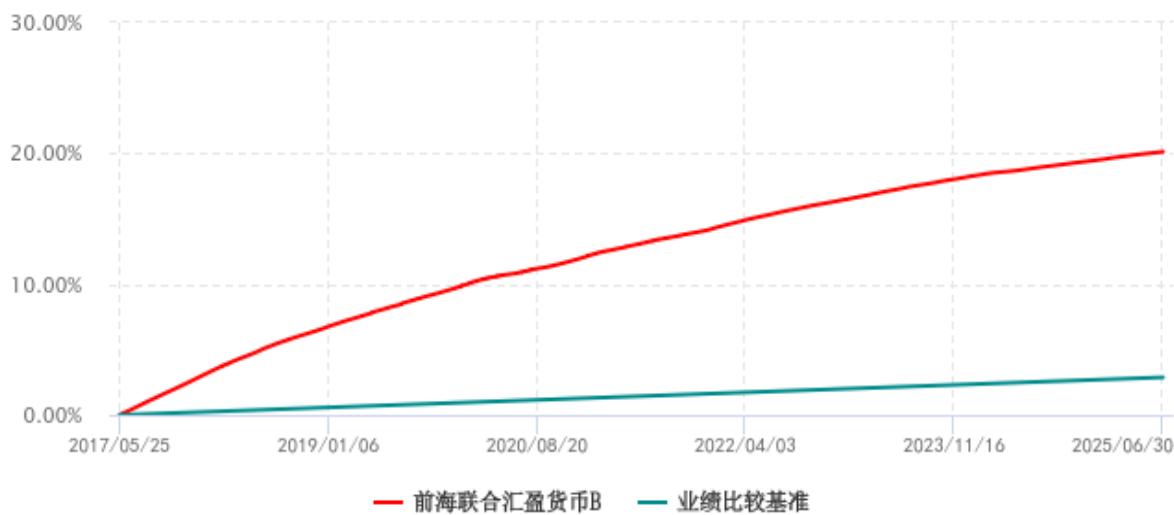
2、本基金收益分配方式是按日结转份额。

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

前海联合汇盈货币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
(2017年05月25日-2025年06月30日)



前海联合汇盈货币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
(2017年05月25日-2025年06月30日)



3.3 其他指标

无。

§ 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27只产品，包括货币型、债券型、混合型和FOF等类型。

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		
张文	本基金的基金经理	2020-12-01	-	12年	张文先生，硕士，12年证券基金投资研究交易经验。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、新疆前海联合泓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）、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) 和新疆 前海联合泓嘉 纯债债券型证 券投资基金基 金经理 (自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 7 月 27 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 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)。
--	--	--	--	--	---

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相关规定。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》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。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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，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

2025年上半年，我国经济呈现向好态势，社会信心持续提振，高质量发展扎实推进，但仍面临国内需求不足、物价持续低位运行、风险隐患较多等困难和挑战。国内方面，上半年总量数据表现亮眼，出口体现出较强韧性，社融增速稳定，但景气指标下滑，地产等指标表现一般，后续经济修复动能有望提升。国际方面，外部环境更趋复杂严峻，世界经济增长动能减弱，贸易壁垒增多，主要经济体经济表现有所分化，通胀走势和货币政策调整存在不确定性，美国4月对全球征收对等关税后，中美经贸关系实现阶段性缓和。

资金面方面，一季度资金面紧平衡，资金价格偏贵，央行5月降准降息后流动性重回充裕状态，资金价格环比下行。债市方面，一季度基本面企稳，市场对货币政策预期落空，机构止盈压力增加，收益率大幅上行，二季度初受美国关税政策影响，债市收益率大幅下行，5月12日中美谈

判断达成阶段性成果后收益率上行，之后市场窄幅波动。较年初，长债收益率略有下行，其他品种有 3-27bp 不同幅度上行，10 年国债收益率下行 3bp 至 1.65% 附近，1/3/5/10 年国开债收益率分别上行 27/15/11/-4bp 左右，1yAAA 存单/3yAAA 商金债/3yAAA 城投债/5y 二级资本债上行 5/14/3/8bp 左右，信用利差不同程度压缩，城投债表现亮眼。（数据来源：Wind）

报告期内，本基金操作以逆回购为主，资产的安全性和流动性较高。本基金流动性未出现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合汇盈货币 A 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.3899%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%；截至报告期末前海联合汇盈货币 B 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.5136%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

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 2025 年下半年，在上半年 GDP 增速 5.3% 的背景下，实现全年 5% 的经济增长目标难度不大，宏观政策可能更多转向调整结构和修复需求。具体来看，出口和工业表现有望保持韧性，地产、投资预计表现偏弱势，反内卷的背景下物价和名义 GDP 有望回升。流动性方面，美联储下半年可能有 1-2 次降息，我国央行以稳为主，资金面偏宽松。下半年，继续看好纯债表现，但波动空间较去年变小，需要尤为关注交易拥挤度及机构行为对市场的影响。具体投资以票息策略为优，利率债根据市场变化灵活调整久期。

下半年，继续看好货币市场表现，把握合适机会配置底仓，关注利差变化，根据不同资产性价比动态调整组合结构。

4.6 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帐务处理；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，由运营分管高管、投研分管高管、基金运营部负责人、研究发展部负责人、信用研究部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人及其他指定人员组成，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。

4.7 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 9,018.55 元，实际分配收益 9,018.55 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金基金资产净值连续 60 个工作日以上低于 5000 万元。本基金管理人已向证监会报告持续运作本基金，并在持续运作中。

报告期内，本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等固定费用由本基金管理人支付承担。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在新疆前海联合汇盈货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金共进行利润分配 9,018.55 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合汇盈货币市场基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,372,891.07	1,472,251.83
结算备付金		21,212.63	20,867.37
存出保证金		22.01	—
交易性金融资产	6.4.7.2	—	203,752.49
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		—	203,752.49
资产支持证券		—	—
投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	890,147.62	960,156.97
应收清算款		62.14	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		2,284,335.47	2,657,028.66
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—

应付清算款		-	19,906.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		282.39	331.43
应付托管费		94.16	110.48
应付销售服务费		467.68	549.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		47.20	65.24
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	76,713.00	114,241.64
负债合计		77,604.43	135,204.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,206,731.04	2,521,823.74
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		2,206,731.04	2,521,823.74
负债和净资产总计		2,284,335.47	2,657,028.66

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,206,731.04 份。其中前海联合汇盈货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,192,373.33 份；前海联合汇盈货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 14,357.71 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合汇盈货币市场基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业收入		14,172.55	46,607.11
1. 利息收入		14,005.04	32,832.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,315.08	7,374.82
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		8,689.96	25,457.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		167.51	13,775.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	167.51	13,775.07

资产支持证券 投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列)	6.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	-	-
减: 二、营业总支出		5,154.00	11,810.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,723.87	4,948.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	574.70	1,649.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,855.43	3,451.06
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融 资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	-	1,762.14
三、利润总额(亏损 总额以“-”号填列)		9,018.55	34,796.39
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损 以“-”号填列)		9,018.55	34,796.39
五、其他综合收益的 税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,018.55	34,796.39

6.3 净资产变动表

会计主体: 新疆前海联合汇盈货币市场基金

本报告期: 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,521,823.74	-	2,521,823.74
二、本期期初净资产	2,521,823.74	-	2,521,823.74

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-315,092.70	-	-315,092.70
(一)、综合收益总额	-	9,018.55	9,018.55
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-315,092.70	-	-315,092.70
其中：1.基金申购款	1,385,655.83	-	1,385,655.83
2.基金赎回款	-1,700,748.53	-	-1,700,748.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-9,018.55	-9,018.55
四、本期期末净资产	2,206,731.04	-	2,206,731.04
项目			
上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	55,578,697.27	-	55,578,697.27
二、本期期初净资产	55,578,697.27	-	55,578,697.27
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-52,872,958.14	-	-52,872,958.14
(一)、综合收益总额	-	34,796.39	34,796.39
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-52,872,958.14	-	-52,872,958.14
其中：1.基金申购款	1,607,371.05	-	1,607,371.05
2.基金赎回款	-54,480,329.19	-	-54,480,329.19
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-34,796.39	-34,796.39
四、本期期末净资产	2,705,739.13	-	2,705,739.13

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：

邹文庆

党刚

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合汇盈货币市场基金(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[2017]711号《关于准予新疆前海联合汇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》和《新疆前海联合汇盈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210,160,335.22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(2017)第565号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合汇盈货币市场基金基金合同》于2017年5月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,160,335.22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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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《新疆前海联合汇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2025年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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

基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	1,372,891.07
等于：本金	1,372,608.18
加：应计利息	282.89
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,372,891.07

6.4.7.2 交易性金融资产

无余额。

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

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	890,147.62	—
银行间市场	—	—
合计	890,147.62	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,713.00
合计	76,713.00

6.4.7.7 实收基金

前海联合汇盈货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,507,539.46	2,507,539.46
本期申购	1,385,582.40	1,385,582.40
本期赎回(以“-”号填列)	-1,700,748.53	-1,700,748.53
本期末	2,192,373.33	2,192,373.33

前海联合汇盈货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,284.28	14,284.28
本期申购	73.43	73.43
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	14,357.71	14,357.71

注：申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

前海联合汇盈货币 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	8,945.18	-	8,945.18

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	-8,945.18	-	-8,945.18
本期末	-	-	-

前海联合汇盈货币 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	73.37	-	73.37
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	-73.37	-	-73.37
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,262.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36.75
其他	15.88
合计	5,315.08

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	167.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	167.51
----	--------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,920.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,000.00
减：应计利息总额	3,920.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

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
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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人

注：以下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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,723.87	4,948.13
其中：应支付销售机构的客户 维护费	182.54	319.07
应支付基金管理人的净 管理费	1,541.33	4,629.06

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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	574.70	1,649.39

注：支付基金托管人中国邮储银行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。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合汇盈货币 A	前海联合汇盈货币 B	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	2,208.63	-	2,208.63
合计	2,208.63	-	2,208.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合汇盈货币 A	前海联合汇盈货币 B	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	2,287.32	182.85	2,470.17
合计	2,287.32	182.85	2,470.17

注：支付基金销售机构的销售服务费，本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。基金销售服务费每日计提，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。销售服务费的计算公式为：

A 类基金份额日销售服务费=前一日 A 类基金份额的基金资产净值 X 0.25%/ 当年天数。

B 类基金份额日销售服务费=前一日 B 类基金份额的基金资产净值 X 0.01%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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固有资金投资本基金的情况

前海联合汇盈货币 B

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 05 月 25 日）持有的基金份额	-	10,000,000
报告期初持有的基金份额	-	15,899,819.38
报告期内申购/买入总份额	-	22,622.73
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	15,922,442.11
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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。

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

无。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,372,891.07	5,262.45	1,305,578.28	6,502.18

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

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

无。

6.4.11 利润分配情况

前海联合汇盈货币 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
8,963.16	-	-17.98	8,945.18	-

前海联合汇盈货币 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
73.43	-	-0.06	73.37	-

6.4.12 期末（2025 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

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

本基金为货币市场基金，主要投资于各类货币市场工具，预期风险和预期收益低于股票型基金、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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款放在本基金的托管人中国邮储银行。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%。

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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	203,752.49
合计	-	203,752.49

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。

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

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期

融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2025 年 06 月 30 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公司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 2025 年 06 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 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						
货币资金	1,372,891. 07	—	—	—	—	1,372,891. 07
结算备付金	21,212.63	—	—	—	—	21,212.63
存出保证金	22.01	—	—	—	—	22.01
买入返售金 融资产	890,147.62	—	—	—	—	890,147.62
应收清算款	—	—	—	—	62.14	62.14
资产总计	2,284,273. 33	—	—	—	62.14	2,284,335. 47
负债						
应付管理人 报酬	—	—	—	—	282.39	282.39
应付托管费	—	—	—	—	94.16	94.16
应付销售服 务费	—	—	—	—	467.68	467.68
应付利润	—	—	—	—	47.20	47.20
其他负债	—	—	—	—	76,713.00	76,713.00
负债总计	—	—	—	—	77,604.43	77,604.43
利率敏感度 缺口	2,284,273. 33	—	—	—	-77,542.29	2,206,731. 04
上年度末 2024 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						
货币资金	1,472,251. 83	—	—	—	—	1,472,251. 83
结算备付金	20,867.37	—	—	—	—	20,867.37
交易性金融 资产	203,752.49	—	—	—	—	203,752.49
买入返售金 融资产	960,156.97	—	—	—	—	960,156.97
资产总计	2,657,028. 66	—	—	—	—	2,657,028. 66
负债						
应付清算款	—	—	—	—	19,906.72	19,906.72
应付管理人 报酬	—	—	—	—	331.43	331.43

应付托管费	-	-	-	-	110.48	110.48
应付销售服务费	-	-	-	-	549.41	549.41
应付利润	-	-	-	-	65.24	65.24
其他负债	-	-	-	-	114,241.64	114,241.64
负债总计	-	-	-	-	135,204.92	135,204.92
利率敏感度缺口	2,657,028.66	-	-	-	-	2,521,823.74

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

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变化（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	-	-

第二层次	-	203,752.49
第三层次	-	-
合计	-	203,752.49

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股票和债券，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

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	890,147.62	38.97
	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	1,394,103.70	61.03
4	其他各项资产	84.15	0.00
5	合计	2,284,335.47	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0
	其中：买断式回购融资		0
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	0	0
	其中：买断式回购融资	0	0

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

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	1
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	4
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限(天数)	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	103.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.52	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	0.0024%
报告期内偏离度的最低值	-0.0007%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0001%

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%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“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。

7.9.2 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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	22.01
2	应收清算款	62.14
3	应收利息	—
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	84.15

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

前海联合汇盈货币 A	10,350	211.82	-	-	2,192,373.33	100%
前海联合汇盈货币 B	4	3,589.43	14,357.44	100%	0.27	0.00%
合计	10,354	213.13	14,357.44	0.65%	2,192,373.60	99.35%

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	个人	318,160.19	14.42%
2	个人	141,970.54	6.43%
3	个人	107,796.50	4.88%
4	个人	86,814.88	3.93%
5	个人	76,531.13	3.47%
6	个人	63,505.98	2.88%
7	个人	53,932.40	2.44%
8	个人	53,899.02	2.44%
9	个人	53,216.49	2.41%
10	个人	49,372.07	2.24%

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。

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	前海联合汇盈货币 A	363,161.91	16.5648%
	前海联合汇盈货币 B	-	-
	合计	363,161.91	16.4570%

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)。

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	前海联合汇盈货币 A	0~10
	前海联合汇盈货币 B	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合汇盈货币 A	0
	前海联合汇盈货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合汇盈货币 A	前海联合汇盈货币 B
基金合同生效日（2017 年 05 月 25 日）基金份额总额	160,335.22	210,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,507,539.46	14,284.28
本报告期基金总申购份额	1,385,582.40	73.43
减：本报告期基金总赎回份额	1,700,748.53	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,192,373.33	14,357.71

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- 2、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

本报告期内，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

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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无受稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3号）及有关法律法规的相关规定，我公司制定了《交易席位管理制度》：

（1）券商选择标准：

- 1) 财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究实力较强；
- 2) 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) 最近一年的分类评价等级为 C 级及 C 级以上，同时最近 2 年没有重大违法违规行为。

（2）券商选择程序：

- 1) 公司根据以上标准进行考察后确定参与证券交易的证券公司；
- 2) 公司与被选择的证券公司签订证券交易单元租用协议。

2、本报告期内，新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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

				比例				
国投证券股份有限公司	-	-	21,700,000.00	90.08%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	2,390,000.00	9.92%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

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	新疆前海联合汇盈货币市场基金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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-01-22
2	新疆前海联合汇盈货币市场基金 2024 年第四季度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-01-22
3	新疆前海联合基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-03-21
4	新疆前海联合汇盈货币市场基金 2024 年年度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-03-29
5	新疆前海联合汇盈货币市场基金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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-04-01
6	新疆前海联合汇盈货币市场基金 2025 年第一季度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-04-22

7	新疆前海联合汇盈货币市场基金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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-04-25
8	新疆前海联合汇盈货币市场基金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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-05-27
9	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-05-30
10	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025-06-13

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合汇盈货币市场基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合汇盈货币市场基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合汇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。

12.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人住所处外，其他备查文件等存放于基金管理人处。

12.3 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

二〇二五年八月二十九日