

新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年08月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介.....6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

2.3 基金管理人和基金托管人7

2.4 信息披露方式7

2.5 其他相关资料7

§ 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8

3.3 其他指标9

§ 4 管理人报告9

4.1 基金管理人及基金经理情况9

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13

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13

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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37

7.12 投资组合报告附注	37
§ 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
8.3 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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	40
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	41
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45

12.3 查阅方式.....45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	前海联合泓瑞定开债券
基金主代码	005722
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018 年 03 月 07 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	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	100,392.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、封闭期投资策略 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金采取久期策略、期限结构策略、信用债投资策略等积极投资策略，在严格控股风险的前提下，发掘和利用潜在投资机会，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型基金，长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：基金管理人对本基金的风险等级评价结果以公司官网最新披露的旗下基金产品风险等级评价说明为准。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑妍	胡燕
	联系电话	0755-82780666	0571-87659392
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95527
传真		0755-82780000	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		518057	310006
法定代表人		贺国灵	陈海强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金中期报告置备地点	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
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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
---------------	--

本期已实现收益	365.69
本期利润	412.69
加权平均基金份额本期利润	0.0041
本期加权平均净值利润率	0.37%
本期基金份额净值增长率	0.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	12,847.60
期末可供分配基金份额利润	0.1280
期末基金资产净值	113,239.80
期末基金份额净值	1.1280
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	30.08%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

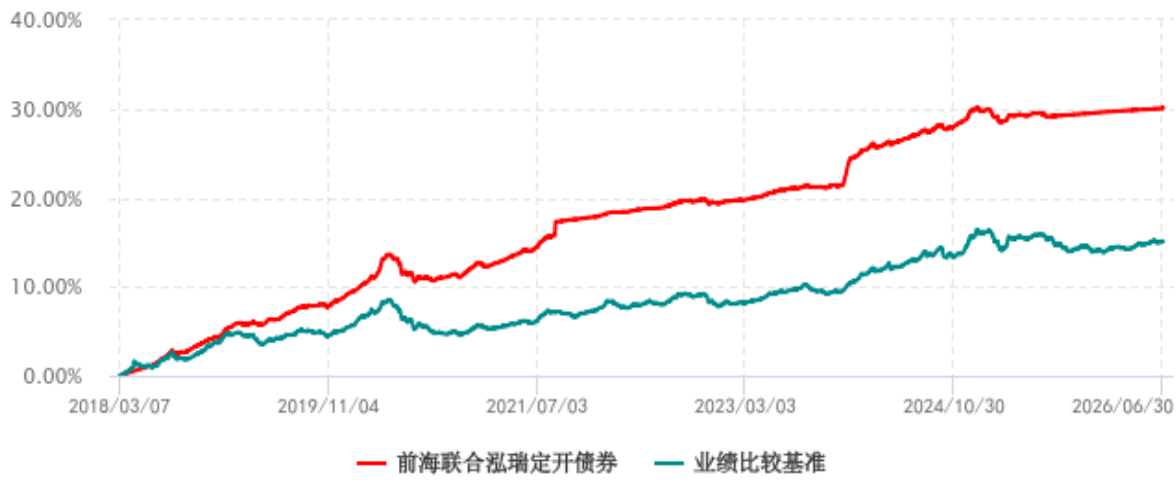
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.19%	0.01%	0.62%	0.04%	-0.43%	-0.03%
过去六个月	0.36%	0.01%	0.91%	0.04%	-0.55%	-0.03%
过去一年	0.47%	0.02%	-0.56%	0.06%	1.03%	-0.04%
过去三年	7.53%	0.05%	5.12%	0.08%	2.41%	-0.03%
过去五年	13.71%	0.05%	8.48%	0.07%	5.23%	-0.02%
过去七年	21.79%	0.06%	10.29%	0.07%	11.50%	-0.01%
自基金合同生效起至今	30.08%	0.05%	15.09%	0.07%	14.99%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来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

新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准
收益率历史走势对比图
(2018年03月07日-2026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4.00亿元人民币，公司股东为上海证券有限责任公司，持股比例为100%。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30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, 创新业 务部负责人	2021-08-20	-	13 年	张文先生，硕 士，13 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）、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）和新疆前海联合泳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）。现任新疆前海联合基金管理有限公司创新业务部负责人、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

2026 年上半年，GDP 同比增长 4.7%，增速符合全年经济增长预期目标。美以伊冲突持续超预期，局势反复，地缘冲突变化下风险偏好有所变化，美联储主席更换后货币政策进入观察期。国内基本面开局较好，二季度有所回落，出口延续高景气，内需及投资偏弱。（数据来源：国家统计局）

债券市场震荡偏强，上半年资金面整体宽松，6 月流动性有所收敛；现券收益率震荡下行，信用利差同步收窄，杠杆收益表现平稳，票息加利率债交易策略表现较好。

报告期内，本基金持仓以交易所利率债为主，资产的安全性和流动性较高，未来一个季度会根据基本面和资金面的变化，灵活调整资产结构及杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合泓瑞定开债券基金份额净值为 1.1280 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

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 2026 年下半年，国内经济增长具备向好基础，宏观调控政策仍存发力空间。具体来看，出口有望继续保持韧性，内需修复进度或将加快，企业盈利水平持续改善；但海外流动性预期反复、国内基本面有所分化等因素，或将对市场形成阶段性扰动。国内货币政策以稳为主，市场流动性保持宽松。下半年，继续看好纯债表现。

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

无。

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。

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，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》及其他法

律法规和基金合同的有关规定，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合规守信、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本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	12,618.68	11,724.88
结算备付金		-	-
存出保证金		13.49	133.19
交易性金融资产	6.4.7.2	100,648.19	101,009.64
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		100,648.19	101,009.64
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	-	-
应收清算款		-	-
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		113,280.36	112,867.71
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		27.90	28.83
应付托管费		9.30	9.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.36	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	-	-
负债合计		40.56	38.44
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	100,392.20	100,394.12
未分配利润	6.4.7.8	12,847.60	12,435.15
净资产合计		113,239.80	112,829.27
负债和净资产总计		113,280.36	112,867.71

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1280 元，基金份额总额 100,392.20 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		638.03	-1,462.49
1. 利息收入		3.49	40.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3.49	29.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融		-	10.49

资产收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		587.54	22,097.97
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	587.54	22,097.97
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收	6.4.7.13	-	-
益			
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	47.00	-23,600.89
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		225.34	2,114.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	168.33	1,586.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	56.11	528.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		0.90	-
8. 其他费用	6.4.7.19	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		412.69	-3,577.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		412.69	-3,577.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		412.69	-3,577.24

6.3 净资产变动表

会计主体：新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	100,394.12	12,435.15	112,829.27
二、本期期初净资产	100,394.12	12,435.15	112,829.27
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-1.92	412.45	410.53
（一）、综合收益总额	-	412.69	412.69
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	-1.92	-0.24	-2.16
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-1.92	-0.24	-2.16
（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）	-	-	-
四、本期期末净资产	100,392.20	12,847.60	113,239.80
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	950,679.69	120,239.23	1,070,918.92
二、本期期初净资产	950,679.69	120,239.23	1,070,918.92
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-	-3,577.24	-3,577.24
（一）、综合收益总额	-	-3,577.24	-3,577.24
（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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（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）	-	-	-

四、本期期末净资产	950,679.69	116,661.99	1,067,341.68
-----------	------------	------------	--------------

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：

贺国灵	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

新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2018]331号《关于准予新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》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《新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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 4,510,000,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0173 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2018 年 3 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,510,000,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《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合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即以封闭期内封闭运作和封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)至 3 个月对应日的前一日止。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)至 3 个月对应日的前一日止。首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)至 3 个月对应日的前一日止,以此类推。该对应日不存在的,则该对应日为该对应日对应月度的最后一日。该对应日为非工作日的,则顺延至下一个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上最长不超过 20 个工作日,最短不少于 5 个工作日。基金管理人应在每个封闭期结束前公布开放期和下一封闭期的具体时间安排。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,001,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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,具体为债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款

及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票或权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:在封闭期,投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日内,本基金投资不受上述比例限制。在开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但在每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股

期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	12,618.68
等于：本金	12,618.50
加：应计利息	0.18
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	12,618.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100,059.00	558.19	100,648.19	31.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100,059.00	558.19	100,648.19	31.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		100,059.00	558.19	100,648.19	31.00

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

无。

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

无。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,394.12	100,394.12
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1.92	-1.92

本期末	100,392.20	100,392.20
-----	------------	------------

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

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	13,704.71	-1,269.56	12,435.15
本期期初	13,704.71	-1,269.56	12,435.15
本期利润	365.69	47.00	412.69
本期基金份额交易产生的变动数	-0.26	0.02	-0.24
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-0.26	0.02	-0.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,070.14	-1,222.54	12,847.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	3.30
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	0.12
其他	0.07
合计	3.49

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	633.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-46.00
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	587.54

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
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,370.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,046.00
减：应计利息总额	1,370.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-46.00

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

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	47.00
——股票投资	-
——债券投资	47.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	47.00

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、关联关系

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

本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
浙商银行股份有限公司	基金托管人

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	168.33	1,586.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	168.33	1,586.12

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56.11	528.63

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 × 托管费率计提，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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 03 月 07 日）持有的基金份额	10,001,000	10,001,000
报告期初持有的基金份额	99,676.96	949,676.96
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	99,676.96	949,676.96
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	99.29%	99.89%

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有 限公司	12,618.68	3.30	63,096.60	26.14

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商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

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种。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，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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。本基金的活期存款存放在基金管理人已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行。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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,648.19	101,009.64
合计	100,648.19	101,009.64

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人根据前述法规要求对基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等进行监控，以防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控，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 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,618.68	-	-	-	12,618.68
存出保证金	13.49	-	-	-	13.49
交易性金融资产	100,648.19	-	-	-	100,648.19
资产总计	113,280.36	-	-	-	113,280.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	27.90	27.90
应付托管费	-	-	-	9.30	9.30
应交税费	-	-	-	3.36	3.36
负债总计	-	-	-	40.56	40.56
利率敏感度缺口	113,280.36	-	-	-40.56	113,239.80
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,724.88	-	-	-	11,724.88
存出保证金	133.19	-	-	-	133.19
交易性金融资产	101,009.64	-	-	-	101,009.64
资产总计	112,867.71	-	-	-	112,867.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	28.83	28.83
应付托管费	-	-	-	9.61	9.61
负债总计	-	-	-	38.44	38.44
利率敏感度缺口	112,867.71	-	-	-38.44	112,829.27

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	135.83	71.73
	2. 市场利率上升 25 个基点	-135.47	-71.62

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动而发生波动的风险。本基金持有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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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，因此无重大的其他价格风险。

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	上年度末
---------------	-----	------

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	100,648.19	101,009.64
第三层次	-	-
合计	100,648.19	101,009.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、新发未上市和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,648.19	88.85
	其中：债券	100,648.19	88.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	12,618.68	11.14
8	其他各项资产	13.49	0.01
9	合计	113,280.36	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	100,648.19	88.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,648.19	88.88

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26 国债 01	1,000	100,648.19	88.88

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

7.12.3 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	13.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
242	414.84	100,392.20	100%	-	-

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	99,676.96	99.2876%	1,000	0.9961%	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	99,676.96	99.2876%	1,000	0.9961%	3 年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 03 月 07 日）基金份额总额	4,510,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	100,394.12
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	1.92
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	100,392.20

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，本基金管理人经与本基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的议案》。该议案于 2026 年 2 月 27 日表决通过。有关详细信息请参见本基金管理人于 2026 年 1 月 27 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的公告》以及 2026 年 2 月 28 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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，经公司第三届董事会 2026 年第 4 次临时会议审议通过及完成相应任职程序，自 2026 年 3 月 5 日起，郑妍女士担任公司督察长。自 2026 年 3 月 5 日起，邹文庆先生不再代为履行公司督察长职责。

本报告期内，公司股东上海证券有限责任公司于 2026 年 4 月 8 日做出股东决定，任命肖林先生为公司第三届董事会董事长，任命孙宏钧先生为公司第三届董事会董事。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人高级管理人员及本基金基金经理无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
华创证 券有限 责任公 司	100,366 .51	100.00%	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第四季度报告及提示性公告	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	2026-01-22
2	新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人	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	2026-01-27

	大会的公告		
3	新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的第一次提示性公告	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	2026-01-28
4	新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的第二次提示性公告	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	2026-01-29
5	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	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	2026-02-05
6	新疆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	2026-02-10
7	新疆前海联合基金管理有限公司关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	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	2026-02-28
8	新疆前海联合基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026-03-05
9	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告及提示性公告	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	2026-03-28
10	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年	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	2026-04-22

	第一季度报告及提示性公告		
11	2025 年度新疆前海联合基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	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	2026-04-28
12	新疆前海联合基金管理有限公司关于旗下基金增加临时基金管理人等条款修改基金合同和托管协议的公告	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	2026-04-30
13	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	2026-05-22
14	新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	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	2026-06-13

§ 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

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	20260101 - 20260630	99,676.96	-	-	99,676.96	99.29%
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、转换入份额，赎回份额包含转换出份额。

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泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 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

二〇二六年八月二十九日