

新疆前海联合现金添利货币市场基金

2025 年年度报告

2025 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:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2026 年 03 月 28 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2026年03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。

新疆前海联合现金添利货币市场基金由上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更而来。上海证券现金添利货币型集合资产管理计划的变更已经中国证监会2025年10月30日证监许可〔2025〕2427号文准予变更注册。自2025年12月19日起，上海证券现金添利货币型集合资产管理计划正式变更为新疆前海联合现金添利货币市场基金，《新疆前海联合现金添利货币市场基金基金合同》生效，原《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》同时失效，新疆前海联合基金管理有限公司正式开始管理新疆前海联合现金添利货币市场基金。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（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2025年12月19日起至2025年12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	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	15
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	15
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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 债券回购融资情况	42
8.3 基金投资组合平均剩余期限	42
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	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6 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	43

8.7 “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	44
8.8 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	44
8.9 投资组合报告附注	44
§ 9 基金份额持有人信息	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	45
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 10 开放式基金份额变动	46
§ 11 重大事件揭示	46
11.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
11.4 基金投资策略的改变	47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	48
11.9 其他重大事件	48
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	49

§ 13 备查文件目录	49
13.1 备查文件目录.....	49
13.2 存放地点.....	49
13.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合现金添利货币市场基金
基金简称	前海联合现金添利货币
基金主代码	026121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 月 19 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	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	1,955,484,862.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据客户交易结算资金余额规模及其波动特点，在严格控制风险的前提下，以高流动性金融资产投资为主，精选投资品种，构建低风险投资组合。在力求最大限度保证资产的安全性、流动性的同时，使投资者的闲置资金获得增值收益。
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，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，预期风险和预期收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。

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	中国证券登记结算有 限责任公司
信息披露负责人	姓名	郑妍	陈晨
	联系电话	0755-82780666	010-50938723
	电子邮箱	service@qhlhfund.co m	zctg@chinaclear.com .cn

客户服务电话	400-640-0099	4008-058-058
传真	0755-82780000	-
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	北京市西城区太平桥大街 17 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	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码	518057	100033
法定代表人	贺国灵	于文强

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlfund.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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	580,432.49
本期利润	580,432.49
本期净值收益率	0.0276%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末基金资产净值	1,955,484,862.11
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
累计净值收益率	0.0276%

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，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。

3、本基金收益每日计提，按月支付。

4、本基金合同于 2025 年 12 月 19 日生效，截至本报告期末不足一年。

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

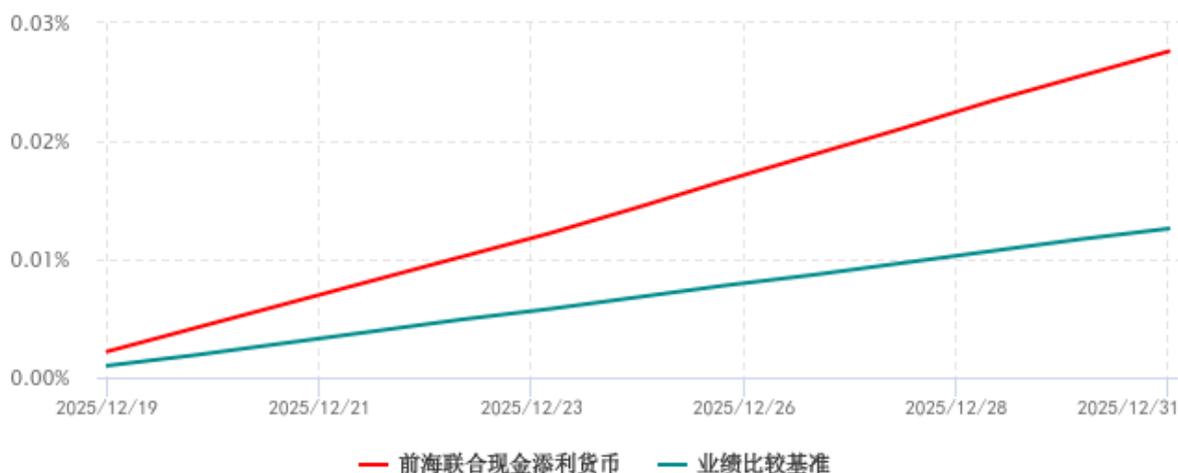
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.0276%	0.0001%	0.0126%	0.0000%	0.0150%	0.0001%

注：1、本基金业绩比较基准为人民币活期存款利率（税后）。

2、本基金收益每日计提，按月支付。

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

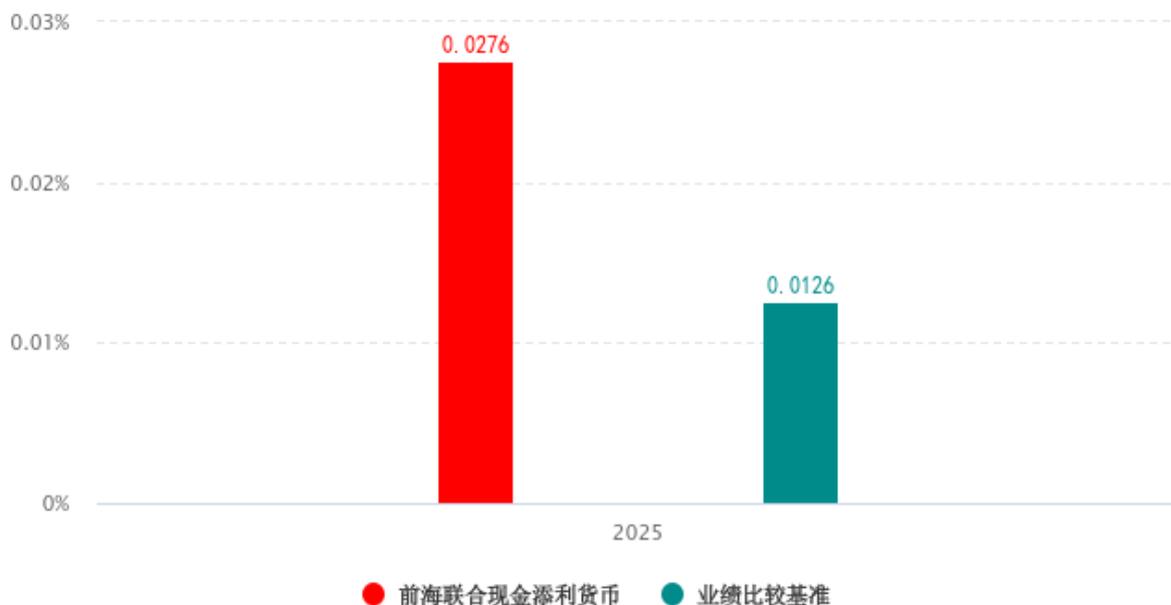
新疆前海联合现金添利货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月19日-2025年12月31日)



注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 19 日，截至本报告期末不满一年。

2、本基金的建仓期为 6 个月，截至报告期末，本基金建仓期尚未结束。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 19 日，2025 年本基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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
2025 年	-	-216,922.64	797,355.13	580,432.49	-
合计	-	-216,922.64	797,355.13	580,432.49	-

§ 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 29 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		
孟令上	本基金基金经理，信用研究部负责人	2025-12-19	-	14 年	孟令上先生，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司金融机构部信用分析师、前海人寿保险股份有限公司风险管理部信用分析师、平安证券股份有限公司投资银行部高级经理、民生证券股份有限公司投资银行事业部企业融资一部业务董事和新疆前海联合基金管理有限公司风险管理部负责人。现任新疆前海联合基金管理有限公司信用研究部负责人、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2022 年 8 月 12 日起任职）、新疆前海联合添泽债券型证券投资基金基金经理（自 2025 年 7 月 23 日起

					任职)、新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金经理(自2025年7月23日起任职)、新疆前海联合弘利债券型证券投资基金基金经理(2025年11月24日起任职)和新疆前海联合现金添利货币市场基金基金经理(2025年12月19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 and 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。

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。

4.3.3 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

回顾 2025 年，债市表现整体偏弱。由于 2024 年年底启动的债券牛市在 1 月上旬进入尾声，春节过后资金面超预期持续偏紧，市场对货币宽松的预期开始修正，上半年债市经历了一波较长时间的调整。下半年，债市整体仍处于逆风期，三季度在基本面预期好转，外部环境缓和以及“反内卷”带来的权益市场风险偏好持续加强的大背景下，债市回调明显，“看股做债”成为债市主选

辑。10 月末，潘行长在金融街论坛表示目前债市整体运行良好，央行重启国债买卖；海外方面，10 月美联储也如期降息，债市整体环境有所改善，带动月末十年期国债收益率向下突破 1.80%。11-12 月，在公募销售费用新规消息和市场风险偏好好转的扰动下，叠加市场对债市中期不乐观和对短期“固收+”基金的赎回担忧，收益率曲线开始熊陡。12 月交易扰动明显增加，一方面商品和股市表现强势，风险偏好增加对债市形成一定压制；另一方面，市场对明年长债的供求关系有所担忧，造成超长债在月末调整较多。但年末资金面整体均衡，DR007 均值在 1.75%左右，一年期国股存单利率到期收益率为 1.63%左右，较 12 月中旬有所下行。（数据来源：WIND）

综合来看，由于过往债市交易过多透支降息预期，2025 年债市整体是预期修正回归的过程。

报告期内，本基金主要持仓以同业存单、高等级信用债等高流动性资产为主。把握年内货币市场利率季节性波动的配置机会，在收益率上行期及跨季跨年末时点进行银行存款和同业存单资产配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合现金添利货币基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.0276%，同期业绩比较基准收益率为 0.0126%。

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，在经历了 2025 年的债市调整，债市收益率有望迎来小幅修复。央行在四季度货币政策例会提出“发挥增量政策和存量政策集成效应，综合运用多种工具”，结合中央经济工作会议“灵活高效降准降息”的提法，2026 年总量宽松或仍然可以期待。考虑到 2026 年仍至少有一次 OMO 降息空间，目前的收益率水平相较全年来说仍处于偏上位置，年初票息策略仍占优，仍是布局配置高息资产的时点。策略方面，本基金在 2026 年仍以票息策略为主，将在年初布局各期限的银行存款和同业存单资产，下半年根据市场环境择机进行到期配置，注重择时窗口，把握趋势性机会。

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、监督检查等方法，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。

4.8 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“每日计提，按月支付”的方式。本报告期内应分配收益 580,432.49 元，实际分配收益 580,432.49 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，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有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，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。

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

本托管人复核了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、投资组合报告等内容，认为其内容真实、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	安永华明（2026）审字第 80013781_H27 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	新疆前海联合现金添利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现金添利货币市场基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的新疆前海联合现金添利货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了新疆前海联合现金添利货币市场基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新疆前海联合现金

	<p>添利货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>新疆前海联合现金添利货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估新疆前海联合现金添利货币市场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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督新疆前海联合现金添利货币市场基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关</p>

	披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对新疆前海联合现金添利货币市场基金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现金添利货币市场基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。 我们与治理层就计划的审计范围、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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高鹤	于玉涵
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2026-03-27	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合现金添利货币市场基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	387,131,792.93
结算备付金		9,714.81
存出保证金		7,579.55
交易性金融资产	7.4.7.2	1,546,862,399.40
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,546,862,399.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	23,003,064.64
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	7.4.7.5	-
资产总计		1,957,014,551.33
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
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		412,693.80
应付托管费		91,907.50
应付销售服务费		187,588.08
应付投资顾问费		-
应交税费		149.37
应付利润		797,355.13
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	39,995.34
负债合计		1,529,689.22
净资产:		
实收基金	7.4.7.7	1,955,484,862.11
未分配利润	7.4.7.8	-
净资产合计		1,955,484,862.11
负债和净资产总计		1,957,014,551.33

注 1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,955,484,862.11 份。

2、本基金合同于 2025 年 12 月 19 日生效，本财务报表实际编制期间为 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合现金添利货币市场基金

本报告期：2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,222,190.22

1. 利息收入		408,085.20
其中：存款利息收入	7.4.7.9	405,175.06
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		2,910.14
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		814,105.02
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	814,105.02
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、营业总支出		641,757.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	412,693.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	37,517.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	187,588.08
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	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		16.01
8. 其他费用	7.4.7.19	3,942.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		580,432.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		580,432.49
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		580,432.49

7.3 净资产变动表

会计主体：新疆前海联合现金添利货币市场基金

本报告期：2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	2,008,774,716.35	-	2,008,774,716.35
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-53,289,854.24	-	-53,289,854.24
（一）、综合收益总额	-	580,432.49	580,432.49
（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）	-53,289,854.24	-	-53,289,854.24
其中：1. 基金申购款	2,151,808,072.13	-	2,151,808,072.13
2. 基金赎回款	-2,205,097,926.37	-	-2,205,097,926.37
（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）	-	-580,432.49	-580,432.49
四、本期期末净资产	1,955,484,862.11	-	1,955,484,862.11

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新疆前海联合现金添利货币市场基金（以下简称“本基金”）由上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更而来。上海证券现金添利货币型集合资产管理计划由上海证券现金添利集合资产管理计划变更而来。

上海证券现金添利集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 1 月 23 日起开始募集，于 2013 年 2 月 28 日结束募集工作，于 2013 年 3 月 1 日正式成立。上海证券现金添利集合资产管理计划于 2013 年 3 月 25 日经中国证监业[2013]243 号文备案。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39 号）的规定，上海证券现金添利集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会《关于准予上海证券现金添利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]797 号）批准，自 2022 年 12 月 19 日起，《上海证券

现金添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效，原《上海证券现金添利集合资产管理计划合同》自同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更管理人，管理人由上海证券有限责任公司变更为新疆前海联合基金管理有限公司，上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更为新疆前海联合现金添利货币市场基金。上海证券现金添利货币型集合资产管理计划的变更注册已经中国证监会 2025 年 10 月 30 日证监许可[2025]2427 号文准予变更注册。2025 年 12 月 15 日，上海证券现金添利货币型集合资产管理计划的集合计划份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为新疆前海联合现金添利货币市场基金有关事项的议案》，同意上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更管理人，管理人由上海证券有限责任公司变更为新疆前海联合基金管理有限公司，上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更为新疆前海联合现金添利货币市场基金，即本基金，并进行相关调整。上述集合计划份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。《新疆前海联合现金添利货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）自 2025 年 12 月 19 日生效，《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。于基金合同生效日，本基金的实收基金为人民币 2,008,774,716.35 元，折合 2,008,774,716.35 份基金份额。自基金合同生效日起，本基金的管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在 1 个月以内的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。其中基金投资于企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（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审计报告日批准报出。

7.4.2 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金

信息披露特别规定》、《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。

7.4.3 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于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重

要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，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资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用自有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，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

(1) 本基金每份份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益“每日计提、按月支付”，收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可以选择现金红利或者将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益支付方式是现金分红；

(3) 本基金采用 1.00 元固定份额净值列示，自基金合同生效日起，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付；

(4) 本基金根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则根据基金份额持有人选择的收益支付方式，为基金份额持有人增加相应的基金份额或支付相应的现金收益；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变且不支付现金收益；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，遇投资者剩余基金份额不足以扣减的情形，基金管理人将根据内部应急机制保障基金平稳运行，并保留向该投资者追索相应资金的权利；

(6) 投资者赎回基金份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期月度分红日支付；

(7) 投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日中国人民银行公布的活期存款利率孰低的原则计付收益；

(8) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(9) 在不违反法律法规、本基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

(10) 如需召开基金份额持有人大会，基金份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；

(11) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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 号文《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 号文《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 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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, (如有) 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 号文《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, (如有) 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(如适用)

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 号文《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 号文《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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	387,131,792.93
等于：本金	386,782,267.15
加：应计利息	349,525.78
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	387,131,792.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	15,331,297.46	15,312,390.13	-18,907.33	-0.0010
	银行间市场	1,531,531,101.94	1,532,180,791.23	649,689.29	0.0332
	合计	1,546,862,399.40	1,547,493,181.36	630,781.96	0.0323
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,546,862,399.40	1,547,493,181.36	630,781.96	0.0323

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

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 2025 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	23,003,064.64	-
合计	23,003,064.64	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	30,695.34
其中：交易所市场	-
银行间市场	30,695.34
应付利息	-
预提费用	9,300.00
合计	39,995.34

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,008,774,716.35	2,008,774,716.35
本期申购	2,151,808,072.13	2,151,808,072.13
本期赎回（以“-”号填列）	-2,205,097,926.37	-2,205,097,926.37
本期末	1,955,484,862.11	1,955,484,862.11

注：1、申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

2、本基金合同于 2025 年 12 月 19 日生效，基金合同生效日实收基金为人民币 2,008,774,716.35 元，折合 2,008,774,716.35 份基金份额。

7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	580,432.49	-	580,432.49
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	-580,432.49	-	-580,432.49
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	405,172.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1.29
其他	0.84
合计	405,175.06

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	813,211.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	893.50
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	814,105.02

7.4.7.11.2 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 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	329,986,662.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	329,985,769.11
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	893.50

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 信用减值损失

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	1,314.68
其他	2,627.54
合计	3,942.22

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
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、登记机构
上海证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
百联集团有限公司	基金管理人的实际控制人

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。

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 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	412,693.80
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	412,693.80

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.55% 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 × 0.55% / 当年天数。

当以 0.55% 的管理费计算的 7 日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率时，基金管理人将调整管理费为 0.3%，以降低基金每万份暂估净收益为负并引发证券交收透支的风险，直至该类风险消除，基金管理人方可恢复计提 0.55% 的管理费。基金管理人应在费率调整后依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,517.62

注：支付基金托管人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 × 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 2025 年 12 月 19 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
上海证券有限责任公司	187,588.08
合计	187,588.08

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金份额的基金资产净值 × 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 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海证券有限责任公司	21,889,000	1.1194%

注：上述关联方投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

7.4.10.6 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 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	96,777.15	43.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，银行存款账户开立于具有吸储资格的商业银行，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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
-	-216,922.64	797,355.13	580,432.49	-

7.4.12 期末（2025 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

7.4.13.2 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。

本公司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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	20,157,239.67
合计	20,157,239.67

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为证券公司短期融资券、短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	1,511,373,862.27
合计	1,511,373,862.27

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 2025 年 12 月 31 日
AAA	15,331,297.46
AAA 以下	-
未评级	-
合计	15,331,297.46

注：长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资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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、份额持有人集中度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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，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），均能够及时变现。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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	387,131,79 2.93	-	-	-	-	387,131,79 2.93
结算备付金	9,714.81	-	-	-	-	9,714.81
存出保证金	7,579.55	-	-	-	-	7,579.55
交易性金融 资产	853,700,85 5.28	693,161,54 4.12	-	-	-	1,546,862, 399.40
买入返售金 融资产	23,003,064 .64	-	-	-	-	23,003,064 .64
资产总计	1,263,853, 007.21	693,161,54 4.12	-	-	-	1,957,014, 551.33
负债						
应付管理人 报酬	-	-	-	-	412,693.80	412,693.80
应付托管费	-	-	-	-	91,907.50	91,907.50
应付销售服 务费	-	-	-	-	187,588.08	187,588.08
应交税费	-	-	-	-	149.37	149.37
应付利润	-	-	-	-	797,355.13	797,355.13
其他负债	-	-	-	-	39,995.34	39,995.34
负债总计	-	-	-	-	1,529,689. 22	1,529,689. 22
利率敏感度 缺口	1,263,853, 007.21	693,161,54 4.12	-	-	- 1,529,689. 22	1,955,484, 862.11

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 2025 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,567,181.27
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,563,279.98

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。

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币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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	-
第二层次	1,546,862,399.40
第三层次	-
合计	1,546,862,399.40

7.4.14.2.2 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。

本基金本期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§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	1,546,862,399.40	79.04
	其中：债券	1,546,862,399.40	79.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	23,003,064.64	1.18
	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	387,141,507.74	19.78
4	其他各项资产	7,579.55	0.00
5	合计	1,957,014,551.33	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	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
	其中：买断式回购融资	-	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。

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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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	23.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	9.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天（含）—90 天	7.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	49.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.04	-

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,331,297.46	0.78
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,157,239.67	1.03
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,511,373,862.27	77.29
8	其他	-	-
9	合计	1,546,862,399.40	79.10
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------	--------------	---------------

1	112515168	25 民生银行 CD168	1,000,000	99,157,780.9 1	5.07
2	112503406	25 农业银行 CD406	1,000,000	98,942,083.1 1	5.06
3	112586028	25 徽商银行 CD224	1,000,000	98,895,690.9 1	5.06
4	112519307	25 恒丰银行 CD307	500,000	49,969,192.8 4	2.56
5	112584398	25 江西银行 CD127	500,000	49,935,415.9 6	2.55
6	112584560	25 广东南海 农商行 CD086	500,000	49,923,494.3 9	2.55
7	112503280	25 农业银行 CD280	500,000	49,864,154.5 8	2.55
8	112519266	25 恒丰银行 CD266	500,000	49,848,191.3 5	2.55
9	112519190	25 恒丰银行 CD190	500,000	49,787,312.5 4	2.55
10	112583422	25 成都农商 银行 CD059	500,000	49,751,069.5 3	2.54

8.7 “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	0.0323%
报告期内偏离度的最低值	0.0210%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0242%

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。

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

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。

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	7,579.55
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,579.55

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

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
21,119	92,593.63	38,476,382.3 3	1.97%	1,917,008,47 9.78	98.03%

注：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）	占总份额比例
----	-------	---------	--------

1	个人	28,411,910.45	1.45%
2	个人	26,872,660.25	1.37%
3	个人	22,471,339.89	1.15%
4	券商类机构	21,889,000.00	1.12%
5	个人	19,701,844.14	1.01%
6	个人	12,719,673.82	0.65%
7	个人	12,213,138.50	0.62%
8	个人	10,752,601.20	0.55%
9	个人	10,000,272.93	0.51%
10	其他机构	9,297,881.20	0.48%

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

无。

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	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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025年12月19日）基金份额总额	2,008,774,716.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,151,808,072.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,205,097,926.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,955,484,862.11

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、公司董事会于 2025 年 10 月 13 日完成换届，原第二届董事黄炜、孙莉、孙磊、吴昱村、夏正林、张卫国不再任职；截至 2025 年 12 月 31 日，公司第三届董事会成员为：贺国灵（代履职董事长）、陈力源、陈钊、柳永明、段军山。

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。

2、本报告期内，本托管人的专门基金托管部门负责人由方堃先生变更为朱立元先生。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 2026 年第 3 次临时会议审议通过并经过全体独立董事同意，本基金自 2026 年 2 月 6 日起，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。本基金本年度没有应支付的审计费用。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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	
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

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：上海证券有限责任公司（2个），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

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 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。

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	新疆前海联合现金添利货币市场基金开放日常申购、赎回业务的公告	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	2025-12-19
2	新疆前海联合基金管理有限公司关于上海	中国证券报、中国证监会基金电子披露网	2025-12-19

	证券现金添利货币型 集合资产管理计划变 更注册为新疆前海联 合现金添利货币市场 基金相关业务安排的 公告	站及基金管理人网站	
--	---	-----------	--

§ 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

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。

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、中国证监会核准上海证券现金添利货币型集合资产管理计划变更注册的文件；
- 2、《新疆前海联合现金添利货币市场基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合现金添利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，其他备查文件等文件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

二〇二六年三月二十八日