新疆前海联合海盈货币市场基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新疆前海联合海盈货币	
基金主代码	002247	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 24 日	
报告期末基金份额总额	545,191,057.49 份	
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，力争获取超越业绩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。	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
下属分级基金的交易代码	002247	002248
报告期末下属分级基金的份额总额	13,196,694.40 份	531,994,363.09 份

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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
1.本期已实现收益	28,071.05	741,496.66
2.本期利润	28,071.05	741,496.66
3.期末基金资产净值	13,196,694.40	531,994,363.09

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新疆前海联合海盈货币 A 净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2552%	0.0003%	0.0894%	0.0000%	0.1658%	0.0003%
过去六个月	0.4941%	0.0004%	0.1779%	0.0000%	0.3162%	0.0004%
过去一年	0.9849%	0.0004%	0.3549%	0.0000%	0.6300%	0.0004%
过去三年	3.4854%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	2.4198%	0.0010%
过去五年	6.5106%	0.0014%	1.7753%	0.0000%	4.7353%	0.0014%
过去七年	11.2438%	0.0018%	2.4860%	0.0000%	8.7578%	0.0018%
过去十年	22.7079%	0.0030%	3.5506%	0.0000%	19.1573%	0.0030%
自基金合同生效起至今	24.9385%	0.0032%	3.8247%	0.0000%	21.1138%	0.0032%

新疆前海联合海盈货币 B 净值表现

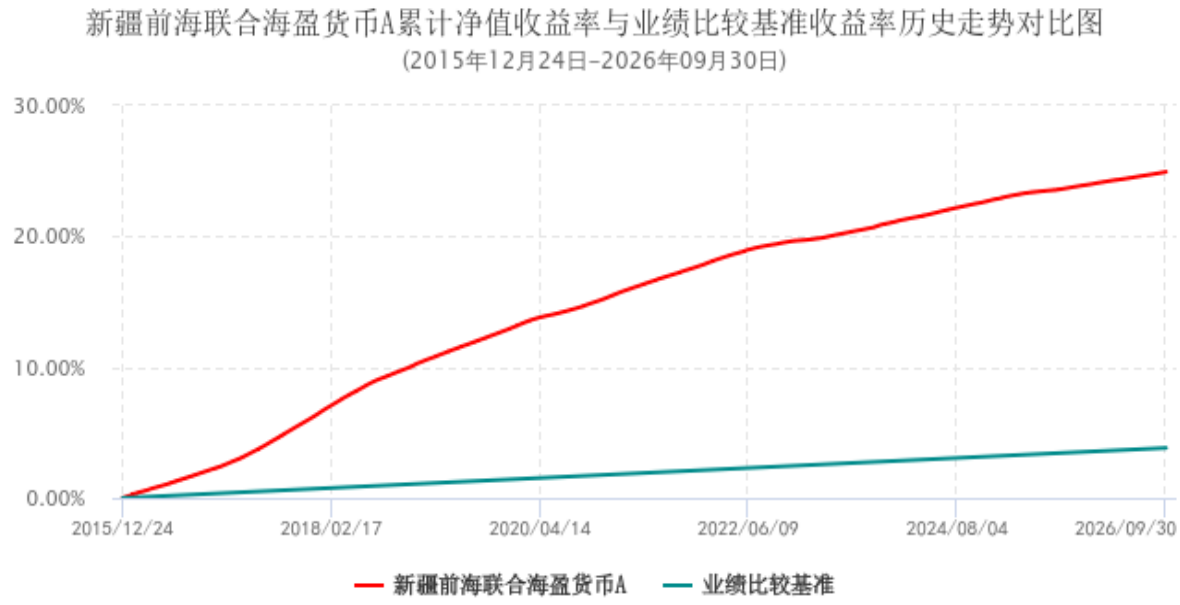
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3081%	0.0001%	0.0894%	0.0000%	0.2187%	0.0001%
过去六个月	0.6108%	0.0003%	0.1779%	0.0000%	0.4329%	0.0003%
过去一年	1.2290%	0.0004%	0.3549%	0.0000%	0.8741%	0.0004%

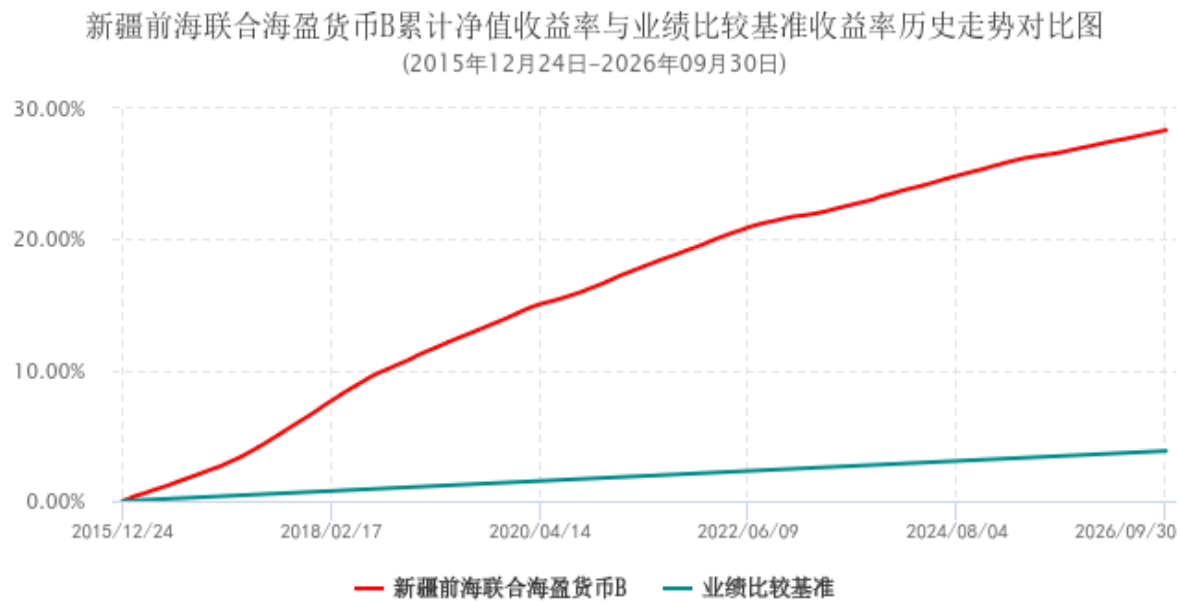
过去三年	4.2645%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	3.1989%	0.0010%
过去五年	7.8510%	0.0014%	1.7753%	0.0000%	6.0757%	0.0014%
过去七年	13.2096%	0.0018%	2.4860%	0.0000%	10.7236%	0.0018%
过去十年	25.8205%	0.0030%	3.5506%	0.0000%	22.2699%	0.0030%
自基金合同生效起至今	28.3558%	0.0032%	3.8247%	0.0000%	24.5311%	0.0032%

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





§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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（已离任）,创新业务部负责人	2021-05-18	2026-08-07	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）、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）、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理（自 2020 年 12 月 1 日至 2026 年 8 月 6 日）和新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理（自 2021 年 5 月 18 日至 2026 年 8 月 6 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）。
徐铭	本基金的基金经理	2026-08-07	-	10 年	徐铭女士，硕士，10 年证券基金投资研究经验。曾任上海国利货币

					经纪有限公司货币市场部经纪人、汇添富基金管理股份有限公司债券交易员、恒越基金管理有限公司信用研究员、上海证券有限责任公司资产管理总部大集合产品基金经理。现任新疆前海联合弘利债券型证券投资基金基金经理（自 2026 年 3 月 10 日起任职）、新疆前海联合现金添利货币市场基金基金经理（自 2026 年 3 月 10 日起任职）、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理（自 2026 年 8 月 7 日起任职）和新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理（自 2026 年 8 月 7 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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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，并且交易占优比也没有明显异常，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，中国经济整体延续供强需弱、内外分化的运行特征。经济增长边际修复，实际 GDP 同比增速较二季度小幅抬升，三季度预计同比增长 4.5%（二季度为 4.3%）。在 PPI 持续回升的带动下，名义 GDP 增速提速更为显著，三季度预计同比增长 6.2%，名义增速明显高于实际增速，GDP 平减指数持续转正。从债市表现来看，三季度债券市场整体呈现长端牛市、短端震荡的结构性行情。利率债长端品种与信用债整体表现亮眼，短端利率债及同业存单表现相对平淡。三季度资金面整体呈现“体感偏松、价格偏高”的特征，整体表现为量松价不松。市场流动性总量相对充裕，但 DR001 中枢持续站稳 1.35%上方，资金价格居高不下，导致市场投资者对短端资产的配置热情整体偏弱。（数据来源：国家统计局、wind）

同业存单市场走势与资金面格局高度绑定。若当前“量松价不松”的资金面特征延续，二级市场 1 年期国股同业存单收益率将维持刚性，中枢大概率稳定在 1.48%以上。当前同业存单的核心压力集中于一级发行端，若四季度无降准等增量宽松政策落地，在一级发行压力传导下，1 年期国股同业存单收益率存在突破 1.50%的上行空间。（数据来源：wind）

报告期内，本基金规模在三季度有所增长。在充分保障组合流动性的前提下，择机配置同业存单和银行存款，增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末新疆前海联合海盈货币 A 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.2552%,同期业绩比较基准收益率为 0.0894%;截至报告期末新疆前海联合海盈货币 B 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.3081%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	127,677,027.42	23.33
	其中:债券	127,677,027.42	23.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	166,044,514.80	30.34
	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	253,539,197.99	46.33
4	其他资产	-	-
5	合计	547,260,740.21	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

无。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	22
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	42
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

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。

5.3.2 报告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	83.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	7.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	2.74	-
	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）	6.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.38	-

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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	7,004,144.93	1.28
6	中期票据	-	-
7	同业存单	120,672,882.49	22.13

8	其他	-	-
9	合计	127,677,027.42	23.42
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按公允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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112614007	26 江苏银行 CD007	200,000	19,990,576.75	3.67
2	112695702	26 长沙银行 CD087	200,000	19,961,425.07	3.66
3	112694193	26 广州农村商业银行 CD037	100,000	9,995,309.43	1.83
4	112605280	26 建设银行 CD280	100,000	9,977,581.10	1.83
5	112619158	26 恒丰银行 CD158	100,000	9,977,544.68	1.83
6	112693504	26 珠海华润银行 CD015	100,000	9,966,893.37	1.83
7	112615042	26 民生银行 CD042	100,000	9,941,728.58	1.82
8	112680716	26 江西银行 CD079	100,000	9,933,157.90	1.82
9	112515285	25 民生银行 CD285	80,000	7,991,193.10	1.47
10	072610182	26 华安证券 CP005	70,000	7,004,144.93	1.28

5.7 “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	0.0013%
报告期内偏离度的最低值	-0.0012%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0005%

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%。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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

26 华安证券 CP005 发债主体受到监管部门处罚情况：

2026 年 4 月 7 日，根据皖银罚决字[2026]4 号，因未按规定开展客户尽职调查、未按规定报告可疑交易，华安证券被央行安徽省分行警告并处罚款 44.10 万元。

本基金对华安证券所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

除上述主体外，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。

5.9.3 其他资产构成

无。

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
报告期期初基金份额总额	27,015,126.54	327,187,790.32
报告期期间基金总申购份额	8,811,182.50	1,840,828,711.22
报告期期间基金总赎回份额	22,629,614.64	1,636,022,138.45
报告期期末基金份额总额	13,196,694.40	531,994,363.09

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	-	61,907.60	-	-
合计			61,907.60	-	

注：红利再投指本报告期内管理人固有资金红利再投合计数。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260929 - 20260929	-	100,017,082.10	-	100,017,082.10	18.35%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准新疆前海联合海盈货币市场基金募集的文件；

2、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》；

3、《新疆前海联合海盈货币市场基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

9.2 存放地点

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

9.3 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

二〇二六年十月二十七日