新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6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:中国光大银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

§1 重要提示

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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月10日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	前海联合泳盛纯债	
基金主代码	006358	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年1月10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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	499,061,094.21份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合泳盛纯债A	前海联合泳盛纯债C
下属分级基金的交易代码:	006358	006359
报告期末下属分级基金的份额总额	499,054,753.01份	6,341.20份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,通过定量分析增强组合策略操作的方法,确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果,利用自主开发的信用分析系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括:期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。 首先,本基金宏观周期研究的基础上,决定整体组合的久期、杠杆率策略。 一方面,本基金将分析众多的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等),并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面,本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析,从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上,确定资产在非信用类固定收益类证券(现金、国家债券、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,整体组合的久期范围以及杠杆率水平。 其次,本基金将在期限结构策略、行业轮动策略的基础上获得债券市场整体回报率,通过息差策略、个券挖掘策略获得超额收益。 1、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期配置;当收益率曲线走势难以判断时,参考基准指数的样本券久期构建组合久期,确保组合收益超过基准收益。具体来看,又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。 (1)骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。 (2)子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点,适用于收益率曲线较陡时;杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端,适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动;梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分别于收益率曲线,适用于收益率曲线水平移动。 2、行业配置策略。债券市场所涉及行业众多,同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生,本基金分别采用以下的分析策略: (1)分散化投资:发行人涉及众多行业,本基金将保持在各行业配置比例上的分散化结构,避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。 (2)行业投资:本基金将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判,确定在下一阶段在各行业的配置比例,卖出景气度降低行业的债券,提前布局景气度提升行业的债券。 3、息差策略。通过正回购,融资买入收益率高于回购成本的债券,从而获得杠杆放大收益。 本基金将采取低杠杆、高流动性策略,适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报,选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种,灵活控制杠杆组合仓位,降低组合波动率。 针对中小企业私募债券,本基金以持有到期,获得本金和票息收入为主要投资策略,同时,密切关注债券的信用风险变化,力争在控制风险的前提下,获得较高收益。本基金投资中小企业私募债,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。 4、个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性,在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略,甄别具有估值优势、基本面改善的公司,采取高度分散策略,重点布局优势债券,争取提高组合超额收益空间。 5、资产支持证券投资策略。本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。
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	本基金为债券型基金,长期平均风险与预期收益率高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱张斌	石立平
	联系电话	0755-82780666	010-63639180
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95595
传真		0755-82780000	010-63639132

2.4信息披露方式

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

§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

基金级别	前海联合泳盛纯债A	前海联合泳盛纯债C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月10日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月10日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,438,715.66	2,633,130.64
本期利润	10,156,731.67	2,205,207.52
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0082
本期基金份额净值增长率	2.23%	4.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0152	0.0331
期末基金资产净值	510,159,680.50	6,596.74
期末基金份额净值	1.0223	1.0403

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

前海联合泳盛纯债A

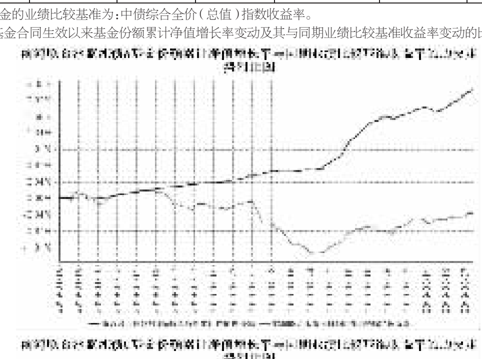
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.52%	0.03%	0.28%	0.03%	0.24%	0.00%
过去三个月	1.75%	0.04%	-0.24%	0.06%	1.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.23%	0.03%	-0.31%	0.05%	2.54%	-0.02%

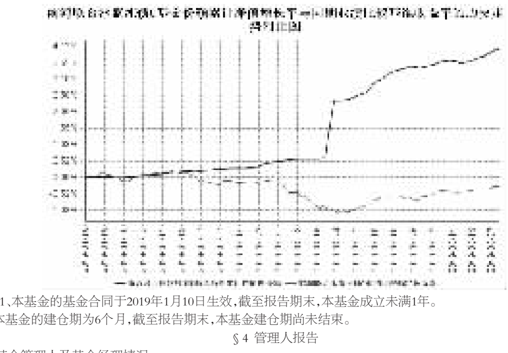
前海联合泳盛纯债C

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
过去一个月	0.50%	0.03%	0.28%	0.03%	0.22%	0.00%
过去三个月	3.51%	0.19%	-0.24%	0.06%	3.75%	0.13%
自基金合同生效起至今	4.03%	0.14%	-0.31%	0.05%	4.34%	0.09%

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





注:1、本基金的基金合同于2019年1月10日生效,截至报告期末,本基金成立未满1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。

§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。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22只开放式基金,包括2只货币市场基金、10只债券型基金、9只混合型基金和1只指数型基金,另管理11只专户理财产品,管理资产总规模超过341亿元人民币。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾婷婷	本基金的基金经理	2019年1月24日	-	7年	曾婷婷女士,北京大学硕士、中山大学双学士,CPA,7年证券、基金从业经历。2013年4月至2015年8月任华润元大基金固定收益部研究员。2011年11月至2013年3月,任职于第一创业证券研究所。2008年10月至2011年10月任安永会计师事务所高级审计。2015年10月加入前海联合基金。现任前海联合泳盛纯债兼新疆前海联合海盈货币、前海联合汇盈货币和前海联合泳辉纯债的基金经理。
张雅洁	本基金的基金经理	2019年1月10日	-	9年	张雅洁女士,悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士,9年证券基金投资研究经验。2013年6月至2015年9月在博时基金从事固定收益研究和投资工作,曾担任博时上证企债30ETF等基金的基金经理助理,2010年2月至2013年5月在融通基金从事信用债研究工作。2015年9月加入前海联合基金,现任前海联合泳盛纯债兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添鑫定开债券、前海联合添和纯债、前海联合永兴纯债、前海联合添惠纯债、前海联合泳祺纯债和前海联合泳益纯债的基金经理。

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"为根据公司对外公告的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。

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。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年,货币政策宽松,资金面关键时点边际收紧,债市总体震荡。年初经济数据依然较差,央行通过公开市场、定向降准、全面降准等手段持续释放流动性,债券市场大幅走强,收益率下行。紧接着2月社融数据大超市场预期,市场风险偏好显著回升,股市大涨,债市调整,股债跷跷板效应明显。3月经济数据走弱。央行公开市场操作出现了降频缩量,资金面边际收紧,美联储议息会议宣布暂停加息,债券收益率曲线平坦化,短端上行,长端下行。

二季度,债市先跌后涨,4月因社融数据大幅反弹,猪价带动通胀反弹,资金面宽松边际减弱,债市大幅调整,收益率大幅上行。中美贸易摩擦在5月突然升温,经济数据明显回落。5月底银行托管事件对资金面有较大冲击,引发市场流动性分层,为了应对银行托管事件对资金面冲击以及外部的不确定性,央行加大公开市场的流动性投放,利率中枢下行,债市收益率全面下行。6月经济数据继续走弱,中美贸易摩擦未见缓和,加上包商银行事件持续发酵,央行加大公开市场投放力度,对小银行进行定向降准、再贴现、SLF、增信存单发行,同时直接增加券商短期融资券待偿还余额,市场总量流动性增强,利率中枢再度下移。资金面的充裕导致债券收益率大幅下行。

本基金成立之初主要配置存款、短债,回购。经过一段时间运作,本基金配置重心将转向信用债,增加配置部分收益较好的中等等级的城投债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合泳盛纯债A基金份额净值为1.0223元,本报告期基金份额净值增长率为2.23%;截至本报告期末前海联合泳盛纯债C基金份额净值为1.0403元,本报告期基金份额净值增长率为4.03%;同期业绩比较基准收益率为-0.31%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济面临下行压力,外需走弱。二季度房地产调控有收紧的趋势,反映出政府对未来经济模式和走向清晰的定位,下半年房地产投资有回落风险。

在全球经济下行的背景下,货币政策有所松动,部分国家已启动降息操作,美联储释放鸽派信号,美国降息概率显著上升,国内货币政策的制约也相应减少。虽CPI在二季度阶段性走高,但预计通胀难以形成掣肘。

总体看,基本面及货币政策对债市利好,关键时点资金面有扰动,调整可能是较好的机会。

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,由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成,分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议,但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内,参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7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

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,中国光大银行股份有限公司在新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金(以下称"本基金")托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金2019年半年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§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:新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日
资 产:	
银行存款	257,959.11
结算备付金	725,895.80
存出保证金	2,965.38
交易性金融资产	495,688,800.00
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	435,402,800.00
资产支持证券投资	60,286,000.00
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	39,952,259.93
应收证券清算款	8,575.36
应收利息	13,897,229.60
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	550,533,685.18
负债和所有者权益	**本期末 2019年6月30日**
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	40,050,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	125,376.83
应付托管费	41,792.27
应付销售服务费	1.02
应付交易费用	11,328.05
应交税费	52,591.39
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	86,318.38
负债合计	40,367,407.94
所有者权益:	
实收基金	499,061,094.21
未分配利润	11,105,183.03
所有者权益合计	510,166,277.24
负债和所有者权益总计	550,533,685.18

注:1、报告截止日2019年6月30日,前海联合泳盛纯债A基金份额净值1.0223元,基金份额总额499,054,753.01份;前海联合泳盛纯债C基金份额净值1.0403元,基金份额总额6,341.20份。前海联合泳盛纯债份额总额合计为499,061,094.21份。

2、本基金的基金合同生效日为2019年1月10日,无上年度末可比数据。

6.2利润表

会计主体:新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	14,755,147.67
1.利息收入	14,709,419.91
其中:存款利息收入	1,062,969.23
债券利息收入	10,682,204.07
资产支持证券利息收入	1,170,634.05
买入返售金融资产收入	1,793,612.56
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-3,261,437.53
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-3,265,001.82
资产支持证券投资收益	3,564.29
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	3,290,092.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	17,072.40
减:二、费用	2,393,208.48
1.管理人报酬	931,041.58
2.托管费	310,347.21
3.销售服务费	259,035.53
4.交易费用	14,172.18
5.利息支出	751,422.41
其中:卖出回购金融资产支出	751,422.41
6.税金及附加	34,271.19
7.其他费用	92,918.38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	12,361,939.19
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	12,361,939.19

注:本基金的基金合同生效日为2019年1月10日,无上年度可比期间数据。

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	603,516,661.09	-	603,516,661.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,361,939.19	12,361,939.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-104,455,566.88	-1,256,756.16	-105,712,323.04
其中:1.基金申购款	499,052,964.93	948,265.17	500,001,230.10
2.基金赎回款	-603,508,531.81	-2,205,021.33	-605,713,553.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	499,061,094.21	11,105,183.03	510,166,277.24

注:本基金的基金合同生效日为2019年1月10日,无上年度可比期间数据。

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:

王晓耕　　刘菲　　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

新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金(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]1150号《关于准予新疆前海联合泳盛纯债债券型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《新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2018年12月4日至2019年1月8日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 603,516,644.62 元;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(2019)第0007号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金合同》于2019年1月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为603,516,661.09份基金份额,其中认购资金利息折合为16.47份基金份额。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金根据认(申)购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费,不收取销售服务费的,称为A 类基金份额;收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,不收取认购费和申购费的,称为C 类基金份额。本基金的A 类基金份额和C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金的A 类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合泳盛纯债债券型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,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、公开发行的次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具和货币市场工具。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2019年8月24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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年上半年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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月10日 (基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告 [2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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。对资管产品在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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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费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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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("新疆前海联合")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("中国光大银行")	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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

无。

6.4.8.1.2债券交易

无。

6.4.8.1.3债券回购交易

无。

6.4.8.1.4权证交易

无。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	931,041.58
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:自2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日,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X0.3%管理费费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	310,347.21

注:自2019年1月10(基金合同生效日)日至2019年6月30日,支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值X 0.10%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。

6.4.8.2.3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 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合泳盛纯债A	前海联合泳盛纯债C	合计
新疆前海联合	-	259,035.53	259,035.53
合计	-	259,035.53	259,035.53

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金份额销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	257,959.11	128,506.79

注:本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.4.10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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	495,688,800.00	90.04
	其中:债券	435,402,800.00	79.09
	资产支持证券	60,286,000.00	10.95
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	39,952,259.93	7.26
	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	983,854.91	0.18
8	其他各项资产	13,908,770.34	2.53
9	合计	550,533,685.18	100.00

7.2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前十名股票投资明细

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

7.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	143,338,200.00	28.10
	其中:政策性金融债	52,530,200.00	10.30
4	企业债券	271,908,600.00	53.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,156,000.00	3.95
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	435,402,800.00	85.35

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	108602	国开1704	420,000	42,424,200.00	8.32
2	1980077	19长顺社会债	300,000	30,510,000.00	5.98
3	1980054	19清镇城投债	300,000	30,486,000.00	5.98
4	1880220	18贵阳经开债01	290,000	30,429,700.00	5.96
5	1780271	17安顺专项债	300,000	30,384,000.00	5.96

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149805	借呗54A1	300,000	30,060,000.00	5.89
2	149993	花呗65A1	200,000	20,212,000.00	3.96
3	149690	借呗53A1	100,000	10,014,000.00	1.96

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报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.11投资组合报告附注

7.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.11.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.11.3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	2,965.38
2	应收证券清算款	8,575.36
3	应收股利	-
4	应收利息	13,897,229.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,908,770.34

7.11.4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。

7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6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

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
前海联合泳盛纯债A	241	2,070,766.61	499,050,803.47	100.00%	3,949.54	0.00%
前海联合泳盛纯债C	193	32.86	-	-	6,341.20	100.00%
合计	375	1,330,829.58	499,050,803.47	100.00%	10,290.74	0.00%

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	前海联合泳盛纯债A	1,785.25	0.0004%
	前海联合泳盛纯债C	3,011.44	47.4901%
	合计	4,796.69	0.0010%

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)。

8.3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的情况

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	前海联合泳盛纯债A	0~10
	前海联合泳盛纯债C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合泳盛纯债A	0~10
	前海联合泳盛纯债C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	前海联合泳盛纯债A	前海联合泳盛纯债C
基金合同生效日(2019年1月10日)基金份额总额	4,412.22	603,512,248.87
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	499,050,914.28	2,050.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	573.49	603,507,958.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	499,054,753.01	6,341.20

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

本报告期基金管理人、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

本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

本基金因成立时间较短,暂未进行审计。本基金管理人拟聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对基金2019年年报进行审计。

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

本报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华创证券	2	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》:

(1)券商选择标准:

1)实力雄厚,信誉良好;内部管理规范,严格;注册资本符合证监会相关要求;

2)研究实力较强,有稳定的研究机构和专业的研究人员,能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务,包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等,并能根据基金投资的特定需求,提供专门研究报告;

3)券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的,对该券商研究方面的要求按照上述第2点规定执行;

(2)券商选择程序:

1)券商研究质量与研究服务评价;

2)拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商;

3)上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准;

4)签约。在获得批准后,按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

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	
	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
华创证券	140,994,920.55	100.00%	3,914,650,000.00	100.00%	-	-

§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	20190101-20190630	499,050,803.47	-	-	499,050,803.47	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
注:本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,单一投资者持有基金份额比例过于集中可能引起产品的流动性风险,本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,有效防控产品流动性风险,公平对待投资者,保障中小投资者合法权益,本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权,不受特定投资者的影响。							

注:报告期内申购份额包含红利再投份额。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

新疆前海联合基金管理有限公司

2019年8月24日