新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

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:南京银行股份有限公司
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。

基金托管人南京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1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	前海联合泓鑫混合	
基金主代码	002780	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月26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	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,291,300.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合泓鑫混合A	前海联合泓鑫混合C
下属分级基金的交易代码:	002780	007043
报告期末下属分级基金的份额总额	165,451,467.98份	839,832.18份

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过对不同资产类别的优化配置及组合精选,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值.此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。 在大类资产配置中,本基金主要考虑 q 宏观经济指标,包括国际经济和国内经济的GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等,以判断阶段性的最优资产; q 微观经济指标,包括市场供金供求状况、不同类别资产的盈利变化情况及盈利预期等; q 对场方面指标,包括市场成交量、估值水平、股票及债券市场的涨跌及预期收益率以及反映投资人情绪的技术指标等; q 政策因素,包括宏观政策、资本市场相关政策和整个行业相关政策等的出台对市场的影响等。 2.股票投资策略 q 行业配置策略 本基金管理人在进行行业配置时,将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中,基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。 Q 优选个股策略 本基金构建股票组合的步骤是:根据定量与定性分析确定股票初选库;基于公司基本面全面考量,筛选优势企业,运用现金流贴现模型等估值方法,分析股票内在价值;结合风险管理,构建股票组合并对其进行动态调整。 3.债券投资策略 在选择债券品种时,第一,综合考虑发债主体的信用水平、主营业务情况、发展情况、财务指标、国家政策和市场机遇等因素进行动态调整;第二,根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;第三,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;第四,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资.在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。 4.权证投资策略 本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。 基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。 5.股指期货投资策略 为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货等金融衍生品,本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。 6.国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作.基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险,对冲特殊情况下的流动性风险。 7.资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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	南京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	琼依斌	王峰
	联系电话	0755-82780666	021-24198808
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	Wangf@njcbtg.com
客户服务电话		400-640-0099	95302
传真		0755-82780000	021-54662130

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	前海联合泓鑫混合A	前海联合泓鑫混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	17,632,490.16	23,160.97
本期利润	39,995,424.73	13,714.25
加权平均基金份额本期利润	0.1884	0.0202
本期基金份额净值增长率	21.18%	6.61%
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	0.0306	0.1243
期末基金资产净值	185,926,786.83	948,847.30
期末基金份额净值	1.1238	1.1298

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。

4、本基金自2019年2月26日起,增加C类基金份额并设置相应的基金代码。

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

前海联合泓鑫混合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	6.61%	1.33%	2.84%	0.57%	3.77%	0.76%
过去三个月	0.74%	1.57%	-0.54%	0.75%	1.28%	0.82%
过去六个月	21.18%	1.36%	13.28%	0.77%	7.90%	0.59%
过去一年	10.83%	1.33%	6.62%	0.76%	4.21%	0.57%
自基金合同生效起至今	12.38%	1.23%	4.69%	0.58%	7.69%	0.65%

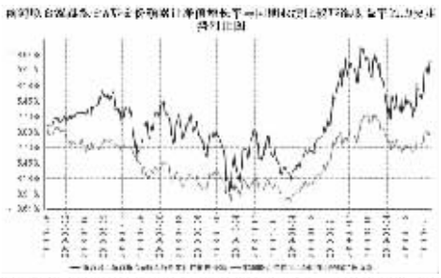
前海联合泓鑫混合C

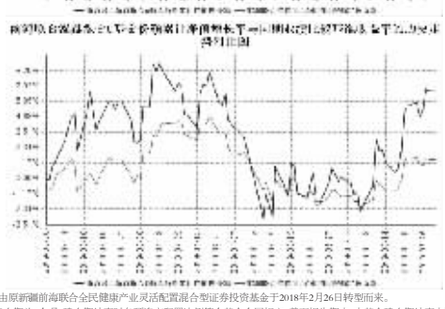
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.59%	1.33%	2.84%	0.57%	3.75%	0.76%
过去三个月	1.11%	1.57%	-0.54%	0.75%	1.65%	0.82%
自基金合同生效起至今	6.61%	1.48%	1.39%	0.77%	5.22%	0.71%

注:1、本基金的业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。

2、本基金自2019年2月26日起,增加C类基金份额并设置相应的基金代码。

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、本基金由原新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金于2018年2月26日转型而来。

2、本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定,截至报告期末,本基金建仓期结束未满1年。

3、本基金自2019年2月26日起,增加C类基金份额并设置相应的基金代码;前海联合泓鑫混合C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起始日为2019年2月26日。

§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		
林材	本基金的基金经理	2016年11月30日	-	11年	林材先生,理学硕士,11年证券基金投资研究经验,2011年10月至2015年7月任金元顺安基金经理,2008年11月至2011年10月任民生加银基金医药行业研究员,基金经理助理,2000年7月至2003年9月曾任职于广州医药集团,2015年9月加入前海联合基金,现任前海联合泓鑫混合兼前海联合沪深300、前海联合添利债券、前海联合新思路混合、前海联合国民健康混合和前海联合研究优选混合的基金经理。
何杰	本基金的基金经理	2018年4月12日	-	9年	何杰先生,经济数学理学硕士,9年证券、基金投资研究经验。2013年5月至2018年2月任前海人寿保险投份有限公司资产管理中心投资经理,2010年3月至2013年3月任华创证券股份有限责任公司研究所研究员。2018年3月加入前海联合基金,现任前海联合泓鑫混合兼前海联合研究优选混合、前海联合润丰混合、前海联合新思路混合和前海联合先进制造的基金经理。

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投权、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运作分析

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年,宏观预期下调、信用风险、贸易战仍然是影响市场的三大主要因素,不同于去年的是,年初决策层"六个稳"各项措施,使得信用风险得到有效的控制;贸易战虽然在5月份再次出现反复,但边际影响趋弱;而二季度经济数据确认下行后,宏观经济和企业盈利的预期下行空间,成为影响市场的最主要因素。

从市场表现看,一季度在前述三大因素集体向好的共振下快速上涨;二季度经济预期下调、贸易战反复,市场出现较大幅度回调.但由于信用风险的有效控制,以及减税降费等政策措施的落地,我们认为本轮调整低点和中长期底部区间已经出现。

从本基金实际操作情况看:一季度,我们采取精选个股、保持中性仓位的策略,1-2月表现较好,但3月份跑输市场;二季度,市场大幅回调,我们踏合考虑市场的极端风险可控,因此在下跌中将整体仓位提高至较高水平,并适当优化了持仓结构,最终获得较好超额收益。

配置结构上,考虑到中国正处于新旧动能重要转换期,我们认为,云计算、5G、新能源、创新药为代表的新经济板块,仍将是中长期高质量发展的主线;消费板块中,满足美好生活需求将贯穿主线,医疗服务、品牌消费、大众消费品长期看仍将稳健增长;周期板块中,虽然总量下行趋势确认,但仍可关注市场份额和ROE持续提升的行业龙头。综上,我们在个股选择上,仍主要按上述思路精选基本面优秀、增长趋势明确的优质公司,坚守长期价值投资底线,与上市公司共同成长。

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泓鑫混合A基金份额净值为1.1238元,本报告期基金份额净值增长率为21.18%,同期业绩比较基准收益率为13.28%;截至本报告期末前海联合泓鑫混合C基金份额净值为1.1298元,本报告期基金份额净值增长率为6.61%,同期业绩比较基准收益率为1.39%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们对主导市场的重要因素排序,仍然为宏观预期和企业盈利、贸易战、信用风险。

从基本面看,地产、基建韧性好于预期,经济失速风险不大,而宏观经济和企业盈利预期有望在三季度见底;从市场估值看,仍处于历史合理区下方;从流动性看,货币政策总体仍维持宽松预期,且保持不发生系统性风险的底线。

因此,我们对下半年市场总体走势中性偏乐观,而随着经济预期见底,结构性机会可能会相对增多。

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银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行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书后复核工作,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,本基金托管人在对新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,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,不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金的管理人一一新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何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。

本基金报告期内未进行利润分配。

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

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鑫灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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核查,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:新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	4,419,425.81	3,612,961.88
结算备付金	2,474,660.13	4,487,330.58
存出保证金	511,262.14	456,000.40
交易性金融资产	173,948,600.17	117,243,222.90
其中:股票投资	163,945,600.17	97,179,222.90
基金投资	-	-
债券投资	10,003,000.00	20,064,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	9,200,000.00	82,000,150.00
应收证券清算款	-	641,312.69
应收利息	326,077.63	357,201.44
应收股利	-	-
应收申购款	23,360.46	564.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	190,903,386.34	208,798,744.04
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31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	-	-
应付证券清算款	3,165,580.28	501,297.38
应付赎回款	4,941.40	9.12
应付管理人报酬	236,645.37	283,194.10
应付托管费	23,664.54	28,319.43
应付销售服务费	312.97	-
应付交易费用	499,221.46	398,259.24
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	97,386.19	340,000.02
负债合计	4,027,752.21	1,551,079.29
所有者权益:		
实收基金	166,291,300.16	223,477,013.12
未分配利润	20,584,333.97	-16,229,348.37
所有者权益合计	186,875,634.13	207,247,664.75
负债和所有者权益总计	190,903,386.34	208,798,744.04

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额166,291,300.16份.其中A类基金份额净值1.1238元,A类基金份额165,451,467.98份;C类基金份额净值1.1298元,C类基金份额839,832.18份。

6.2利润表

会计主体:新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一.收入	43,740,922.91	-1,706,819.29
1.利息收入	882,765.39	1,042,324.43
其中:存款利息收入	69,011.72	99,051.51
债券利息收入	283,717.17	76,230.13
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	530,036.50	867,042.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以"-"填列)	20,460,438.05	-1,029,528.71
其中:股票投资收益	18,884,904.51	-1,913,562.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	50,435.81	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,525,097.73	884,033.60
3.公允价值变动收益 (损失以"-"号填列)	22,353,487.85	-1,720,447.50
4.汇兑收益 (损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以"-"号填列)	44,231.62	832.49
减:二.费用	3,731,783.93	1,886,114.92
1.管理人报酬	1,667,421.10	914,576.57
2.托管费	166,742.14	91,457.72
3.销售服务费	1,030.71	-
4.交易费用	1,735,403.48	810,786.88
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	0.31	-
7.其他费用	161,186.19	69,293.75
三.利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	40,009,138.98	-3,592,934.21
减:所得税费用	-	-
四.净利润 (净亏损以"-"号填列)	40,009,138.98	-3,592,934.21

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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)	223,477,013.12	-16,229,348.37	207,247,664.75
二.本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	40,009,138.98	40,009,138.98
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)	-57,185,712.96	-3,195,456.64	-60,381,169.60
其中:1.基金申购款	2,020,812.94	213,486.31	2,234,299.25
2.基金赎回款	-59,206,525.90	-3,408,942.95	-62,615,468.85
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)	166,291,300.16	20,584,333.97	186,875,634.13
项目	上年度可比期间 2018年2月26日(基金合同生效日)至2018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)	48,511,259.39	443,045.83	48,954,305.22
二.本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-3,592,934.21	-3,592,934.21
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)	193,593,643.59	6,583,286.96	200,176,930.55
其中:1.基金申购款	193,718,694.94	6,586,843.25	200,305,538.19
2.基金赎回款	-125,051.35	-3,556.29	-128,607.64
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)	242,104,902.98	3,433,398.58	245,538,301.56

注:本基金的基金合同生效日为2018年2月26日,上年度可比期间为2018年2月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日。

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

新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")由原新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"原基金")变更而来。原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[2016]113号《关于准予新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由基金管理人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《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金为契约型开放式基金,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200,705,876.98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(2016)第1563号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月30日正式生效,原基金合同生效日的基金份额总额为200,706,010.90份基金份额,其中认购资金利息折合133.92份基金份额。原基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

原基金基金份额持有人大会自2018年2月5日至2018年2月25日(基金合同失效前日)止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,并报中国证监会备案。根据原基金基金份额持有人大会决议,《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自2018年2月26日生效,同时《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金正式转型为新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式,存续期限不定,原基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为48,954,305.22元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合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,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等)、资产支持证券、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)、同业存单、股指期货、国债期货、货币市场工具、权证以及经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相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,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:沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*50%。

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》、《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合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。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》、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》、财税[2016]36号《关于金融推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确金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股票、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纳税销售额。

(2)对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,股票的股息、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)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.对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税.对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)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未能发揮其本和本人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、基金销售机构、登记机构
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	基金托管人

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8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1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,667,421.10	914,576.57
其中:支付销售机构的客户维护费	6,163.82	227.00

注:支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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 X 1.50% / 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1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年2月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	166,742.14	91,457.72

注:支付基金托管人南京银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 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1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合泓鑫混合A	前海联合泓鑫混合C	合计
新疆前海联合	-	0.73	0.73