

新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 债券回购融资情况.....	33
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	33
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	34
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	35
7.8 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.....	35
7.9 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36

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	36
§9 开放式基金份额变动.....	37
§10 重大事件揭示.....	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
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	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	39
10.9 其他重大事件	39
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	40
§12 备查文件目录.....	40
12.1 备查文件目录.....	40
12.2 存放地点.....	40
12.3 查阅方式.....	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合海盈货币市场基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	12,142,465,472.94 份	
基金合同存续期	不定期	
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	381,765,117.87 份	11,760,700,355.07 份

2.2 基金产品说明

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	<p>本基金将采用积极管理的投资策略，通过对货币市场利率走势的预判，控制利率风险、在满足基金流动性需求的前提下，减少基金资产净值波动，力争获取超越比较基准的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过比较各类资产的风险与收益率变化，动态调整优先配置的资产类别和配置比例，在满足流动性需求的前提下择机进行杠杆操作。</p> <p>2、利率债投资策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的研究方法，通过对宏观经济走势的预判以及资本市场流动性变化的预测估算未来利率市场的走势及合理中枢，进而动态调整组合的久期策略。</p> <p>3、信用债投资策略</p> <p>本基金通过“自下而上”的定性和定量的研究方法分析发债主体的实际偿债能力来控制投资组合信用风险，以达到信用风险可控的目标。</p>
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李华
	联系电话	0755-82780666
	电子邮箱	service@qhlhfund.com
客户服务电话	400-640-0099	95588
传真	0755-82780000	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	广东省深圳市福田区华富路 1018 号中航中心 26 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518031	100140
法定代表人	王晓耕	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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

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	深圳市福田区华富路 1018 号中航中心 26 楼

§ 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	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	217,659.38	44,945,392.00
本期利润	217,659.38	44,945,392.00
本期净值收益率	1.1514%	1.2756%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	381,765,117.87	11,760,700,355.07

期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
累计净值收益率	1.2050%	1.3341%

注：1、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，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。

2、本基金收益分配方式是按日结转份额。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

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

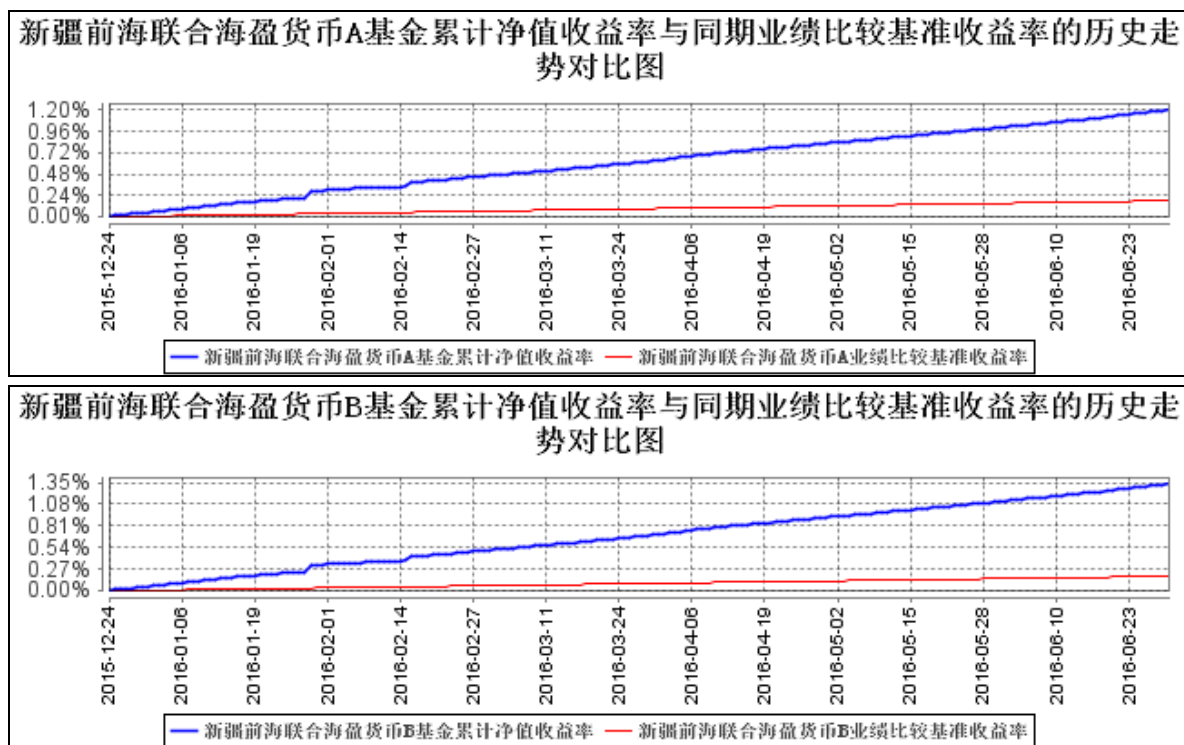
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1988%	0.0016%	0.0287%	0.0000%	0.1701%	0.0016%
过去三个月	0.5631%	0.0011%	0.0870%	0.0000%	0.4761%	0.0011%
过去六个月	1.1514%	0.0062%	0.1740%	0.0000%	0.9774%	0.0062%
自基金合同生效起至今	1.2050%	0.0061%	0.1817%	0.0000%	1.0233%	0.0061%

新疆前海联合海盈货币 B

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
过去一个月	0.2184%	0.0016%	0.0287%	0.0000%	0.1897%	0.0016%
过去三个月	0.6249%	0.0011%	0.0870%	0.0000%	0.5379%	0.0011%
过去六个月	1.2756%	0.0062%	0.1740%	0.0000%	1.1016%	0.0062%
自基金合同生效起至今	1.3341%	0.0061%	0.1817%	0.0000%	1.1524%	0.0061%

注：本基金业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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



注：1、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 24 日。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§ 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，本公司管理 1 只货币市场基金，资产规模超过 121 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		
张雅洁	本基金的基金经理	2015年12月24日	-	7年	张雅洁女士，悉尼大学及中央昆士兰大学金融学与会计学双硕士，7年证券从业经验，具有基金从业资格。曾在融通基金管理有限公司、博时基金管理有限公司工作，从事渠道管理、固定收益研究以及投资研究等工作，曾担任博时上证企债30ETF等基金的基金经理助理，具有丰富的固定收益投研经验。

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”为根据公司决定确定的解聘日期。

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》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行，保护投资者合法权益。本报告期内，本基金管理人仅有新疆前海联合海盈货币市场基金一只产品运作，不存在非公平交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发现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

本基金 2016 年上半年的配置策略以“短久期、高评级”阶梯配置为主，重点满足流动性需求。

在基金成立之初配置策略相对谨慎，重点满足流动性需求，投资品种以匹配封闭期的协议存款为主。基金打开申赎后，一季度基于对货币市场利率处于底部区域的判断，组合资产维持短久期的配置。同时考虑到春节前银行为应对提现需求增加，以及一季度末 MPA 考核将导致节点性的流动性偏紧，届时增加了协议存款和 AAA 评级银行存单的配置比例以获取超额收益。

二季度以来，考虑到市场对信用风险担忧而导致短融和超短融交易不活跃，组合资产仍以存单和协议存款为主。从本年定调为稳健货币政策的角度来分析，债券市场收益率进一步大幅下行的概率较低，因此组合资产也不宜大幅提高久期。另一方面，从交易性机会的角度来考虑，到年中季末银行 MPA 考核将导致节点性的流动性偏紧，故采取了适度的使用杠杆增加半年以内的协议存款和中高评级银行存单的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类基金份额净值收益率为 1.1514%，B 类基金份额净值收益率为 1.2756%，同期业绩比较基准收益率为 0.1740%。

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 2016 年下半年的债券市场，在经济基本面低迷的大背景下，企业盈利能力持续下滑，而统计局公布的 6 月 CPI 数据也给市场重建了全年低通胀态势的信心。整体上来看基本面对债市的支撑未有改变。资金面方面，考虑到目前实体经济基本处于流动性陷阱的环境中，而汇率方面也面临不可回避的贬值压力，货币政策进一步放松的概率较小，由此推演由流动性所推动的债券大牛市已在逐步走向尾声。

尽管如此，从大类资产配置的角度来看，在风险偏好仍低的市场环境下，配置固定收益类证券获取持有票息以及杠杆增厚的收益仍是较为稳妥的投资策略。

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新准则、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。基金会除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会会计复核岗位，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。配备的基金会会计具备会计资格和基金从业资格，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。

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。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 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“每日分配、按日支付”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金单位收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并每日以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益 45,163,051.38 元,实际分配收益 45,163,051.38 元。

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海盈货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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，新疆前海联合海盈货币市场基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合海盈货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》

等有关法律法规。

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海盈货币市场基金 2016 年半年度报告中财务指标、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：新疆前海联合海盈货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,795,576,601.56	13,413,996,459.56
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,566,614,760.58	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,566,614,760.58	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,531,089,576.62	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	15,203,973.45	8,935,005.37
应收股利		-	-
应收申购款		235,705,501.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,144,190,414.20	13,422,931,464.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		520,395.59	849,095.94
应付托管费		157,695.60	257,301.81
应付销售服务费		4,953.87	51.38
应付交易费用	6.4.7.7	43,661.21	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		856,093.81	976,984.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	142,141.18	80,000.00
负债合计		1,724,941.26	2,163,433.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,142,465,472.94	13,420,768,031.55
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		12,142,465,472.94	13,420,768,031.55
负债和所有者权益总计		12,144,190,414.20	13,422,931,464.93

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 12,142,465,472.94 份。其中新疆前海联合海盈货币 A 级基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 381,765,117.87 份；新疆前海联合海盈货币 B 级基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 11,760,700,355.07 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合海盈货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		53,544,610.76
1.利息收入		53,333,552.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,619,691.00
债券利息收入		9,674,646.50
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,039,214.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		76,058.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	76,058.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	135,000.00
减：二、费用		8,381,559.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,799,474.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,768,906.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,108.45
4. 交易费用	6.4.7.19	20.05
5. 利息支出		608,580.89
其中：卖出回购金融资产支出		608,580.89
6. 其他费用	6.4.7.20	183,468.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,163,051.38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,163,051.38

注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 24 日，无上年度可比期间（下同）。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合海盈货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	13,420,768,031.55	-	13,420,768,031.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,163,051.38	45,163,051.38
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）	-1,278,302,558.61	-	-1,278,302,558.61
其中：1. 基金申购款	23,521,886,255.78	-	23,521,886,255.78
2. 基金赎回款	-24,800,188,814.39	-	-24,800,188,814.39
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）	-	-45,163,051.38	-45,163,051.38

五、期末所有者权益(基金净值)	12,142,465,472.94	-	12,142,465,472.94
-----------------	-------------------	---	-------------------

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：

<u> 王晓耕 </u>	<u> 刘菲 </u>	<u> 黄嘉宇 </u>
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

新疆前海联合海盈货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）证监许可【2015】2800 号文《关于核准新疆前海联合海盈货币市场基金募集的批复》，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》、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 12 月 8 日至 2015 年 12 月 22 日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费用的净认购金额为人民币 13,411,070,976.88 元；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 2,926,682.68 元，折合为 2,926,682.68 份基金份额。以上金额共计人民币 13,413,997,659.56 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（2015）第 1401 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》于 2015 年 12 月 24 日正式生效。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》和《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书》，本基金分设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，两类基金份额单独设置基金代码，并根据投资者首次申购的最低金额是否不低于 500 万元进行不同级别基金份额的判断和处理。投资者可自行选择申购的基金份额等级，不同基金份额等级之间可以相互转换。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括：现金，通知存款，期限在一年以内（含一年）的银行存款，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的同业存单，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的非金融企业债务融资工具，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。

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》、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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。

6.4.4.2 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。

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、结算备付金、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。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。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(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。每份基金份额面值为 1.00 元。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，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下应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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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则按直线法计算。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付；

4、本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；

5、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；

6、在不违反法律法规、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；

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 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，本基金计算影子价格过程中确定债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)对于在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

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》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税；

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	203,576,601.56
定期存款	4,592,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	4,152,000,000.00
其中：存款期限 3 个月以上	440,000,000.00
其他存款	-
合计：	4,795,576,601.56

注：1、定期存款期限指定期存款的票面存期。

2、本基金报告期内提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日

		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,566,614,760.58	3,566,478,000.00	-136,760.58	-0.0011%
	合计	3,566,614,760.58	3,566,478,000.00	-136,760.58	-0.0011%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	3,531,089,576.62	-
合计	3,531,089,576.62	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	4,435.72
应收定期存款利息	2,573,609.17
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	11,835,939.15
应收买入返售证券利息	789,989.41
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	15,203,973.45

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	43,661.21
合计	43,661.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	142,141.18
合计	142,141.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,071,628.33	1,071,628.33
本期申购	500,774,547.79	500,774,547.79
本期赎回(以“-”号填列)	-120,081,058.25	-120,081,058.25
本期末	381,765,117.87	381,765,117.87

金额单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 B		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,419,696,403.22	13,419,696,403.22
本期申购	23,021,111,707.99	23,021,111,707.99
本期赎回(以“-”号填列)	-24,680,107,756.14	-24,680,107,756.14
本期末	11,760,700,355.07	11,760,700,355.07

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	217,659.38	-	217,659.38
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	-217,659.38	-	-217,659.38
本期末	-	-	-

单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	44,945,392.00	-	44,945,392.00
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	-44,945,392.00	-	-44,945,392.00
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	142,485.29
定期存款利息收入	37,457,949.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,255.93
其他	-
合计	37,619,691.00

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,433,146,345.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,391,425,938.30
减：应收利息总额	41,644,348.47
买卖债券差价收入	76,058.58

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	135,000.00
合计	135,000.00

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	20.05
银行间市场交易费用	-
合计	20.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	83,541.64
信息披露费	49,726.04

其他	415.04
汇划费	34,912.35
债券托管账户维护费	14,873.50
合计	183,468.57

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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（“新疆前海联合基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

6.4.10 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

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 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,799,474.60
其中：支付销售机构的客户维护费	19,130.96

注：本基金的管理费按前一日资产净值的0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。其计算公式为： $H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$ 。H为每日应计提的基金管理费，E为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,768,906.82

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 0.10% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。其计算公式为： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 。H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	合计
新疆前海联合基金	3,924.75	-	3,924.75
合计	3,924.75	-	3,924.75

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类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，按月支付给新疆前海联合基金，再由新疆前海联合基金计算并支付给各基金销售机构。B 级基金份额不收取销售服务费。

2、销售服务费的计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日 A 类基金份额的基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 。

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 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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
基金合同生效日(2015 年 12 月 24 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	109,000,000.00

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	-	109,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.8977%

注：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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	203,576,601.56	142,485.29

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币A				
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
191,899.01	-	25,760.37	217,659.38	-
新疆前海联合海盈货币B				
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
45,092,042.81	-	-146,650.81	44,945,392.00	-

6.4.12 期末（2016年6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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，主要投资于货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的相关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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以

中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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 2016年6月30日
A-1	80,146,414.38
A-1 以下	-
未评级	3,375,659,619.93
合计	3,455,806,034.31

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债、短期融资券和银行同业存单。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日
AAA	110,808,726.27
AAA 以下	-
未评级	-
合计	110,808,726.27

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分交易性金融资产均为银行间同业市场交易，未持有其他有重大流动性风险的投资品种。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，其上限不超过法律法规的相关规定。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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性缺口进行监控，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。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,795,576,601.56	-	-	-	4,795,576,601.56
交易性金融资产	3,566,614,760.58	-	-	-	3,566,614,760.58
买入返售金融资产	3,531,089,576.62	-	-	-	3,531,089,576.62
应收利息	-	-	-	15,203,973.45	15,203,973.45
应收申购款	-	-	-	235,705,501.99	235,705,501.99
资产总计	11,893,280,938.76	-	-	250,909,475.44	12,144,190,414.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	520,395.59	520,395.59

应付托管费	-	-	-	157,695.60	157,695.60
应付销售服务费	-	-	-	4,953.87	4,953.87
应付交易费用	-	-	-	43,661.21	43,661.21
应付利润	-	-	-	856,093.81	856,093.81
其他负债	-	-	-	142,141.18	142,141.18
负债总计	-	-	-	1,724,941.26	1,724,941.26
利率敏感度缺口	11,893,280,938.76	-	-	-249,184,534.18	12,142,465,472.94
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,413,996,459.56	-	-	-	13,413,996,459.56
应收利息	-	-	-	8,935,005.37	8,935,005.37
资产总计	13,413,996,459.56	-	-	8,935,005.37	13,422,931,464.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	849,095.94	849,095.94
应付托管费	-	-	-	257,301.81	257,301.81
应付销售服务费	-	-	-	51.38	51.38
应付利润	-	-	-	976,984.25	976,984.25
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	2,163,433.38	2,163,433.38
利率敏感度缺口	13,413,996,459.56	-	-	6,771,571.99	13,420,768,031.55

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	上升约 2,003,164.59	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 1,995,521.22	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(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。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

1) 各层次金融工具公允价值

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 3,566,614,760.58 元，无属于第一或第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产）。

2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

2、除公允价值外，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	固定收益投资	3,566,614,760.58	29.37
	其中：债券	3,566,614,760.58	29.37
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,531,089,576.62	29.08
	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	4,795,576,601.56	39.49
4	其他各项资产	250,909,475.44	2.07
5	合计	12,144,190,414.20	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.74	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中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

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	4

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。

7.3.2 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	59.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)—60 天	19.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.91	-
3	60 天(含)—90 天	9.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	97.95	-

7.4 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。

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	730,284,599.14	6.01
	其中：政策性金融债	730,284,599.14	6.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	350,400,963.09	2.89
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,485,929,198.35	20.47
8	其他	-	-
9	合计	3,566,614,760.58	29.37
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	110,808,726.27	0.91

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111618172	16 华夏 CD172	4,000,000	397,157,319.44	3.27
2	160209	16 国开 09	3,600,000	359,199,606.85	2.96
3	111693021	16 广州农村商业 银行 CD054	3,000,000	299,105,952.45	2.46
4	111611190	16 平安 CD190	2,000,000	197,707,505.67	1.63
5	111610121	16 兴业 CD121	2,000,000	197,459,289.89	1.63

6	150215	15 国开 15	1,900,000	189,999,742.48	1.56
7	130213	13 国开 13	1,100,000	110,808,726.27	0.91
8	111610179	16 兴业 CD179	1,000,000	99,938,975.87	0.82
9	111692312	16 宁波银行 CD070	1,000,000	99,912,787.27	0.82
10	111694889	16 广州农村商业 银行 CD102	1,000,000	99,779,742.66	0.82

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0920%
报告期内偏离度的最低值	-0.0919%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0283%

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%。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,203,973.45
4	应收申购款	235,705,501.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	250,909,475.44

7.9.4 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
新疆前海联合海盈货币 A	5,610	68,050.82	8,871,648.70	2.32%	372,893,469.17	97.68%
新疆前海联合海盈货币 B	78	150,778,209.68	11,665,699,967.02	99.19%	95,000,388.05	0.81%
合计	5,688	2,134,751.31	11,674,571,615.72	96.15%	467,893,857.22	3.85%

注：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）。

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	新疆前海联合海盈货币 A	4,705,864.29	1.2327%
	新疆前海联合海盈货币 B	-	-
	合计	4,705,864.29	0.0388%

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	新疆前海联合海盈货币 A	>100
	新疆前海联合海盈货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	新疆前海联合海盈货币 A	10~50
	新疆前海联合海盈货币 B	0

	合计	10 ^{~50}
--	----	-------------------

§ 9 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
基金合同生效日（2015 年 12 月 24 日） 基金份额总额	1,071,131.75	13,412,926,527.81
本报告期期初基金份额总额	1,071,628.33	13,419,696,403.22
本报告期基金总申购份额	500,774,547.79	23,021,111,707.99
减：本报告期基金总赎回份额	120,081,058.25	24,680,107,756.14
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	381,765,117.87	11,760,700,355.07

§ 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

2016 年 4 月 12 日，本基金管理人原职工监事毕晓南因个人原因离职，不再担任职工监事。经职工选举由赵伟担任职工监事。

本报告期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

本基金于 2015 年 12 月 24 日成立，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 2016 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	
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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
兴业证券	19,991,662.30	100.00%	3,035,200,000.00	100.00%	-	-

注：1、本期无租用证券公司交易单元的变更情况。

2、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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

10.9 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	新疆前海联合基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	新疆前海联合海盈货币市场基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 9 日
3	新疆前海联合基金管理有限公司关于增加新疆前海联合海盈货币市场基金代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 1 月 15 日
4	新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年春节假期前暂停大额申购业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 2 月 2 日
5	新疆前海联合基金管理有限公司关于开放港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 10 日
6	新疆前海联合基金管理有限公司网上直销交易系统上线公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 10 日
7	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 26 日
8	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 3 月 26 日
9	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 6 日
10	新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 4 月 21 日
11	新疆前海联合基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 14 日
12	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 17 日
13	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 18 日
14	新疆前海联合基金管理有限公司关于开放外国人开立证券投资基金账户的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 24 日
15	新疆前海联合基金管理有限公司关于开放外国人开立证券投资基金账户的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 30 日
16	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 5 月 31 日

17	新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年端午节假期前暂停大额申购业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 4 日
18	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 22 日
19	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 22 日
20	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 8 月 22 日发布公告，自 8 月 18 日起，增聘敬夏玺先生为本基金基金经理。

§ 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资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

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

2016 年 8 月 24 日