

新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年年度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 审计报告	13
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	36
8.1 期末基金资产组合情况	36
8.2 债券回购融资情况	36
8.3 基金投资组合平均剩余期限	37
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
8.5 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	38
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
8.7 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	39
8.8 投资组合报告附注	39
§9 基金份额持有人信息	40
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
9.3 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	40
§10 开放式基金份额变动	40
§11 重大事件揭示	41
11.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
11.4 基金投资策略的改变	41
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	43
11.9 其他重大事件	43
§12 影响投资者决策的其他重要信息	44
§13 备查文件目录	45
13.1 备查文件目录	45
13.2 存放地点	45
13.3 查阅方式	45

§ 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	12,287,385,051.54 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	494,110,978.76 份	11,793,274,072.78 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	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。 1、资产配置策略 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。 2、利率债投资策略 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。 3、信用债投资策略 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。
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	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
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	北京市西城区复兴门内大街 55

	区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qlhfund.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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	2016 年		2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
本期已实现收益	869,868.97	130,572,126.47	567.25	7,746,788.99
本期利润	869,868.97	130,572,126.47	567.25	7,746,788.99
本期净值收益率	2.3874%	2.6445%	0.0530%	0.0578%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末基金资产净值	494,110,978.76	11,793,274,072.78	1,071,628.33	13,419,696,403.22
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
累计净值收益率	2.4417%	2.7038%	0.0530%	0.0578%

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

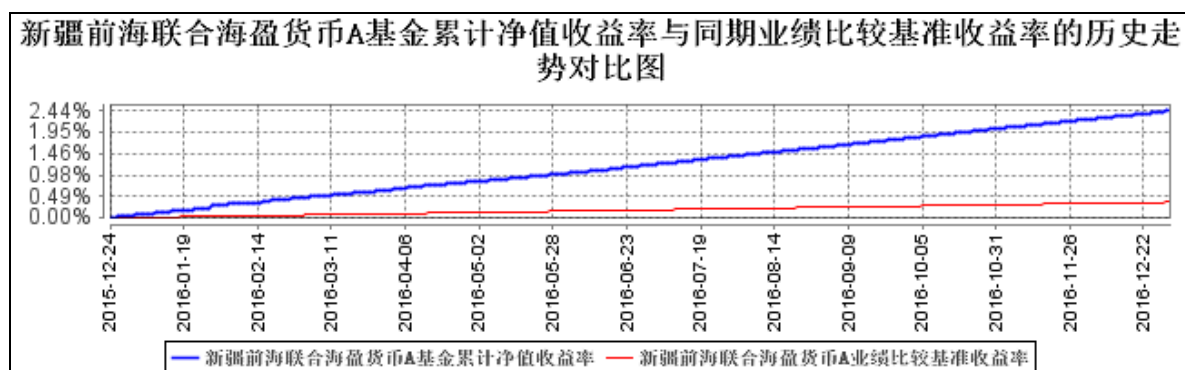
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6127%	0.0009%	0.0880%	0.0000%	0.5247%	0.0009%
过去六个月	1.2220%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.0460%	0.0011%
过去一年	2.3874%	0.0045%	0.3500%	0.0000%	2.0374%	0.0045%
自基金合同 生效起至今	2.4417%	0.0044%	0.3577%	0.0000%	2.0840%	0.0044%

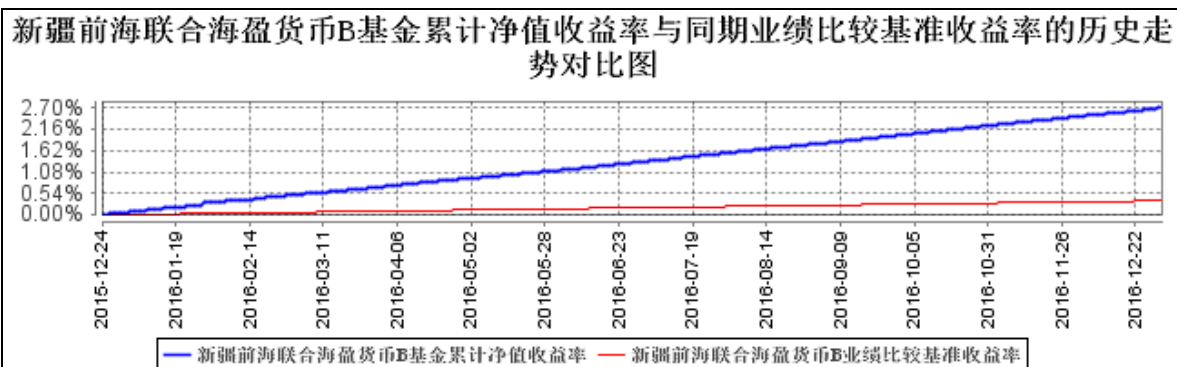
新疆前海联合海盈货币 B

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
过去三个月	0.6752%	0.0009%	0.0880%	0.0000%	0.5872%	0.0009%
过去六个月	1.3516%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.1756%	0.0011%
过去一年	2.6445%	0.0045%	0.3500%	0.0000%	2.2945%	0.0045%
自基金合同 生效起至今	2.7038%	0.0044%	0.3577%	0.0000%	2.3461%	0.0044%

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

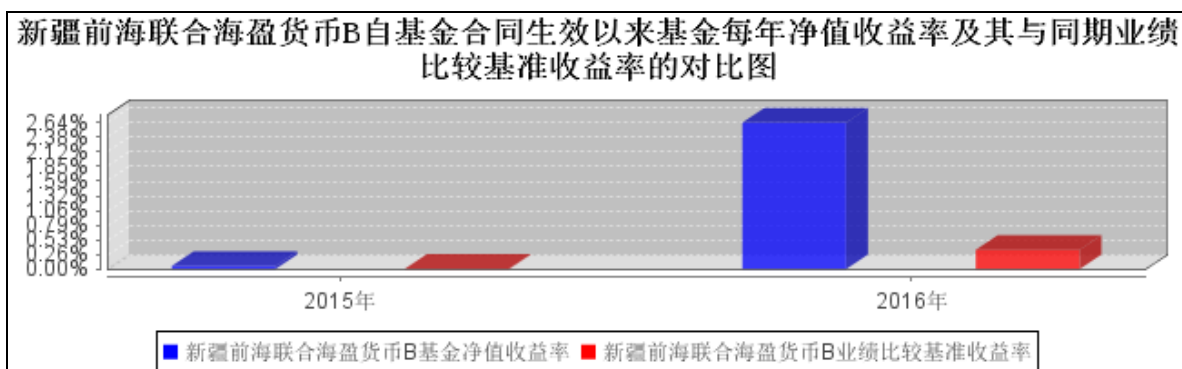
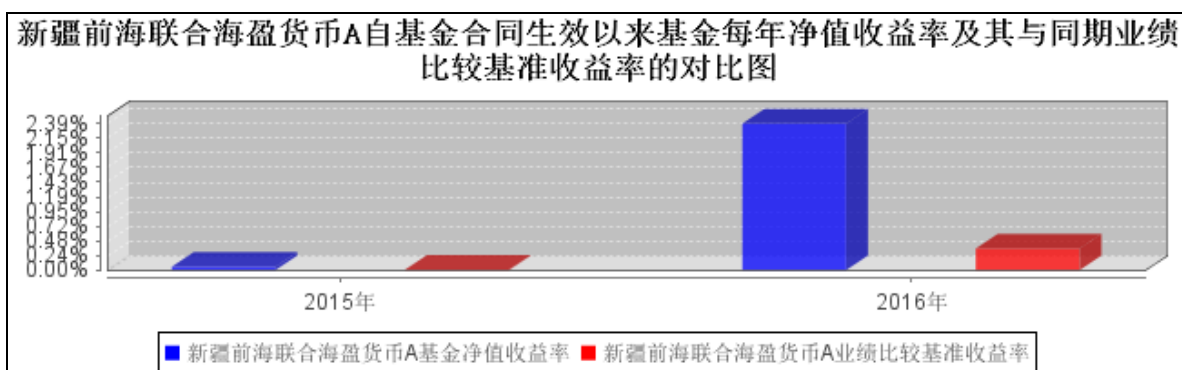




注：1、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 24 日。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 A					
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
2016年	784,542.22	—	85,326.75	869,868.97	—
2015年	496.58	—	70.67	567.25	—
合计	785,038.80	—	85,397.42	870,436.22	—

单位：人民币元

新疆前海联合海盈货币 B					
--------------	--	--	--	--	--

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
2016年	129,364,111.10	-	1,208,015.37	130,572,126.47	-
2015年	6,769,875.41	-	976,913.58	7,746,788.99	-
合计	136,133,986.51	-	2,184,928.95	138,318,915.46	-

§ 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8只开放式基金，包括1只货币市场基金、3只债券型基金、3只混合型基金和1只指数型基金，另管理2只专户理财产品，管理资产总规模超过139亿元人民币。

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与会计双硕士，7年证券从业经验。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。
敬夏玺	本基金的基 金经理	2016年8月 18日	-	6年	敬夏玺先生，中央财经大学金融学硕士，6年基金投资研究、交易经验。2011年7月至2016年5月任职于融通基金，历任债券交易员、固定收益部投资经理，管理公司债券专户产品。2010年7月至2011年7月任工银瑞信基金中央交易室交易员。
曾婷婷	本基金的基 金经理	2016年9月5 日	-	5年	曾婷婷女士，北京大学硕士、中山大学双学士，CICPA，5年证券、基金从业经验，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。
--	--	--	--	--	---

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和分配机制，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。本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 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

本基金投资策略主要以“短久期、高评级”阶梯配置为主，重点满足流动性需求。2016 年以来，国内宏观经济运行平稳，GDP 全年增长 6.7%。PMI 触底反弹，年底回升至荣枯线以上。由于房地产调控影响，固定资产投资增速下滑至 8%附近，出口受欧美经济影响下降 2%，消费则较为平稳。供给侧改革导致商品价格普涨，PPI 同比由负转正，CPI 小幅回升。人民币贬值，外汇占款持续下降，央行“去杠杆、防风险”意图明确，债券市场在经历了前三季度区间震荡后，迎来了四季度大幅下跌的局面，资金面从下半年开始关键时点偏紧。11 月底-12 月中，资金面紧张局面达到近 2 年多以来高点，资金利率飙升导致债市暴跌。基于年初对国内货币政策保持中性态度，债券市场收益率进一步大幅下行的概率较低，因此保持较短的组合久期。同时考虑到市场对信用风险担忧并且信用利差较窄，组合的资产配置以存单和协议存款为主。组合平稳地度过了 2016 年年底市场的“钱荒”以及“货币基金危机”，保证了组合的流动性需求。报告期内，新疆前海联合海盈货币 A 取得了 2.39%的收益，新疆前海联合海盈货币 B 取得了 2.64%的收益，同期业绩比较基准为 0.35%。

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 2.3874%，B 类基金份额净值收益率为 2.6445%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年四季度以来国内宏观经济基本面逐渐企稳，供给侧改革带来的工业品价格反弹带动工业企业利润改善以及 PPI 大幅回升并结束了连续 4 年多的负增长。纵观 2017 年全年，全年经济增速预计高于去年，通胀水平均值也会高于去年，但通胀预计不会大幅上涨，供给侧改革仍然发力，但如果需求面没有明显改善，供给收缩对经济的带动效果将减弱。债券市场在经历了去年底的大

跌后，绝对收益水平已经回到近年来的均值附近，配置价值逐渐显现，但随着货币政策转向中性，债券收益率水平中枢抬升已成为事实，在经济基本面延续改善但态势不稳的预期下，债券市场预计将会在一个较高的收益水平下小幅震荡。

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、实时监控及专项检查等方法，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，本基金管理人开展了基金管理公司业务风险全面自查，对公司各项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。

会计师事务所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。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委员会，由副总经理、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。

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 131,441,995.44 元，实际分配收益 131,441,995.44 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 审计报告

新疆前海联合海盈货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新疆前海联合海盈货币市场基金(以下简称“新疆前海联合海盈货币”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日和 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是新疆前海联合海盈货币 的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

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。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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。

三、审计意见

我们认为，上述新疆前海联合海盈货币的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了新疆前海联合海盈货币 2016 年 12 月 31 日和 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师 陈 玲

中国 · 上海市

注册会计师 陶 忆

2017 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1, 013, 196, 819. 59	13, 413, 996, 459. 56
结算备付金		450, 000. 00	-
存出保证金		1, 802. 76	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4, 345, 975, 293. 15	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4, 328, 321, 293. 15	-
资产支持证券投资		17, 654, 000. 00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6, 159, 087, 838. 62	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	25, 590, 367. 90	8, 935, 005. 37
应收股利		-	-
应收申购款		767, 197, 817. 53	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		12, 311, 499, 939. 55	13, 422, 931, 464. 93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20, 067, 737. 88	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		863, 824. 59	849, 095. 94
应付托管费		575, 883. 04	257, 301. 81
应付销售服务费		11, 351. 07	51. 38
应付交易费用	7.4.7.7	111, 365. 06	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		2, 270, 326. 37	976, 984. 25

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	214,400.00	80,000.00
负债合计		24,114,888.01	2,163,433.38
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	12,287,385,051.54	13,420,768,031.55
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		12,287,385,051.54	13,420,768,031.55
负债和所有者权益总计		12,311,499,939.55	13,422,931,464.93

注：1、截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日，新疆前海联合海盈货币基金 A 类基金份额净值 1.000 元，新疆前海联合海盈货币基金 B 类基金份额净值 1.000 元；基金份额总额 12,287,385,051.54 份，其中 A 类基金份额 494,110,978.76 份，B 类基金份额 11,793,274,072.78 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		156,657,449.15	8,935,005.37
1.利息收入		155,726,755.21	8,935,005.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	74,113,507.86	8,935,005.37
债券利息收入		62,354,410.74	-
资产支持证券利息收入		101,280.64	-
买入返售金融资产收入		19,157,555.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		795,693.94	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	795,693.94	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
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	135,000.00	-
减：二、费用		25,215,453.71	1,187,649.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,250,160.58	849,095.94

2. 托管费	7.4.10.2.2	4,988,760.38	257,301.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	85,063.63	51.38
4. 交易费用	7.4.7.18	260.12	-
5. 利息支出		7,521,475.65	-
其中：卖出回购金融资产支出		7,521,475.65	-
6. 其他费用	7.4.7.19	369,733.35	81,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		131,441,995.44	7,747,356.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		131,441,995.44	7,747,356.24

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	131,441,995.44	131,441,995.44
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）	-1,133,382,980.01	-	-1,133,382,980.01
其中：1. 基金申购款	58,432,796,982.24	-	58,432,796,982.24
2. 基金赎回款	-59,566,179,962.25	-	-59,566,179,962.25
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）	-	-131,441,995.44	-131,441,995.44
五、期末所有者权益（基金净值）	12,287,385,051.54	-	12,287,385,051.54
项目	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）	13,413,997,659.56	-	13,413,997,659.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,747,356.24	7,747,356.24
三、本期基金份额交	6,770,371.99	-	6,770,371.99

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	6, 770, 371. 99	-	6, 770, 371. 99
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-7, 747, 356. 24	-7, 747, 356. 24
五、期末所有者权益(基金净值)	13, 420, 768, 031. 55	-	13, 420, 768, 031. 55

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:

_____ 王晓耕	_____ 刘菲	_____ 黄嘉宇
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“中国证监会”)证监许可[2015]2800号《关于准予新疆前海联合海盈货币市场基金注册的批复》核准,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《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 13,411,070,976.88 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(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,基金合同生效日的基金份额总额为 13,413,997,659.56 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,926,682.68 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量,分设 A 类和 B 类两类基金份额。两类基金份额分别设置基金代码,按照不同的费率计提销售服务费,并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。本基金的 A 类基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万份以下的持有人, B 类基金份额针对在单个基金账户保留份额在 500 万份以上(含 500 万)的持有人。A 类基金份额持有人在单个基金账户内持有的 A 类基金份额合计达到或超过 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将基金份额持有人在該基金账户下保留的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额; B 类基金份额持有人单个基金账户内持有的 B 类基金份额合计低于 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将基金份额持有人在該基金账户下保留的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》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：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。本基金的业绩比较基准为：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 2017 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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和资产支持证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。

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

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或资产支持证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。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值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投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，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投资组合价值。

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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的则按直线法计算。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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）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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	23,196,819.59	96,459.56
定期存款	990,000,000.00	13,413,900,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	200,000,000.00	13,413,900,000.00
存款期限 1-3 个月	590,000,000.00	-
存款期限 3 个月以上	200,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	1,013,196,819.59	13,413,996,459.56

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	19,893,490.93	19,932,000.00	38,509.07	0.0003%
	银行间市场	4,308,427,802.22	4,302,740,500.00	-5,687,302.22	-0.0463%
	合计	4,328,321,293.15	4,322,672,500.00	-5,648,793.15	-0.0460%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 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	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值；

3、本基金本报告期末持有资产支持证券：摊余成本 17,654,000.00 元，影子定价 17,619,000.00 元，偏离金额-35,000.00 元，偏离度-0.0003%。本基金上年度末未持有资产支持证券。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	3,600,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	2,559,087,838.62	-
合计	6,159,087,838.62	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	-	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,549.61	68,293.45
应收定期存款利息	3,799,653.23	8,866,711.92
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	222.75	-
应收债券利息	16,136,805.00	-
应收买入返售证券利息	5,641,403.73	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6,733.58	-
合计	25,590,367.90	8,935,005.37

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	111,365.06	-
合计	111,365.06	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	214,400.00	80,000.00
合计	214,400.00	80,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 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	1,897,219,863.18	1,897,219,863.18
本期赎回(以“-”号填列)	-1,404,180,512.75	-1,404,180,512.75
本期末	494,110,978.76	494,110,978.76

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 12 月 31 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	56,535,577,119.06	56,535,577,119.06
本期赎回(以“-”号填列)	-58,161,999,449.50	-58,161,999,449.50
本期末	11,793,274,072.78	11,793,274,072.78

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额；赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

2、本基金自 2015 年 12 月 8 日起至 2015 年 12 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 13,411,070,976.88 元。根据《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 2,926,682.68 元在本基金成立后，折算为 2,926,682.68 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书》及《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》的相关规定，本基金于 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 1 月 10 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2016 年 1 月 11 日起开始办理。

7.4.7.10 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	869,868.97	-	869,868.97
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	-869,868.97	-	-869,868.97
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	130,572,126.47	-	130,572,126.47
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	-130,572,126.47	-	-130,572,126.47
本期末	-	-	-

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	193,263.84	68,293.45
定期存款利息收入	73,899,816.07	8,866,711.92
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	20,412.26	-
其他	15.69	-
合计	74,113,507.86	8,935,005.37

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	16,066,043,670.93	-
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	15,990,613,199.39	-
减: 应收利息总额	74,634,777.60	-
买卖债券差价收入	795,693.94	-

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

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

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	135,000.00	-
合计	135,000.00	-

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	40.12	-
银行间市场交易费用	220.00	-
合计	260.12	-

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	105,400.00	-
信息披露费	100,000.00	80,000.00
基金份额持有人大会相关费用	52,000.00	-
汇划费	77,918.31	1,200.00
债券托管账户维护费	33,000.00	-
其他	1,415.04	-
合计	369,733.35	81,200.00

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

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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(“新疆前海联合”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
凯信恒有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东

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

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,250,160.58	849,095.94
其中：支付销售机构的客户维护费	85,633.84	30.73

注：1、根据《新疆前海联合基金管理有限公司关于召开前海联合海盈货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的基金份额持有人大会于 2016 年 9 月 13 日表决通过了《关于新疆前海联合海盈货币市场基金降低管理费率有关事项的议案》，本基金的管理费率自 2016 年 9 月 13 日起，由 0.33% 年费率降至 0.15% 年费率。

2、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 X 管理费率计提，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 0.33% / 当年天数。(2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2016 年 9 月 12 日)

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。(2016 年 9 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日)

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,988,760.38	257,301.81

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 0.10% / 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	15,635.90	-	15,635.90
合计	15,635.90	-	15,635.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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	4.84	-	4.84
合计	4.84	-	4.84

注：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，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构；B 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

A 类基金份额日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

新疆前海联合海盈货币 A

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
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	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	-	-

新疆前海联合海盈货币 B

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
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	110,299,811.96	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	30,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	80,299,811.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	0.6535%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 12 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	23,196,819.59	193,264.00	96,459.56	68,293.45

注：本基金的银行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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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
784,542.22	-	85,326.75	869,868.97	-
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
129,364,111.10	-	1,208,015.37	130,572,126.47	-

注：本基金在本年度累计分配收益为 131,441,995.44 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 130,148,653.32 元，计入应付收益科目 1,293,342.12 元。

7.4.12 期末（2016 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

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

本基金为货币市场基金，主要投资于各类货币市场工具，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益”的风险收益目标。

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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行；定期存款存放在大中型商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不得投资于信用评级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具，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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	40,055,433.78	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,168,180,544.85	-
合计	4,208,235,978.63	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债、超短期融资债券和同业存单。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	120,085,314.52	-
合计	120,085,314.52	-

注：未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

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。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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						
银行存款	1,013,196,819.59	-	-	-	-	1,013,196,819.59
结算备付金	450,000.00	-	-	-	-	450,000.00
存出保证金	1,802.76	-	-	-	-	1,802.76
交易性金融资产	4,326,081,802.22	19,893,490.93	-	-	-	4,345,975,293.15
买入返售金融资产	6,159,087,838.62	-	-	-	-	6,159,087,838.62
应收利息	-	-	-	-	25,590,367.90	25,590,367.90
应收申购款	-	-	-	-	767,197,817.53	767,197,817.53
资产总计	11,498,818,263.19	19,893,490.93	-	-	792,788,185.43	12,311,499,939.55
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	20,067,737.88	20,067,737.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	863,824.59	863,824.59
应付托管费	-	-	-	-	575,883.04	575,883.04
应付销售服务费	-	-	-	-	11,351.07	11,351.07
应付交易费用	-	-	-	-	111,365.06	111,365.06
应付利润	-	-	-	-	2,270,326.37	2,270,326.37
其他负债	-	-	-	-	214,400.00	214,400.00
负债总计	-	-	-	-	24,114,888.01	24,114,888.01
利率敏感度缺口	11,498,818,263.19	19,893,490.93	-	-	768,673,297.42	12,287,385,051.54
上年度末 2015 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						
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。

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	
		影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,446,092.01	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,444,447.09	-

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。本基金的所有资产及负债均以人民币计价，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。

7.4.14 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

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 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 4,345,975,293.15 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)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

§ 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	4,345,975,293.15	35.30
	其中：债券	4,328,321,293.15	35.16
	资产支持证券	17,654,000.00	0.14
2	买入返售金融资产	6,159,087,838.62	50.03
	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	1,013,646,819.59	8.23
4	其他各项资产	792,789,988.19	6.44
5	合计	12,311,499,939.55	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.46	
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2016 年 7 月 13 日	28.63	发生巨额赎回	7 月 15 日
2	2016 年 7 月 14 日	31.30	发生巨额赎回	7 月 15 日
3	2016 年 7 月 18 日	32.59	发生巨额赎回	7 月 22 日
4	2016 年 7 月 19 日	40.71	发生巨额赎回	7 月 22 日
5	2016 年 7 月 20 日	37.47	发生巨额赎回	7 月 22 日
6	2016 年 7 月 21 日	37.78	发生巨额赎回	7 月 22 日
7	2016 年 8 月 23 日	23.07	发生巨额赎回	8 月 24 日
8	2016 年 11 月 30 日	20.30	发生巨额赎回	12 月 13 日
9	2016 年 12 月 1 日	24.71	发生巨额赎回	12 月 13 日
10	2016 年 12 月 2 日	31.93	发生巨额赎回	12 月 13 日
11	2016 年 12 月 5 日	30.98	发生巨额赎回	12 月 13 日
12	2016 年 12 月 6 日	28.83	发生巨额赎回	12 月 13 日
13	2016 年 12 月 7 日	33.54	发生巨额赎回	12 月 13 日
14	2016 年 12 月 8 日	34.38	发生巨额赎回	12 月 13 日
15	2016 年 12 月 9 日	26.26	发生巨额赎回	12 月 13 日
16	2016 年 12 月 12 日	34.48	发生巨额赎回	12 月 13 日
17	2016 年 12 月 14 日	38.53	发生巨额赎回	12 月 15 日
18	2016 年 12 月 26 日	38.71	发生巨额赎回	12 月 29 日
19	2016 年 12 月 27 日	32.48	发生巨额赎回	12 月 29 日
20	2016 年 12 月 28 日	22.87	发生巨额赎回	12 月 29 日

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	23
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。

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	73.91	0.16
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	6.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	7.54	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	4.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	1.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		93.74	0.16

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。

8.4 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	19,893,490.93	0.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	619,926,159.68	5.05
	其中：政策性金融债	619,926,159.68	5.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	610,114,440.26	4.97
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,078,387,202.28	25.05
8	其他	-	-
9	合计	4,328,321,293.15	35.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.5 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	111698242	16 宁波银行 CD202	5,000,000	499,527,855.16	4.07
2	160201	16 国开 01	2,550,000	254,880,542.78	2.07
3	160401	16 农发 01	2,200,000	219,990,787.31	1.79
4	111610025	16 兴业 CD025	2,000,000	199,797,448.26	1.63
5	111698486	16 宁波银行 CD211	2,000,000	199,747,697.43	1.63
6	111680206	16 宁波银行 CD223	2,000,000	199,203,212.84	1.62
7	111615267	16 民生 CD267	1,700,000	168,867,347.67	1.37
8	111690040	16 南京银行 CD004	1,400,000	139,857,308.13	1.14
9	111619099	16 恒丰银行 CD099	1,200,000	119,901,199.14	0.98

10	111698202	16 河北银行 CD057	1,100,000	108,985,910.00	0.89
----	-----------	------------------	-----------	----------------	------

8.6 “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	-0.2499%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0421%

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%。

8.7 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

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	1689246	16 上和 1A1(总价)	350,000.00	17,654,000.00	0.14

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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	1,802.76
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,590,367.90
4	应收申购款	767,197,817.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	792,789,988.19

8.8.4 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。

§ 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

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	7,426	66,537.97	40,228,763.37	8.14%	453,882,215.39	91.86%
新疆前海联合海盈货币 B	124	95,107,048.97	11,183,662,345.04	94.83%	609,611,727.74	5.17%
合计	7,550	1,627,468.22	11,223,891,108.41	91.34%	1,063,493,943.13	8.66%

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）。

9.2 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	2,364,398.59	0.4785%
	新疆前海联合海盈货币 B	—	—
	合计	2,364,398.59	0.0192%

9.3 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	10~50
	新疆前海联合海盈货币 B	0
	合计	10~50
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

§ 10 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）	1,071,131.75	13,412,926,527.81

基金份额总额		
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	1,897,219,863.18	56,535,577,119.06
减:本报告期基金总赎回份额	1,404,180,512.75	58,161,999,449.50
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	494,110,978.76	11,793,274,072.78

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

新疆前海联合海盈货币市场基金于 2016 年 8 月 18 日至 2016 年 9 月 11 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于新疆前海联合海盈货币市场基金降低管理费率有关事项的议案》及《关于新疆前海联合海盈货币市场基金调整投资限制有关事项的议案》，以上议案自 2016 年 9 月 13 日起生效。本次持有人大会决议生效后，根据持有人大会通过的议案，《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》关于对基金管理费率及投资限制的调整于 2016 年 9 月 13 日生效，新疆前海联合海盈货币市场基金的基金管理人管理费率自 2016 年 9 月 13 日起由 0.33% 降至 0.15%；并将“本基金不得投资于信用等级在 AAA 级以下的债券”调整为“本基金不得投资于信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具”。有关详细信息参见本公司于 2016 年 8 月 9 日至 2016 年 9 月 14 日发布的一系列相关公告。

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

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。

11.3 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。

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

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2015 年 12 月 24 日基金成立以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 105,400.00 元。

11.6 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，本管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
兴业证券	1	-	-	-	-	新增
恒泰证券	2	-	-	-	-	新增
华泰证券	2	-	-	-	-	新增

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

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	39,884,662.30	100.00%	7,494,200,000.00	93.39%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	530,000,000.00	6.61%	-	-

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。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

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
2	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
3	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
4	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
5	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 29 日
6	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
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 5 月 17 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 5 月 18 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 5 月 31 日
10	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
11	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
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 7 月 4 日
13	新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年端午节假日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
14	新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合海盈货币市场基金修订基金合同和托管协议的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 5 日
15	新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书(更新)(2016 年第 1 号)	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 8 日
16	新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书(更新)摘要(2016 年第 1 号)	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 8 日
17	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合海盈货币市场基金基金份额持有	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 9 日

	人大会的公告		
18	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合海盈货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 10 日
19	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合海盈货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 8 月 11 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 8 月 17 日
21	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 8 月 23 日
22	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 8 月 30 日
23	新疆前海联合海盈货币市场基金 2016 年中秋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 9 月 9 日
24	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合海盈货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 9 月 14 日
25	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 9 月 20 日
26	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 10 月 18 日
27	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 10 月 24 日
28	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 11 月 29 日
29	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 12 月 3 日
30	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 12 月 12 日
31	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 12 月 15 日
32	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 12 月 17 日
33	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 12 月 26 日
34	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司代理销售旗下基金的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 29 日
35	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增南京途牛金融信息服务有限公司代理销售旗下基金的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

敬夏玺先生于 2016 年 8 月 18 日增聘为新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理，公告日期为 2016 年 8 月 22 日，公告标题为《新疆前海联合基金管理有限公司关于增聘新疆前海联合

海盈货币市场基金基金经理的公告》；曾婷婷女士于 2016 年 9 月 5 日增聘为新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理，公告日期为 2016 年 9 月 7 日，公告标题为《新疆前海联合基金管理有限公司关于增聘新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理的公告》。本公司已将上述基金经理变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局以及中国证券投资基金业协会备案。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

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
2017 年 3 月 31 日