

# 新疆前海联合海盈货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12        |
| 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.....       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34        |
| 7.2 债券回购融资情况.....                            | 34        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 35        |
| 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.....         | 35        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 35        |
| 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.....      | 36        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....          | 36        |
| 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.....   | 36        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                            | 37        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>37</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 37        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                | 38        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....   | 38        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                  | <b>38</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                    | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                     | 38        |
| 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 .....    | 39        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....         | 39        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                       | 39        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....               | 39        |
| 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 .....       | 39        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....              | 39        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....               | 40        |
| 10.9 其他重大事件 .....                         | 40        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>41</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 ..... | 41        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 42        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                    | <b>42</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                          | 42        |
| 12.2 存放地点.....                            | 42        |
| 12.3 查阅方式.....                            | 42        |

## § 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      | 2,907,207,776.91 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 | 30,374,762.98 份    | 2,876,833,013.93 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<br/>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<br/>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<br/>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             | 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日) | 报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 566,473.29                            | 94,405,891.81                         |
| 本期利润          | 566,473.29                            | 94,405,891.81                         |
| 本期净值收益率       | 1.7526%                               | 1.8830%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末基金资产净值      | 30,374,762.98                         | 2,876,833,013.93                      |
| 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(2017 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 累计净值收益率       | 4.2371%                               | 4.6377%                               |

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

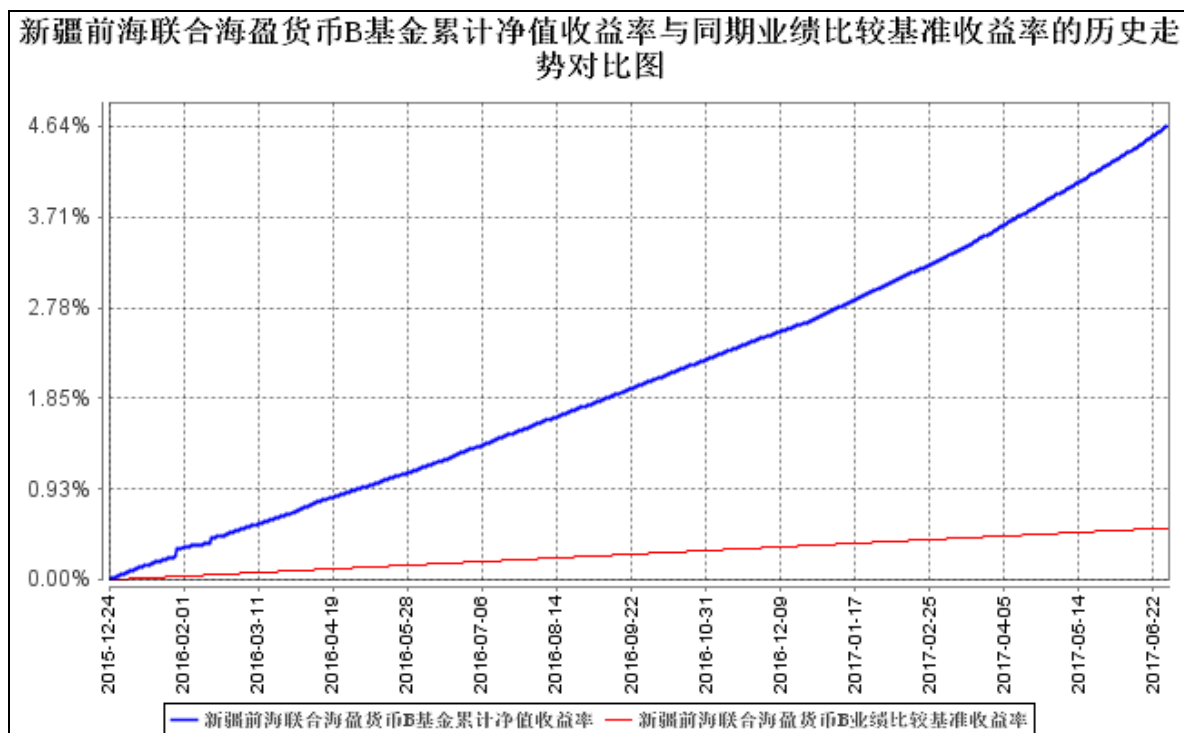
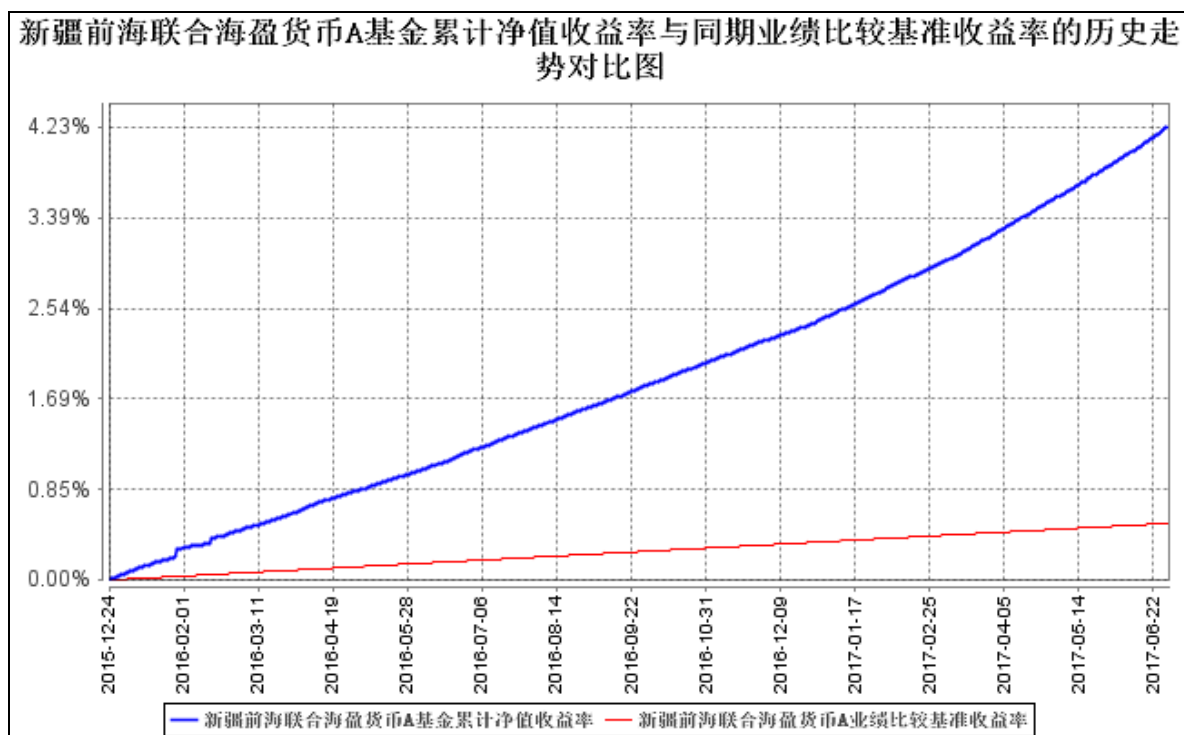
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.3401%  | 0.0007%     | 0.0288%    | 0.0000%       | 0.3113% | 0.0007% |
| 过去三个月      | 0.9703%  | 0.0017%     | 0.0873%    | 0.0000%       | 0.8830% | 0.0017% |
| 过去六个月      | 1.7526%  | 0.0018%     | 0.1736%    | 0.0000%       | 1.5790% | 0.0018% |
| 过去一年       | 2.9960%  | 0.0021%     | 0.3495%    | 0.0000%       | 2.6465% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.2371%  | 0.0041%     | 0.5312%    | 0.0000%       | 3.7059% | 0.0041% |

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      | 0.3606%  | 0.0007%     | 0.0288%    | 0.0000%       | 0.3318% | 0.0007% |
| 过去三个月      | 1.0331%  | 0.0017%     | 0.0873%    | 0.0000%       | 0.9458% | 0.0017% |
| 过去六个月      | 1.8830%  | 0.0018%     | 0.1736%    | 0.0000%       | 1.7094% | 0.0018% |
| 过去一年       | 3.2601%  | 0.0021%     | 0.3495%    | 0.0000%       | 2.9106% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.6377%  | 0.0041%     | 0.5312%    | 0.0000%       | 4.1065% | 0.0041% |

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，本公司旗下共管理10只开放式基金，包括2只货币市场基金、3只债券型基金、4只混合型基金和1只指数型基金，另管理6只专户理财产品，管理资产总规模超过111亿元人民币。

#### 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年证券基金投资研究经验。<br>2013年6月至2015年9月在博时基金从事固定收益研究和投资工作，曾担任博时上证企债30ETF等基金的基金经理助理，2010年2月至2013年5月在融通基金从事信用债研究工作。2015年9月加入前海联合基金，现任新疆前海联合海盈货币兼前海联合添利债券、前海联合添鑫债券和前海联合添和纯债的基金经理。 |
| 敬夏玺 | 本基金的基金经理 | 2016年8月18日      | -    | 7年     | 敬夏玺先生，中央财经大学金融学硕士，7年基金投资研究、交易经验。<br>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。2016年5月加入前海联合基金。现任新疆前海联合海盈货币兼前海联合添利债券、前海联合添鑫债券和前海联合汇盈货币的基金经理。   |
| 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、基金从业经历。<br>2013年4月至2015年8月任华润元大基金固定收益部研究员。2011年11月至2013年3月，任职于第一创业证券研究所。2008年10月至2011年10月任安永会计师事务所高级审计。2015年10月加入前海联合基金。现任新疆前海联合海盈货币兼前海联合汇盈货币的基金经理。 |

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”为根据公司对外的公告的解聘日期；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的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》等有关法律法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个

业务环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。2017 年上半年，GDP 维持在 6.9%，投资企稳、消费小幅回升，基本面总体较为平稳。CPI 维持低位，PPI 受供给侧改革影响维持较高位置。上半年影响债券市场的关键因素在于政策面。为了配合金融去杠杆和政策严监管的趋势，资金面扰动较大，银行在 MPA 考核的压力下，对资金的拆借将更加谨慎，债券市场收益率趋势下行概率较小，因此组合保持较短的久期。同时考虑到市场对信用风险担忧，组合的资产配置以回购、存单、协议存款为主。从报告期看，此策略为组合取得了较为理想的收益，收益排名较去年均有明显提升。

#### 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 1.7526%，B 类基金份额净值收益率为 1.8830%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

结合当下政策基调和经济的增长动力来看，预计下半年宏观经济将呈现稳中趋缓的走势。

首先，财政政策受制于政府债务控制难以大幅扩张，基建投资存在下行压力；而房地产投资或在销售增速和库存双下行的角力下最终维持平稳。其次，货币政策在年初开始去杠杆的大背景下仍将维持不紧不松；再叠加金融整顿及国企降杠杆的自上而下的行政管理，制造业投资预计会面临利润改善但融资成本上行的局面。因此投资整体上来看仍有下行压力。消费方面主要受制于汽车销售高基数的影响，下行压力明显；进出口方面，货物进出口的持续改善同时伴随着服务贸易逆差的影响，维持平稳是大概率事件。

再综合考虑到财政和货币政策继续收紧空间不大，预计经济下行压力将在 4 季度后开始较为明显，下半年经济稳中趋缓将是大概率事件。

#### 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。

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**

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 94,972,365.10 元, 实际分配收益 94,972,365.10 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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 808,623,565.75         | 1,013,196,819.59         |
| 结算备付金      |         | 600,105.46             | 450,000.00               |
| 存出保证金      |         | 27,089.91              | 1,802.76                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 1,509,422,779.33       | 4,345,975,293.15         |
| 其中：股票投资    |         | -                      | -                        |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 1,497,338,779.33       | 4,328,321,293.15         |
| 资产支持证券投资   |         | 12,084,000.00          | 17,654,000.00            |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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    | 847,385,808.22            | 6,159,087,838.62            |
| 应收证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 11,593,170.38             | 25,590,367.90               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 10,186.56                 | 767,197,817.53              |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 3,177,662,705.61          | 12,311,499,939.55           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2016年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 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       |            | 266,999,546.50            | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | 20,067,737.88               |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 554,623.64                | 863,824.59                  |
| 应付托管费           |            | 369,749.06                | 575,883.04                  |
| 应付销售服务费         |            | 5,674.70                  | 11,351.07                   |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 61,434.89                 | 111,365.06                  |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | 24,184.05                 | -                           |
| 应付利润            |            | 374,848.94                | 2,270,326.37                |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 2,064,866.92              | 214,400.00                  |
| 负债合计            |            | 270,454,928.70            | 24,114,888.01               |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,907,207,776.91          | 12,287,385,051.54           |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -                         | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 2,907,207,776.91          | 12,287,385,051.54           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 3,177,662,705.61          | 12,311,499,939.55           |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,907,207,776.91 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 30,374,762.98 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 2,876,833,013.93 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2017年1月1日至2017<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 |
|----------------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 105,184,589.70                 | 53,544,610.76                       |
| 1.利息收入                     |            | 104,782,814.47                 | 53,333,552.18                       |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11   | 21,590,067.36                  | 37,619,691.00                       |
| 债券利息收入                     |            | 35,619,673.85                  | 9,674,646.50                        |
| 资产支持证券利息收入                 |            | 278,612.82                     | -                                   |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 47,294,460.44                  | 6,039,214.68                        |
| 其他利息收入                     |            | -                              | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 401,775.23                     | 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   | 392,238.99                     | 76,058.58                           |
| 资产支持证券投资                   | 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                          |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 10,212,224.60                  | 8,381,559.38                        |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 3,842,493.37                   | 5,799,474.60                        |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,561,662.19                   | 1,768,906.82                        |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 45,296.79                      | 21,108.45                           |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 6,283.31                       | 20.05                               |
| 5. 利息支出                    |            | 3,583,578.84                   | 608,580.89                          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,583,578.84                   | 608,580.89                          |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 172,910.10                     | 183,468.57                          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 94,972,365.10                  | 45,163,051.38                       |
| 减：所得税费用                    |            | -                              | -                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 94,972,365.10                  | 45,163,051.38                       |

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日至2017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)                        | 12,287,385,051.54               | -              | 12,287,385,051.54  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 94,972,365.10  | 94,972,365.10      |
| 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)      | -9,380,177,274.63               | -              | -9,380,177,274.63  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 10,288,595,260.34               | -              | 10,288,595,260.34  |
| 2. 基金赎回款                               | -19,668,772,534.97              | -              | -19,668,772,534.97 |
| 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) | -                               | -94,972,365.10 | -94,972,365.10     |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,907,207,776.91                | -              | 2,907,207,776.91   |
|  | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                |                    |
| 项目                                     | 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“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该基金账户下保留的 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该基金账户下保留的 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 8 月 25 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 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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[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。

## 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 5,623,565.75           |
| 定期存款           | 803,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 275,000,000.00         |
| 存款期限 1-3 个月    | 40,000,000.00          |
| 存款期限 3 个月以上    | 488,000,000.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 808,623,565.75         |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2017 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 | 4,992,624.22           | 4,990,461.00     | -2,163.22    | -0.0001% |
|    | 银行间市场 | 1,492,346,155.11       | 1,494,324,000.00 | 1,977,844.89 | 0.0680%  |
|    | 合计    | 1,497,338,779.33       | 1,499,314,461.00 | 1,975,681.67 | 0.0680%  |

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。

3、本基金本报告期末持有资产支持证券：摊余成本 12,084,000.00 元，影子定价 12,068,000.00

元，偏离金额-16,000.00 元，偏离度-0.0006%。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 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<br>2017年6月30日 |           |
|------------|-------------------|-----------|
|            | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_交易所 | 847,385,808.22    | -         |
| 合计         | 847,385,808.22    | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,920.35          |
| 应收定期存款利息   | 2,610,222.12      |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 270.00            |
| 应收债券利息     | 5,705,791.18      |
| 应收买入返售证券利息 | 3,268,551.49      |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 5,415.24          |
| 合计         | 11,593,170.38     |

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017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 | 61,434.89         |
| 合计          | 61,434.89         |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017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        | 133,866.92        |
| 其它应付款       | 1,931,000.00      |
| 合计          | 2,064,866.92      |

**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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 494,110,978.76             | 494,110,978.76  |
| 本期申购          | 102,600,245.42             | 102,600,245.42  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -566,336,461.20            | -566,336,461.20 |
| 本期末           | 30,374,762.98              | 30,374,762.98   |

金额单位：人民币元

| 新疆前海联合海盈货币 B  |                            |                    |
|---------------|----------------------------|--------------------|
| 项目            | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                    |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额               |
| 上年度末          | 11,793,274,072.78          | 11,793,274,072.78  |
| 本期申购          | 10,185,995,014.92          | 10,185,995,014.92  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -19,102,436,073.77         | -19,102,436,073.77 |
| 本期末           | 2,876,833,013.93           | 2,876,833,013.93   |

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。

#### 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           | 566,473.29  | -     | 566,473.29  |
| 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        | -566,473.29 | -     | -566,473.29 |
| 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           | 94,405,891.81  | -     | 94,405,891.81  |
| 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        | -94,405,891.81 | -     | -94,405,891.81 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 41,304.89                  |
| 定期存款利息收入  | 21,546,010.54              |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 2,628.94                   |
| 其他        | 122.99                     |
| 合计        | 21,590,067.36              |

#### 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 9,687,068,662.12           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 9,628,117,537.76           |
| 减：应收利息总额                | 58,558,885.37              |
| 买卖债券差价收入                | 392,238.99                 |

**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**

无。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 10.07                      |
| 银行间市场交易费用 | 6,273.24                   |
| 合计        | 6,283.31                   |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 75,424.51                  |
| 信息披露费 | 49,588.57                  |

|           |            |
|-----------|------------|
| 其他        | 300.00     |
| 汇划费       | 29,443.18  |
| 债券托管账户维护费 | 18,153.84  |
| 合计        | 172,910.10 |

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 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  | 3,842,493.37         | 5,799,474.60         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 25,366.17            | 19,130.96            |

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 2017 年 6 月 30 日)

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 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 | 2,561,662.19                    | 1,768,906.82                    |

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。

#### 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                              |              |           |
|----------------|---------------------------------|--------------|-----------|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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         | 19,604.93                       | -            | 19,604.93 |
| 合计             | 19,604.93                       | -            | 19,604.93 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |              |           |
|                | 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         | 3,924.75                        | -            | 3,924.75  |
| 合计             | 3,924.75                        | -            | 3,924.75  |

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 X 0.25%/ 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

新疆前海联合海盈货币 A

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 |
|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 基金合同生效日(2015年12月24日)<br>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                    | 4,869,567.17                   | -                                   |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                              | -                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 4,869,567.17                   | -                                   |
| 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<br>额比例         | -                              | -                                   |

新疆前海联合海盈货币 B

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 |
|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 基金合同生效日(2015年12月24日)<br>持有的基金份额 | -                              | -                                   |
| 报告期初持有的基金份额                     | 80,299,811.96                  | -                                   |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 1,067,618.38                   | 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                  | 81,367,430.34                  | -                                   |
| 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<br>额比例         | -                              | 0.8977%                             |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额、转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额；  
期间赎回/卖出总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                              |           | 上年度可比期间                         |            |
|--------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
|        | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |           | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 | 5,623,565.75                    | 41,304.89 | 203,576,601.56                  | 142,485.29 |

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。

**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 |
|--------------|---------------|------------|------------|----|
| 648,158.62   | -             | -81,685.33 | 566,473.29 | -  |

## 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 |
|---------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 96,219,683.91 | -             | -1,813,792.10 | 94,405,891.81 | -  |

注：本基金在本半年度累计分配收益为 94,972,365.10 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 96,867,842.53 元，计入应付收益科目-1,895,477.43 元。

**6.4.12 期末（2017 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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 266,999,546.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 111710216 | 17 兴业银行 CD216 | 2017 年 7 月 3 日 | 99.70  | 500,000   | 49,848,388.45  |
| 130213    | 13 国开 13      | 2017 年 7 月 3 日 | 100.79 | 200,000   | 20,157,391.01  |
| 170204    | 17 国开 04      | 2017 年 7 月 3 日 | 99.43  | 2,000,000 | 198,858,236.29 |
| 合计        |               |                |        | 2,700,000 | 268,864,015.75 |

#### 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。

##### 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<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 29,944,612.39     | 40,055,433.78       |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 1,233,307,219.92  | 4,168,180,544.85    |
| 合计     | 1,263,251,832.31  | 4,208,235,978.63    |

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<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | -                   |
| AAA 以下 | -                 | -                   |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 未评级 | 234,086,947.02 | 120,085,314.52 |
| 合计  | 234,086,947.02 | 120,085,314.52 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债和政策性金融债。

### 6.4.13.3 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 2017 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 266,999,546.50 元将在 2017 年 7 月 3 日前到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017年6月30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                | 808,623,565.75   | -              | -    | -    | -             | 808,623,565.75   |
| 结算备付金               | 600,105.46       | -              | -    | -    | -             | 600,105.46       |
| 存出保证金               | 27,089.91        | -              | -    | -    | -             | 27,089.91        |
| 交易性金融资产             | 1,293,487,918.82 | 215,934,860.51 | -    | -    | -             | 1,509,422,779.33 |
| 买入返售金融资产            | 847,385,808.22   | -              | -    | -    | -             | 847,385,808.22   |
| 应收利息                | -                | -              | -    | -    | 11,593,170.38 | 11,593,170.38    |
| 应收申购款               | -                | -              | -    | -    | 10,186.56     | 10,186.56        |
| 资产总计                | 2,950,124,488.16 | 215,934,860.51 | -    | -    | 11,603,356.94 | 3,177,662,705.61 |
| 负债                  |                  |                |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 266,999,546.50   | -              | -    | -    | -             | 266,999,546.50   |
| 应付管理人报酬             | -                | -              | -    | -    | 554,623.64    | 554,623.64       |
| 应付托管费               | -                | -              | -    | -    | 369,749.06    | 369,749.06       |
| 应付销售服务费             | -                | -              | -    | -    | 5,674.70      | 5,674.70         |
| 应付交易费用              | -                | -              | -    | -    | 61,434.89     | 61,434.89        |
| 应付利息                | -                | -              | -    | -    | 24,184.05     | 24,184.05        |
| 应付利润                | -                | -              | -    | -    | 374,848.94    | 374,848.94       |
| 其他负债                | -                | -              | -    | -    | 2,064,866.92  | 2,064,866.92     |
| 负债总计                | 266,999,546.50   | -              | -    | -    | 3,455,382.20  | 270,454,928.70   |
| 利率敏感度缺口             | 2,683,124,941.66 | 215,934,860.51 | -    | -    | 8,147,974.74  | 2,907,207,776.91 |
| 上年度末<br>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 |

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（2017年6月30日）             | 上年度末（2016年12月31日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 1,054,782.28                | 1,446,092.01      |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -1,051,844.14               | -1,444,447.09     |

#### 6.4.13.4.2 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

(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 2017 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一层次的余额为 4,992,624.22 元，属于第二层次的余额为 1,504,430,155.11 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 4,345,975,293.15 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。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 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            | 1,509,422,779.33 | 47.50         |
|    | 其中：债券             | 1,497,338,779.33 | 47.12         |
|    | 资产支持证券            | 12,084,000.00    | 0.38          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 847,385,808.22   | 26.67         |
|    | 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      | 809,223,671.21   | 25.47         |
| 4  | 其他资产              | 11,630,446.85    | 0.37          |
| 5  | 合计                | 3,177,662,705.61 | 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 | 4.31           |                |
|    | 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 | 266,999,546.50 | 9.18           |
|    | 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  | 2017 年 6 月 29 日 | 26.29             | 发生巨额赎回 | 6 月 30 日 |

### 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    | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 14 |

#### 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                 | 51.19               | 9.18                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 7.90                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.04                | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 39.44               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | -                   | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 10.52               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 109.05              | 9.18                |

#### 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      | 4,992,624.22   | 0.17          |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 229,094,322.80 | 7.88          |
|    | 其中：政策性金融债 | 229,094,322.80 | 7.88          |
| 4  | 企业债券      | -              | -             |

|    |                      |                  |       |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券              | 410,002,531.83   | 14.10 |
| 6  | 中期票据                 | -                | -     |
| 7  | 同业存单                 | 853,249,300.48   | 29.35 |
| 8  | 其他                   | -                | -     |
| 9  | 合计                   | 1,497,338,779.33 | 51.50 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 30,236,086.51    | 1.04  |

## 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  | 011751026 | 17 中船 SCP001  | 2,000,000 | 200,098,227.66 | 6.88         |
| 2  | 170204    | 17 国开 04      | 2,000,000 | 198,858,236.29 | 6.84         |
| 3  | 111715178 | 17 民生银行 CD178 | 1,500,000 | 148,456,477.49 | 5.11         |
| 4  | 111716107 | 17 上海银行 CD107 | 1,000,000 | 99,515,654.72  | 3.42         |
| 5  | 111710281 | 17 兴业银行 CD281 | 1,000,000 | 98,984,058.48  | 3.40         |
| 6  | 111707141 | 17 招商银行 CD141 | 1,000,000 | 98,980,916.90  | 3.40         |
| 7  | 111710284 | 17 兴业银行 CD284 | 1,000,000 | 98,974,403.85  | 3.40         |
| 8  | 111715115 | 17 民生银行 CD115 | 800,000   | 79,778,267.29  | 2.74         |
| 9  | 111710216 | 17 兴业银行 CD216 | 600,000   | 59,818,066.14  | 2.06         |
| 10 | 011753021 | 17 华能 SCP004  | 500,000   | 49,995,604.27  | 1.72         |

## 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                   | 0.0674%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0426% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0259%  |

### 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

| 序号 | 证券代码    | 证券名称      | 数量(份)      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 1789045 | 17 上和 1A1 | 200,000.00 | 12,084,000.00 | 0.42         |

## 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   | 27,089.91     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 11,593,170.38 |
| 4  | 应收申购款   | 10,186.56     |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 11,630,446.85 |

### 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 | 7,880    | 3,854.67       | 11,934,006.87    | 39.29%  | 18,440,756.11 | 60.71% |
| 新疆前海联合海盈货币 B | 28       | 102,744,036.21 | 2,876,833,013.93 | 100.00% | -             | -      |
| 合计           | 7,908    | 367,628.70     | 2,888,767,020.80 | 99.37%  | 18,440,756.11 | 0.63%  |

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 | 1,700,418.96 | 5.5981%  |
|                  | 新疆前海联合海盈货币 B | -            | -        |
|                  | 合计           | 1,700,418.96 | 0.0585%  |

## 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 | 50~100             |
|                                | 新疆前海联合海盈货币 B | 0                  |
|                                | 合计           | 50~100             |
| 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 |
| 本报告期初基金份额总额                       | 494,110,978.76 | 11,793,274,072.78 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 102,600,245.42 | 10,185,995,014.92 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                     | 566,336,461.20 | 19,102,436,073.77 |
| 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                       | 30,374,762.98  | 2,876,833,013.93  |

## § 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**

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

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**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**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      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增 |
| 广发证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增 |
| 恒泰证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | 新增 |

**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 | 383,854,320.50 | 100.00% | 14,201,435,000.00 | 75.03% | - | - |
| 华泰证券 | -              | -       | 4,727,108,723.29  | 24.97% | - | - |
| 安信证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |
| 广发证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |
| 恒泰证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |
| 华创证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |

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

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

（2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

## 10.8 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 | 2017 年 1 月 3 日  |
| 2  | 新疆前海联合基金管理有限公司关于新增和讯信息科技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 | 2017 年 1 月 7 日  |
| 3  | 新疆前海联合基金管理有限公司关于新增北京肯瑞特财富投资管理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 | 2017 年 1 月 20 日 |
| 4  | 新疆前海联合基金管理有限公司海盈货币基                          | 证监会指定信息披         | 2017 年 1 月 20 日 |



|    |   |                  |                 |
|----|---|------------------|-----------------|
|    | 金 2017 年春节假期前暂停大额申购业务的公告                      | 露报纸、公司网站         |                 |
| 5  | 新疆前海联合基金管理有限公司海盈货币基金-招募说明书(更新)摘要(2017 年第 1 号) | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 6  | 新疆前海联合基金管理有限公司海盈货币基金-招募说明书(更新)(2017 年第 1 号)   | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 7  | 关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下基金开通基金定投业务的公告               | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2017 年 3 月 10 日 |
| 8  | 新疆前海联合基金管理有限公司关于调整新疆前海联合海盈货币市场基金转换业务最低申请份额的公告 | 证监会指定信息披露报纸、公司网站 | 2017 年 3 月 21 日 |
| 9  | 新疆前海联合海盈货币基金 2017 年五一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 | 2017 年 4 月 26 日 |
| 10 | 新疆前海联合海盈货币基金 2017 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 | 2017 年 5 月 22 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |   |                  |                  |                  | 报告期末持有基金情况       |        |
|--------|----------------|---|------------------|------------------|------------------|------------------|--------|
|        | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间   | 期初份额             | 申购份额             | 赎回份额             | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构     | 1              | 2017 年 4 月 6 日至 2017 年 4 月 13 日, 2017 年 5 月 23 日至 2017 年 6 月 28 日 | -                | 1,010,173,264.85 | 1,010,173,264.85 | -                | -      |
|        | 2              | 2017 年 5 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日                                  | 108,896,257.94   | 2,611,397,035.57 | 1,711,854,159.35 | 1,008,439,134.16 | 34.69% |
|        | 3              | 2017 年 1 月 5 日, 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 3 月 30 日                  | 1,601,056,620.03 | 1,456,306,260.95 | 3,007,362,880.98 | 50,000,000.00    | 1.72%  |
|        | 4              | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 18 日                                   | 2,006,446,175.00 | 28,176,050.19    | 2,034,622,225.19 | -                | -      |
| 个人     | -              | -   | -                | -                | -                | -                | -      |
| 产品特有风险 |                |   |                  |                  |                  |                  |        |

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

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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  
2017 年 8 月 29 日