

新疆前海联合泳祺纯债债券型证券
投资基金
2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海联合泳祺纯债	
基金主代码	006203	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 6 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,881,428,073.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合泳祺纯债 A	前海联合泳祺纯债 C
下属分级基金的交易代码:	006203	006204
报告期末下属分级基金的份额总额	1,745,606,385.24 份	135,821,687.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。</p> <p>首先，本基金宏观周期研究的基础上，决定整体组合的久期、杠杆率策略。一方面，本基金将分析众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析，从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例，整体组合的久期范围以及杠杆率水平。</p> <p>其次，本基金将在期限结构策略、行业轮动策略的基础上获得债券市场整体回报率，通过息差策略、个券挖掘策略获得超额收益。</p> <p>1、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。</p> <p>（1）骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。</p> <p>（2）子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是</p>

	<p>使投资组合中的债券久期均匀分别于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。</p> <p>2、行业配置策略。债券市场所涉及行业众多，同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生，本基金分别采用以下的分析策略：</p> <p>（1）分散化投资：发行人涉及众多行业，本基金将保持在各行业配置比例上的分散化结构，避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。</p> <p>（2）行业投资：本基金将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行业的债券。</p> <p>3、息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。</p> <p>本基金将采取低杠杆、高流动性策略，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。</p> <p>4、个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>针对中小企业私募债券，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。本基金投资中小企业私募债，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>6、资产支持证券投资策略。</p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。</p>
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期平均风险与预期收益率高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	新疆前海联合基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱张斌
	联系电话	0755-82780666
	电子邮箱	service@qhlhfund.com
客户服务电话	400-640-0099	95528
传真	0755-82780000	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
----------------------	------------------

基金半年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址
-------------	----------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	前海联合泳祺纯债 A	前海联合泳祺纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	31,436,662.38	5,202,150.61
本期利润	35,391,106.60	6,415,022.72
加权平均基金份额本期利润	0.0194	0.0393
本期基金份额净值增长率	1.92%	3.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0265	0.0454
期末基金资产净值	1,803,200,596.17	142,878,291.53
期末基金份额净值	1.0330	1.0520

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合泳祺纯债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.42%	0.04%	0.28%	0.03%	0.14%	0.01%
过去三个月	0.55%	0.07%	-0.24%	0.06%	0.79%	0.01%
过去六个月	1.92%	0.06%	0.24%	0.06%	1.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.06%	2.34%	0.06%	0.96%	0.00%

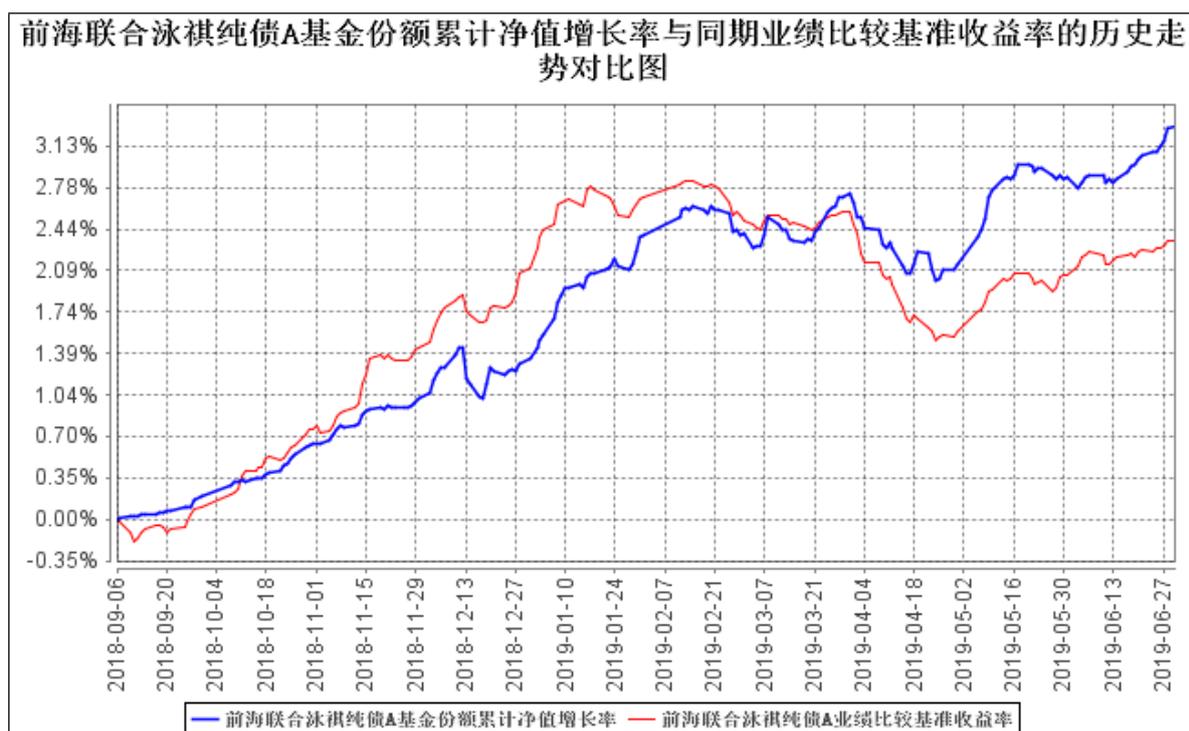
前海联合泳祺纯债 C

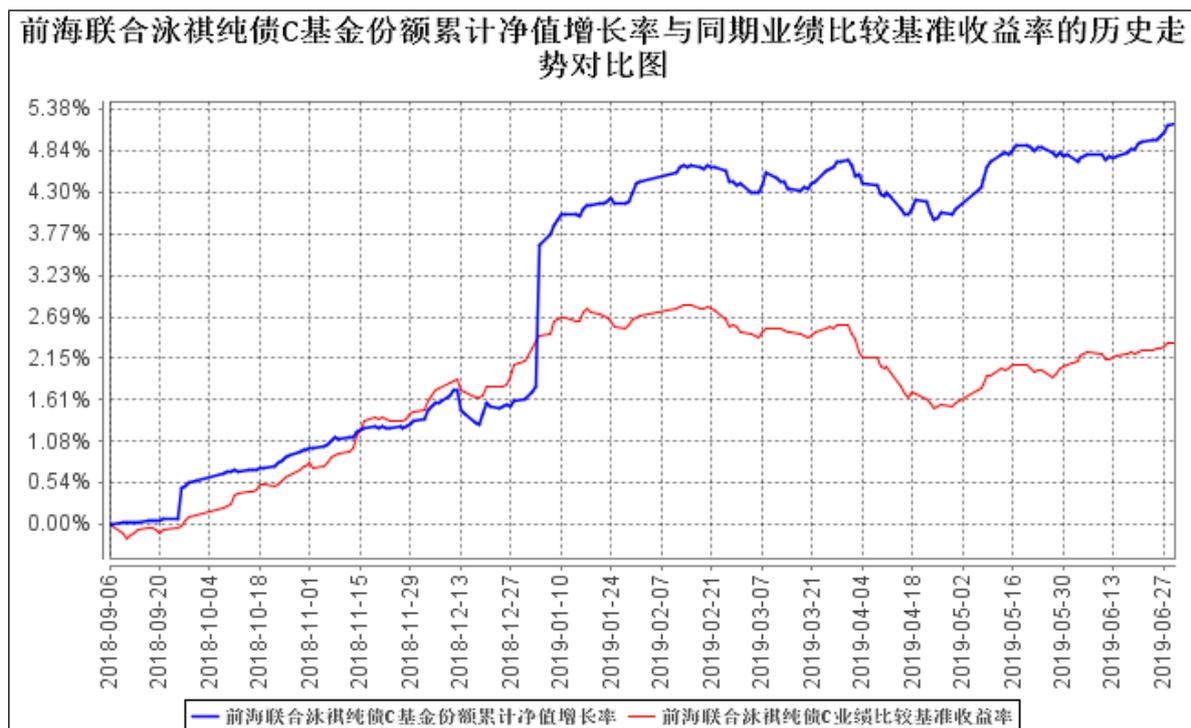
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去一个月	0.38%	0.04%	0.28%	0.03%	0.10%	0.01%
过去三个月	0.46%	0.07%	-0.24%	0.06%	0.70%	0.01%
过去六个月	3.51%	0.18%	0.24%	0.06%	3.27%	0.12%
自基金合同生效起至今	5.20%	0.14%	2.34%	0.06%	2.86%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金的基金合同于2018年9月6日生效，截至报告期末，本基金成立未满1年。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可[2015]1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 2 亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雅洁	本基金的基金经理	2018 年 9 月 6 日	-	9 年	张雅洁女士，悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士，9 年证券基金投资研究经验。2013 年 6 月至 2015 年 9 月在博时基金从事固定收益研究和投资工作，曾担任博时上证企债 30ETF 等基金的基金经理助理，2010 年 2 月至 2013 年 5 月在融通基金从事信用债研究工作。2015 年 9 月加入前海联合基金，现任前海联合泳祺纯债兼前海联合添利债券、新疆前海联合海盈货币、前海联合添鑫定开债券、前海联合添和纯债、前海联合永兴纯债、前海联合添惠纯债、前海联合泳盛纯债和前海联合泳益纯债的基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2019 年 1 季度货币政策逐步呈现边际收紧的态势，在春节前后的宏观政策变动和中美贸易谈判进展的真空期，债券市场收益率借着过节资金充裕的东风一路下行，透支了未来经济增长略显疲弱以及降准的预期。随后 2 季度社融数据有所改善，资金面也回到中性宽裕的局面，债券资产进入较大幅度的市场调整期。直到 5 月下旬包商银行事件冲击后，信用风险溢价抬升带动利差走扩，市场机构投资者的风险偏好下降，在央行金融维稳的主导下货币资金价格创下今年以来的新低。与此同时，经济增长的数据较 1 季度有所回落，在基本面和资金面的双轮驱动下，带动 6 月以来利率债收益率曲线呈现的牛陡走势。

本基金在上半年维持高评级短久期的策略，通过持有商业银行债获取底仓票息收益，再辅以中久期利率债的波段交易，以实现通过资本利得增厚基金收益的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合泳祺纯债 A 基金份额净值为 1.0330 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.92%；截至本报告期末前海联合泳祺纯债 C 基金份额净值为 1.0520 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.51%；同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看债市：在包商银行事件后，货币政策承担了维持金融和社会稳定的重任，难以在短期内主动收紧；而国内财政政策对经济增速放缓的容忍度加大，暂无强刺激的动力和必要；同时通胀压力趋稳，短期内的基本面利空较少。

考虑到目前短端绝对收益率已经较低，长端资产在修复行情后继续下行的阻力也再次出现；预计在下半年，中端资产在市场多方力量博弈不明朗的环境下，突显出攻守兼备的配置和交易的相对吸引力。而在信用分层的债券市场中寻找 AA+和 AAA 的合理利差，增持包商银行事件冲击中估值受损的普金债，通过微调提高组合静态收益将有助于控制组合在债市波动时的回撤幅度。

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债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由新疆前海联合基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	81,640,680.80	442,846,696.20
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,463,209,000.00	1,300,414,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,463,209,000.00	1,300,414,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	960,011,360.02
应收证券清算款	-	-
应收利息	45,224,971.08	15,160,775.52
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,590,074,651.88	2,718,432,831.74
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	642,863,395.70	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	496,577.08	146,334.02
应付托管费	165,525.69	48,777.99
应付销售服务费	47,171.81	57,677.58
应付交易费用	20,361.56	16,519.22
应交税费	-	-

应付利息	315,278.58	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	87,453.76	86,000.00
负债合计	643,995,764.18	355,308.81
所有者权益：		
实收基金	1,881,428,073.16	2,679,467,379.25
未分配利润	64,650,814.54	38,610,143.68
所有者权益合计	1,946,078,887.70	2,718,077,522.93
负债和所有者权益总计	2,590,074,651.88	2,718,432,831.74

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，前海联合泳祺纯债 A 基金份额净值 1.0330 元，基金份额总额 1,745,606,385.24 份；前海联合泳祺纯债 C 基金份额净值 1.0520 元，基金份额总额 135,821,687.92 份。前海联合泳祺纯债份额总额合计为 1,881,428,073.16 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
一、收入	52,536,740.02	
1.利息收入	42,272,573.60	
其中：存款利息收入	472,678.70	
债券利息收入	39,366,015.08	
资产支持证券利息收入	-	
买入返售金融资产收入	2,433,879.82	
其他利息收入	-	
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,307,201.38	
其中：股票投资收益	-	
基金投资收益	-	
债券投资收益	2,307,201.38	
资产支持证券投资收益	-	
贵金属投资收益	-	
衍生工具收益	-	
股利收益	-	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,167,316.33	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,789,648.71	

列)	
减：二、费用	10,730,610.70
1. 管理人报酬	3,033,499.45
2. 托管费	1,011,166.52
3. 销售服务费	333,724.01
4. 交易费用	16,525.00
5. 利息支出	6,173,419.08
其中：卖出回购金融资产支出	6,173,419.08
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	162,276.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	41,806,129.32
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	41,806,129.32

注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 9 月 6 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,679,467,379.25	38,610,143.68	2,718,077,522.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,806,129.32	41,806,129.32
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）	-798,039,306.09	-15,765,458.46	-813,804,764.55
其中：1.基金申购款	40.36	1.49	41.85
2.基金赎回款	-798,039,346.45	-15,765,459.95	-813,804,806.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净	-	-	-

值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,881,428,073.16	64,650,814.54	1,946,078,887.70

注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 9 月 6 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王晓耕	_____ 刘菲	_____ 陈艳
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)证监许可[2018]1036号《关于准予新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2018年8月30日至2018年9月4日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币201,504,664.53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(2018)第0608号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,504,664.63份基金份额,其中认购资金利息折合为0.10份基金份额。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募券、资产支持证券、公开发行的次级债、债券回购、银行存款、同

业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具和货币市场工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票、权证,也不参与新股申购和增发。本基金的投资组合比例为:投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;每个交易日日终本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2019 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税

[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新疆前海联合基金管理有限公司（“新疆前海联合”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发”）	基金托管人

银行”)	
------	--

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,033,499.45
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	1,011,166.52
----------------	--------------

注：支付基金托管人浦发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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合泳祺纯债 A	前海联合泳祺纯债 C	合计
	新疆前海联合	-	333,724.01
合计	-	333,724.01	333,724.01

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 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。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
浦发银行	1,640,680.80	148,374.77	-	-

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 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 642,863,395.70 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
1828014	18 兴业绿色金融 01	2019 年 7 月 5 日	101.51	1,000,000	101,510,000.00
1920006	19 南京银行 01	2019 年 7 月 5 日	99.73	420,000	41,886,600.00
1828016	18 民生银行 01	2019 年 7 月 3 日	101.09	1,600,000	161,744,000.00
180214	18 国开 14	2019 年 7 月 1 日	102.34	1,715,000	175,513,100.00
1828005	18 浙商银行 01	2019 年 7 月 3 日	102.33	1,105,000	113,074,650.00
1920001	19 宁波银行 01	2019 年 7 月 3 日	100.04	927,000	92,737,080.00
合计				6,767,000	686,465,430.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,463,209,000.00	95.10
	其中：债券	2,463,209,000.00	95.10
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	81,640,680.80	3.15
8	其他各项资产	45,224,971.08	1.75
9	合计	2,590,074,651.88	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,336,771,000.00	120.08
	其中：政策性金融债	854,856,000.00	43.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	126,438,000.00	6.50
9	其他	-	-
10	合计	2,463,209,000.00	126.57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180214	18 国开 14	2,700,000	276,318,000.00	14.20
2	180206	18 国开 06	1,800,000	189,954,000.00	9.76
3	1828016	18 民生银行 01	1,800,000	181,962,000.00	9.35
4	1828005	18 浙商银行 01	1,600,000	163,728,000.00	8.41
5	1820076	18 盛京银行 03	1,500,000	149,925,000.00	7.70

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

1. 18 民生银行 01 债务主体被监管机构处罚事项:

(1) 2018 年 11 月 9 日, 据银保监银罚决字〔2018〕5 号, 民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则, 被中国银行保险监督管理委员会处以 200 万元的罚款。

(2) 2018 年 11 月 9 日, 据银保监银罚决字〔2018〕8 号, 民生银行因内控管理严重违反审慎经营规则、同业投资违规接受担保等 7 项违法违规事项, 被中国银行保险监督管理委员会处以 3160 万元的罚款。

(3) 2019 年 4 月 2 日, 根据大银保监罚决字〔2019〕76、78、80 号, 因以贷收贷, 掩盖资产真实质量; 以贷转存, 虚增存贷款规模等案由, 民生银行被大连银保监局处以合计 250 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析, 认为民生银行净资产规模大, 经营情况良好, 上述罚款占其净资产及净利润比例低, 且民生银行主体评级为市场最高的 AAA 评级, 上述事项对民生银行自身信用基本面影响很小, 对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于民生银行的决策程序说明: 基于民生银行基本面研究以及二级市场的判断, 本基金投资于民生银行, 其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析, 认为上述事项对民生银行经营和价值应不会构成重大影响, 对基金运作无影响。

2. 18 浙商银行 01 债务主体被监管机构处罚事项:

2018 年 11 月 9 日, 据银保监银罚决字〔2018〕11 号, 浙商银行因投资同业理财产品未尽职审查; 为客户缴交土地出让金提供理财资金融资; 投资非保本理财产品违规接受回购承诺; 理财产品销售文本使用误导性语言; 个人理财资金违规投资; 理财产品相互交易, 业务风险隔离不到位; 为非保本理财产品提供保本承诺被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 5550 万元。基金管理人经审慎分析, 认为浙商银行净资产规模大, 经营情况良好, 上述罚款占其净资产及净利润比例低, 且浙商银行主体评级为市场最高的 AAA 评级, 目前各项监管指标表现良好, 上述事项对浙商银行自身信用基本面影响很小, 对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于浙商银行的决策程序说明：基于浙商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于浙商银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对浙商银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

3.18 盛京银行 03 债务主体被监管机构处罚事项：

2019 年 4 月 24 日，因违反规定发放个人住房贷款，依据《中华人民共和国银行业监督管理办法》第四十六条第五项，盛京银行被辽宁银保监局处以 20 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为盛京银行资产规模较大，经营情况较好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且盛京银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对盛京银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于盛京银行的决策程序说明：基于盛京银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于盛京银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对盛京银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

4.18 渤海银行 02 债务主体被监管机构处罚事项：

2018 年 11 月 9 日，渤海银行由于内控管理严重违反审慎经营规则、理财及自营投资资金违规用于缴交土地款等 5 项违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币 2530 万元。

基金管理人经审慎分析，认为渤海银行资产规模大，经营情况良好，上述罚款占其净利润及净资产比例较低，且渤海银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，该事项对渤海银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于渤海银行的决策程序说明：基于渤海银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于渤海银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对渤海银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

5.18 平安银行 01 债务主体被监管机构处罚事项：

2018 年 7 月 26 日，据银反洗罚决字〔2018〕2 号，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，平安银行未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 40 万元罚款；未按照规定报送大额交易报

告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；对平安银行合计处以 140 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项和第（三）项规定，对相关责任人共处以 14 万元罚款。

基金管理人经审慎分析，认为平安银行资产规模大，经营情况良好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且平安银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对平安银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对平安银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

6.18 兴业绿色金融 01 债务主体被监管机构处罚事项：

2018 年 9 月 12 日，上海证监局认为兴业银行存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件，未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试，不具备任职资格”的情形，对兴业银行出具责令整改的监管措施，责令兴业银行于 2018 年 10 月 25 日前完成整改并提交整改报告。收到上述决定后，兴业银行成立整改小组核查相关情况、梳理有关流程并落实整改，并及时向上海证监局报送了整改报告。

基金管理人经审慎分析，认为兴业银行净资产规模大，经营情况良好，各项监管指标及财务指标表现良好，实力强，主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对兴业银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于兴业银行的决策程序说明：基于兴业银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于兴业银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对兴业银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	45,224,971.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,224,971.08

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合泳祺纯债 A	208	8,392,338.39	1,745,603,186.49	100.00%	3,198.75	0.00%
前海联合泳祺纯债 C	130	1,044,782.21	135,820,944.46	100.00%	743.46	0.00%
合计	296	6,356,175.92	1,881,424,130.95	100.00%	3,942.21	0.00%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合泳祺纯债 A	1,771.34	0.0001%
	前海联合泳祺纯债 C	323.05	0.0002%
	合计	2,094.39	0.0001%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海联合泳祺纯债 A	0~10
	前海联合泳祺纯债 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合泳祺纯债 A	0
	前海联合泳祺纯债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海联合泳祺纯 债 A	前海联合泳祺纯 债 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 6 日）基金份 额总额	3,345.45	201,501,319.18
本报告期期初基金份额总额	1,827,606,479.00	851,860,900.25
本报告期期间基金总申购份额	14.52	25.84
减：本报告期期间基金总赎回份额	82,000,108.28	716,039,238.17
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,745,606,385.24	135,821,687.92

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金于 2019 年 3 月 15 日至 2019 年 4 月 12 日以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，审议《关于申请降低新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金 A 类份额赎回费率的议案》。本次基金份额持有人大会于 2019 年 4 月 15 日表决通过了《关于申请降低新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金 A 类份额赎回费率的议案》，本次大会的决议自该日起生效。有关详细信息请参见本基金管理人于 2019 年 3 月 11 日至 2019 年 4 月 16 日发布的系列相关公告。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

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

(2) 券商选择程序：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	605,600,000.00	100.00%	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	1,235,130,576.93	-	82,000,000.00	1,153,130,576.93	61.29%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

新疆前海联合基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日