

# 新疆前海联合海盈货币市场基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	5,594,916,506.91 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	36,943,901.12 份	5,557,972,605.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金将采用积极管理的投资策略，通过对货币市场利率走势的预判，控制利率风险、在满足基金流动性需求的前提下，减少基金资产净值波动，力争获取超越比较基准的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、市场供需结构变化和短期资金面扰动等因素的综合分析，优先考虑安全性和流动性因素，根据各类资产的信用风险、流动性风险及经风险调整后的收益率水平，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。</p> <p>2、利率债投资策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的研究方法，通过对宏观经济走势的预判以及资本市场流动性变化的预测估算未来基准利率的走势及合理中枢。再结合利率债目前的收益率曲线形态以及期限利差所在历史分位来动态调整所投标的。</p> <p>3、信用债投资策略</p> <p>信用债的表现受到基准利率及信用利差两方面影响。本基金对于信用债仓位、评级及期限的选择均建立在对经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险分析的基础上。个券分析方面，通过自下而上的研究方法分析发债主体所在行业的基本面情况，以及发债主体企业的实际偿债能力来控制投资组合信用风险。并结合当前市场的信用利差估值水平重点挖掘被低估的可投个券。本基金将通过分散化投资来规避行业和个券的集中信用风险暴露，提高组合收益。内部评级体系通过自上而下的宏观分析，以及定性和定量的企业偿债能力分析做到对发债主体信用风险的事前防范和事后跟踪，以达到信用风险可控的目标。</p> <p>4、久期管理策略</p>

	<p>本基金根据对未来短期利率走势的研判，满足货币基金资产的高流动性需求及其相关的投资比例规定，动态调整组合的久期。当预期市场短期利率上升时，本基金将通过提高剩余期限较短债券的投资比例来降低组合久期，以减少组合利率风险；当预期市场短期利率下降时，则通过提高剩余期限较长债券的投资比例来拉长久期，以获取债券价格上升的资本利得收益。</p> <p>5、债券回购策略</p> <p>在回购利率过高、流动性收紧等不宜加杠杆的市场环境下，本基金将降低杠杆投资比例。在对组合进行杠杆操作时，根据资金面宽松还是收紧的预期来调整正回购借入资金的期限。当预计资金面宽松程度未来有所下降时，进行长期限正回购操作，锁定融资成本。</p> <p>6、流动性管理策略</p> <p>本基金作为现金管理类工具，须保证资产的安全性和流动性，根据对持有人申购赎回情况的动态预测，调整组合中高流动性资产的权重；通过管理债券组合期限结构的分布，合理匹配基金的未来现金流。在确保流动性的前提下争取超额收益。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将对市场利率、偿债条款、对应资产池的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素进行定性分析，并辅助用蒙特卡洛模拟的数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值。</p> <p>8、其他金融工具的投资策略</p> <p>本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。</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	邱张斌	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

## 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	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( 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	508,425.07	74,045,629.20
本期利润	508,425.07	74,045,629.20
本期净值收益率	1.2889%	1.4148%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	36,943,901.12	5,557,972,605.79
期末基金份额净值	1.000	1.000

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	0.2069%	0.0011%	0.0292%	0.0000%	0.1777%	0.0011%
过去三个月	0.6297%	0.0018%	0.0885%	0.0000%	0.5412%	0.0018%
过去六个月	1.2889%	0.0018%	0.1760%	0.0000%	1.1129%	0.0018%
过去一年	2.7722%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	2.4173%	0.0017%
过去三年	10.3020%	0.0024%	1.0646%	0.0000%	9.2374%	0.0024%
自基金合同生效起至今	11.6311%	0.0034%	1.2493%	0.0000%	10.3818%	0.0034%

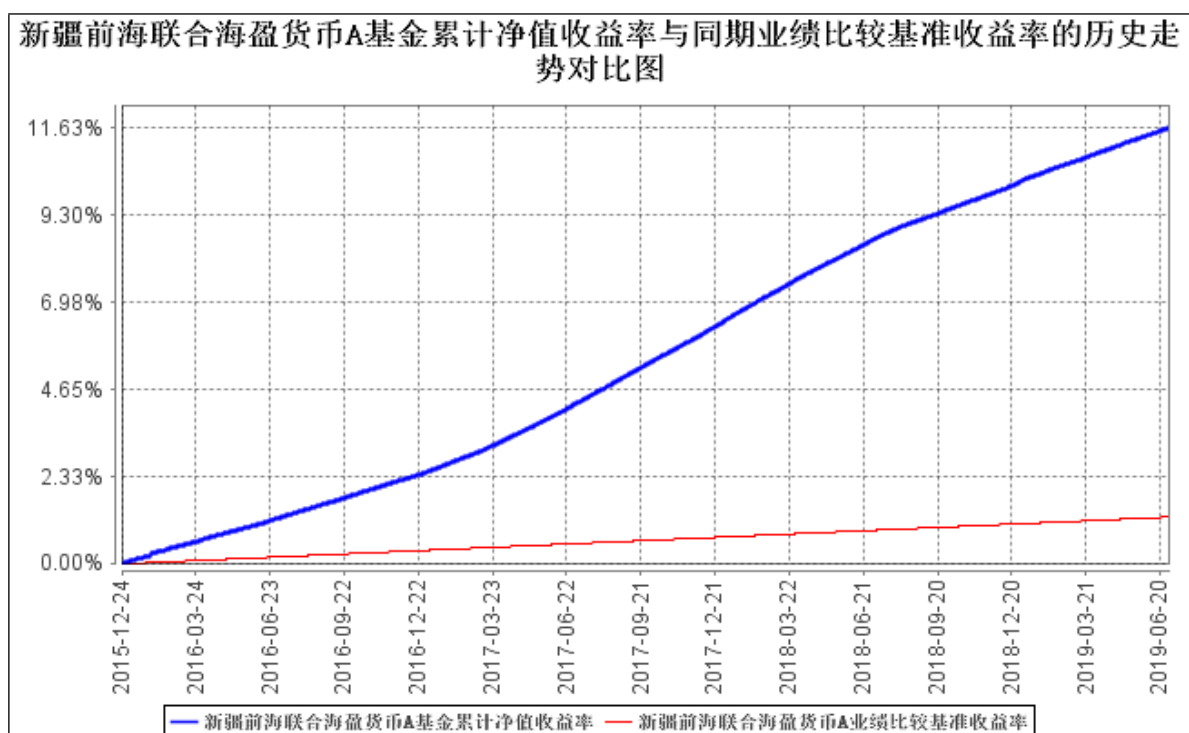
新疆前海联合海盈货币 B

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

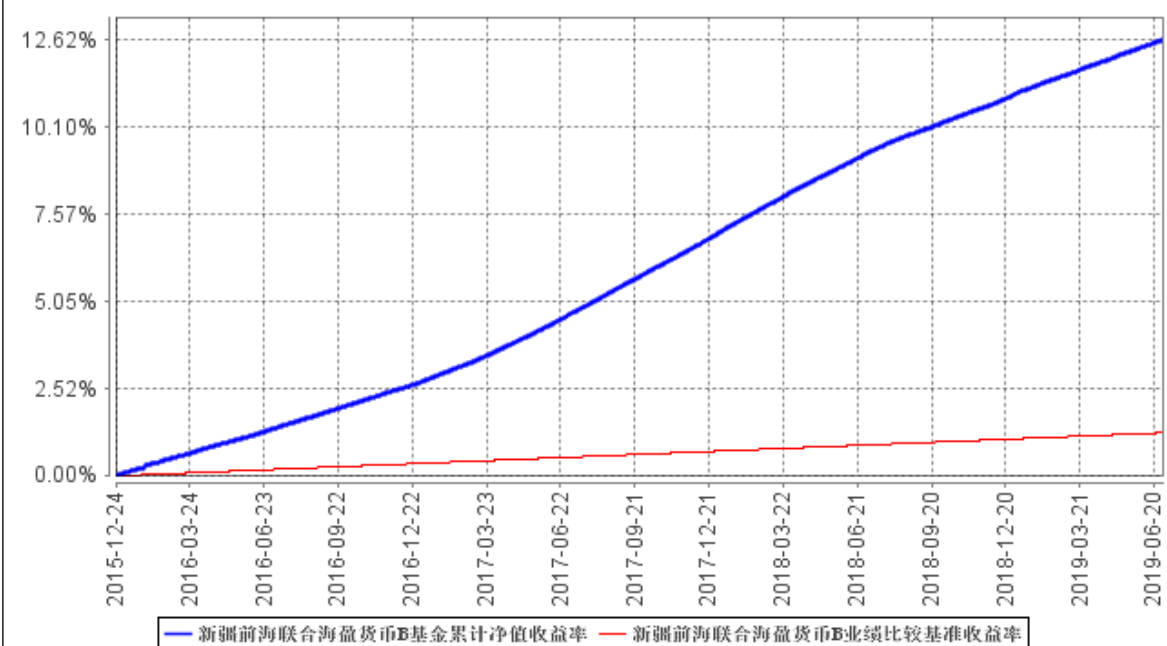
过去一个月	0.2275%	0.0011%	0.0292%	0.0000%	0.1983%	0.0011%
过去三个月	0.6924%	0.0018%	0.0885%	0.0000%	0.6039%	0.0018%
过去六个月	1.4148%	0.0018%	0.1760%	0.0000%	1.2388%	0.0018%
过去一年	3.0297%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	2.6748%	0.0017%
过去三年	11.1392%	0.0024%	1.0646%	0.0000%	10.0746%	0.0024%
自基金合同生效起至今	12.6220%	0.0034%	1.2493%	0.0000%	11.3727%	0.0034%

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



新疆前海联合海盈货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## §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	2015 年 12 月 24 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、前海联合泳祺纯债、前海联合泳盛纯债和前海联合泳益纯债的基金经理。
敬夏玺	本基金	2016 年 8 月	2019 年 1 月	8 年	敬夏玺先生，中央财经大

	的基金经理	18 日	24 日		<p>学金融学硕士，8 年基金投资研究、交易经验。</p> <p>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。</p> <p>2016 年 5 月加入前海联合基金。现任前海联合添利债券兼前海联合添鑫定开债券、前海联合汇盈货币、前海联合泓元定开债券、前海联合泓瑞定开债券和前海联合润丰混合的基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 1 月曾任新疆前海联合海盈货币的基金经理。</p>
曾婷婷	本基金的基金经理	2016 年 9 月 5 日	—	7 年	<p>曾婷婷女士，北京大学硕士、中山大学双学士，CPA，7 年证券、基金从业经历。2013 年 4 月至 2015 年 8 月任华润元大基金固定收益部研究员。</p> <p>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。</p> <p>现任新疆前海联合海盈货币兼前海联合汇盈货币、前海联合泳盛纯债和前海联合泳辉纯债的基金经理。</p>

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

上半年，货币政策宽松，资金面关键时点边际收紧，债市总体震荡。

年初经济数据依然较差，央行通过公开市场、定向降准、全面降准等手段持续释放流动性，债券市场大幅走强，收益率下行。紧接着 2 月社融数据大超市场预期，市场风险偏好显著回升，股市大涨，债市调整，股债跷跷板效应明显。3 月经济数据走弱，央行公开市场操作出现了降频缩量，资金面边际收紧，美联储议息会议宣布暂停加息，债券收益率曲线平坦化，短端上行，长端下行。

二季度，债市先跌后涨，4 月因社融数据大幅反弹，猪价带动通胀反弹，资金面宽松边际减弱，债市大幅调整，收益率大幅上行。中美贸易摩擦在 5 月突然升温，经济数据明显回落。5 月底包商银行事件对资金面有较大冲击，引发市场流动性分层，为了应对包商银行事件对资金面冲击以及外部的不确定性，央行加大公开市场的流动性投放，利率中枢下行，债市收益率全面下行。6 月经济数据继续走弱，中美贸易摩擦未见缓和，加上包商银行事件持续发酵，央行加大公开市场投放力度，对小银行进行定向降准、再贴现、SLF、增信存单发行，同时直接增加券商短期融资券待偿还余额，市场总量流动性增强，利率中枢再度下移。资金面的充裕导致债券收益率大幅下行。

报告期内，本基金主要以同业存单、中短期存款为主，在季末时点，通过逆回购来增加超额收益。本基金维持了较好的静态收益，超过业绩比较基准。流动性未出现异常，满足了投资者正

常的申购、赎回要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期新疆前海联合海盈货币 A 的基金份额净值收益率为 1.2889%，本报告期新疆前海联合海盈货币 B 的基金份额净值收益率为 1.4148%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济面临下行压力，外需走弱。二季度房地产调控有收紧的趋势，反映出政府对未来经济模式和走向清晰的定位，下半年房地产投资有回落风险。

在全球经济下行的背景下，货币政策有所松动，部分国家已启动降息操作，美联储释放鸽派信号，美国降息概率显著上升，国内货币政策的制约也相应减少。虽然 CPI 在二季度阶段性走高，但预计通胀难以形成掣肘。

总体看，基本面及货币政策对债市利好，关键时点资金面扰动带来的调整可能是较好的机会。

#### 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人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人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**

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 74,554,054.27 元, 实际分配收益 74,554,054.27 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 2019 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：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
<b>资 产：</b>		
银行存款	771,358,771.59	1,062,056,905.88
结算备付金	-	-
存出保证金	27,580.43	-
交易性金融资产	3,306,266,110.17	2,487,168,911.03
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,290,917,574.17	2,417,168,911.03
资产支持证券投资	15,348,536.00	70,000,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,708,395,842.59	1,214,264,581.40
应收证券清算款	-	-
应收利息	11,711,257.26	17,508,382.56
应收股利	-	-
应收申购款	59,000.00	255,971,451.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,797,818,562.04	5,036,970,231.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	-	-
卖出回购金融资产款	98,939,750.53	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	100,000,000.00	-
应付管理人报酬	470,421.44	626,309.24
应付托管费	156,807.13	208,769.73
应付销售服务费	7,397.41	9,289.56
应付交易费用	71,923.58	113,346.87
应交税费	1,286.98	21,308.27

应付利息	13,667.36	-
应付利润	1,185,315.92	2,472,028.26
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,055,484.78	2,195,000.00
负债合计	202,902,055.13	5,646,051.93
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	5,594,916,506.91	5,031,324,179.95
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,594,916,506.91	5,031,324,179.95
负债和所有者权益总计	5,797,818,562.04	5,036,970,231.88

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，新疆前海联合海盈货币 A 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 36,943,901.12 份；新疆前海联合海盈货币 B 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 5,557,972,605.79 份。新疆前海联合海盈货币份额总额合计为 5,594,916,506.91 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	83,551,353.06	297,909,675.07
1.利息收入	83,285,037.51	298,550,723.47
其中：存款利息收入	13,592,346.71	101,628,445.90
债券利息收入	46,965,168.01	130,721,679.04
资产支持证券利息收入	1,901,886.64	17,810.83
买入返售金融资产收入	20,825,636.15	66,182,787.70
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	266,315.55	-641,048.40
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	263,013.71	-641,048.40
资产支持证券投资	3,301.84	-
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）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	8,997,298.79	21,681,621.34



1. 管理人报酬	3,954,667.62	9,566,953.81
2. 托管费	1,318,222.45	3,188,984.53
3. 销售服务费	49,250.17	61,887.40
4. 交易费用	228.68	-
5. 利息支出	3,455,178.57	8,672,836.08
其中：卖出回购金融资产支出	3,455,178.57	8,672,836.08
6. 税金及附加	8,102.52	9,320.12
7. 其他费用	211,648.78	181,639.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	74,554,054.27	276,228,053.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	74,554,054.27	276,228,053.73

### 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：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）	5,031,324,179.95	-	5,031,324,179.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,554,054.27	74,554,054.27
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）	563,592,326.96	-	563,592,326.96
其中：1. 基金申购款	10,150,847,250.49	-	10,150,847,250.49
2. 基金赎回款	-9,587,254,923.53	-	-9,587,254,923.53
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）	-	-74,554,054.27	-74,554,054.27
五、期末所有者权益（基金净值）	5,594,916,506.91	-	5,594,916,506.91
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	16,187,125,621.62	-	16,187,125,621.62
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	276,228,053.73	276,228,053.73
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)	-11,948,835,408.23	-	-11,948,835,408.23
其中: 1. 基金申购款	16,641,125,613.90	-	16,641,125,613.90
2. 基金赎回款	-28,589,961,022.13	-	-28,589,961,022.13
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)	-	-276,228,053.73	-276,228,053.73
五、期末所有者权益 (基金净值)	4,238,290,213.39	-	4,238,290,213.39

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

新疆前海联合海盈货币市场基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“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》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》、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》和《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书》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。

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 2019 年 8 月 22 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。

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[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、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。

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

无。

**6.4.8.1.2 债券交易**

无。

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.8.1.4 权证交易**

无。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,954,667.62	9,566,953.81
其中：支付销售机构的客户维护费	91,264.82	64,051.69

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,318,222.45	3,188,984.53

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 0.05% 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 × 0.05% / 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		
	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	41,857.63	-	41,857.63
合计	41,857.63	-	41,857.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	55,996.51	-	55,996.51
合计	55,996.51	-	55,996.51

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：

日销售服务费 = 前一日 A 类基金份额的基金资产净值 × 0.25% / 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**

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
基金合同生效日（ 2015 年 12 月 24 日）持有的 基金份额	—	—
期初持有的基金份额	1,809,469.00	—
期间申购/买入总份额	4,984.59	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	1,814,453.59	—
期末持有的基金份额	—	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	—

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	新疆前海联合海盈货币 A	新疆前海联合海盈货币 B
基金合同生效日（ 2015 年 12 月 24 日）持有的 基金份额	—	—
期初持有的基金份额	—	20,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	2,230,522.06
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	14,000,000.00
期末持有的基金份额	—	8,230,522.06
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	0.1900%

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。

#### 6.4.8.4.2 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
中国工商银行	101,358,771.59	49,737.61	1,506,991.84	37,087.25

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。

#### 6.4.8.6 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 98,939,750.53 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
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 1 日	100.03	1,000,000	100,026,418.73
190005	19 附息国债 05	2019 年 7 月 1 日	99.95	20,000	1,998,987.00
合计				1,020,000	102,025,405.73

###### 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	固定收益投资	3,306,266,110.17	57.03
	其中：债券	3,290,917,574.17	56.76
	资产支持证券	15,348,536.00	0.26
2	买入返售金融资产	1,708,395,842.59	29.47
	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	771,358,771.59	13.30
4	其他各项资产	11,797,837.69	0.20
5	合计	5,797,818,562.04	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	5.70	
	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	98,939,750.53	1.77
	其中：买断式回购融资	—	—

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

## 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	49.32	1.77
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	36.39	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	9.09	—
	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)	8.63	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		103.42	1.77

## 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	112,954,801.89	2.02
2	央行票据	—	—
3	金融债券	330,509,495.84	5.91
	其中：政策性金融债	230,120,750.15	4.11
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	270,018,360.35	4.83
6	中期票据	—	—
7	同业存单	2,577,434,916.09	46.07
8	其他	—	—
9	合计	3,290,917,574.17	58.82

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

## 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	111921124	19 渤海银行 CD124	3,000,000	299,494,513.08	5.35
2	111812163	18 北京银行 CD163	3,000,000	299,324,265.86	5.35
3	111996593	19 宁波银行 CD074	2,000,000	199,511,205.50	3.57
4	111921164	19 渤海银行 CD164	2,000,000	199,250,094.12	3.56
5	111915153	19 民生银行 CD153	1,500,000	149,555,294.70	2.67
6	111920055	19 广发银行 CD055	1,500,000	149,552,405.20	2.67
7	180209	18 国开 09	1,000,000	100,026,418.73	1.79
8	071900056	19 中信 CP007	1,000,000	100,001,759.54	1.79
9	111809344	18 浦发银行 CD344	1,000,000	99,843,086.36	1.78
10	111997990	19 宁波银行 CD091	1,000,000	99,593,872.32	1.78

## 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	0.0668%
报告期内偏离度的最低值	-0.0138%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0283%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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	1989031	19 永动 1A	100,000	10,000,000.00	0.18
2	1989094	19 上和 2A1	100,000	5,292,736.00	0.09
3	1989013	19 上和 1A1	90,000	55,800.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

19 中信 CP007 发行主体被监管部门处罚事件：

2019 年 7 月 16 日，中信证券在保荐上海柏楚电子科技股份有限公司科创板首次公开发行股票申请过程中将部分内容在招股说明书注册稿中擅自进行了删减。另外，从 7 月 1 日到 3 日提交的 7 版招股说明书注册稿及反馈意见落实函的签字盖章日期均为 2019 年 7 月 1 日，日期签署与实际时间不符。按照《科创板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》第七十四条第（一）项、第（二）项的相关规定，证监会决定对中信证券采取出具警示函的行政监督管理措施，并要求中信证券三十日内将整改情况的报告报送证监会。

基金管理人经审慎分析，认为中信证券经营情况良好，主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对中信证券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。

本基金投资于中信证券的决策程序说明：基于中信证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中信证券，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，认为上述事项对中信证券经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

### 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	27,580.43
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,711,257.26
4	应收申购款	59,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	11,797,837.69

#### 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	10,441	3,538.35	11,782,468.42	31.89%	25,161,432.70	68.11%
新疆 前海 联合 海盈 货币 B	59	94,202,925.52	5,557,972,605.79	100.00%	—	—
合计	10,496	533,052.26	5,569,755,074.21	99.55%	25,161,432.70	0.45%

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	503,597,680.83	9.00%
2	银行类机构	500,076,183.08	8.94%
3	银行类机构	496,628,488.07	8.88%
4	银行类机构	417,785,520.16	7.47%
5	其他机构	250,378,058.86	4.48%
6	基金类机构	230,863,770.89	4.13%
7	其他机构	223,020,925.60	3.99%
8	基金类机构	210,014,853.81	3.75%

9	银行类机构	202,886,090.26	3.63%
10	保险类机构	200,113,785.35	3.58%

注：持有人类别包括银行类机构、保险类机构、券商类机构、信托类机构、基金类机构、其他机构、个人。

### 8.3 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	2,693,219.14	7.2900%
	新疆前海联合海盈货币 B	—	—
	合计	2,693,219.14	0.4527%

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）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新疆前海联合海盈货币 A	>100
	新疆前海联合海盈货币 B	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	新疆前海联合海盈货币 A	0~10
	新疆前海联合海盈货币 B	—
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	新疆前海联合海 盈货币 A	新疆前海联合海 盈货币 B
基金合同生效日（2015 年 12 月 24 日）基 金份额总额	1,071,131.75	13,412,926,527.81
本报告期期初基金份额总额	45,382,739.48	4,985,941,440.47
本报告期期间基金总申购份额	66,189,664.87	10,084,657,585.62
减：本报告期期间基金总赎回份额	74,628,503.23	9,512,626,420.30
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	36,943,901.12	5,557,972,605.79

注：总申购份额含红利再投、转换入、级别调整入份额，总赎回份额含转换出、级别调整出份额。



## §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

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	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 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	558,254,091.44	88.40%	12,446,200,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	73,226,000.00	11.60%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

无。

## §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- 20190321, 20190328 - 20190328, 20190529 -20190530	1,579,406,654.47	17,221,833.60	1,100,000,000.00	496,628,488.07	8.88%
	2	20190101- 20190131, 20190212 - 20190212, 20190214 - 20190326, 20190617 -20190617	1,205,334,751.02	212,450,769.14	1,000,000,000.00	417,785,520.16	7.47%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
注：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。							

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

本报告期内，本基金管理人于 2019 年 1 月 19 日发布公告，本基金从 2019 年 1 月 22 日起取消基金份额自动升降级规则，即单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构将不再把 A 类基金份额自动升级为 B 类基金份额；单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构将不再把 B 类基金份额自动降级为 A 类基金份额。

本报告期内，本基金管理人于 2019 年 2 月 14 日发布公告，自 2019 年 2 月 18 日起，投资者赎回本基金 B 类基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，不受原“单个账户最低份额余额为 500 万份（含）”的限制。

新疆前海联合基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日