

新疆前海联合沪深 300 指数型证券  
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：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	前海联合沪深 300	
基金主代码	003475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 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	
报告期末基金份额总额	50,931,615.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
下属分级基金的交易代码:	003475	007039
报告期末下属分级基金的份额总额	50,551,149.28 份	380,466.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。</p>

### 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
	联系电话	0755-82780666
	电子邮箱	service@qhlhfund.com
客户服务电话	400-640-0099	95588

传真	0755-82780000	010-66105798
----	---------------	--------------

## 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	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
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	559,495.07	108.34
本期利润	11,801,617.09	11,512.68
加权平均基金份额本期利润	0.2314	0.0337
本期基金份额净值增长率	25.11%	3.86%
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	0.0071	0.1068
期末基金资产净值	57,503,555.72	432,443.22
期末基金份额净值	1.1375	1.1366

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。

4、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应基金代码。

#### 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

前海联合沪深 300A

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	5.91%	1.09%	5.13%	1.10%	0.78%	-0.01%
过去三个月	-0.58%	1.44%	-1.11%	1.45%	0.53%	-0.01%
过去六个月	25.11%	1.45%	25.65%	1.47%	-0.54%	-0.02%
过去一年	9.35%	1.43%	8.65%	1.45%	0.70%	-0.02%
自基金合同生效起至今	13.75%	1.06%	7.23%	1.10%	6.52%	-0.04%

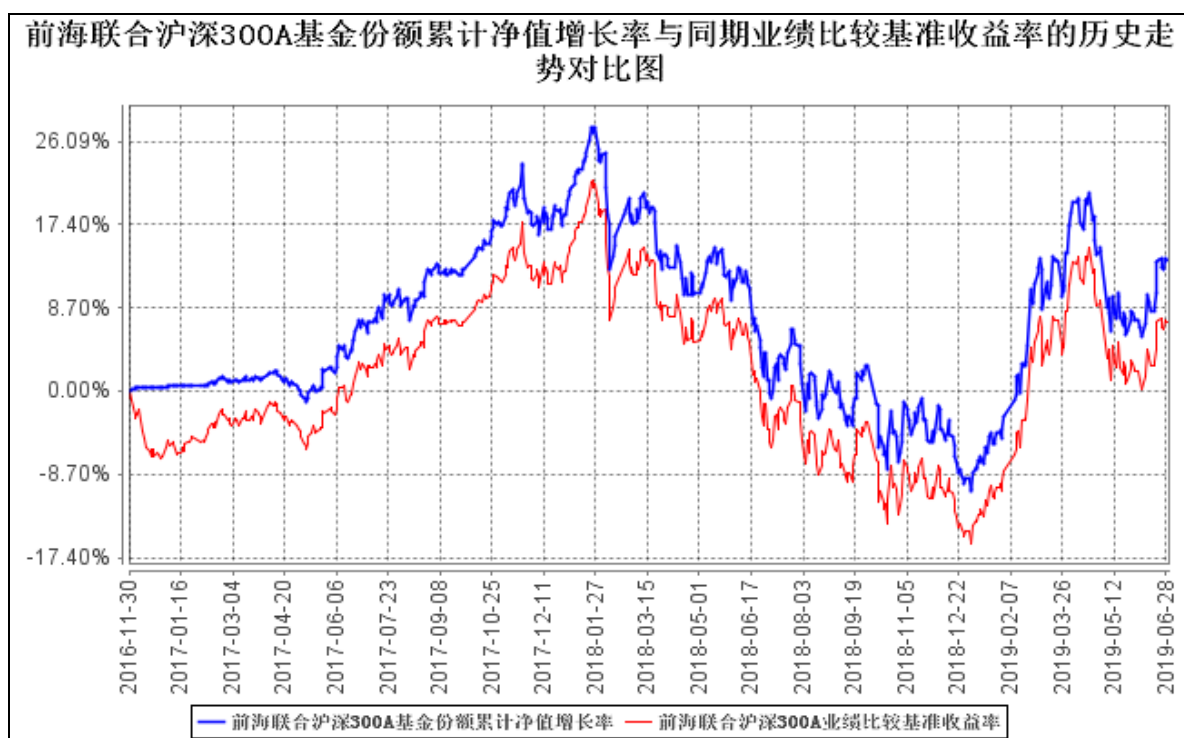
## 前海联合沪深 300C

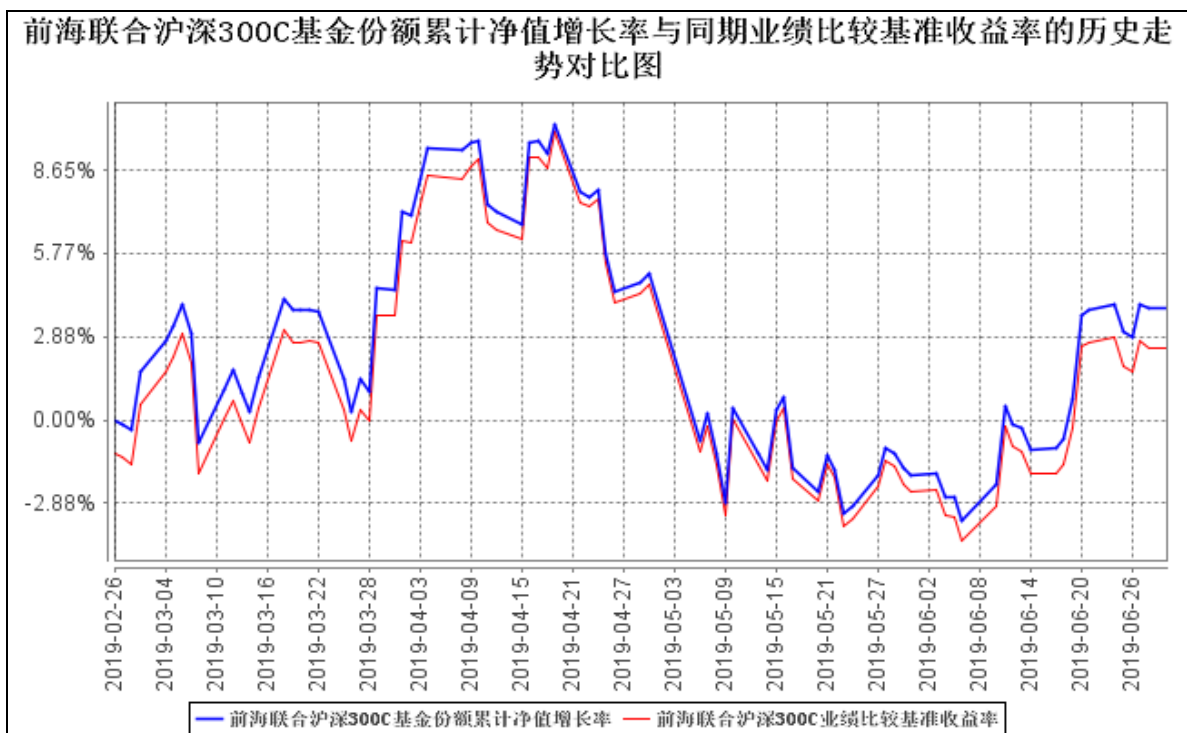
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.88%	1.09%	5.13%	1.10%	0.75%	-0.01%
过去三个月	-0.66%	1.44%	-1.11%	1.45%	0.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.86%	1.45%	2.50%	1.48%	1.36%	-0.03%

注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

2、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应基金代码。

### 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：本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码；前海联合沪深 300C 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起始日为 2019 年 2 月 26 日。

## § 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		
王静	本基金的基金经理	2017 年 3 月 20 日	-	10 年	王静女士，金融学硕士，CFA，10 年证券投资研究经验。2009 年 7 月至 2016 年 4 月任职于民生加银基金，先后从事钢铁、化工、交运、纺织服装、农业等行业研究。2016 年 5 月加入前海联合基金，现任前海联合沪深 300 兼前海联合泳涛混合、前海联合泳隆混合、前海联合泳隼混合、前海联合研究优选混合、前海联合润丰混合、前海联合先进制造混合和前海联合新思路混合的基金经理。
林材	本基金的基金经理	2016 年 11 月 30 日	-	11 年	林材先生，理学硕士，11 年证券基金投资研究经验。2011 年 10 月至 2015 年 7 月任金元顺安基金经理，2008 年 11 月至 2011 年 10 月任民生加银基金医药行业研究员、基金经



					理助理。2000 年 7 月至 2003 年 9 月曾任职于广州医药集团。2015 年 9 月加入前海联合基金。现任前海联合沪深 300 兼前海联合添利债券、前海联合新思路混合、前海联合泓鑫混合、前海联合国民健康混合和前海联合研究优选混合的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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遵规守信情况的说明

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

报告期内沪深 300 指数上涨 27%。年初社融底确立市场底，一季度市场强劲反弹，后由于中美贸易谈判曲折，国内经济整体景气度有所回落，且金融结构性供给侧改革持续推进，短期风险偏好有所降低，市场重回震荡区间。

本基金作为指数基金，报告期内本着审慎尽职的态度，严格按照基金合同，严密控制与指数跟踪偏离度。在定期指数成分股变动时，以最小化交易成本进行相应调仓，取得了较低的跟踪误

差。报告期内跟踪误差产生的主要来源是：1) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；2) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；3) 申购赎回的影响等。

基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量、定性分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。紧密跟踪标的指数，以期实现长期投资收益。

#### 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沪深 300A 基金份额净值为 1.1375 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.11%，同期业绩比较基准收益率为 25.65%；截至本报告期末前海联合沪深 300C 基金份额净值为 1.1366 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.86%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济呈现企稳概率较大，预计未来两个季度完成探底后将缓慢回升，短期应抵御下行风险，长期靠消费、创新走出新一轮低速高质量的发展。流动性将保持较为宽松的状态，但传导至企业融资成本尚需时日，需要在更大力度上推进利率市场化改革来实现。风险溢价方面，虽然外在环境不确定性仍大，改革进入深水区，但控杠杆、促创新，开放加速、减税降费持续等措施可在中长期降低风险溢价。因此大类资产方面我们看好债牛到股牛的转化，判断目前股市临近中长期底部，行业配置方面看好的排序为科技、先进制造、消费、金融、周期。

#### 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。

会计师事务所对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**

本报告期内，本基金曾出现了连续 20 个工作日以上资产净值低于五千万元的情形：从 2018 年 12 月 14 日起至 2019 年 1 月 31 日止，连续 33 个交易日基金资产净值低于 5000 万元。自 2019 年 2 月 1 日起本基金基金资产净值恢复至 5000 万元以上。

## § 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沪深 300 指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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，新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金未进行利润分配。

### 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沪深 300 指数型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	3,141,271.39	2,571,834.27
结算备付金	3,662.50	10,909.09
存出保证金	2,793.75	2,239.22
交易性金融资产	54,939,454.93	43,330,402.76
其中：股票投资	54,939,454.93	43,330,402.76
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	100,000.00	-
应收证券清算款	-	1,301,623.22
应收利息	631.17	351.89
应收股利	-	-
应收申购款	7,404.63	611.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	58,195,218.37	47,217,971.72
<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	-	-
应付证券清算款	100,000.00	-
应付赎回款	9,501.59	157.29
应付管理人报酬	29,848.71	26,818.98
应付托管费	6,888.19	6,188.99
应付销售服务费	158.94	-
应付交易费用	9,178.06	14,064.49
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	103,643.94	210,000.53
负债合计	259,219.43	257,230.28
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	50,931,615.78	51,653,167.22
未分配利润	7,004,383.16	-4,692,425.78
所有者权益合计	57,935,998.94	46,960,741.44
负债和所有者权益总计	58,195,218.37	47,217,971.72

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 50,931,615.78 份。其中 A 类基金份额净值 1.1375 元，A 类基金份额 50,551,149.28 份；C 类基金份额净值 1.1366 元，C 类基金份额 380,466.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

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	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>	12,215,696.67	-6,885,707.45
1.利息收入	19,283.54	18,775.02
其中：存款利息收入	10,240.62	11,348.99
债券利息收入	7,090.04	7,426.03
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,952.88	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	940,175.67	230,725.29
其中：股票投资收益	375,447.09	-354,013.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,433.00	8,750.00
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	566,161.58	575,988.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,253,526.36	-7,136,204.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,711.10	997.21
<b>减：二、费用</b>	402,566.90	423,420.59

1. 管理人报酬	177,047.05	189,535.64
2. 托管费	40,857.01	43,738.93
3. 销售服务费	530.01	-
4. 交易费用	26,752.96	10,704.67
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	157,379.87	179,441.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,813,129.77	-7,309,128.04
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	11,813,129.77	-7,309,128.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

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）	51,653,167.22	-4,692,425.78	46,960,741.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,813,129.77	11,813,129.77
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）	-721,551.44	-116,320.83	-837,872.27
其中：1.基金申购款	1,761,210.31	177,677.63	1,938,887.94
2.基金赎回款	-2,482,761.75	-293,998.46	-2,776,760.21
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）	50,931,615.78	7,004,383.16	57,935,998.94

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)	50,949,752.16	9,385,280.80	60,335,032.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,309,128.04	-7,309,128.04
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)	-85,068.84	-28,962.09	-114,030.93
其中：1.基金申购款	643,603.10	108,638.90	752,242.00
2.基金赎回款	-728,671.94	-137,600.99	-866,272.93
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)	50,864,683.32	2,047,190.67	52,911,873.99

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

新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1861 号《关于准予新疆前海联合沪深 300 指数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》和《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》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 200,202,657.90 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(2016)第 1557 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为



200,202,690.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 32.81 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。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将本基金分设 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。相关费率率的设置及费率水平在招募说明书中列示。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合沪深 300 指数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，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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》、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》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 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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	177,047.05	189,535.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,623.21	997.55

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 0.65% 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 X 0.65% / 当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	40,857.01	43,738.93

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 0.15% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 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		
	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C	合计
新疆前海联合	-	0.89	0.89
合计	-	0.89	0.89
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	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		
	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%。基金销售服务费每日计提，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。

销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		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	3,141,271.39	9,915.63	2,571,834.27	24,900.35

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**

无。

###### **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	54,939,454.93	94.41
	其中：股票	54,939,454.93	94.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	100,000.00	0.17
	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	3,144,933.89	5.40
8	其他各项资产	10,829.55	0.02
9	合计	58,195,218.37	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	812,916.20	1.40
B	采矿业	1,778,441.00	3.07
C	制造业	21,144,253.90	36.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,219,532.00	2.10
E	建筑业	1,613,911.16	2.79
F	批发和零售业	729,942.40	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,645,126.00	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,938,455.95	3.35
J	金融业	19,204,327.50	33.15
K	房地产业	2,537,582.00	4.38
L	租赁和商务服务业	881,861.92	1.52
M	科学研究和技术服务业	34,672.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	63,878.00	0.11

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	359,384.30	0.62
R	文化、体育和娱乐业	240,893.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	54,205,177.33	93.56

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	14,200.00	0.02
C	制造业	511,557.60	0.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,600.00	0.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,680.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	50,240.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	734,277.60	1.27

### 7.2.3 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股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------



1	601318	中国平安	49,000	4,341,890.00	7.49
2	600519	贵州茅台	2,100	2,066,400.00	3.57
3	600036	招商银行	51,700	1,860,166.00	3.21
4	000333	美的集团	20,100	1,042,386.00	1.80
5	601166	兴业银行	54,400	994,976.00	1.72
6	000858	五粮液	8,000	943,600.00	1.63
7	600887	伊利股份	26,900	898,729.00	1.55
8	000651	格力电器	15,700	863,500.00	1.49
9	600276	恒瑞医药	12,894	851,004.00	1.47
10	600030	中信证券	32,800	780,968.00	1.35

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300073	当升科技	6,000	137,820.00	0.24
2	300014	亿纬锂能	4,200	127,932.00	0.22
3	002405	四维图新	6,000	96,600.00	0.17
4	300347	泰格医药	800	61,680.00	0.11
5	603686	龙马环卫	2,900	57,652.00	0.10

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	963,516.00	2.05
2	300498	温氏股份	658,619.00	1.40
3	000002	万科 A	616,341.00	1.31
4	600837	海通证券	362,684.00	0.77
5	600048	保利地产	195,405.00	0.42
6	600030	中信证券	151,899.00	0.32
7	300073	当升科技	144,450.00	0.31
8	600036	招商银行	141,988.00	0.30
9	002594	比亚迪	139,787.00	0.30
10	000069	华侨城 A	120,347.00	0.26

11	601899	紫金矿业	117,784.00	0.25
12	601688	华泰证券	114,950.00	0.24
13	300059	东方财富	113,818.00	0.24
14	000333	美的集团	108,597.00	0.23
15	601108	财通证券	104,526.00	0.22
16	002714	牧原股份	104,273.00	0.22
17	600585	海螺水泥	103,306.00	0.22
18	000858	五粮液	102,519.00	0.22
19	002405	四维图新	102,400.00	0.22
20	600588	用友网络	101,460.00	0.22

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	1,120,863.23	2.39
2	600048	保利地产	693,297.00	1.48
3	600837	海通证券	377,632.00	0.80
4	600519	贵州茅台	310,825.00	0.66
5	600030	中信证券	231,347.00	0.49
6	000858	五粮液	161,741.00	0.34
7	000725	京东方 A	143,114.00	0.30
8	601155	新城控股	115,219.00	0.25
9	600383	金地集团	105,888.00	0.23
10	000063	中兴通讯	102,800.00	0.22
11	601688	华泰证券	102,145.00	0.22
12	601318	中国平安	101,129.00	0.22
13	300059	东方财富	100,894.00	0.21
14	601668	中国建筑	100,449.00	0.21
15	002236	大华股份	95,217.00	0.20
16	600276	恒瑞医药	93,548.00	0.20
17	600739	辽宁成大	83,215.00	0.18
18	000540	中天金融	76,704.00	0.16
19	600585	海螺水泥	72,783.00	0.15
20	002415	海康威视	71,304.00	0.15

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,024,031.86
卖出股票收入（成交）总额	9,034,048.64

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	2,793.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	631.17
5	应收申购款	7,404.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,829.55

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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
前海联合沪深 300A	443	114,110.95	49,311,100.00	97.55%	1,240,049.28	2.45%
前海联合沪深 300C	226	1,683.48	-	-	380,466.50	100.00%
合计	647	78,719.65	49,311,100.00	96.82%	1,620,515.78	3.18%

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	前海联合沪深 300A	580,561.78	1.1485%
	前海联合沪深 300C	801.72	0.2107%
	合计	581,363.50	1.1415%

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	前海联合沪深 300A	0~10
	前海联合沪深 300C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合沪深 300A	0~10
	前海联合沪深 300C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 11 月 30 日）基金份额总额	200,202,690.71	-
本报告期期初基金份额总额	51,653,167.22	-
本报告期期间基金总申购份额	723,355.21	1,037,855.10
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,825,373.15	657,388.60
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	50,551,149.28	380,466.50

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	
广发证券	1	8,690,143.20	48.26%	8,093.23	50.21%	-
安信证券	1	3,080,685.23	17.11%	2,869.03	17.80%	-
恒泰证券	2	2,978,271.00	16.54%	2,773.73	17.21%	-
华金证券	1	2,951,533.71	16.39%	2,158.45	13.39%	-
东兴证券	1	306,473.50	1.70%	224.14	1.39%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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
广发证券	2,500,406.63	100.00%	6,800,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-



## § 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	49,311,100.00	-	-	49,311,100.00	96.82%
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

本报告期内，本基金管理人自 2019 年 2 月 26 日起，对本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额并对本基金的基金合同作出相应修改。有关详细信息请参见本基金管理人于 2019 年 2 月 22 日发布的《关于新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同的公告》。

新疆前海联合基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日