

新疆前海联合泳隼灵活配置 混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 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。

基金托管人浙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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54

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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	前海联合泳隼混合	
基金主代码	004693	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 29 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	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	493,946,007.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合泳隼混合 A	前海联合泳隼混合 C
下属分级基金的交易代码:	004693	007042
报告期末下属分级基金的份额总额	493,944,118.58 份	1,889.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>1、类别资产配置</p> <p>本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场运行内在动量等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。</p> <p>2、股票投资管理</p> <p>(1) 行业配置策略</p> <p>本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。</p> <p>(2) 优选个股策略</p> <p>本基金构建股票组合的步骤是：根据定量与定性分析确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，运用现金流贴现模型等估值方法，分析股票内在价值；结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。</p> <p>3、债券投资管理</p> <p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>(1) 基本价值评估</p> <p>债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。均衡收益率曲线是指，当所有相关的风险都得到补偿时，收益率曲线的合理位置。风险补偿包括五个方面：资金的时间价值（补偿）、通货膨胀补偿、期限</p>

	<p>补偿、流动性补偿及信用风险补偿。通过对这五个部分风险补偿的计量分析，得到均衡收益率曲线及其预期变化。市场收益率曲线与均衡收益率曲线的差异是估算各种剩余期限的个券及组合预期回报的基础。</p> <p>基于均衡收益率曲线，计算不同资产类别、不同剩余期限配置的预期超额回报，并对预期超额回报进行排序，得到投资评级。在此基础上，卖出内部收益率低于均衡收益率的债券，买入内部收益率高于均衡收益率的债券。</p> <p>(2) 债券投资策略</p> <p>债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。</p> <p>(3) 组合构建及调整</p> <p>本公司债券策略组将结合各成员债券投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券投资组合。</p> <p>债券策略组每两周开会讨论债券投资组合，买入低估债券，卖出高估债券。同时从风险管理的角度，评估调整对组合久期、类别权重等的影响。</p> <p>4、衍生品投资策略</p> <p>(1) 股指期货投资管理</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p> <p>(2) 国债期货投资管理</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险。</p> <p>(3) 权证投资管理</p> <p>A、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率及无风险收益率等要素，估计权证合理价值。</p> <p>B、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱巍
	联系电话	0571-87659806

	电子邮箱	service@qhlhfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95527
传真		0755-82780000	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市延安路 368 号
邮政编码		518031	310006
法定代表人		王晓耕	沈仁康

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	前海联合泳隼混合 A	前海联合泳隼混合 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	39,227,499.34	92.97
本期利润	59,427,177.93	-7.17
加权平均基金份额本期利润	0.1203	-0.0039
本期加权平均净值利润率	14.32%	-0.45%
本期基金份额净值增长率	16.59%	-0.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-96,035,392.42	-292.88
期末可供分配基金份额利润	-0.1944	-0.1550
期末基金资产净值	418,001,918.27	1,596.16
期末基金份额净值	0.8463	0.8450
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-15.37%	-0.45%

注：1 上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。

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 25 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

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

前海联合泳隼混合 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	1.69%	1.19%	2.84%	0.57%	-1.15%	0.62%
过去三个月	-7.92%	1.78%	-0.54%	0.75%	-7.38%	1.03%
过去六个月	16.59%	1.59%	13.28%	0.77%	3.31%	0.82%

过去一年	0.28%	1.35%	6.62%	0.76%	-6.34%	0.59%
自基金合同生效起至今	-15.37%	1.25%	-3.34%	0.72%	-12.03%	0.53%

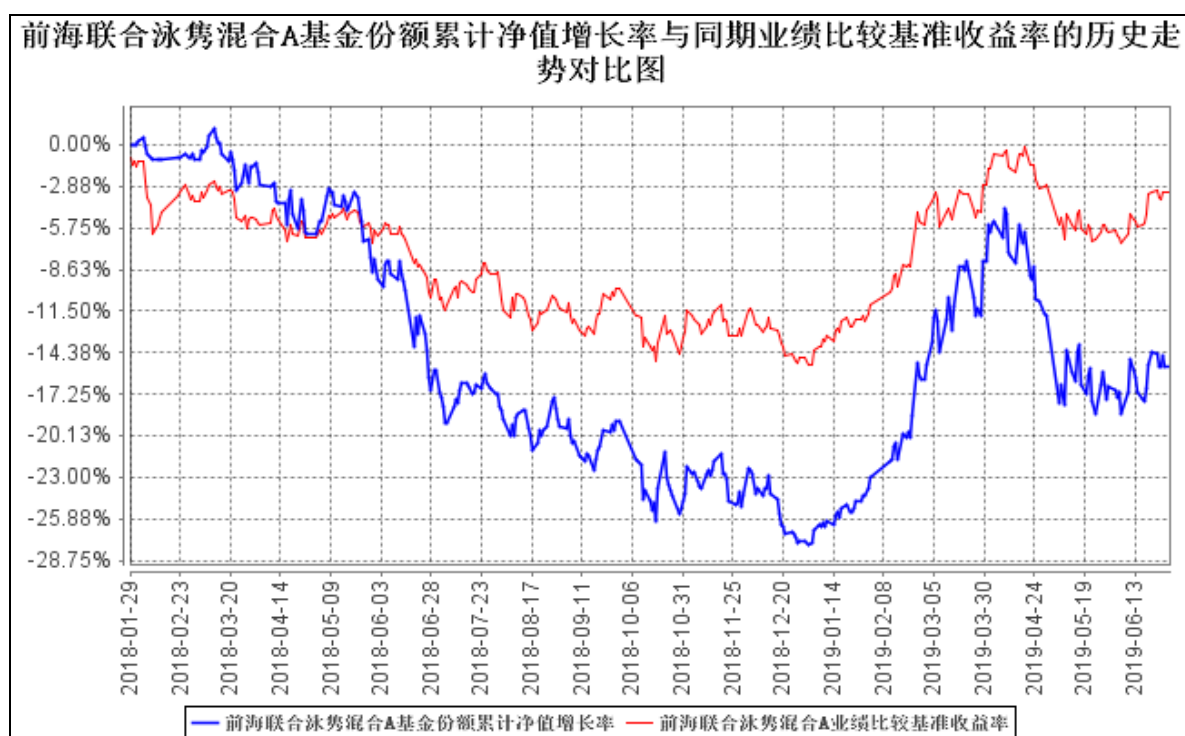
前海联合泳隼混合 C

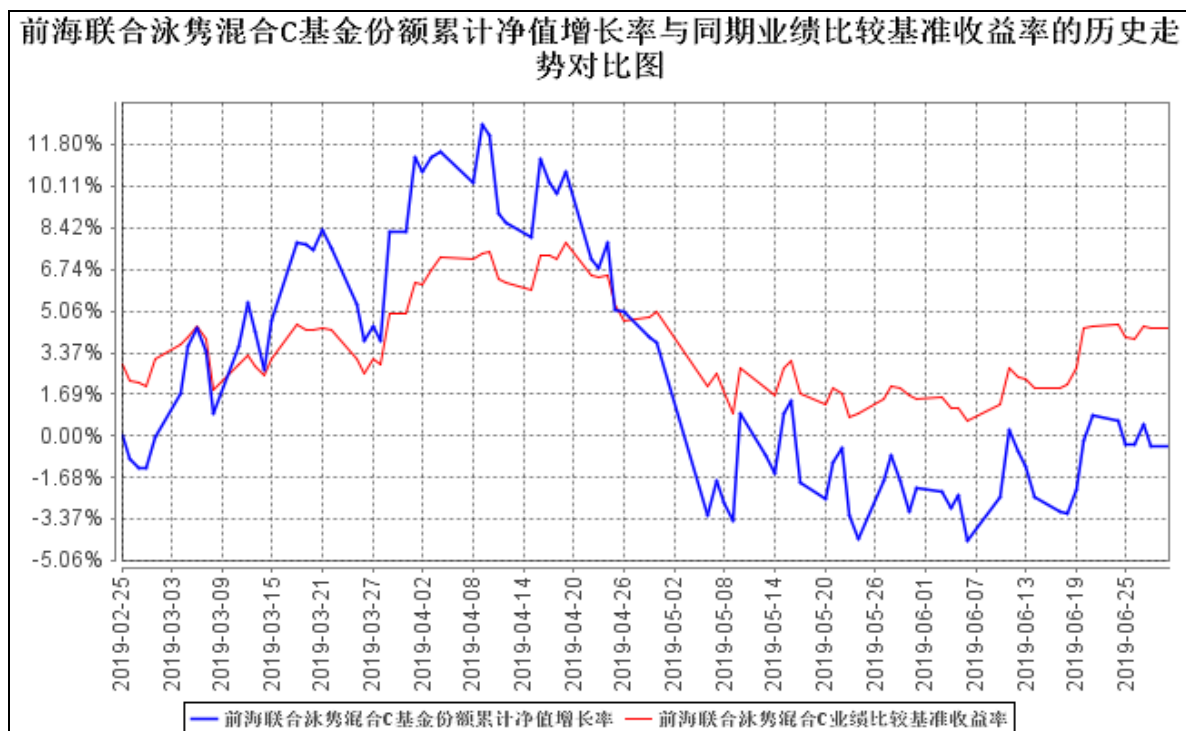
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.66%	1.19%	2.84%	0.57%	-1.18%	0.62%
过去三个月	-8.02%	1.78%	-0.54%	0.75%	-7.48%	1.03%
自基金合同生效起至今	-0.45%	1.74%	4.35%	0.82%	-4.80%	0.92%

注：1、本基金自 2019 年 2 月 25 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

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、本基金自 2019 年 2 月 25 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

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。

3.3 其他指标

无。

§ 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	2018年1月29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，现任前海联合泳隼混合兼前海联合沪深300、前海联合泳涛混合、前海联合泳隆混合、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。
黄海滨	本基金的基金经理	2018年1月31日	-	8年	黄海滨先生，经济学硕士，8年证券投资研究经验。2013年5月至2017年12月任职于前海人寿资产管理中心，历任研究部行业研究员、权益投资部投资经理。2011年8月至2013

				年 2 月任天弘基金股票投资部行业研究员。2010 年 7 月至 2011 年 8 月任华夏基金投资研究部研究员。2017 年 12 月加入前海联合基金，现任前海联合泳隼混合兼前海联合泳涛混合的基金经理。
--	--	--	--	--

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

整个上半年，A 股市场跌宕起伏，年初由于货币政策放松，以及外部环境缓和，市场对经济和企业盈利有比较乐观的预期，风险偏好回升，市场出现普涨行情。但二季度以来市场发生回调，有几个因素：一季度国内经济金融数据呈现走稳向上的态势，导致政策面边际收紧，央行一季度例会重提“把好货币总闸门，不搞大水漫灌”；五一后外部风险加大，美国对 2000 亿美元的中国商品加征 25% 的关税，并可能对额外 3250 亿美元商品征税；5 月底包商银行事件后，银行刚兑预期被打破，金融机构同业业务风险偏好急速下降，流动性结构化分层问题突出。

操作上，上半年泳隼的配置结构一直是低估值蓝筹（主要是金融地产股）加优质成长股（5G、云计算、半导体、新能源、电动车等），仓位保持较高的水平，在一季度业绩表现较好；由于系统性风险，以及组合在消费类行业（食品饮料、家电等）配置比例偏低，二季度净值表现一般。

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隼混合 A 基金份额净值为 0.8463 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.59%，同期业绩比较基准收益率为 13.28%；截至本报告期末前海联合泳隼混合 C 基金份额净值为 0.8450 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.45%，同期业绩比较基准收益率为 4.35%。

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，我们认为市场可能出现震荡走势。影响因素有：1、经济层面，下行压力仍较大，主要是出口-制造业链条关税提高以及房地产调控 5 月份以来升级带来的的负面影响，货币政策虽然已经宽松，但目前看来融资难融资贵问题没得到解决，金融机构风险偏好低，企业扩大投资的信心也不足；2、政策层面，由于高杠杆的约束，逆周期政策实际上很克制，不会通过刺激房地产来追求短期经济的增长，后续政策重点是进一步疏通宽货币流向实体经济（推动利率并轨、降低实体融资成本等）、减费降税扩大内需、继续推动制造业升级和自主创新，以及扩大开放和结构性改革；3、流动性层面，全球央行进入新一轮宽松周期，海外资金成本很便宜，中国的股票和债券资产吸引力上升，外资持续买入 A 股优质上市公司；4、资本市场政策友好，政府推动经济结构转型的决心强烈，科创板将助力科技企业成长；5、估值层面，当前 A 股整体估值水平处于历史低位，资金杠杆率比较低，核心资产的当期估值不便宜，但也不算很贵。

泳隼的配置将关注科技和消费，以及低估值蓝筹。低估值蓝筹和消费白马继续作为底仓，消费升级的趋势是确定的，成长性、估值、ROE 对标国际同行还有优势；下半年重点关注成长股的机会（科技创新、高端制造），预计 5G 建设将开启新一轮创新周期，整个科技产业（5G 设备、5G 三大应用场景、消费电子、云计算、半导体等）都将受益，另外，新能源、电动车这些下半年景气度回升的行业也值得重视。

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责任公司、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，本基金托管人在对新疆前海联合泳隼灵活配置混合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，新疆前海联合泳隼灵活配置混合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泳隼灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在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，新疆前海联合泳隼灵活配置混合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泳隼灵活配置混合型证券投资基金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复核，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：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	23,310,156.04	41,197,103.89
结算备付金		1,168,398.44	2,822,165.53
存出保证金		747,559.90	1,042,906.95
交易性金融资产	6.4.7.2	398,601,654.91	218,525,114.41
其中：股票投资		378,595,654.91	137,647,114.41
基金投资		-	-
债券投资		20,006,000.00	80,878,000.00
资产支持证券投资		-	-
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	-	110,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	654,029.51	1,596,170.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		424,481,798.80	375,183,461.31
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,582,558.05	15,470,706.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		237,612.58	220,098.78
应付托管费		50,916.96	47,164.03
应付销售服务费		0.60	-
应付交易费用	6.4.7.7	509,809.99	561,321.36
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	97,386.19	290,000.00
负债合计		6,478,284.37	16,589,290.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	493,946,007.62	493,965,737.66
未分配利润	6.4.7.10	-75,942,493.19	-135,371,567.25
所有者权益合计		418,003,514.43	358,594,170.41
负债和所有者权益总计		424,481,798.80	375,183,461.31

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，前海联合泳隼混合 A 基金份额净值 0.8463 元，基金份额总额 493,944,118.58 份；前海联合泳隼混合 C 基金份额净值 0.8450 元，基金份额总额 1,889.04 份。前海联合泳隼混合份额总额合计为 493,946,007.62 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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 29 日(基金 合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		63,514,811.39	-71,599,054.92
1.利息收入		1,193,159.98	3,041,161.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,759.08	320,899.19
债券利息收入		702,947.94	282,191.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		390,452.96	2,438,070.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,122,060.62	-69,020,418.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,512,840.67	-71,496,097.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,448,751.51	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,160,468.44	2,475,679.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,199,578.45	-5,619,857.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12.34	59.46
减：二、费用		4,087,640.63	6,506,082.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,436,573.09	1,397,133.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	307,837.05	299,385.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2.48	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,236,841.82	4,745,828.38
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	6.4.7.20	106,386.19	63,733.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		59,427,170.76	-78,105,137.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		59,427,170.76	-78,105,137.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

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）	493,965,737.66	-135,371,567.25	358,594,170.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,427,170.76	59,427,170.76
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）	-19,730.04	1,903.30	-17,826.74
其中：1.基金申购款	2,154.01	-326.88	1,827.13
2.基金赎回款	-21,884.05	2,230.18	-19,653.87
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)	493,946,007.62	-75,942,493.19	418,003,514.43
项目	上年度可比期间 2018年1月29日(基金合同生效日)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)	500,264,478.57	-	500,264,478.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-78,105,137.07	-78,105,137.07
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)	66,704.18	-975.93	65,728.25
其中：1.基金申购款	92,621.77	-3,114.39	89,507.38
2.基金赎回款	-25,917.59	2,138.46	-23,779.13
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	500,331,182.75	-78,106,113.00	422,225,069.75

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

新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金(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[2017]641号《关于准予新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2018]14号《关于同意新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的函》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《新疆前海联合泳隼灵活配置混合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 500,264,450.94 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 0059 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,264,478.57 份基金份额，其中认购资金利息折合 27.63 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，基金托管人为浙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》和《新疆前海联合泳隼灵活配置混合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，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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）。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 0%–95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

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》、《新疆前海联合泳隼灵活配置混合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。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	23,310,156.04
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	23,310,156.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	358,347,315.11	378,595,654.91	20,248,339.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	20,048,600.00	20,006,000.00
	合计	20,048,600.00	20,006,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	378,395,915.11	398,601,654.91	20,205,739.80

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

无余额。

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	5,626.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	473.22
应收债券利息	647,627.40
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	302.76
合计	654,029.51

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	509,809.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	509,809.99

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	97,386.19
合计	97,386.19

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

前海联合泳隼混合 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	493,965,737.66	493,965,737.66
本期申购	263.79	263.79
本期赎回(以“-”号填列)	-21,882.87	-21,882.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	493,944,118.58	493,944,118.58

金额单位：人民币元

前海联合泳隼混合 C	
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,890.22	1,890.22
本期赎回(以“-”号填列)	-1.18	-1.18
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,889.04	1,889.04

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

前海联合泳隼混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-135,267,359.76	-104,207.49	-135,371,567.25
本期利润	39,227,499.34	20,199,678.59	59,427,177.93
本期基金份额交易产生的变动数	4,468.00	-2,278.99	2,189.01
其中：基金申购款	-59.14	18.08	-41.06
基金赎回款	4,527.14	-2,297.07	2,230.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-96,035,392.42	20,093,192.11	-75,942,200.31

单位：人民币元

前海联合泳隼混合 C			
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	92.97	-100.14	-7.17
本期基金份额交易产生的变动数	-285.62	-0.09	-285.71
其中：基金申购款	-285.74	-0.08	-285.82
基金赎回款	0.12	-0.01	0.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-192.65	-100.23	-292.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	58,014.33

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,882.42
其他	6,862.33
合计	99,759.08

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	754,736,804.55
减：卖出股票成本总额	716,223,963.88
买卖股票差价收入	38,512,840.67

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,448,751.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,448,751.51

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	62,949,063.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	60,000,000.00
减：应收利息总额	1,500,312.32
买卖债券差价收入	1,448,751.51

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,160,468.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,160,468.44

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

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

1. 交易性金融资产	20,199,578.45
——股票投资	21,071,578.45
——债券投资	-872,000.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	20,199,578.45

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	12.34
合计	12.34

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,236,241.82
银行间市场交易费用	600.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,236,841.82

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	67,633.41
账户维护费	9,000.00

其他	-
合计	106,386.19

6.4.7.21 分部报告

无。

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
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,436,573.09	1,397,133.99
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的约定年费率计提，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 0.70% / 当年天数。

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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	307,837.05	299,385.94

注：支付基金托管人浙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。

6.4.10.2.3 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		
	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		
	前海联合泳隼混合 A	前海联合泳隼混合 C	合计
新疆前海联合	-	2.48	2.48
合计	-	2.48	2.48

注：1、本基金自 2019 年 2 月 25 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

2、基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金份额销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.40% / 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

无。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)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
浙商银行	23,310,156.04	58,014.33	82,263,926.24	195,184.62

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，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

无。

6.4.12 期末（2019 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	

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

无。

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

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层层面设立风险管理委员会，

讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,006,000.00	20,064,000.00
合计	20,006,000.00	20,064,000.00

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策银行债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	60,814,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	60,814,000.00

注：长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金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,其余额不得超过基金资产净值的 40%,且其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金的基金管理人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。

本基金可投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此可能存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,310,156.04	-	-	-	23,310,156.04
结算备付金	1,168,398.44	-	-	-	1,168,398.44
存出保证金	747,559.90	-	-	-	747,559.90
交易性金融资产	20,006,000.00	-	-	-378,595,654.91	398,601,654.91
应收利息	-	-	-	654,029.51	654,029.51
资产总计	45,232,114.38	-	-	-379,249,684.42	424,481,798.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,582,558.05	5,582,558.05
应付管理人报酬	-	-	-	237,612.58	237,612.58
应付托管费	-	-	-	50,916.96	50,916.96
应付销售服务费	-	-	-	0.60	0.60
应付交易费用	-	-	-	509,809.99	509,809.99
其他负债	-	-	-	97,386.19	97,386.19
负债总计	-	-	-	6,478,284.37	6,478,284.37
利率敏感度缺口	45,232,114.38	-	-	-372,771,400.05	418,003,514.43
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,197,103.89	-	-	-	41,197,103.89
结算备付金	2,822,165.53	-	-	-	2,822,165.53
存出保证金	1,042,906.95	-	-	-	1,042,906.95
交易性金融资产	20,064,000.00	60,814,000.00	-	-137,647,114.41	218,525,114.41
买入返售金融资产	110,000,000.00	-	-	-	110,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,596,170.53	1,596,170.53
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	175,126,176.37	60,814,000.00	-	-139,243,284.94	375,183,461.31

负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,470,706.73	15,470,706.73
应付管理人报酬	-	-	-	220,098.78	220,098.78
应付托管费	-	-	-	47,164.03	47,164.03
应付交易费用	-	-	-	561,321.36	561,321.36
其他负债	-	-	-	290,000.00	290,000.00
负债总计	-	-	-	16,589,290.90	16,589,290.90
利率敏感度缺口	175,126,176.37	60,814,000.00	-	-122,653,994.04	358,594,170.41

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	87,521.30
2. 市场利率上升 25 个基点	-	-86,807.59	

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金净资产 4.79%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应

对可能发生的市场价格风险。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种等合计占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	378,595,654.91	90.57	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	378,595,654.91	90.57	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		23,149,973.18
2. 沪深 300 指数下降 5%		-23,149,973.18	-11,889,189.72

6.4.14 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	378,595,654.91	89.19
	其中：股票	378,595,654.91	89.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,006,000.00	4.71
	其中：债券	20,006,000.00	4.71
	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	24,478,554.48	5.77
8	其他各项资产	1,401,589.41	0.33
9	合计	424,481,798.80	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

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	265,586.15	0.06
C	制造业	178,773,726.26	42.77
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	17,948,700.00	4.29
G	交通运输、仓储和邮政业	31,144,535.35	7.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,786.46	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	150,364,344.15	35.97
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	378,595,654.91	90.57

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所有股票投资明细

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	601155	新城控股	680,000	27,070,800.00	6.48
2	600383	金地集团	2,229,755	26,600,977.15	6.36
3	002146	荣盛发展	2,570,000	24,132,300.00	5.77
4	000977	浪潮信息	910,000	21,712,600.00	5.19
5	600438	通威股份	1,480,000	20,808,800.00	4.98
6	000961	中南建设	2,119,950	18,358,767.00	4.39
7	600340	华夏幸福	560,000	18,239,200.00	4.36
8	600325	华发股份	2,330,000	18,197,300.00	4.35
9	002727	一心堂	630,000	17,948,700.00	4.29
10	300316	晶盛机电	1,410,000	17,892,900.00	4.28
11	001979	招商蛇口	850,000	17,765,000.00	4.25
12	002120	韵达股份	566,500	17,459,530.00	4.18
13	601877	正泰电器	750,000	17,317,500.00	4.14
14	002371	北方华创	246,000	17,035,500.00	4.08
15	002384	东山精密	1,150,000	16,755,500.00	4.01
16	002396	星网锐捷	675,000	15,147,000.00	3.62
17	002129	中环股份	1,469,980	14,347,004.80	3.43
18	300450	先导智能	420,000	14,112,000.00	3.38
19	600233	圆通速递	1,109,895	13,685,005.35	3.27
20	601012	隆基股份	533,154	12,321,188.94	2.95
21	603019	中科曙光	310,000	10,881,000.00	2.60
22	002837	英维克	20,000	324,600.00	0.08
23	600968	海油发展	74,813	265,586.15	0.06
24	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
25	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
26	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01

27	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
28	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
29	300451	创业慧康	146	2,182.70	0.00

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	000977	浪潮信息	36,361,150.67	10.14
2	002384	东山精密	32,852,986.39	9.16
3	000063	中兴通讯	30,617,437.90	8.54
4	600383	金地集团	26,672,914.06	7.44
5	300451	创业慧康	24,961,536.80	6.96
6	600837	海通证券	23,238,220.00	6.48
7	600438	通威股份	21,247,628.95	5.93
8	300316	晶盛机电	21,134,977.50	5.89
9	002120	韵达股份	20,496,821.67	5.72
10	603019	中科曙光	19,917,163.20	5.55
11	002396	星网锐捷	19,722,459.79	5.50
12	600031	三一重工	18,588,089.86	5.18
13	600325	华发股份	18,312,566.00	5.11
14	601877	正泰电器	18,278,032.04	5.10
15	000961	中南建设	17,735,316.24	4.95
16	600030	中信证券	17,704,316.00	4.94
17	002714	牧原股份	17,269,215.00	4.82
18	002727	一心堂	17,123,566.00	4.78
19	000671	阳光城	16,525,111.50	4.61
20	600340	华夏幸福	16,382,299.37	4.57
21	002371	北方华创	14,710,420.10	4.10
22	002129	中环股份	14,395,869.40	4.01
23	600233	圆通速递	14,036,952.20	3.91
24	601688	华泰证券	13,812,817.63	3.85
25	300047	天源迪科	13,779,432.00	3.84
26	300122	智飞生物	13,517,278.24	3.77
27	000776	广发证券	13,011,243.00	3.63
28	001979	招商蛇口	12,373,671.09	3.45

29	300450	先导智能	12,150,674.72	3.39
30	601012	隆基股份	11,733,139.11	3.27
31	601601	中国太保	11,610,184.00	3.24
32	300098	高新兴	10,429,507.00	2.91
33	601009	南京银行	10,426,000.00	2.91
34	601888	中国国旅	10,154,429.14	2.83
35	002821	凯莱英	9,936,888.95	2.77
36	601899	紫金矿业	9,747,000.00	2.72
37	300207	欣旺达	9,419,859.00	2.63
38	300253	卫宁健康	9,233,382.00	2.57
39	600115	东方航空	9,126,891.00	2.55
40	002007	华兰生物	9,096,253.20	2.54
41	600466	蓝光发展	8,680,716.80	2.42
42	300017	网宿科技	8,678,023.00	2.42
43	300059	东方财富	8,381,447.44	2.34
44	002373	千方科技	8,313,724.00	2.32
45	300365	恒华科技	8,262,847.00	2.30
46	600259	广晟有色	8,255,408.00	2.30
47	002876	三利谱	8,136,676.00	2.27
48	600606	绿地控股	8,028,224.67	2.24
49	600919	江苏银行	7,929,650.00	2.21
50	002407	多氟多	7,723,110.00	2.15
51	002304	洋河股份	7,619,829.00	2.12
52	002299	圣农发展	7,615,304.00	2.12
53	002376	新北洋	7,379,857.00	2.06
54	002583	海能达	7,341,477.00	2.05
55	300389	艾比森	7,242,972.24	2.02

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	000063	中兴通讯	35,702,060.91	9.96
2	300451	创业慧康	26,301,344.04	7.33
3	601318	中国平安	24,324,923.00	6.78
4	600837	海通证券	23,840,444.00	6.65

5	600031	三一重工	20,080,902.04	5.60
6	000977	浪潮信息	19,730,784.50	5.50
7	002384	东山精密	16,946,811.00	4.73
8	600030	中信证券	16,537,670.00	4.61
9	002714	牧原股份	15,180,232.88	4.23
10	000001	平安银行	14,746,072.00	4.11
11	600048	保利地产	14,340,419.00	4.00
12	300047	天源迪科	14,037,364.45	3.91
13	000671	阳光城	13,857,951.00	3.86
14	000776	广发证券	13,136,236.00	3.66
15	601688	华泰证券	13,113,401.80	3.66
16	300122	智飞生物	12,575,660.20	3.51
17	300098	高新兴	12,127,468.07	3.38
18	601601	中国太保	11,556,393.00	3.22
19	300365	恒华科技	11,552,436.56	3.22
20	601818	光大银行	11,197,527.00	3.12
21	300253	卫宁健康	11,088,871.75	3.09
22	002371	北方华创	10,971,264.00	3.06
23	601009	南京银行	10,808,580.00	3.01
24	002007	华兰生物	10,471,391.00	2.92
25	601888	中国国旅	10,353,235.10	2.89
26	002821	凯莱英	10,291,870.95	2.87
27	002120	韵达股份	10,058,306.19	2.80
28	601899	紫金矿业	9,958,819.00	2.78
29	603019	中科曙光	9,958,184.00	2.78
30	300207	欣旺达	9,597,370.06	2.68
31	600153	建发股份	9,502,416.10	2.65
32	300017	网宿科技	9,029,703.28	2.52
33	600259	广晟有色	9,011,024.69	2.51
34	002583	海能达	8,886,628.00	2.48
35	300059	东方财富	8,710,000.00	2.43
36	600115	东方航空	8,477,337.00	2.36
37	002304	洋河股份	8,191,888.00	2.28
38	600606	绿地控股	8,091,051.82	2.26
39	002407	多氟多	8,069,104.37	2.25
40	600466	蓝光发展	8,054,207.00	2.25
41	002373	千方科技	7,693,295.00	2.15
42	601186	中国铁建	7,670,600.00	2.14

43	600919	江苏银行	7,641,156.00	2.13
44	601333	广深铁路	7,535,892.00	2.10
45	002299	圣农发展	7,384,549.00	2.06
46	002876	三利谱	7,347,876.00	2.05
47	002468	申通快递	7,331,828.00	2.04
48	300389	艾比森	7,301,961.68	2.04
49	002376	新北洋	7,200,517.00	2.01

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	936,100,925.93
卖出股票收入（成交）总额	754,736,804.55

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

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	20,006,000.00	4.79
	其中：政策性金融债	20,006,000.00	4.79
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,006,000.00	4.79

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	180209	18 国开 09	200,000	20,006,000.00	4.79

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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

中南建设关于深交所对江苏中南建设集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分：

2017 年 11 月 11 日中南建设转让子公司股权实现投资收益 50,100 万元，扣除所得税影响实现净利润 37,357 万元，占公司 2016 年经审计的合并报表归属于母公司的净利润的 91.62%。2017 年 11 月 16 日，中南建设完成了转让中南房地产 47%股权转让的工商变更手续。中南建设迟至 2018 年 6 月 7 日才履行信息披露义务，并迟至 2019 年 1 月 17 日才履行股东大会审议程序。2018 年 8 月 23 日，公司收到江苏证监局警示函。2019 年 3 月 29 日，深交所对江苏中南建设集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分。深交所依据《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 17.2 条、第 17.3 条和第 17.4 条的规定，经本所纪律处分委员会审议通过，本所作出如下处分决定：一、对江苏中南建设集团股份有限公司给予通报批评的处分。二、对江苏中南建设集团股份有限公司董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军、现任董事辛琦、时任董事会秘书张伟给予通报

批评的处分。

基金管理人分析认为，该处罚不会对公司今后经营产生重大影响，原因如下：（1）由于公司前期拿地策略有问题，导致 2015、2016 年业绩出现大幅下滑，所以导致占净利润比例较高，2018 年公司实现归母净利润 21.93 亿元；（2）已经受到违规披露处罚，实际违规发生在 2017 年 11 月，当时负责信息披露的董秘已经更换。

本基金投资于中南建设的决策程序说明：基于中南建设基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中南建设，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，认为该事项对公司经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

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

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	747,559.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	654,029.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,401,589.41

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
前海联合泳隼混合 A	292	1,691,589.45	493,697,000.00	99.95%	247,118.58	0.05%
前海联合泳隼混合 C	36	52.47	-	-	1,889.04	100.00%
合计	309	1,598,530.77	493,697,000.00	99.95%	249,007.62	0.05%

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	前海联合泳隼混合 A	101,149.54	0.0205%
	前海联合泳隼混合 C	1,650.01	87.3465%
	合计	102,799.55	0.0208%

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	前海联合泳隼混合 A	0~10

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海联合泳隼混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合泳隼混合 A	0~10
	前海联合泳隼混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海联合泳隼 混合 A	前海联合泳隼 混合 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 29 日）基金份额总额	500,264,478.57	-
本报告期期初基金份额总额	493,965,737.66	-
本报告期期间基金总申购份额	263.79	1,890.22
减：本报告期期间基金总赎回份额	21,882.87	1.18
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	493,944,118.58	1,889.04

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

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	740,940,768.73	43.87%	541,851.74	40.69%	-
广发证券	1	483,078,096.40	28.60%	449,891.23	33.78%	-
海通证券	1	237,116,720.34	14.04%	173,404.72	13.02%	-
国信证券	1	227,739,412.78	13.48%	166,546.73	12.51%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	2,665,200,000.00	89.45%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	314,500,000.00	10.55%	-	-
华创证券	99,999,900.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	前海联合基金 2018 年 12 月 31 日基金净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	前海联合泳隼混合基金 2018 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 1 月 22 日
3	关于前海联合泳隼混合基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 2 月 21 日
4	前海联合泳隼混合基金 C 类份额开放日常申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 2 月 21 日

5	前海联合泳隼混合基金 2018 年度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 3 月 28 日
6	前海联合泳隼混合基金 2018 年度报告摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 3 月 28 日
7	前海联合泳隼混合基金 2019 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 4 月 19 日
8	关于前海联合基金旗下部分开放式基金开通基金转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 5 月 25 日
9	关于前海联合基金旗下部分开放式基金开通基金转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2019 年 5 月 25 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	20190101-20190630	199,999,000.00	-	-	199,999,000.00	40.49%
	2	20190101-20190630	199,999,000.00	-	-	199,999,000.00	40.49%
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，本基金管理人自 2019 年 2 月 25 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 21 日发布的《关于新疆前海联合泳隼灵活配置混合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》。

§ 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添和纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 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

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等存放于基金管理人处。

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

2019 年 8 月 24 日