

新疆前海联合沪深 300 指数型 证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 2017 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	49,704,488.69 份
基金合同存续期	不定期

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	本基金采用复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。在严格控制偏离度和跟踪误差的前提前，力争获取与标的指数相似的投资收益。
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	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。 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李华	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95588
传真		0755-82780000	010-66105798

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	339,440.82
本期利润	3,394,786.58
加权平均基金份额本期利润	0.0683
本期基金份额净值增长率	6.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0112
期末基金资产净值	53,317,889.72
期末基金份额净值	1.0727

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。

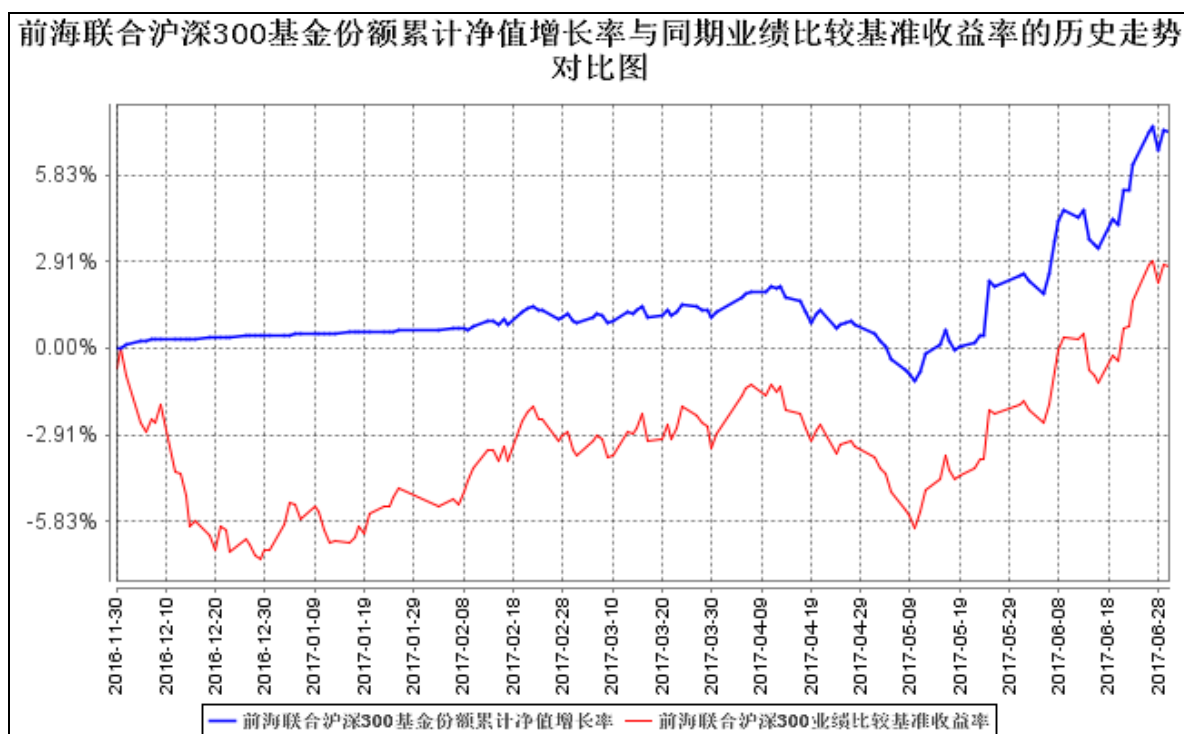
3.2 基金净值表现

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

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	4.70%	0.60%	4.73%	0.64%	-0.03%	-0.04%
过去三个月	5.95%	0.49%	5.79%	0.59%	0.16%	-0.10%
过去六个月	6.80%	0.36%	10.23%	0.54%	-3.43%	-0.18%
自基金合同生效起至今	7.27%	0.33%	2.76%	0.59%	4.51%	-0.26%

注：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%。

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：本基金的基金合同于 2016 年 11 月 30 日生效，截至本报告期末，本基金成立未满一年。按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林材	本基金的 基金经理	2016 年 11 月 30 日	-	9	林材先生，药学硕士，9 年证券投资基金投资研究经验。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 兼前海联合全民健康混合、前海联合新思路混合、前海联合添利债券和前海联合国民健康混合的基金经理。
王静	本基金的 基金经理	2017 年 3 月 20 日	-	8	王静女士，金融学硕士，CFA，8 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的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司对外公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金采取复制指数的投资策略，建仓期逐步建仓，在五月抓住市场调整的机会果断进行了最大幅度的加仓，从而在后期市场反弹中取得了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0727 元，份额累计净值为 1.0727 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 6.80%，同期业绩基准增长率为 10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来半年，经济周期相对平稳，韧性好于预期。随着供给侧改革的逐步深化，本轮经济小周期较以往更加平滑。利率周期将维持相对高位，金融去杠杆持续螺旋式推进，虽然可能推高短期利率，但系统性风险概率亦会逐步降低。改革周期有望进入加速期，国企改革、财税改革、土地改革等陆续推进，有望释放新一轮的制度红利。

企业盈利进入分化期，行业龙头企业盈利的持续稳定性将会好于预期，而不具核心竞争力的中小企业将会在本轮结构调整中陆续淘汰，行业集中度增强。内生增长的稳定性提升将会带来估值的中长期提升。市场整体维持强势震荡格局。

各行业表现有望趋于平衡，业绩增长将是重要的试金石。业绩持续改善的周期龙头价值持续重估，国际比较具优势的金融和消费龙头仍有估值修复空间，内生增长和估值逐步匹配的成长股进入左侧布局时点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值委员会，由副总经理、研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管

理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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沪深 300 指数型证券投资基金基金的托管过程中，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 2017 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：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	387,171.71	49,978,599.91
结算备付金	940,720.22	-
存出保证金	13,016.10	-
交易性金融资产	52,160,022.18	-
其中：股票投资	49,669,772.18	-
基金投资	-	-
债券投资	2,490,250.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	300,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	27,941.64	132,560.35
应收股利	-	-
应收申购款	0.99	199.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,828,872.84	50,111,360.02
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	300,000.00	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	27,710.36	35,402.99
应付托管费	6,394.72	8,169.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	41,878.22	-
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	134,999.82	22,711.30
负债合计	510,983.12	66,284.19
所有者权益：		
实收基金	49,704,488.69	49,825,942.44
未分配利润	3,613,401.03	219,133.39
所有者权益合计	53,317,889.72	50,045,075.83
负债和所有者权益总计	53,828,872.84	50,111,360.02

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，前海联合沪深 300 基金份额净值 1.0727 元，基金份额总额 49,704,488.69 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	3,842,962.29
1.利息收入	415,893.65
其中：存款利息收入	207,564.79
债券利息收入	190.41
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	208,138.45
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	371,543.72
其中：股票投资收益	-12,901.82
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	384,445.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,055,345.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	179.16
减：二、费用	448,175.71

1. 管理人报酬	162,576.88
2. 托管费	37,517.74
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	68,335.27
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	179,745.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,394,786.58
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,394,786.58

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	49,825,942.44	219,133.39	50,045,075.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,394,786.58	3,394,786.58
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）	-121,453.75	-518.94	-121,972.69
其中：1.基金申购款	20,786.40	546.66	21,333.06
2.基金赎回款	-142,240.15	-1,065.60	-143,305.75
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）	49,704,488.69	3,613,401.03	53,317,889.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 王晓耕 </u>	<u> 刘菲 </u>	<u> 黄嘉宇 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）证监许可【2016】1861 号文《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》，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》、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2015 年 12 月 8 日至 2015 年 12 月 22 日，首次发售募集的有效认购资金扣除认购费用的净认购金额为人民币 13,411,070,976.88 元；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 2,926,682.68 元，折合为 2,926,682.68 份基金份额。以上金额共计人民币 13,413,997,659.56 元，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。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

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：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。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2017 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新疆前海联合沪深 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 2017 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;

对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.7.1 关联方报酬

6.4.7.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	162,576.88
其中：支付销售机构的客户维护费	10.82

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。

6.4.7.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,517.74

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。

6.4.7.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.3 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.4 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	387,171.71	16,675.59

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。

6.4.7.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2017年5月31日	重大资产重组	6.21	-	-	58,300	419,569.00	362,043.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	-	-	57,900	193,378.00	208,440.00	-

601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组	22.29	-	-	8,500	158,346.00	189,465.00	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大资产重组	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	15,100	107,835.79	114,307.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大资产重组	30.68	-	-	3,700	126,194.00	113,516.00	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	13,400	91,124.00	100,098.00	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 20 日	重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	26,700	94,972.00	91,581.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大资产重组	14.12	-	-	5,800	83,507.00	81,896.00	-
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大资产重组	20.24	-	-	3,979	82,926.71	80,534.96	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大资产重组	10.57	-	-	7,600	80,148.10	80,332.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大资产重组	24.93	-	-	3,200	118,188.00	79,776.00	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	12,700	76,382.00	67,945.00	-
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大资产重组	17.40	-	-	2,720	47,892.00	47,328.00	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事项	5.16	-	-	7,400	39,269.00	38,184.00	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	4,400	24,632.00	24,376.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大资产重组	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	500	15,764.00	15,410.00	-
300085	银之	2017 年	重大事	18.50	2017	18.88	100	1,831.73	1,850.00	-

	杰	6 月 30 日	项		年 7 月 7 日					
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项	9.06	-	-	100	1,038.24	906.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 47,972,690.22 元；属于第二层次的余额为 16,970,81.96 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,669,772.18	92.27
	其中：股票	49,669,772.18	92.27
2	固定收益投资	2,490,250.00	4.63
	其中：债券	2,490,250.00	4.63
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	300,000.00	0.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,327,891.93	2.47
7	其他各项资产	40,958.73	0.08
8	合计	53,828,872.84	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	123,742.00	0.23
B	采矿业	1,579,276.00	2.96
C	制造业	17,831,680.16	33.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,387,568.00	2.60
E	建筑业	2,359,375.12	4.43
F	批发和零售业	1,103,548.00	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,350,395.00	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,185,271.50	4.10
J	金融业	17,444,057.40	32.72
K	房地产业	2,655,154.00	4.98
L	租赁和商务服务业	441,499.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	260,851.40	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	96,900.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	582,580.00	1.09
S	综合	143,426.00	0.27
	合计	49,545,323.58	92.92

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	采掘业	-	-
C	制造业	64,399.40	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	673.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	41,304.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	910.80	0.00
H	住宿和餐饮业	2,710.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,339.40	0.01
J	金融业	1,637.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,470.00	0.00
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	2,326.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	976.00	0.00
S	综合	1,703.00	0.00
	合计	124,448.60	0.23

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持有港股通投资股票。

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

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	54,400	2,698,784.00	5.06
2	000333	美的集团	41,900	1,803,376.00	3.38

3	600036	招商银行	53,000	1,267,230.00	2.38
4	600519	贵州茅台	2,400	1,132,440.00	2.12
5	601166	兴业银行	62,400	1,052,064.00	1.97
6	600016	民生银行	112,700	926,394.00	1.74
7	601328	交通银行	131,000	806,960.00	1.51
8	001979	招商蛇口	34,000	726,240.00	1.36
9	601668	中国建筑	74,200	718,256.00	1.35
10	600000	浦发银行	55,500	702,075.00	1.32

提示：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 www.qlhfund.com.cn 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	600666	奥瑞德	2,720	47,328.00	0.09
2	600648	外高桥	2,200	40,744.00	0.08
3	600867	通化东宝	160	2,918.40	0.01
4	002085	万丰奥威	140	2,723.00	0.01
5	600754	锦江股份	100	2,710.00	0.01
6	300015	爱尔眼科	100	2,326.00	0.00
7	300085	银之杰	100	1,850.00	0.00
8	000039	中集集团	100	1,803.00	0.00
9	600783	鲁信创投	100	1,703.00	0.00
10	002568	百润股份	100	1,662.00	0.00

提示：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 www.qlhfund.com.cn 网站的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	2,136,567.00	4.27
2	001979	招商蛇口	1,481,951.39	2.96
3	000333	美的集团	1,450,790.00	2.90
4	600016	民生银行	1,197,901.00	2.39
5	601166	兴业银行	1,170,734.00	2.34
6	600036	招商银行	1,054,683.00	2.11

7	600519	贵州茅台	960,397.00	1.92
8	601328	交通银行	853,476.00	1.71
9	600000	浦发银行	780,387.00	1.56
10	601668	中国建筑	716,795.00	1.43
11	600837	海通证券	688,616.00	1.38
12	600030	中信证券	684,982.00	1.37
13	601169	北京银行	671,281.00	1.34
14	601288	农业银行	625,039.00	1.25
15	600048	保利地产	613,416.00	1.23
16	600887	伊利股份	560,181.00	1.12
17	000651	格力电器	541,279.00	1.08
18	601766	中国中车	516,749.00	1.03
19	601398	工商银行	509,882.00	1.02
20	002415	海康威视	473,251.00	0.95

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	001979	招商蛇口	974,330.00	1.95
2	000651	格力电器	622,340.00	1.24
3	600016	民生银行	245,479.00	0.49
4	601166	兴业银行	163,196.00	0.33
5	601169	北京银行	122,261.00	0.24
6	000069	华侨城 A	120,750.00	0.24
7	600649	城投控股	110,836.00	0.22
8	600837	海通证券	110,818.00	0.22
9	600000	浦发银行	109,011.00	0.22
10	600867	通化东宝	94,930.00	0.19
11	600839	四川长虹	82,022.00	0.16
12	002085	万丰奥威	79,470.00	0.16
13	600030	中信证券	76,964.00	0.15
14	300058	蓝色光标	72,246.00	0.14
15	600252	中恒集团	67,230.00	0.13
16	600875	东方电气	65,322.00	0.13
17	601328	交通银行	63,590.00	0.13

18	300002	神州泰岳	63,274.00	0.13
19	000039	中集集团	62,523.00	0.12
20	601258	庞大集团	60,804.00	0.12

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	53,461,026.07
卖出股票收入（成交）总额	6,834,697.83

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	2,490,250.00	4.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	2,490,250.00	4.67

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	019557	17 国债 03	25,000	2,490,250.00	4.67

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 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2016 年 5 月 24 日，兴业银行公布诉讼判决执行情况的公告，根据福建省高级人民法院(2015)闽民初字第 100 号《民事判决书》判决：福建省兴银物业管理有限公司代持的“陈文德”名下兴业银行股份有限公司股票 308.88 万股为原告陈文德先生所有；兴业银行股份有限公司所代管上述股份的分红款为原告陈文德先生所有。

本基金投资于“兴业银行（601166）”的决策程序说明：基于兴业银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“兴业银行”股票，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人分析认为，该诉讼事件是一起有关个人购买兴业银行股份的纠纷事件，16 年 5 月兴业银行已按照判决结果将福建省兴银物业管理有限公司代持 308.88 万股份（兴业银行总股本 208 亿）过户予该个人股东，其仅为一起个人纠纷事件，且转让股份占总股本比例很低，因而事

件已于 16 年出清，认为不会对兴业银行基本面造成影响。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。

7.12.2 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	13,016.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,941.64
5	应收申购款	0.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,958.73

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600666	奥瑞德	47,328.00	0.09	重大资产重组

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

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
228	218,002.14	49,311,100.00	99.21%	393,388.69	0.79%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	256,769.51	0.5200%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	49,825,942.44
本报告期基金总申购份额	20,786.40
减:本报告期基金总赎回份额	142,240.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	49,704,488.69

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、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

本基金因成立时间较短，暂未进行审计。本基金管理人拟聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对基金 2017 年年报进行审计。

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	39,705,553.03	65.86%	36,977.41	65.85%	新增
安信证券	1	9,356,537.89	15.52%	8,713.69	15.52%	新增
恒泰证券	2	6,125,774.00	10.16%	5,704.96	10.16%	新增
华泰证券	2	5,104,423.98	8.47%	4,753.69	8.47%	新增
广发证券	1	-	-	-	-	新增
华创证券	2	-	-	-	-	新增

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	2,491,250.00	100.00%	1,450,500,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

§ 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	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6	49,311,100.00	-	-	49,311,100.00	99.21

		月 30 日					
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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

王静女士于 2017 年 3 月 20 日被增聘为本基金基金经理，公告日期为 2017 年 3 月 21 日，公告标题为《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的基金经理变更公告》。

新疆前海联合基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日