

# 新疆前海联合永兴纯债债券型 证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 28 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 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.11 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
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.....	37
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>42</b>
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.....	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	42

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>43</b>
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金
基金简称	前海联合永兴纯债
基金主代码	003928
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 14 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	1,588,167,524.91 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/收益的产品。

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晓耕	朱巍
	联系电话	0755-82780666	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	0571-87659965
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	杭州市庆春路 288 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.qlhfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人或托管人的办公地址

#### 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	35,724,366.56
本期利润	50,638,156.65
加权平均基金份额本期利润	0.0348
本期加权平均净值利润率	2.92%
本期基金份额净值增长率	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	308,768,839.50
期末可供分配基金份额利润	0.1944
期末基金资产净值	1,917,910,824.72
期末基金份额净值	1.2076
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	20.76%

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。

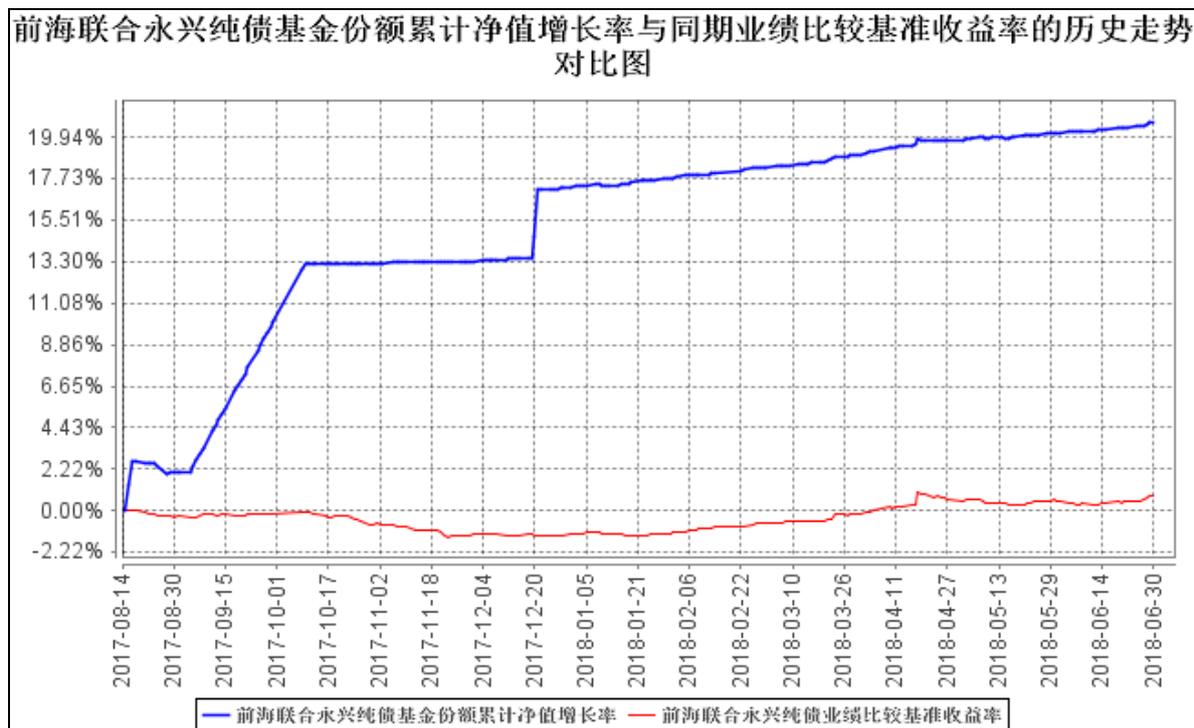
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.49%	0.03%	0.34%	0.06%	0.15%	-0.03%
过去三个月	1.45%	0.04%	1.01%	0.10%	0.44%	-0.06%
过去六个月	2.98%	0.04%	2.16%	0.08%	0.82%	-0.04%
自基金合同生效起至今	20.76%	0.29%	0.84%	0.07%	19.92%	0.22%

注：本基金的业绩表较基准为中债综合全价（总值）指数 收益率。

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



注：本基金的基金合同于 2017 年 8 月 14 日生效。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16只开放式基金，包括2只货币市场基金、7只债券型基金、6只混合型基金和1只指数型基金，另管理10只专户理财产品，管理资产总规模超过200亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雅洁	本基金的基金经理	2017年8月14日	-	8年	张雅洁女士，悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士，8年证券基金投资研究经验。2013年6月至2015年9月在博时基金从事固定收益研究和投资工作，曾担任博时上证企债30ETF等基金的基金经理助理，2010年2月至2013年5月在融通基金从事信用债研究工作。2015年9月加入前海联合基金。现任前海联合永兴纯债兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添鑫定开债券、前海联合添和纯债和前海联合添惠纯债的基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司对外的公告的解聘日期；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的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》等有关法律法规和本基金合同的规定，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。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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，未发现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

本基金在上半年配置了部分高收益的存款，并主要增配 1-3 年的政策性金融债。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2076 元，份额累计净值为 1.2076 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.98%，业绩比较基准收益率为 2.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面来看，经济增速的趋势下半年大概率将弱于 2 季度。即使最终的 GDP 数据不差，但实际经济体的周转活力尚未见质变，因而债市目前没有根本性的利空因素。在今天的监管环境下，狭义流动性的宽松难以传导到广义流动性，使得狭义流动性更多是淤积在银行间市场，压低了货币市场利率和短期债券收益率。从资金面来看，央行通过公开市场调节特殊时点流动性压力，货币政策由保持流动性“合理稳定”转向“合理充裕”。从供需结构来看，降准后的银行可用资金量较前期有所改善，只要财政不大幅发力利率债应该仍是最大的受益者；而风险偏好的回升所带来的信用债市场的回暖，仍需观察财政刺激力度以及后续信用扩张的恢复，比如能看到中高等级的发行放量逐步传导至中低等级的发行上来。

综上所述，在基本面无利空的大前提下，由资金面或债市供给因素而带来的短期收益率回升

都是逐步加仓的买入机会。目前策略为以静制动，等待债市调整时适度拉长久期。

#### 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。

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永兴纯债债券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，新疆前海联合永兴纯债债券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永兴纯债债券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，新疆前海联合永兴纯债债券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永兴纯债债券型证券投资基金 2018 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：新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	504,805,321.03	3,675,154.27
结算备付金		75,000.00	9,215.31
存出保证金		6,180.28	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,642,011,000.00	239,369,440.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,642,011,000.00	239,369,440.28
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	57,019,439.53	895,038,222.53
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	30,877,621.38	4,719,304.20
应收股利		-	-
应收申购款		0.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,234,794,563.21	1,142,811,336.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		311,999,172.00	138,599,672.10
应付证券清算款		4,000,000.00	2,958,430.68
应付赎回款		-	1.16
应付管理人报酬		485,777.66	59,929.21
应付托管费		161,925.88	19,976.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,766.94	2,575.43
应交税费		-	-

应付利息		119,918.87	266,042.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,177.14	6,433.55
负债合计		316,883,738.49	141,913,060.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,588,167,524.91	853,546,291.25
未分配利润	6.4.7.10	329,743,299.81	147,351,984.37
所有者权益合计		1,917,910,824.72	1,000,898,275.62
负债和所有者权益总计		2,234,794,563.21	1,142,811,336.59

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2076 元，基金份额总额 1,588,167,524.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		59,883,266.13
1.利息收入		43,104,425.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,809,430.09
债券利息收入		26,180,032.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,114,963.10
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,453.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	23,453.64
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,913,790.09
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	1,841,596.67
<b>减：二、费用</b>		9,245,109.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,528,739.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	842,913.19

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,998.98
5. 利息支出		5,748,650.51
其中：卖出回购金融资产支出		5,748,650.51
6. 税金及附加		
7. 其他费用	6.4.7.20	109,807.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>50,638,156.65</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>50,638,156.65</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	853,546,291.25	147,351,984.37	1,000,898,275.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,638,156.65	50,638,156.65
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）	734,621,233.66	131,753,158.79	866,374,392.45
其中：1.基金申购款	2,289,063,477.93	418,907,572.75	2,707,971,050.68
2.基金赎回款	-1,554,442,244.27	-287,154,413.96	-1,841,596,658.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,588,167,524.91	329,743,299.81	1,917,910,824.72

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：

                      
王晓耕

基金管理人负责人

                      
刘菲

主管会计工作负责人

                      
黄嘉宇

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2671号《关于准予新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,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《新疆前海联合永兴纯债债券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 201,156,751.74 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(2017)第 797 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 201,156,802.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 50.40 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具和货币市场工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票、以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2018 年 8 月 28 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》、《新疆前海联合泓鑫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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

## 6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,805,321.03
定期存款	500,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	200,000,000.00
其他存款	-
合计：	504,805,321.03

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	1,627,055,574.07	1,642,011,000.00	14,955,425.93
	合计	1,627,055,574.07	1,642,011,000.00	14,955,425.93
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,627,055,574.07	1,642,011,000.00	14,955,425.93

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	53,019,439.53	-
合计	57,019,439.53	-

##### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	3,055.79
应收定期存款利息	6,490,277.81
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	30.42
应收债券利息	24,336,031.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	48,223.30
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.52
合计	30,877,621.38

#### 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	17,766.94
合计	17,766.94

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	99,177.14
合计	99,177.14

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	853,546,291.25	853,546,291.25
本期申购	2,289,063,477.93	2,289,063,477.93
本期赎回(以“-”号填列)	-1,554,442,244.27	-1,554,442,244.27
本期末	1,588,167,524.91	1,588,167,524.91

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,520,595.73	2,831,388.64	147,351,984.37
本期利润	35,724,366.56	14,913,790.09	50,638,156.65
本期基金份额交易产生的变动数	128,523,877.21	3,229,281.58	131,753,158.79
其中：基金申购款	406,134,865.16	12,772,707.59	418,907,572.75
基金赎回款	-277,610,987.95	-9,543,426.01	-287,154,413.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	308,768,839.50	20,974,460.31	329,743,299.81

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	27,196.17
定期存款利息收入	10,579,486.15
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,216.58
其他	201,531.19
合计	10,809,430.09

**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**

无。

**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 2018年1月1日至2018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	23,453.64
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	23,453.64

**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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	726,964,488.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	713,701,237.75
减：应收利息总额	13,239,796.83
买卖债券差价收入	23,453.64

**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**

无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	14,913,790.09
——股票投资	-
——债券投资	14,913,790.09
——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	14,913,790.09

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	745,932.12
基金转换费收入	1,095,664.55
合计	1,841,596.67

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	698.98
银行间市场交易费用	14,300.00
合计	14,998.98

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	49,588.57
其他	300.00
汇划费	1,330.00
账户维护费	9,000.00
合计	109,807.14

## 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

截至本财务报告批准报出日，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、基金销售机构、登记机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	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。

## 6.4.10 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

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 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	2,528,739.66
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 X 管理费费率计提，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 0.30% / 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
----	----	---------

	2018年1月1日至2018年6月30日	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	842,913.19	-

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 X 托管费率计提，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 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

关联方名称	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行	4,805,321.03	27,196.17

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（2018 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**

无。

**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**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 311,999,172.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170205	17 国开 05	2018 年 7 月 6 日	99.81	1,000,000	99,810,000.00
170305	17 进出 05	2018 年 7 月 6 日	99.84	1,000,000	99,840,000.00
140202	14 国开 02	2018 年 7 月 6 日	101.09	1,200,000	121,308,000.00
合计				3,200,000	320,958,000.00

**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**

本基金为债券型证券投资基金，属于中等风险品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具和货币市场工具。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

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行浙商银行，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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2017 年 12 月 31 日：13.92%)。

#### 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。

2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 311,999,172.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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%(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该比例限制)，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%。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值占基金资产净值的比例为 0%。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值为 1,679,380,200.38 元，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此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 2018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	504,805,321.03				504,805,321.03
结算备付金	75,000.00				75,000.00
存出保证金	6,180.28				6,180.28
交易性金融资产	619,998,000.00	1,022,013,000.00			1,642,011,000.00
买入返售金融资产	57,019,439.53				57,019,439.53

应收利息	-	-	-	30,877,621.38	30,877,621.38
应收申购款	0.99	-	-	-	0.99
资产总计	1,181,903,941.83	1,022,013,000.00	-	30,877,621.38	2,234,794,563.21
负债					
卖出回购金融资产款	311,999,172.00	-	-	-	311,999,172.00
应付证券清算款	-	-	-	4,000,000.00	4,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	485,777.66	485,777.66
应付托管费	-	-	-	161,925.88	161,925.88
应付交易费用	-	-	-	17,766.94	17,766.94
应付利息	-	-	-	119,918.87	119,918.87
其他负债	-	-	-	99,177.14	99,177.14
负债总计	311,999,172.00	-	-	4,884,566.49	316,883,738.49
利率敏感度缺口	869,904,769.83	1,022,013,000.00	-	25,993,054.89	1,917,910,824.72
上年度末 2017 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	3,675,154.27	-	-	-	3,675,154.27
结算备付金	9,215.31	-	-	-	9,215.31
交易性金融资产	239,369,440.28	-	-	-	239,369,440.28
买入返售金融资产	362,018,222.53	-	-	-	362,018,222.53
应收利息	-	-	-	4,719,304.20	4,719,304.20
其他资产	-	-	-	533,020,000.00	533,020,000.00
资产总计	605,072,032.39	-	-	537,739,304.20	1,142,811,336.59
负债					
卖出回购金融资产款	138,599,672.10	-	-	-	138,599,672.10
应付证券清算款	-	-	-	2,958,430.68	2,958,430.68
应付赎回款	-	-	-	1.16	1.16
应付管理人报酬	-	-	-	59,929.21	59,929.21
应付托管费	-	-	-	19,976.39	19,976.39
应付交易费用	-	-	-	2,575.43	2,575.43
应付利息	-	-	-	266,042.45	266,042.45
其他负债	-	-	-	6,433.55	6,433.55
负债总计	138,599,672.10	-	-	3,313,388.87	141,913,060.97
利率敏感度缺口	466,472,360.29	-	-	534,425,915.33	1,000,898,275.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
	1. 市场利率下降25个基点	5,216,297.22	36,039.00
2. 市场利率上升25个基点	-5,185,306.49	-36,019.61	

**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。

于2018年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资（2017年12月31日：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017年12月31日：同）。

**6.4.14 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2018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二层次的余额为1,642,011,000.00元，无属于第一层次和第三层次的余额（于2017年12月31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二层次的余额为239,369,440.28元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

(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 2018 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（2017 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资		
3	固定收益投资	1,642,011,000.00	73.47
	其中：债券	1,642,011,000.00	73.47
	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	57,019,439.53	2.55
	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	504,880,321.03	22.59
8	其他各项资产	30,883,802.65	1.38
9	合计	2,234,794,563.21	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,642,011,000.00	85.61
	其中：政策性金融债	1,642,011,000.00	85.61
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	1,642,011,000.00	85.61

## 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	170205	17 国开 05	4,400,000	439,164,000.00	22.90
2	180202	18 国开 02	3,500,000	352,975,000.00	18.40
3	160208	16 国开 08	2,400,000	238,392,000.00	12.43
4	140202	14 国开 02	1,800,000	181,962,000.00	9.49
5	170305	17 进出 05	1,000,000	99,840,000.00	5.21

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。**

**7.11.2 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。**

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,180.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,877,621.38
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	30,883,802.65

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
197	8,061,764.09	1,588,144,294.13	100.00%	23,230.78	0.00%

### 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	16,406.54	0.0010%

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2017年8月14日）基金份额总额	201,156,802.14
本报告期期初基金份额总额	853,546,291.25
本报告期基金总申购份额	2,289,063,477.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,554,442,244.27
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	1,588,167,524.91

## § 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

本报告期内，本基金管理人于 2018 年 6 月 26 日发布公告，周明先生自 2018 年 6 月 25 日起担任公司总经理助理职务。

本报告期内，本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更换会计师事务所。

### 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	
华创证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	新增
国信证券	1	-	-	-	-	新增
海通证券	1	-	-	-	-	新增
兴业证券	1	-	-	-	-	新增

## 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
华创证券	40,362,717.95	100.00%	1,473,600,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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。

## 10.8 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	新疆前海联合基金管理有限公司 2017 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	2018 年 1 月 2 日
2	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 19 日
3	关于新疆前海联合基金管理有限公司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	2018 年 3 月 21 日

4	关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下 11 只基金修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 24 日
5	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 24 日
6	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同修改前后对照表	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 24 日
7	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金托管协议	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 24 日
8	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金招募说明书	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 24 日
9	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 30 日
10	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 30 日
11	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 4 月 13 日
12	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018 年第 1 号）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 4 月 13 日
13	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 4 月 23 日
14	关于新疆前海联合基金管理有限公司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	2018 年 6 月 12 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	20180101-20180107	170,705,872.31	253,144,580.22	208,905,518.41	214,944,934.12	13.53%
	2	20180101-20180201, 20180223-20180228	341,412,598.16	185,832,210.53	447,868,119.32	79,376,689.37	5.00%
	3	20180301-20180630	-	1,266,714,938.02	-	1,266,714,938.02	79.76%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告，李华先生自 2018 年 7 月 21 日起离任公司督察长职务，由总经理王晓耕女士代为履行督察长职务，且代为履行职务期限自 2018 年 7 月 21 日起不超过 90 日。

## § 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永兴纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金合同》；
- 3、《新疆前海联合永兴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，其他备查文件等文本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

2018 年 8 月 28 日