

新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资 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：中国工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。

基金托管人中国工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

§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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	12
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金
基金简称	前海联合沪深 300
基金主代码	003475
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 30 日
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,864,683.32 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下，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 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 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	王晓耕	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105798
	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	010-66105799
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省深圳市福田区华富	北京市西城区复兴门内大街 55

	路 1018 号中航中心 26 楼	号
邮政编码	518031	100140
法定代表人	王晓耕	易会满

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、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	-172,923.07
本期利润	-7,309,128.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1437
本期加权平均净值利润率	-12.41%
本期基金份额净值增长率	-12.16%
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	941,565.24
期末可供分配基金份额利润	0.0185
期末基金资产净值	52,911,873.99
期末基金份额净值	1.0402
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	4.02%

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

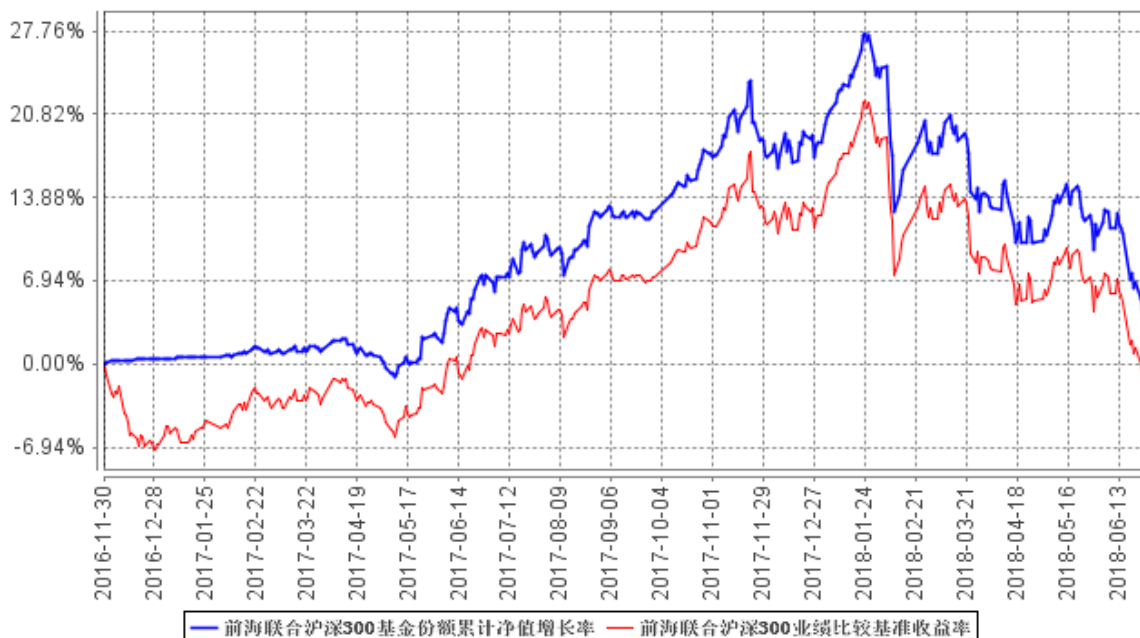
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.83%	1.22%	-7.27%	1.22%	0.44%	0.00%
过去三个月	-8.93%	1.07%	-9.43%	1.08%	0.50%	-0.01%
过去六个月	-12.16%	1.09%	-12.24%	1.10%	0.08%	-0.01%
过去一年	-3.03%	0.90%	-3.96%	0.90%	0.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.02%	0.74%	-1.31%	0.80%	5.33%	-0.06%

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

前海联合沪深300基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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		
王静	本基金的 基金经理	2017 年 3 月 20 日	-	9 年	王静女士，金融学硕士，CFA，9 年证券投资研究经验。2009 年 7 月至 2016 年 4 月任职于民生加银基金，先后从事钢铁、化工、交运、纺织服装、农业等行业研究。2016 年 5 月加入前海联合基金，现任前海联合沪深 300 兼前海联合泳涛混合、前海联合泳隆混合和前海联合泳隼混合的基金经理。
林材	本基金的 基金经理	2016 年 11 月 30 日	-	10 年	林材先生，药学硕士，10 年证券基金投资研究经验。2011 年 10 月至 2015 年 7 月任金元顺安基金经理，2008 年 11 月至 2011 年 10 月任民生加银基金医药行业研

					究员、基金经理助理。2000 年 7 月至 2003 年 9 月曾任职于广州医药集团。2015 年 9 月加入前海联合基金，现任前海联合沪深 300 兼前海联合泓鑫混合、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。
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

报告期内沪深 300 指数下跌 12.9%，创 2016 年熔断以来的半年度最大跌幅。本基金紧密跟踪标的指数，力争实现中长期投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0402 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.16%，业绩比较基准收益率为-12.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为宏观经济整体上呈现回落态势，分化加剧。增长贡献最大的消费下半年有一定压力，主要是房贷挤出效应、贫富分化加剧、棚改政策调整等，中长期随着人均可支配收入提升空间仍大。投资呈现稳态，基建投资增速边际回升，制造业稳中有升，地产投资增速呈现回落态势。出口受贸易战影响呈现回落状态。汇总预计 2018 年实际 GDP 在 6.5-6.6%。

利率方面，从资金供需来看，随着经济增速回落和实体去杠杆，资金需求下降，同时资金供给增速也在下来，供需两弱。但由于中美利差持续下降，人民币贬值压力增大，汇改之后的关联度在增强，也制约利率回落的幅度。整体判断十年期国债维持在 3.3-3.6%。

风险溢价方面，影响风险偏好的主要因素，贸易战需做好长期作战准备，接受发达国家游戏规则，但仍是次要矛盾，主要矛盾仍在于切实推进供给侧结构性改革，释放红利。去杠杆暂呈稳态，加快培育新兴产业发展动能，财政政策更加发力，国企改革和减税方面是改革深入推进的验金石。唯有这样，短期阵痛，才能换来长期估值空间的打开。

总之，盈利温和回落中分化，利率回落但幅度有限，风险溢价短期提升但如若改革进展顺利中长期溢价有望下降。2018-2019 年整体股市震荡，结构呈现分化。而 2020 年后经济有望进入低速高效阶段，利率回归低位后，长期风险溢价下降，或迎来中长慢牛。

回落中有分化机会，我们看好受益制造业投资分化的先进制造、受益经济转型升级的科技先锋、受益龙头市占率提升的低估值蓝筹、受益消费下沉的美好生活，其中蕴含着可观的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管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 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：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,641,124.81	987,998.43
结算备付金		-	-
存出保证金		538.67	1,311.66
交易性金融资产	6.4.7.2	49,455,662.76	59,548,157.07
其中：股票投资		49,455,662.76	57,051,657.07
基金投资		-	-
债券投资		-	2,496,500.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	642.33	62,271.72
应收股利		-	-
应收申购款		2,608.87	1,350.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,100,577.44	60,601,088.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	-
应付赎回款		17,280.33	8,093.38
应付管理人报酬		29,676.44	33,094.13
应付托管费		6,848.41	7,637.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,491.79	7,200.84
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	129,406.48	210,030.49
负债合计		188,703.45	266,055.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	50,864,683.32	50,949,752.16
未分配利润	6.4.7.10	2,047,190.67	9,385,280.80
所有者权益合计		52,911,873.99	60,335,032.96
负债和所有者权益总计		53,100,577.44	60,601,088.90

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，前海联合沪深 300 基金份额净值 1.0402 元，基金份额总额 50,864,683.32 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：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	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-6,885,707.45	3,842,962.29
1.利息收入		18,775.02	415,893.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,348.99	207,564.79
债券利息收入		7,426.03	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）		230,725.29	371,543.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-354,013.54	-12,901.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,750.00	-
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	575,988.83	384,445.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,136,204.97	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）	6.4.7.18	997.21	179.16
减：二、费用		423,420.59	448,175.71

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	189,535.64	162,576.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,738.93	37,517.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,704.67	68,335.27
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	179,441.35	179,745.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,309,128.04	3,394,786.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,309,128.04	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：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）	50,949,752.16	9,385,280.80	60,335,032.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,309,128.04	-7,309,128.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-85,068.84	-28,962.09	-114,030.93
其中：1.基金申购款	643,603.10	108,638.90	752,242.00
2.基金赎回款	-728,671.94	-137,600.99	-866,272.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	50,864,683.32	2,047,190.67	52,911,873.99
项目	上年度可比期间 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：

_____ 王晓耕	_____ 刘菲	_____ 黄嘉宇
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“中国证监会”)证监许可[2016]1861 号《关于准予新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金注册的批复》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《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,202,657.90 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1557 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,202,690.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 32.81 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金

合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2018 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得

税。

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

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

6.4.7 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	3,641,124.81
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：	3,641,124.81

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	48,522,159.66	49,455,662.76	933,503.10
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	48,522,159.66	49,455,662.76	933,503.10

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	642.15
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	-
应收债券利息	-
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	0.18
合计	642.33

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	5,491.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,491.79

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	65.13
预提费用	79,341.35
应付指数使用费	50,000.00
合计	129,406.48

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	50,949,752.16	50,949,752.16
本期申购	643,603.10	643,603.10
本期赎回(以“-”号填列)	-728,671.94	-728,671.94
本期末	50,864,683.32	50,864,683.32

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	1,116,320.82	8,268,959.98	9,385,280.80
本期利润	-172,923.07	-7,136,204.97	-7,309,128.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,832.51	-27,129.58	-28,962.09
其中：基金申购款	12,608.31	96,030.59	108,638.90
基金赎回款	-14,440.82	-123,160.17	-137,600.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	941,565.24	1,105,625.43	2,047,190.67

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
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	58.48
其他	12.42
合计	11,348.99

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	3,558,410.60
减：卖出股票成本总额	3,912,424.14
买卖股票差价收入	-354,013.54

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	8,750.00
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	8,750.00

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	2,569,500.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,491,250.00
减：应收利息总额	69,500.00
买卖债券差价收入	8,750.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	575,988.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	575,988.83

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	-7,136,204.97
——股票投资	-7,130,954.97
——债券投资	-5,250.00
——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	-7,136,204.97

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	964.83
基金转换费收入	32.38
合计	997.21

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	10,704.67

银行间市场交易费用	-
合计	10,704.67

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	29,752.78
信息披露费	49,588.57
汇划费	100.00
指数使用费	100,000.00
合计	179,441.35

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、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	189,535.64	162,576.88
其中：支付销售机构的客户维护费	997.55	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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	43,738.93	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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
深圳市宝能利 通资产管理有 限公司	49,311,100.00	96.9500%	49,311,100.00	96.7800%

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,641,124.81	11,278.09	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。

6.4.10.6 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

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
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组	7.47	-	-	26,600	242,269.43	198,702.00	-
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大资产重组	17.08	-	-	10,300	194,958.05	175,924.00	-
600221	海航控股	2018 年 1 月 11 日	重大事项	3.23	2018 年 7 月 20 日	2.91	54,300	178,081.43	175,389.00	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大资产重组	19.52	-	-	6,979	142,206.71	136,230.08	-
002739	万达院线	2017 年 7 月 4 日	重大资产重组	52.04	-	-	2,400	132,001.00	124,896.00	-
601727	上海电气	2018 年 6 月 7 日	重大事项	6.34	-	-	16,600	117,960.79	105,244.00	-
000540	中天城投	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组	4.87	-	-	20,400	88,843.59	99,348.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	18.38	4,150	153,300.88	96,612.00	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大资产重组	15.03	-	-	6,400	113,407.00	96,192.00	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大资产重组	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.19	8,800	60,581.96	51,392.00	-
601118	海南橡胶	2018 年 5 月 25 日	重大资产重组	6.62	-	-	7,400	47,502.58	48,988.00	-
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大资产重组	32.50	-	-	1,400	50,876.00	45,500.00	-
002411	必康股份	2018 年 6 月 19 日	重大事项	28.34	-	-	1,500	42,075.00	42,510.00	-
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项	4.96	-	-	8,100	63,784.00	40,176.00	-
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	5.43	-	-	5,800	41,270.00	31,494.00	-

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。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进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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。本基金的活期银行

存款存放在本基金的托管行，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2017 年 12 月 31 日：同）。

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在开放期可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 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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

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 1.44%。

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 53,099,396.44 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方案: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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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	3,641,124.81	-	-	-	3,641,124.81
存出保证金	538.67	-	-	-	538.67
交易性金融资产	-	-	-	49,455,662.76	49,455,662.76
应收利息	-	-	-	642.33	642.33
应收申购款	-	-	-	2,608.87	2,608.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,641,663.48	-	-	49,458,913.96	53,100,577.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,280.33	17,280.33
应付管理人报酬	-	-	-	29,676.44	29,676.44
应付托管费	-	-	-	6,848.41	6,848.41
应付交易费用	-	-	-	5,491.79	5,491.79
其他负债	-	-	-	129,406.48	129,406.48
负债总计	-	-	-	188,703.45	188,703.45
利率敏感度缺口	3,641,663.48	-	-	49,270,210.51	52,911,873.99
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	987,998.43	-	-	-	987,998.43
存出保证金	1,311.66	-	-	-	1,311.66
交易性金融资产	2,496,500.00	-	-	57,051,657.07	59,548,157.07
应收利息	-	-	-	62,271.72	62,271.72
应收申购款	-	-	-	1,350.02	1,350.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,485,810.09	-	-	57,115,278.81	60,601,088.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,093.38	8,093.38
应付管理人报酬	-	-	-	33,094.13	33,094.13
应付托管费	-	-	-	7,637.10	7,637.10
应付交易费用	-	-	-	7,200.84	7,200.84
其他负债	-	-	-	210,030.49	210,030.49

负债总计	-	-	-	266,055.94	266,055.94
利率敏感度缺口	3,485,810.09	-	-	56,849,222.87	60,335,032.96

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

于 2018 年 6 月 30 日本基金未持有交易性债券投资 (2017 年 12 月 31 日：4.14%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况 (如流动性原因) 导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	49,455,662.76	93.47	57,051,657.07	94.56

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	49,455,662.76	93.47	57,051,657.07	94.56

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5	2,384,019.65	2,925,003.31
2. 沪深 300 指数下降 5	-2,384,019.65	-2,925,003.31	

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一层次的余额为 47,987,065.68 元；属于第二层次的余额为 1,468,597.08 元，无属于第三层次的余额（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一层次的余额为 55,809,245.67 元；属于第二层次的余额为 3,709,977.40 元，属于第三层次的余额为 28,934.00 元）。

(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	49,455,662.76	93.14
	其中：股票	49,455,662.76	93.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,641,124.81	6.86
8	其他各项资产	3,789.87	0.01
9	合计	53,100,577.44	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	71,136.00	0.13
B	采矿业	1,538,992.00	2.91
C	制造业	21,138,514.06	39.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,267,403.00	2.40
E	建筑业	1,700,213.84	3.21
F	批发和零售业	960,203.50	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,471,969.00	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,855,001.48	3.51
J	金融业	15,227,540.68	28.78
K	房地产业	2,275,768.00	4.30
L	租赁和商务服务业	732,074.36	1.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	180,844.84	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	270,896.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	384,132.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	49,074,688.76	92.75

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	48,988.00	0.09
B	采掘业	-	-
C	制造业	330,688.00	0.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,298.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	380,974.00	0.72

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	601318	中国平安	48,200	2,823,556.00	5.34

2	000333	美的集团	39,800	2,078,356.00	3.93
3	600519	贵州茅台	2,400	1,755,504.00	3.32
4	600036	招商银行	46,600	1,232,104.00	2.33
5	001979	招商蛇口	47,400	902,970.00	1.71
6	601166	兴业银行	56,300	810,720.00	1.53
7	600887	伊利股份	28,400	792,360.00	1.50
8	600276	恒瑞医药	10,178	771,085.28	1.46
9	600016	民生银行	107,800	754,600.00	1.43
10	601328	交通银行	124,500	714,630.00	1.35
11	000858	五粮液	8,900	676,400.00	1.28
12	002415	海康威视	17,050	633,066.50	1.20
13	601288	农业银行	173,500	596,840.00	1.13
14	600030	中信证券	36,000	596,520.00	1.13
15	600104	上汽集团	16,100	563,339.00	1.06
16	601668	中国建筑	95,620	522,085.20	0.99
17	601398	工商银行	98,100	521,892.00	0.99
18	600000	浦发银行	53,900	515,284.00	0.97
19	600900	长江电力	29,300	472,902.00	0.89
20	601601	中国太保	13,800	439,530.00	0.83
21	601169	北京银行	67,900	409,437.00	0.77
22	000725	京东方 A	108,600	384,444.00	0.73
23	600048	保利地产	31,100	379,420.00	0.72
24	002304	洋河股份	2,800	368,480.00	0.70
25	000001	平安银行	38,800	352,692.00	0.67
26	600837	海通证券	37,100	351,337.00	0.66
27	600309	万华化学	7,660	347,917.20	0.66
28	601988	中国银行	96,300	347,643.00	0.66
29	600690	青岛海尔	16,800	323,568.00	0.61
30	600019	宝钢股份	41,400	322,506.00	0.61
31	002027	分众传媒	33,648	322,011.36	0.61
32	600585	海螺水泥	9,300	311,364.00	0.59
33	600518	康美药业	13,600	311,168.00	0.59
34	600028	中国石化	47,000	305,030.00	0.58
35	601888	中国国旅	4,400	283,404.00	0.54
36	000063	中兴通讯	21,600	281,448.00	0.53
37	000538	云南白药	2,500	267,400.00	0.51
38	601818	光大银行	72,500	265,350.00	0.50
39	601229	上海银行	16,560	260,985.60	0.49
40	601766	中国中车	33,800	260,260.00	0.49

41	601211	国泰君安	17,200	253,528.00	0.48
42	603288	海天味业	3,400	250,376.00	0.47
43	600009	上海机场	4,400	244,112.00	0.46
44	002024	苏宁云商	16,900	237,952.00	0.45
45	601939	建设银行	34,900	228,595.00	0.43
46	601857	中国石油	29,500	227,445.00	0.43
47	601688	华泰证券	15,000	224,550.00	0.42
48	600703	三安光电	11,500	221,030.00	0.42
49	601006	大秦铁路	26,900	220,849.00	0.42
50	600015	华夏银行	29,360	218,732.00	0.41
51	002230	科大讯飞	6,800	218,076.00	0.41
52	600050	中国联通	44,000	216,480.00	0.41
53	300059	东方财富	16,276	214,517.68	0.41
54	002008	大族激光	4,000	212,760.00	0.40
55	601009	南京银行	26,940	208,246.20	0.39
56	000568	泸州老窖	3,400	206,924.00	0.39
57	600919	江苏银行	31,900	204,479.00	0.39
58	002475	立讯精密	8,950	201,733.00	0.38
59	002594	比亚迪	4,200	200,256.00	0.38
60	601390	中国中铁	26,600	198,702.00	0.38
61	600196	复星医药	4,700	194,533.00	0.37
62	000338	潍柴动力	22,100	193,375.00	0.37
63	600031	三一重工	21,100	189,267.00	0.36
64	002236	大华股份	8,300	187,165.00	0.35
65	002142	宁波银行	11,480	187,009.20	0.35
66	300003	乐普医疗	5,000	183,400.00	0.35
67	601186	中国铁建	21,100	181,882.00	0.34
68	601088	中国神华	9,100	181,454.00	0.34
69	000776	广发证券	13,600	180,472.00	0.34
70	002450	康得新	10,300	175,924.00	0.33
71	600221	海航控股	54,300	175,389.00	0.33
72	600741	华域汽车	7,300	173,156.00	0.33
73	601899	紫金矿业	47,600	171,836.00	0.32
74	601989	中国重工	42,500	171,700.00	0.32
75	601628	中国人寿	7,500	168,900.00	0.32
76	000963	华东医药	3,450	166,462.50	0.31
77	600660	福耀玻璃	6,300	161,973.00	0.31
78	601336	新华保险	3,700	158,656.00	0.30
79	600436	片仔癀	1,400	156,702.00	0.30

80	603799	华友钴业	1,600	155,952.00	0.29
81	601012	隆基股份	9,300	155,217.00	0.29
82	002466	天齐锂业	3,100	153,729.00	0.29
83	600958	东方证券	16,400	149,732.00	0.28
84	300124	汇川技术	4,500	147,690.00	0.28
85	601225	陕西煤业	17,800	146,316.00	0.28
86	600867	通化东宝	6,100	146,217.00	0.28
87	002456	欧菲光	9,000	145,170.00	0.27
88	600999	招商证券	10,600	145,008.00	0.27
89	000100	TCL 集团	49,300	142,970.00	0.27
90	002460	赣锋锂业	3,700	142,746.00	0.27
91	300015	爱尔眼科	4,400	142,076.00	0.27
92	600352	浙江龙盛	11,800	141,010.00	0.27
93	600795	国电电力	53,500	140,170.00	0.26
94	600340	华夏幸福	5,400	139,050.00	0.26
95	002252	上海莱士	6,979	136,230.08	0.26
96	000166	申万宏源	31,100	135,907.00	0.26
97	601933	永辉超市	17,600	134,464.00	0.25
98	600487	亨通光电	6,020	132,741.00	0.25
99	600406	国电南瑞	8,400	132,720.00	0.25
100	600886	国投电力	18,200	132,314.00	0.25
101	600029	南方航空	15,600	131,820.00	0.25
102	600271	航天信息	5,200	131,404.00	0.25
103	601607	上海医药	5,400	129,060.00	0.24
104	002044	美年健康	5,700	128,820.00	0.24
105	601155	新城控股	4,100	126,977.00	0.24
106	601901	方正证券	18,700	125,103.00	0.24
107	002739	万达院线	2,400	124,896.00	0.24
108	000895	双汇发展	4,700	124,127.00	0.23
109	600011	华能国际	19,400	123,384.00	0.23
110	300070	碧水源	8,800	122,584.00	0.23
111	600570	恒生电子	2,300	121,785.00	0.23
112	600066	宇通客车	6,300	120,897.00	0.23
113	601985	中国核电	21,300	120,345.00	0.23
114	002202	金风科技	9,410	118,942.40	0.22
115	601111	中国国航	13,300	118,237.00	0.22
116	600115	东方航空	17,800	117,836.00	0.22
117	600516	方大炭素	4,800	117,024.00	0.22
118	300136	信维通信	3,800	116,774.00	0.22

119	600089	特变电工	16,800	116,424.00	0.22
120	601600	中国铝业	30,300	116,352.00	0.22
121	600588	用友网络	4,650	113,971.50	0.22
122	601669	中国电建	21,200	113,632.00	0.21
123	000423	东阿阿胶	2,100	113,001.00	0.21
124	601377	兴业证券	21,100	111,197.00	0.21
125	600535	天士力	4,280	110,509.60	0.21
126	300408	三环集团	4,700	110,450.00	0.21
127	600111	北方稀土	9,700	110,386.00	0.21
128	600606	绿地控股	16,400	107,256.00	0.20
129	600398	海澜之家	8,400	107,016.00	0.20
130	000413	东旭光电	17,400	105,444.00	0.20
131	601727	上海电气	16,600	105,244.00	0.20
132	600383	金地集团	10,300	104,957.00	0.20
133	000503	海虹控股	3,300	104,874.00	0.20
134	000768	中航飞机	6,600	103,224.00	0.20
135	002736	国信证券	11,300	102,830.00	0.19
136	600332	白云山	2,700	102,735.00	0.19
137	300122	智飞生物	2,200	100,628.00	0.19
138	600522	中天科技	11,300	99,553.00	0.19
139	000540	中天城投	20,400	99,348.00	0.19
140	601788	光大证券	9,000	98,820.00	0.19
141	600176	中国巨石	9,600	98,208.00	0.19
142	000783	长江证券	18,000	97,740.00	0.18
143	300072	三聚环保	4,150	96,612.00	0.18
144	600010	包钢股份	62,260	96,503.00	0.18
145	600705	中航资本	20,600	96,202.00	0.18
146	002310	东方园林	6,400	96,192.00	0.18
147	600637	东方明珠	6,300	94,878.00	0.18
148	600893	航发动力	4,200	93,744.00	0.18
149	002572	索菲亚	2,900	93,322.00	0.18
150	002241	歌尔股份	9,100	92,729.00	0.18
151	600068	葛洲坝	12,800	92,288.00	0.17
152	600085	同仁堂	2,600	91,728.00	0.17
153	300024	机器人	5,100	88,740.00	0.17
154	600177	雅戈尔	11,500	88,550.00	0.17
155	601877	正泰电器	3,900	87,048.00	0.16
156	002007	华兰生物	2,700	86,832.00	0.16
157	600023	浙能电力	18,600	86,676.00	0.16

158	601919	中远海控	17,600	86,592.00	0.16
159	600739	辽宁成大	5,700	86,526.00	0.16
160	600674	川投能源	9,900	86,328.00	0.16
161	601998	中信银行	13,900	86,319.00	0.16
162	000157	中联重科	20,500	84,255.00	0.16
163	600018	上港集团	13,800	82,248.00	0.16
164	601198	东兴证券	6,300	82,152.00	0.16
165	601618	中国中冶	24,600	81,918.00	0.15
166	600804	鹏博士	6,800	81,600.00	0.15
167	600547	山东黄金	3,400	81,328.00	0.15
168	000425	徐工机械	19,100	80,984.00	0.15
169	000625	长安汽车	8,900	80,100.00	0.15
170	300144	宋城演艺	3,400	79,900.00	0.15
171	601800	中国交建	7,000	79,730.00	0.15
172	002493	荣盛石化	7,700	79,464.00	0.15
173	601997	贵阳银行	6,300	77,868.00	0.15
174	000623	吉林敖东	4,250	76,415.00	0.14
175	601018	宁波港	18,100	76,201.00	0.14
176	600362	江西铜业	4,800	76,080.00	0.14
177	601555	东吴证券	11,100	75,813.00	0.14
178	002065	东华软件	8,800	75,680.00	0.14
179	600208	新湖中宝	19,800	75,636.00	0.14
180	002081	金螳螂	7,400	74,740.00	0.14
181	600926	杭州银行	6,700	74,303.00	0.14
182	000786	北新建材	4,000	74,120.00	0.14
183	601099	太平洋	31,400	73,476.00	0.14
184	300017	网宿科技	6,790	72,720.90	0.14
185	002050	三花股份	3,800	71,630.00	0.14
186	600482	中国动力	4,100	71,545.00	0.14
187	002714	牧原股份	1,600	71,136.00	0.13
188	600100	同方股份	8,100	71,118.00	0.13
189	600816	安信信托	9,792	70,894.08	0.13
190	002294	信立泰	1,900	70,623.00	0.13
191	000728	国元证券	9,450	69,930.00	0.13
192	600109	国金证券	9,800	69,678.00	0.13
193	600809	山西汾酒	1,100	69,179.00	0.13
194	600219	南山铝业	25,400	68,834.00	0.13
195	002146	荣盛发展	7,800	68,094.00	0.13
196	000792	盐湖股份	6,250	67,625.00	0.13

197	002508	老板电器	2,200	67,364.00	0.13
198	601333	广深铁路	15,700	66,725.00	0.13
199	603993	洛阳钼业	10,600	66,674.00	0.13
200	002558	世纪游轮	2,780	66,108.40	0.12
201	600297	广汇汽车	11,200	65,632.00	0.12
202	002797	第一创业	9,680	65,533.60	0.12
203	600498	烽火通信	2,600	64,610.00	0.12
204	600170	上海建工	21,116	64,192.64	0.12
205	603858	步长制药	1,500	64,185.00	0.12
206	603833	欧派家居	500	63,765.00	0.12
207	000630	铜陵有色	28,800	63,648.00	0.12
208	600438	通威股份	9,000	62,100.00	0.12
209	002673	西部证券	8,200	61,910.00	0.12
210	000876	新希望	9,700	61,498.00	0.12
211	601117	中国化学	9,000	60,570.00	0.11
212	000839	中信国安	12,700	60,071.00	0.11
213	600153	建发股份	6,600	59,334.00	0.11
214	002624	完美世界	1,900	58,919.00	0.11
215	000826	启迪桑德	3,333	58,260.84	0.11
216	002085	万丰奥威	6,100	57,340.00	0.11
217	600549	厦门钨业	3,770	57,228.60	0.11
218	000709	河钢股份	19,300	56,935.00	0.11
219	600977	中国电影	3,500	56,140.00	0.11
220	000060	中金岭南	11,500	55,890.00	0.11
221	601633	长城汽车	5,600	54,992.00	0.10
222	601360	三六零	1,900	54,910.00	0.10
223	600489	中金黄金	8,000	54,560.00	0.10
224	000983	西山煤电	7,200	54,072.00	0.10
225	002352	鼎泰新材	1,200	54,000.00	0.10
226	600415	小商品城	12,500	53,875.00	0.10
227	600663	陆家嘴	3,400	53,686.00	0.10
228	000961	中南建设	8,500	53,635.00	0.10
229	601216	君正集团	15,900	53,583.00	0.10
230	600118	中国卫星	2,800	53,480.00	0.10
231	600583	海油工程	10,100	53,126.00	0.10
232	002500	山西证券	7,800	52,572.00	0.10
233	600157	永泰能源	29,500	52,510.00	0.10
234	600188	兖州煤业	4,000	52,160.00	0.10
235	600038	中直股份	1,300	51,987.00	0.10

236	600820	隧道股份	8,700	51,417.00	0.10
237	000415	渤海金控	8,800	51,392.00	0.10
238	600369	西南证券	13,200	50,820.00	0.10
239	601992	金隅集团	15,400	50,512.00	0.10
240	300433	蓝思科技	2,400	50,352.00	0.10
241	002470	金正大	7,300	50,224.00	0.09
242	601228	广州港	8,600	49,966.00	0.09
243	600346	恒力股份	3,400	49,844.00	0.09
244	002074	国轩高科	3,490	49,069.40	0.09
245	002555	三七互娱	4,000	48,600.00	0.09
246	300027	华谊兄弟	7,800	48,048.00	0.09
247	000898	鞍钢股份	8,600	47,902.00	0.09
248	000627	天茂集团	6,800	47,736.00	0.09
249	601881	中国银河	5,800	47,154.00	0.09
250	600909	华安证券	8,200	46,904.00	0.09
251	600008	首创股份	11,000	46,420.00	0.09
252	601021	春秋航空	1,300	45,539.00	0.09
253	002602	世纪华通	1,400	45,500.00	0.09
254	000671	阳光城	7,500	44,775.00	0.08
255	000402	金融街	5,500	44,275.00	0.08
256	000938	紫光股份	700	43,820.00	0.08
257	000559	万向钱潮	6,400	43,520.00	0.08
258	002153	石基信息	1,500	43,500.00	0.08
259	002411	必康股份	1,500	42,510.00	0.08
260	300251	光线传媒	4,100	41,738.00	0.08
261	600704	物产中大	7,900	41,317.00	0.08
262	600376	首开股份	5,800	40,774.00	0.08
263	002385	大北农	9,800	40,474.00	0.08
264	601898	中煤能源	8,300	40,089.00	0.08
265	600682	南京新百	2,400	39,456.00	0.07
266	300033	同花顺	1,000	38,870.00	0.07
267	600688	上海石化	6,700	38,123.00	0.07
268	002601	佰利联	2,900	37,497.00	0.07
269	600959	江苏有线	7,200	36,720.00	0.07
270	600061	国投资本	3,900	36,192.00	0.07
271	601866	中远海发	14,500	36,105.00	0.07
272	600339	中油工程	7,600	34,124.00	0.06
273	601991	大唐发电	11,200	33,936.00	0.06
274	600373	中文传媒	2,600	33,410.00	0.06

275	600372	中航电子	2,500	32,650.00	0.06
276	601238	广汽集团	2,900	32,306.00	0.06
277	601718	际华集团	8,000	32,160.00	0.06
278	000723	美锦能源	5,800	31,494.00	0.06
279	000959	首钢股份	7,200	29,592.00	0.06
280	601611	中国核建	3,700	29,230.00	0.06
281	601958	金钼股份	4,400	27,588.00	0.05
282	603160	汇顶科技	400	25,956.00	0.05
283	600025	华能水电	8,200	24,928.00	0.05
284	601808	中海油服	2,600	24,804.00	0.05
285	002468	艾迪西	1,400	24,010.00	0.05
286	002625	龙生股份	1,900	22,249.00	0.04
287	002925	盈趣科技	400	22,152.00	0.04
288	601828	美凯龙	1,400	21,392.00	0.04
289	603260	合盛硅业	300	21,171.00	0.04
290	600233	圆通速递	1,600	21,120.00	0.04
291	001965	招商公路	2,500	20,350.00	0.04
292	601108	财通证券	1,800	20,304.00	0.04
293	600390	五矿资本	2,400	18,600.00	0.04
294	002608	*ST 舜船	2,500	17,250.00	0.03
295	601212	白银有色	3,800	15,542.00	0.03
296	601838	成都银行	1,700	14,875.00	0.03
297	601878	浙商证券	1,700	14,280.00	0.03

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	002327	富安娜	26,800	290,512.00	0.55
2	601118	海南橡胶	7,400	48,988.00	0.09
3	000008	神州高铁	8,100	40,176.00	0.08
4	300085	银之杰	100	1,298.00	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	000063	中兴通讯	290,800.00	0.48

2	603288	海天味业	266,503.00	0.44
3	601229	上海银行	196,617.00	0.33
4	600867	通化东宝	151,002.80	0.25
5	600487	亨通光电	146,742.00	0.24
6	600516	方大炭素	131,010.00	0.22
7	600176	中国巨石	115,392.00	0.19
8	300408	三环集团	114,217.00	0.19
9	600398	海澜之家	107,188.00	0.18
10	000786	北新建材	88,726.00	0.15
11	002493	荣盛石化	81,096.00	0.13
12	600809	山西汾酒	72,596.00	0.12
13	002050	三花股份	69,713.00	0.12
14	002085	万丰奥威	65,013.00	0.11
15	600438	通威股份	64,770.00	0.11
16	601360	三六零	64,574.00	0.11
17	002027	分众传媒	61,495.00	0.10
18	603858	步长制药	58,896.00	0.10
19	300433	蓝思科技	57,280.00	0.09
20	603833	欧派家居	56,824.00	0.09

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	002327	富安娜	773,600.00	1.28
2	601318	中国平安	193,872.00	0.32
3	600048	保利地产	186,821.00	0.31
4	600036	招商银行	69,252.00	0.11
5	002465	海格通信	67,314.00	0.11
6	601166	兴业银行	54,184.00	0.09
7	000750	国海证券	53,721.00	0.09
8	600895	张江高科	48,222.00	0.08
9	300315	掌趣科技	47,528.00	0.08
10	000686	东北证券	46,498.00	0.08
11	600827	百联股份	44,343.00	0.07
12	601328	交通银行	42,202.00	0.07

13	002174	游族网络	41,840.00	0.07
14	600649	城投控股	41,602.00	0.07
15	601601	中国太保	39,291.00	0.07
16	600016	民生银行	38,588.00	0.06
17	600900	长江电力	38,543.00	0.06
18	002426	胜利精密	38,024.00	0.06
19	600030	中信证券	37,320.00	0.06
20	601966	玲珑轮胎	36,309.00	0.06

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	3,447,384.80
卖出股票收入（成交）总额	3,558,410.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	538.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	642.33
5	应收申购款	2,608.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,789.87

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	601118	海南橡胶	48,988.00	0.09	重大资产重组
2	000008	神州高铁	40,176.00	0.08	重大事项

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
356	142,878.32	49,311,100.00	96.95%	1,553,583.32	3.05%

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	679,999.64	1.3369%

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	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（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	50,949,752.16
本报告期基金总申购份额	643,603.10
减：本报告期基金总赎回份额	728,671.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	50,864,683.32

§ 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	
广发证券	1	4,333,419.00	61.85%	4,035.86	61.86%	-
安信证券	1	2,672,376.40	38.15%	2,488.74	38.14%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

（2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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	证监会指定信息披露	2018 年 1 月 2 日

	2017 年 12 月 31 日基金净值公告	露报纸、公司网站	
2	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书更新（2017 年第 2 号）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 12 日
3	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书更新摘要（2017 年第 2 号）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 12 日
4	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 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
5	新疆前海联合基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 31 日
6	新疆前海联合基金管理有限公司关于旗下部分基金参与大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 2 月 6 日
7	新疆前海联合基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 2 月 12 日
8	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
9	新疆前海联合沪深 300 指数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
10	新疆前海联合沪深 300 指数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
11	新疆前海联合沪深 300 指数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
12	新疆前海联合沪深 300 指数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
13	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 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
14	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 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
15	新疆前海联合基金管理有限公司新增代理销售机构以及参加代理销售机构费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 30 日
16	新疆前海联合基金管理有限公司关于新增代理销售机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 3 月 30 日
17	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 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

§ 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	20180101-20180630	49,311,100.00	-	-	49,311,100.00	96.95%
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

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沪深 300 指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金合同》；
- 3、《新疆前海联合沪深 300 指数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

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

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