

# 新疆前海联合泳隼灵活配置 混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)起至 2018 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 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.....	51

8.9 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.....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
8.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
9.3 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.....	56
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	58
11.2 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.....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.8 其他重大事件.....	60
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
12.1 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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	前海联合泳隼混合
基金主代码	004693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 29 日
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	493,965,737.66 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱张斌	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	0571-8868688
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qh1hfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-136,509,778.97
本期利润	-136,503,617.62
加权平均基金份额本期利润	-0.2741
本期加权平均净值利润率	-31.75%
本期基金份额净值增长率	-27.41%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配利润	-135,371,567.25
期末可供分配基金份额利润	-0.2741
期末基金资产净值	358,594,170.41
期末基金份额净值	0.7259
3.1.3 累计期末指标	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-27.41%

注：1 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金的基金合同于 2018 年 1 月 29 日生效，截至 2018 年 12 月 31 日成立不满 1 年，故 2018 年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

#### 3.2 基金净值表现

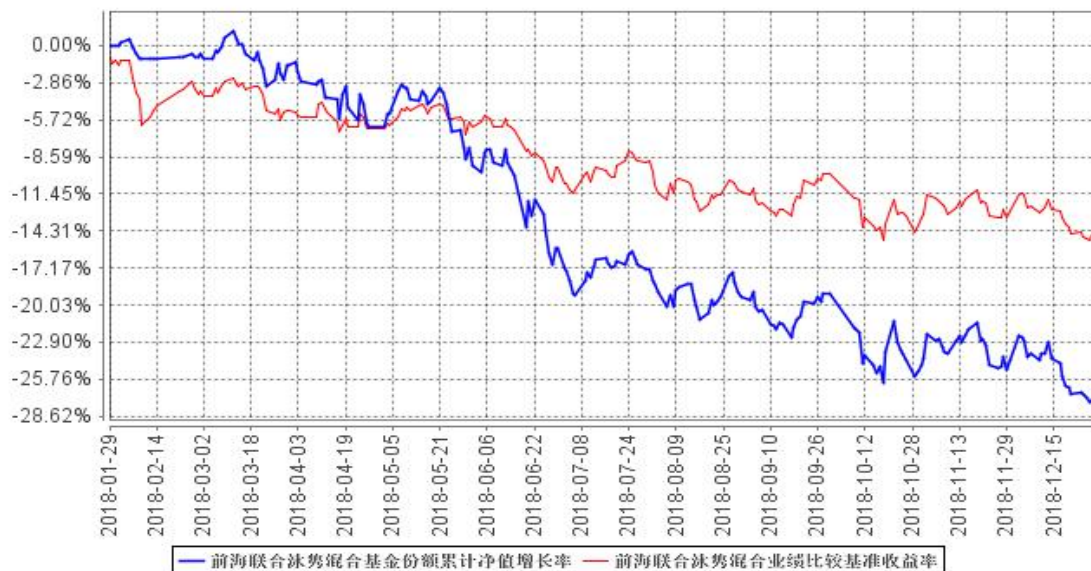
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-10.25%	1.25%	-5.31%	0.81%	-4.94%	0.44%
过去六个月	-13.98%	1.06%	-5.87%	0.74%	-8.11%	0.32%
自基金合同生效起至今	-27.41%	1.02%	-14.67%	0.68%	-12.74%	0.34%

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

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

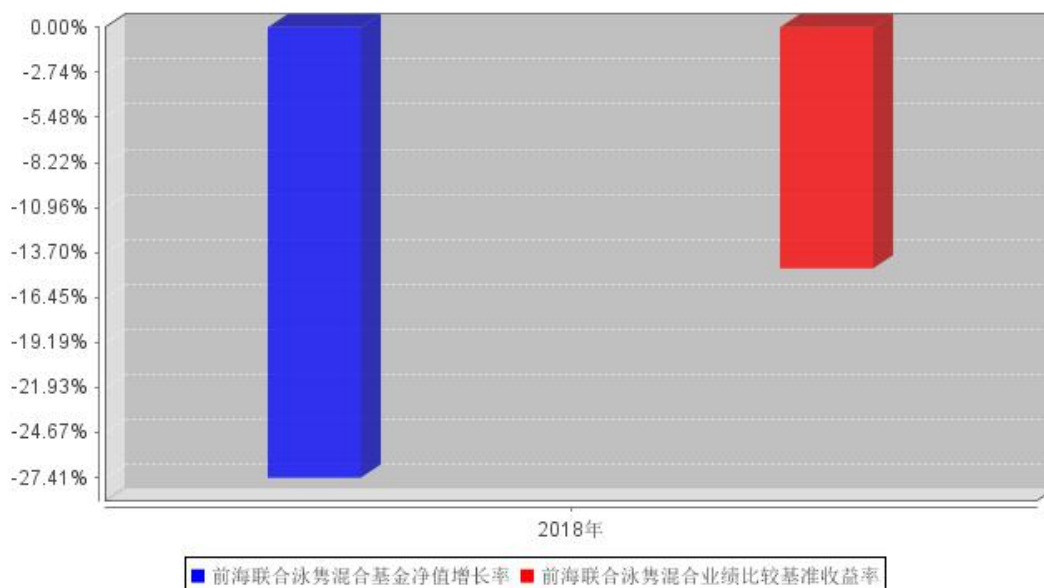
前海联合泳隼混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于 2018 年 1 月 29 日生效，截至本报告期末，本基金成立未满一年。  
2、本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至报告期末，本基金建仓期结束未满 1 年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合泳隼混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2018 年 1 月 29 日生效，2018 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准



收益率按本基金实际存续期计算。

### **3.3 其他指标**

无。

### **3.4 过去三年基金的利润分配情况**

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，本公司旗下共管理20只开放式基金，包括2只货币市场基金、8只债券型基金、9只混合型基金和1只指数型基金，另管理9只专户理财产品，管理资产总规模超过356亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王静	本基金的基金经理	2018年1月29日	-	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，现任前海联合泳隼混合兼前海联合沪深300、前海联合泳涛混合、前海联合泳隆混合、前海联合研究优选混合、前海联合润丰混合和前海联合先进制造混合的基金经理。
黄海滨	本基金的基金经理	2018年1月31日	-	8年	黄海滨先生，经济学硕士，8年证券投资研究经验。2013年5月至2017年12月任职于前海人寿资产管理中心，历任研究部行业研究员、权益投资部投资经理。

					<p>2011年8月至2013年2月任天弘基金股票投资部行业研究员。2010年7月至2011年8月任华夏基金投资研究部研究员。</p> <p>2017年12月加入前海联合基金，现任前海联合泳隼混合兼前海联合泳涛混合的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机

会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### **4.3.2 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。

#### **4.3.3 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**

2018 年沪深 300 下跌了 25.3%，全 A 指数下跌了 28.25%，上证综指一度跌破 2500 点，创业板指跌破 1200 点。2018 年全球主要经济体股市都表现不好，背后有两大因素：全球经济周期见顶，欧美日央行在多年货币宽松后开始或计划缩表。其中中国股市表现最差有多方面的原因：1) 中美贸易摩擦不断升级并扩散到其他领域，投资者担忧中国发展的外部环境恶化；2) 国内金融去杠杆推进，表外融资大幅萎缩，社融增速持续下行，民企受伤严重，融资难融资贵的问题突出；3) 2018 年中美经济周期和货币政策周期不同步，国内资产价格承受较大压力；4) 在内外部压力下，2018 年下半年特别是四季度经济数据出现快速下行，上市公司盈利增速也受到较大影响；5) 股价下跌与股权质押爆仓风险形成反馈。

泳隼基金 2018 年组合主要配置了低估值蓝筹（金融地产）和成长性较好的细分行业龙头股。由于仓位控制和个股选择上的失误。由于系统性风险，组合净值遭遇较大损失。

#### 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 0.7259 元；本报告期基金份额净值增长率为-27.41%，业绩比较基准收益率为-14.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在内外部压力加大的情况下，国内政策在去年四季度加大了对冲力度，货币政策进一步宽松、基建发力、减费降税政策陆续推出、民企融资难融资贵和股权质押问题得到高层重视、股市监管回归市场化。

投资者尤其关注货币宽松什么时候传导到信用端。从 1 月份数据来看，社会融资已经有一定改善，结构上以票据融资和短期贷款为主，随着政策加大支持力度、银行资本金补充，以及风险偏好回升，后续社融数据结构有望改善，实体经济的融资成本有望下降。社融数据和结构的改善传导到经济有一定的时滞，预计 2019 年上半年经济数据和上市公司盈利增速仍处于下行阶段，下半年有望企稳。

2019 年，货币政策会继续宽松，财政政策也会加大力度，但更重要的是，要加大结构性改革力度和培育经济新动能。市场预计存在较多的结构性机会。

配置上我们关注能够受益于政策的方向，看好金融地产基建，以及受益于产业政策支持的高新技术产业。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司业务风险全面自查，对公司各项内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为

核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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，新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金净值、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》等有关法律法规。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金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 审计报告

普华永道中天审字(2019)第 20821 号

新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 一、 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“前海联合泳隼混合基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了前海联合泳隼混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于前海联合泳隼混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

### 三、 管理层和治理层对财务报表的责任

前海联合泳隼混合基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估前海联合泳隼混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算前海联合泳隼混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督前海联合泳隼混合基金的财务报告过程。

### 四、 注册会计师对财务报表审计的责任



我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对前海联合泳隼混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海联合泳隼混合基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

薛 竞

中国·上海市

注册会计师

李 隐 煜

2019年3月26日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	41,197,103.89
结算备付金		2,822,165.53
存出保证金		1,042,906.95
交易性金融资产	7.4.7.2	218,525,114.41
其中：股票投资		137,647,114.41
基金投资		-
债券投资		80,878,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	110,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,596,170.53
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		375,183,461.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		15,470,706.73
应付赎回款		-
应付管理人报酬		220,098.78
应付托管费		47,164.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	561,321.36
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	290,000.00
负债合计		16,589,290.90
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	493,965,737.66
未分配利润	7.4.7.10	-135,371,567.25
所有者权益合计		358,594,170.41
负债和所有者权益总计		375,183,461.31

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7259 元，基金份额总额 493,965,737.66 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-125,924,980.33
1. 利息收入		5,527,030.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	478,127.71
债券利息收入		1,417,095.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,631,806.78
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-131,464,789.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-135,485,976.24
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	73,907.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	3,947,279.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	6,161.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,617.57
<b>减：二、费用</b>		10,578,637.29
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,775,236.82
2. 托管费	7.4.10.2.2	594,693.69

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,907,420.51
5. 利息支出		1,886.27
其中：卖出回购金融资产支出		1,886.27
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.19	299,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-136,503,617.62
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-136,503,617.62

注：本基金的基金合同于 2018 年 1 月 29 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）到 2018 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,264,478.57	-	500,264,478.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-136,503,617.62	-136,503,617.62
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）	-6,298,740.91	1,132,050.37	-5,166,690.54
其中：1. 基金申购款	104,786.73	-5,351.84	99,434.89
2. 基金赎回款	-6,403,527.64	1,137,402.21	-5,266,125.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	493,965,737.66	-135,371,567.25	358,594,170.41

注：本基金的基金合同于 2018 年 1 月 29 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）到 2018 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王晓耕	_____ 刘菲	_____ 陈艳
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2017]641号《关于准予新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2018]14号《关于同意新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的函》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《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 500,264,450.94 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0059 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 500,264,478.57 份基金份额,其中认购资金利息折合 27.63 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 0%-95%,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2019 年 3 月 26 日批准报

出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期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。

#### 7.4.4.4 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和资产支持证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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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和债券，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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会

关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	41,197,103.89
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：	41,197,103.89

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	138,470,353.06	137,647,114.41	-823,238.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	80,048,600.00	80,878,000.00	829,400.00
	合计	80,048,600.00	80,878,000.00	829,400.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	218,518,953.06	218,525,114.41	6,161.35
----	----------------	----------------	----------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	110,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	110,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	4,264.00
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	1,270.00
应收债券利息	1,444,991.78
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	145,175.45
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	469.30
合计	1,596,170.53

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	561,176.82

银行间市场应付交易费用	144.54
合计	561,321.36

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	290,000.00
合计	290,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	500,264,478.57	500,264,478.57
本期申购	104,786.73	104,786.73
本期赎回(以“-”号填列)	-6,403,527.64	-6,403,527.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	493,965,737.66	493,965,737.66

注：1、申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自2018年1月8日起至2018年1月23日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币500,264,450.94元，折合为500,264,450.94份基金份额。根据《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币27.63元在本基金成立后，折合为27.63份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年4月25日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自2018年4月26日开始办理。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	-136,509,778.97	6,161.35	-136,503,617.62
本期基金份额交易产生的变动数	1,242,419.21	-110,368.84	1,132,050.37
其中：基金申购款	-7,993.13	2,641.29	-5,351.84
基金赎回款	1,250,412.34	-113,010.13	1,137,402.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-135,267,359.76	-104,207.49	-135,371,567.25

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	269,787.32
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	191,534.66
其他	16,805.73
合计	478,127.71

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	2,340,588,750.23
减：卖出股票成本总额	2,476,074,726.47
买卖股票差价收入	-135,485,976.24

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年12月31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	73,907.40
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	73,907.40

**7.4.7.13.2 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29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,085,216.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,000,000.00
减：应收利息总额	11,309.59
买卖债券差价收入	73,907.40

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

无。

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,947,279.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,947,279.21

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	6,161.35
——股票投资	-823,238.65
——债券投资	829,400.00
——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	6,161.35

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,617.57
合计	6,617.57

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

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,906,845.51
银行间市场交易费用	575.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	6,907,420.51

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
信息披露费	230,000.00
审计费用	60,000.00
账户维护费	9,000.00
其他	400.00
合计	299,400.00

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《关于新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》和更新的《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，自 2019 年 2 月 25 日起，增加收取销售服务费的 C 类基金份额并对本基金的基金合同作出相应修改。本基金增加 C



类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值，投资者申购时可以自主选择与 A 类基金份额或 C 类基金份额相对应的基金代码进行申购。原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类基金份额后，全部自动转换为新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额。

#### 7.4.9 关联方关系

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
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	基金管理人的股东
凯信恒有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,775,236.82
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	594,693.69

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

### 7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行	41,197,103.89	269,787.32

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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担中等风险、预期收益中等的证券投资基金品种。本基金的投资范围为具有良好流动性

的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行

人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 12 月 31 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 16.96%。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借

入短期资金应对流动性需求，其余不得超过基金资产净值的 40%，且其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计

资产					
银行存款	41,197,103.89	-	-	-	41,197,103.89
结算备付金	2,822,165.53	-	-	-	2,822,165.53
存出保证金	1,042,906.95	-	-	-	1,042,906.95
交易性金融资产	20,064,000.00	60,814,000.00	-	137,647,114.41	218,525,114.41
买入返售金融资产	110,000,000.00	-	-	-	110,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,596,170.53	1,596,170.53
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	175,126,176.37	60,814,000.00	-	139,243,284.94	375,183,461.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,470,706.73	15,470,706.73
应付管理人报酬	-	-	-	220,098.78	220,098.78
应付托管费	-	-	-	47,164.03	47,164.03
应付交易费用	-	-	-	561,321.36	561,321.36
其他负债	-	-	-	290,000.00	290,000.00
负债总计	-	-	-	16,589,290.90	16,589,290.90
利率敏感度缺口	175,126,176.37	60,814,000.00	-	122,653,994.04	358,594,170.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	87,521.30
	2. 市场利率上升 25 个基点	-86,807.59

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观

经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	137,647,114.41	38.39
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	137,647,114.41	38.39

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	11,889,189.72
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-11,889,189.72

#### 7.4.14 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 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 137,596,968.61 元，属于第二层次的余额为 80,928,145.80 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	137,647,114.41	36.69
	其中：股票	137,647,114.41	36.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,878,000.00	21.56
	其中：债券	80,878,000.00	21.56
	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	110,000,000.00	29.32
	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	44,019,269.42	11.73
8	其他各项资产	2,639,077.48	0.70
9	合计	375,183,461.31	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,249,365.41	5.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,584,500.00	2.12
F	批发和零售业	9,164,309.10	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	4,846,394.10	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,950,000.00	1.94
J	金融业	41,581,645.80	11.60
K	房地产业	49,270,900.00	13.74
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	137,647,114.41	38.39

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	355,000	19,915,500.00	5.55
2	002146	荣盛发展	2,100,000	16,695,000.00	4.66
3	600048	保利地产	1,080,000	12,733,200.00	3.55
4	601155	新城控股	530,000	12,555,700.00	3.50
5	000001	平安银行	1,200,000	11,256,000.00	3.14
6	601818	光大银行	2,800,000	10,360,000.00	2.89
7	600153	建发股份	1,299,902	9,164,309.10	2.56
8	002371	北方华创	240,000	9,062,400.00	2.53
9	001979	招商蛇口	420,000	7,287,000.00	2.03
10	002065	东华软件	1,000,000	6,950,000.00	1.94
11	002463	沪电股份	810,030	5,807,915.10	1.62
12	002120	韵达股份	159,947	4,846,394.10	1.35
13	601186	中国铁建	350,000	3,804,500.00	1.06
14	600528	中铁工业	360,000	3,780,000.00	1.05
15	000425	徐工机械	1,000,000	3,230,000.00	0.90
16	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
17	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.01
18	300753	爱朋医疗	1,055	42,326.60	0.01
19	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.01

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002146	荣盛发展	82,136,144.18	22.91
2	600703	三安光电	70,079,678.91	19.54

3	601288	农业银行	53,981,143.76	15.05
4	600048	保利地产	50,705,389.58	14.14
5	001979	招商蛇口	45,544,854.57	12.70
6	601155	新城控股	42,823,372.80	11.94
7	601318	中国平安	42,460,553.22	11.84
8	000977	浪潮信息	40,605,438.27	11.32
9	600276	恒瑞医药	34,853,158.15	9.72
10	000858	五粮液	34,348,673.36	9.58
11	600884	杉杉股份	33,432,488.43	9.32
12	603589	口子窖	31,399,773.50	8.76
13	600521	华海药业	31,168,623.02	8.69
14	600584	长电科技	30,878,578.44	8.61
15	600029	南方航空	30,541,990.91	8.52
16	600153	建发股份	29,906,346.65	8.34
17	601939	建设银行	28,800,684.00	8.03
18	002294	信立泰	28,465,598.18	7.94
19	000998	隆平高科	27,038,079.49	7.54
20	000333	美的集团	26,869,922.60	7.49
21	000786	北新建材	26,680,709.79	7.44
22	600028	中国石化	26,366,102.85	7.35
23	000963	华东医药	25,854,774.00	7.21
24	601233	桐昆股份	25,801,609.43	7.20
25	601222	林洋能源	25,286,933.56	7.05
26	300316	晶盛机电	24,850,557.97	6.93
27	603799	华友钴业	24,562,672.73	6.85
28	300166	东方国信	24,027,427.00	6.70
29	002202	金风科技	23,781,571.33	6.63
30	002371	北方华创	23,534,743.24	6.56
31	300323	华灿光电	22,906,994.16	6.39
32	002466	天齐锂业	22,609,554.46	6.31
33	601336	新华保险	22,555,872.75	6.29
34	000425	徐工机械	22,454,239.00	6.26
35	000001	平安银行	21,993,380.00	6.13
36	002035	华帝股份	21,729,507.35	6.06
37	002463	沪电股份	21,682,412.05	6.05
38	300433	蓝思科技	20,752,771.76	5.79

39	600585	海螺水泥	20,423,116.10	5.70
40	601012	隆基股份	19,955,858.90	5.57
41	300037	新宙邦	19,931,303.00	5.56
42	600487	亨通光电	19,912,313.45	5.55
43	603986	兆易创新	19,840,252.60	5.53
44	601818	光大银行	19,770,000.00	5.51
45	600507	方大特钢	19,700,192.46	5.49
46	000596	古井贡酒	19,564,097.98	5.46
47	600115	东方航空	19,120,041.00	5.33
48	000703	恒逸石化	18,976,353.02	5.29
49	002815	崇达技术	18,670,481.00	5.21
50	002262	恩华药业	18,304,273.20	5.10
51	002709	天赐材料	17,086,065.98	4.76
52	300003	乐普医疗	17,029,120.38	4.75
53	002024	苏宁云商	16,816,627.46	4.69
54	600519	贵州茅台	16,798,496.00	4.68
55	002714	牧原股份	16,775,961.23	4.68
56	600030	中信证券	16,685,339.00	4.65
57	300271	华宇软件	16,646,422.02	4.64
58	600383	金地集团	16,347,257.59	4.56
59	601877	正泰电器	16,042,572.50	4.47
60	002439	启明星辰	16,030,357.36	4.47
61	600036	招商银行	15,763,350.00	4.40
62	300383	光环新网	15,367,998.24	4.29
63	300409	道氏技术	15,357,411.00	4.28
64	002126	银轮股份	15,286,106.60	4.26
65	600740	山西焦化	14,677,329.65	4.09
66	300017	网宿科技	14,658,389.15	4.09
67	002027	分众传媒	14,340,724.40	4.00
68	600893	航发动力	14,147,217.99	3.95
69	300159	新研股份	14,116,552.71	3.94
70	600845	宝信软件	14,087,369.15	3.93
71	600104	上汽集团	13,976,833.25	3.90
72	300443	金雷风电	13,691,917.00	3.82
73	002589	瑞康医药	13,368,951.00	3.73
74	002384	东山精密	13,145,342.62	3.67

75	601398	工商银行	13,140,887.55	3.66
76	000961	中南建设	13,078,489.60	3.65
77	600559	老白干酒	12,898,370.32	3.60
78	300373	扬杰科技	12,855,307.12	3.58
79	600782	新钢股份	12,453,651.00	3.47
80	600859	王府井	12,318,947.40	3.44
81	600196	复星医药	12,269,792.00	3.42
82	300567	精测电子	12,098,110.00	3.37
83	002368	太极股份	11,952,135.90	3.33
84	600438	通威股份	11,940,644.26	3.33
85	002751	易尚展示	11,756,846.00	3.28
86	002366	台海核电	11,669,423.40	3.25
87	002460	赣锋锂业	11,368,621.58	3.17
88	600525	长园集团	11,327,930.02	3.16
89	600570	恒生电子	11,279,674.00	3.15
90	002773	康弘药业	11,165,899.58	3.11
91	002007	华兰生物	11,115,706.00	3.10
92	300760	迈瑞医疗	10,939,974.60	3.05
93	600056	中国医药	10,816,975.60	3.02
94	601699	潞安环能	10,814,228.00	3.02
95	603019	中科曙光	10,756,266.00	3.00
96	600887	伊利股份	10,733,749.60	2.99
97	002065	东华软件	10,595,823.00	2.95
98	002185	华天科技	10,585,088.06	2.95
99	002382	蓝帆医疗	10,479,736.94	2.92
100	002373	千方科技	10,475,920.10	2.92
101	600019	宝钢股份	10,454,537.00	2.92
102	600685	中船防务	10,372,837.00	2.89
103	002465	海格通信	10,299,983.00	2.87
104	300036	超图软件	10,269,996.44	2.86
105	002668	奥马电器	10,247,048.80	2.86
106	000537	广宇发展	10,142,237.00	2.83
107	600482	中国动力	10,063,418.00	2.81
108	000661	长春高新	10,051,147.88	2.80
109	600340	华夏幸福	9,879,313.45	2.76
110	300170	汉得信息	9,799,922.00	2.73

111	600837	海通证券	9,791,767.78	2.73
112	000568	泸州老窖	9,582,319.00	2.67
113	603179	新泉股份	9,527,078.50	2.66
114	000776	广发证券	9,494,513.00	2.65
115	002475	立讯精密	9,294,589.95	2.59
116	600426	华鲁恒升	9,230,686.22	2.57
117	600745	闻泰科技	9,220,682.00	2.57
118	002812	创新股份	9,020,507.00	2.52
119	002236	大华股份	8,976,883.88	2.50
120	002008	大族激光	8,644,961.83	2.41
121	002304	洋河股份	8,258,401.16	2.30
122	002212	南洋股份	8,189,942.00	2.28
123	601328	交通银行	8,180,000.00	2.28
124	300182	捷成股份	7,877,383.95	2.20
125	601933	永辉超市	7,558,230.00	2.11
126	300618	寒锐钴业	7,558,041.20	2.11
127	601166	兴业银行	7,520,100.00	2.10
128	002050	三花智控	7,492,582.00	2.09
129	601111	中国国航	7,458,015.00	2.08
130	000888	峨眉山A	7,354,112.88	2.05
131	000100	TCL 集团	7,321,620.00	2.04
132	000671	阳光城	7,258,963.16	2.02

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	62,884,466.77	17.54
2	002146	荣盛发展	59,782,202.86	16.67
3	601288	农业银行	53,335,104.78	14.87
4	600884	杉杉股份	35,992,209.08	10.04
5	600276	恒瑞医药	35,544,560.16	9.91
6	000977	浪潮信息	34,801,339.49	9.70
7	600048	保利地产	34,572,114.00	9.64
8	001979	招商蛇口	34,366,119.69	9.58
9	603589	口子窖	33,307,260.55	9.29

10	000858	五 粮 液	33,274,072.86	9.28
11	600029	南方航空	29,491,456.40	8.22
12	601155	新城控股	29,470,587.93	8.22
13	601939	建设银行	28,989,716.92	8.08
14	600584	长电科技	28,749,027.78	8.02
15	002294	信立泰	28,184,253.48	7.86
16	600521	华海药业	27,254,487.46	7.60
17	000786	北新建材	27,047,416.46	7.54
18	000998	隆平高科	25,648,161.80	7.15
19	000333	美的集团	25,088,888.26	7.00
20	000963	华东医药	24,636,424.72	6.87
21	601233	桐昆股份	24,531,706.00	6.84
22	600028	中国石化	23,921,976.69	6.67
23	000596	古井贡酒	23,235,896.63	6.48
24	300166	东方国信	21,935,219.87	6.12
25	601336	新华保险	21,589,696.48	6.02
26	601318	中国平安	21,353,272.00	5.95
27	300323	华灿光电	21,281,049.64	5.93
28	600487	亨通光电	21,211,111.21	5.92
29	603799	华友钴业	21,200,688.40	5.91
30	300037	新宙邦	21,096,351.00	5.88
31	002466	天齐锂业	20,987,055.87	5.85
32	300316	晶盛机电	20,892,330.30	5.83
33	600585	海螺水泥	20,084,532.32	5.60
34	600153	建发股份	19,995,746.00	5.58
35	601222	林洋能源	19,548,295.48	5.45
36	300433	蓝思科技	19,373,007.42	5.40
37	600507	方大特钢	19,162,822.76	5.34
38	601012	隆基股份	19,162,128.91	5.34
39	002035	华帝股份	18,788,103.06	5.24
40	600115	东方航空	18,732,548.13	5.22
41	000425	徐工机械	18,572,556.51	5.18
42	002815	崇达技术	17,943,496.96	5.00
43	002202	金风科技	17,847,461.00	4.98
44	000703	恒逸石化	17,657,236.76	4.92
45	002463	沪电股份	17,620,205.81	4.91
46	600030	中信证券	17,392,101.79	4.85
47	300271	华宇软件	16,838,526.94	4.70



48	002262	恩华药业	16,753,305.44	4.67
49	002709	天赐材料	16,407,325.48	4.58
50	002439	启明星辰	16,058,500.95	4.48
51	300003	乐普医疗	15,852,574.90	4.42
52	600519	贵州茅台	15,690,976.00	4.38
53	600383	金地集团	15,564,223.03	4.34
54	002714	牧原股份	15,482,882.10	4.32
55	002024	苏宁云商	15,449,315.97	4.31
56	600036	招商银行	15,407,125.00	4.30
57	603986	兆易创新	15,383,941.76	4.29
58	300383	光环新网	14,775,262.24	4.12
59	600740	山西焦化	14,296,342.52	3.99
60	300159	新研股份	14,093,261.00	3.93
61	002126	银轮股份	14,021,897.66	3.91
62	600893	航发动力	13,602,315.00	3.79
63	600845	宝信软件	13,544,175.30	3.78
64	600559	老白干酒	13,285,395.40	3.70
65	002589	瑞康医药	13,253,402.20	3.70
66	002371	北方华创	12,966,560.40	3.62
67	300017	网宿科技	12,884,504.00	3.59
68	601398	工商银行	12,871,810.81	3.59
69	300409	道氏技术	12,776,772.00	3.56
70	601877	正泰电器	12,490,256.83	3.48
71	300443	金雷风电	12,452,138.46	3.47
72	600782	新钢股份	12,331,230.00	3.44
73	002007	华兰生物	12,266,014.00	3.42
74	600104	上汽集团	12,180,259.97	3.40
75	600570	恒生电子	12,116,295.00	3.38
76	300373	扬杰科技	12,101,600.20	3.37
77	300567	精测电子	11,803,044.00	3.29
78	600438	通威股份	11,800,103.28	3.29
79	002368	太极股份	11,774,878.82	3.28
80	002027	分众传媒	11,647,282.00	3.25
81	600196	复星医药	11,615,285.00	3.24
82	600056	中国医药	11,122,041.44	3.10
83	000961	中南建设	11,042,538.79	3.08
84	000661	长春高新	10,986,329.04	3.06
85	600887	伊利股份	10,807,302.90	3.01

86	300760	迈瑞医疗	10,782,052.29	3.01
87	000001	平安银行	10,604,459.19	2.96
88	600859	王府井	10,524,437.93	2.93
89	002668	奥马电器	10,411,889.40	2.90
90	601699	潞安环能	10,332,808.00	2.88
91	600482	中国动力	10,269,699.60	2.86
92	002185	华天科技	10,206,615.76	2.85
93	002460	赣锋锂业	10,161,233.00	2.83
94	002384	东山精密	10,102,398.99	2.82
95	000537	广宇发展	10,046,001.69	2.80
96	300036	超图软件	10,043,570.00	2.80
97	002773	康弘药业	10,011,162.00	2.79
98	002366	台海核电	9,875,192.79	2.75
99	600019	宝钢股份	9,855,560.96	2.75
100	600685	中船防务	9,813,051.56	2.74
101	603019	中科曙光	9,739,620.00	2.72
102	600837	海通证券	9,653,514.57	2.69
103	603179	新泉股份	9,618,521.60	2.68
104	600340	华夏幸福	9,565,159.30	2.67
105	600525	长园集团	9,372,000.00	2.61
106	000776	广发证券	9,330,791.00	2.60
107	002382	蓝帆医疗	9,325,113.00	2.60
108	000568	泸州老窖	9,322,873.39	2.60
109	601818	光大银行	9,246,000.00	2.58
110	002236	大华股份	9,085,651.00	2.53
111	002373	千方科技	9,021,973.44	2.52
112	002465	海格通信	9,015,856.00	2.51
113	002751	易尚展示	8,748,289.02	2.44
114	600745	闻泰科技	8,606,046.00	2.40
115	002475	立讯精密	8,382,223.00	2.34
116	601328	交通银行	8,316,000.00	2.32
117	300182	捷成股份	8,245,713.05	2.30
118	002008	大族激光	8,164,851.00	2.28
119	002212	南洋股份	7,515,404.00	2.10
120	002812	创新股份	7,473,792.00	2.08
121	601166	兴业银行	7,371,600.00	2.06
122	600426	华鲁恒升	7,307,804.52	2.04
123	601111	中国国航	7,296,078.00	2.03

124	300145	中金环境	7,242,736.16	2.02
-----	--------	------	--------------	------

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。

#### 8.4.3 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	2,614,545,079.53
卖出股票收入（成交）总额	2,340,588,750.23

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。

#### 8.5 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	80,878,000.00	22.55
	其中：政策性金融债	20,064,000.00	5.60
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	80,878,000.00	22.55

#### 8.6 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	1820062	18 盛京银行 02	300,000	30,117,000.00	8.40
2	1820009	18 宁波银行 01	200,000	20,548,000.00	5.73
3	180209	18 国开 09	200,000	20,064,000.00	5.60
4	1820037	18 宁波银行 03	100,000	10,149,000.00	2.83

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体除宁波银行、平安银行、光大银行外，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。

#### 1、18 宁波银行 03 债务主体被监管部门处罚事件：

2018 年 6 月 22 日，宁波银行以不正当手段违规吸收存款，依据《中华人民共和国商业银行法》第七十四条，被宁波银监局罚款人民币 60 万元。

本基金投资于宁波银行的决策程序说明：基于宁波银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于宁波银行，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，宁波银行净资产规模大，经营情况良好，上述罚款占其净利润比例较低，对宁波银行正常经营影响很小，不影响宁波银行对本基金所持有的债券到期偿付义务的履行。

#### 2、平安银行股票发行主体被监管部门处罚事件：

(1) 主要违法违规事实：贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 2 月 12 日，大连银监局对公司行政处罚决定：罚款人民币 40 万元。基金管理人分析认为，该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

(2) 主要违法违规事实：违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 3 月 14 日，中国人民银行对公司行政处罚决定：没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元。基金管理人分析认为，该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

(3) 主要违法违规事实：贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 7 月 10 日，天津银监局对公司行政处罚决定：罚款人民币 50 万元。基金管理人分析认为，该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

(4) 主要违法违规事实：未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 8 月 1 日，中国人民银行对公司行政处罚决定：合计罚款 140 万元。基金管理人分析认为，该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

### 3、光大银行股票发行主体被监管部门处罚事件：

(1) 主要违法违规事实：(一) 内控管理严重违反审慎经营规则；(二) 以误导方式违规销售理财产品；(三) 以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；(四) 违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；(五) 同业投资违规接受担保；(六) 通过同业投资或贷款虚增存款规模。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会对公司行政处罚决定：没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。基金管理人分析认为，该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于光大银行的决策程序说明：基于光大银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于光大银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

(2) 主要违法违规事实：虚报、瞒报金融统计数据。

【简述事件对受罚主体的影响】2018 年 12 月 24 日，中国人民银行许昌市中心支行对公司行政处罚决定：警告并罚款 4 万元。该事件对该公司正常经营影响较小。

【简述投资决策流程】本基金投资于光大银行的决策程序说明：基于光大银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于光大银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

【简述对基金运作影响】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，对基金运作无影响。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 8.12.3 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	1,042,906.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,596,170.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,639,077.48

### 8.12.4 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。

### **8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### **8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
284	1,739,315.98	493,697,000.00	99.95%	268,737.66	0.05%

### 9.2 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	111,048.31	0.0225%

### 9.3 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、基金投资和相关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



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年1月29日）基金份额总额	500,264,478.57
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	104,786.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,403,527.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	493,965,737.66

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

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。

本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日及 10 月 18 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。

本基金管理人于 2018 年 12 月 4 日发布公告，自 2018 年 12 月 3 日起，由邱张斌先生担任公司督察长（合规负责人），总经理王晓耕女士不再代为履行督察长（合规负责人）职务。

经新疆前海联合基金管理有限公司股东会 2018 年第 2 次临时会议（2018 年 11 月 28 日）审议通过，产生了公司第二届董事会的七位董事：黄炜（股东董事）、邓清泉（股东董事）、孙磊（股东董事）、王晓耕（管理层董事）、孙学致（独立董事）、冯梅（独立董事）、张卫国（独立董事）。其中，邓清泉先生和张卫国先生为新任董事；张东成先生自 2018 年 11 月 28 日起不再担任公司独立董事。公司第二届董事会 2018 年第 1 次定期会议（2018 年 12 月 3 日）决议由黄炜先生担任第二届董事会董事长，由邓清泉先生担任第二届董事会副董事长。

以上事项已按有关规定进行备案。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对基金 2018 年年报进行审计，该事务所自 2018 年 1 月 29 日基金成立以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 60,000.00 元。

### 11.6 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，本管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	2,298,627,684.18	46.41%	2,140,713.51	51.87%	-
兴业证券	1	1,187,283,601.36	23.97%	868,268.16	21.04%	-
长江证券	1	726,258,791.27	14.66%	531,112.52	12.87%	-
海通证券	1	298,468,244.69	6.03%	218,269.30	5.29%	-
广发证券	1	226,316,916.12	4.57%	210,772.68	5.11%	-
国信证券	1	215,726,747.67	4.36%	157,760.69	3.82%	-

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。
- 2、截至 2018 年 12 月 31 日，我公司通过华创证券的交易席位买卖证券的年交易佣金，出现超过 2018 年所有基金买卖证券交易佣金的 30%的情况。2018 年上半年 A 股市场交投相对活跃，公司处于建仓期的新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金可使用的交易席位数量有限，同时建仓

期成交量较大，造成在华创证券交易席位上的佣金比例较高。而 2018 年全年成交量整体呈现出下半年萎缩态势，后续增加交易席位数量后仍无法将华创证券交易席位的佣金所占比例降低至 30% 以下。

### 11.7.2 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	-	-	12,200,000,000.00	56.56%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	3,824,000,000.00	17.73%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	822,000,000.00	3.81%	-	-
国信证券	-	-	4,723,000,000.00	21.90%	-	-

### 11.8 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泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 6 日
2	关于新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 24 日
3	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 1 月 30 日
4	新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 2 月 1 日
5	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 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
6	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 4 月 26 日
7	新疆前海联合基金管理有限公司 2018 年 6 月 30 日基金净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 7 月 2 日
8	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 7 月 19 日

9	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 8 月 28 日
10	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 8 月 28 日
11	新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 10 月 24 日
12	关于前海联合基金管理有限公司网上交易平台工行直连及快付通支付渠道费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2018 年 11 月 9 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2018.10.01-2018.12.31	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	40.49%
	2	2018.10.01-2018.12.31	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	40.49%
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。

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金合同》；
- 3、《新疆前海联合泳隼灵活配置混合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。

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日