

# 新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司  
基金托管人:南京银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年7月19日

**§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。  
基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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预示其未来表现,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。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	新疆前海联合泓鑫混合
交易代码	004920
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月28日
报告期末基金份额总额	242,104,002.00份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过资产配置实现基金资产的增值,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在宏观和微观两个层面进行资产配置,并采用自下而上的个股选择策略,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中国综合价格指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金。
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

**3.1 主要财务指标**

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
本期利润总额	-1,809,922.84
本期净利润	-4,570,969.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0190
期末基金份额净值	2.465,520.194
期末基金份额净值	1.042

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,计入费用后将实际收益水平更低于所列数字。  
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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.60%	1.00%	-4.52%	0.07%	3.00%	0.81%

注:本基金转型日期为2018年2月26日,截止本报告期末,本基金业绩满一年。

**3.2.2 自基金合同生效以来基金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**

**§4 管理人报告**

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
林林	本基金的基金经理	2018年11月30日	-	10年
栢杰	本基金的基金经理	2018年4月12日	-	8年

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,为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。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 公平交易专项说明**  
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 报告期内基金投资策略和运作分析**  
从基本面看,宏观经济持续下行,但高频数据显现宏观经济运行仍然平稳;从市场估值看,市场估值也接近历史底部区域。因此经济复苏风险不大,市场风险溢价主要受政策影响,金融去杠杆两大因素制约,中期通胀难以明确复苏,市场波动较大,因此报告期内基金保持仓位水平。

回顾年初,考虑到中证上证正处新旧动能转换阵痛期,医药、计算机、新能源为代表的经济板块,将是中期主题,但技术进步成长进程中,需精选引领行业的龙头个股;消费板块中,满足美好生活需求将贯穿主题,关注新业态、新产品等消费升级模式;周期板块中,关注低估值可持续成长个股的性价比。因此,在个股选择上,主要把握上述战略精选基本盘+成长趋势明确的优质公司,坚守长期价值投资逻辑,与上市公司共同成长。

**4.5 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1.0142元;本报告期基金份额净值增长率为-1.46%,业绩比较基准收益率为-4.52%。

**4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**  
无。

**§5 投资组合报告**

**5.1 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	140,163,494.00	57.36
2	其中:股票	140,163,494.00	57.36
3	固定收益投资	20,028,000.00	8.28
4	其中:债券	20,028,000.00	8.28
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	63,000,000.00	25.83
9	其中:买入返售金融资产-票据融资	-	-
10	合计	267,794,428.74	100.00

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,406,894.00	34.76
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	金融业	44,877,000.00	18.58
J	房地产业	-	-
K	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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,070,000.00	4.02
S	综合	-	-
T	合计	140,163,494.00	67.08

**5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合**  
本基金本报告期末未持有港股投资股票。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000077	恒顺信息	890,000	20,780,500.00	8.26
2	000070	华信电子	300,000	19,042,000.00	7.49
3	000047	艾派克	870,000	12,329,000.00	4.85
4	300349	金种子酒	626,700	12,289,742.80	4.92
5	600308	华泰之家	910,000	11,540,400.00	4.51
6	002532	弘讯科技	1,266,984	11,015,812.68	4.28
7	300360	汇川技术	300,000	10,603,000.00	4.03
8	300144	瑞松科技	420,000	9,970,000.00	4.02
9	002491	通威股份	680,000	9,489,500.00	3.69
10	000069	华谊集团	1,200,000	8,977,200.00	3.52

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000994	华信转债	190,000	4,352,500.00	1.70
2	000028	中信转债	20,000	2,208,000.00	0.82
3	000038	片仔癀	20,000	2,236,000.00	0.92
4	002262	惠华转债	100,000	2,001,000.00	0.80
5	600778	恒顺转债	26,000	1,989,700.00	0.81
6	300027	新康邦	70,000	1,175,200.00	0.46
7	300356	康得转债	29,000	1,791,020.20	0.71
8	000088	华联转债	20,000	1,689,200.00	0.68
9	300068	聚源转债	100,000	1,621,200.00	0.65
10	300342	森森转债	80,000	1,308,400.00	0.50

**3.1 主要财务指标**

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
本期利润总额	-1,809,922.84
本期净利润	-4,570,969.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0190
期末基金份额净值	2.465,520.194
期末基金份额净值	1.042

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,计入费用后将实际收益水平更低于所列数字。  
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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.60%	1.00%	-4.52%	0.07%	3.00%	0.81%

注:本基金转型日期为2018年2月26日,截止本报告期末,本基金业绩满一年。

**§4 管理人报告**

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
林林	本基金的基金经理	2018年11月30日	-	10年
栢杰	本基金的基金经理	2018年4月12日	-	8年

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,为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。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 公平交易专项说明**  
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 报告期内基金投资策略和运作分析**  
从基本面看,宏观经济持续下行,但高频数据显现宏观经济运行仍然平稳;从市场估值看,市场估值也接近历史底部区域。因此经济复苏风险不大,市场风险溢价主要受政策影响,金融去杠杆两大因素制约,中期通胀难以明确复苏,市场波动较大,因此报告期内基金保持仓位水平。

回顾年初,考虑到中证上证正处新旧动能转换阵痛期,医药、计算机、新能源为代表的经济板块,将是中期主题,但技术进步成长进程中,需精选引领行业的龙头个股;消费板块中,满足美好生活需求将贯穿主题,关注新业态、新产品等消费升级模式;周期板块中,关注低估值可持续成长个股的性价比。因此,在个股选择上,主要把握上述战略精选基本盘+成长趋势明确的优质公司,坚守长期价值投资逻辑,与上市公司共同成长。

**4.5 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1.0142元;本报告期基金份额净值增长率为-1.46%,业绩比较基准收益率为-4.52%。

**4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**  
无。

**§5 投资组合报告**

**5.1 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	140,163,494.00	57.36
2	其中:股票	140,163,494.00	57.36
3	固定收益投资	20,028,000.00	8.28
4	其中:债券	20,028,000.00	8.28
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	63,000,000.00	25.83
9	其中:买入返售金融资产-票据融资	-	-
10	合计	267,794,428.74	100.00

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,406,894.00	34.76
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	金融业	44,877,000.00	18.58
J	房地产业	-	-
K	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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,070,000.00	4.02
S	综合	-	-
T	合计	140,163,494.00	67.08

**5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合**  
本基金本报告期末未持有港股投资股票。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000077	恒顺信息	890,000	20,780,500.00	8.26
2	000070	华信电子	300,000	19,042,000.00	7.49
3	000047	艾派克	870,000	12,329,000.00	4.85
4	300349	金种子酒	626,700	12,289,742.80	4.92
5	600308	华泰之家	910,000	11,540,400.00	4.51
6	002532	弘讯科技	1,266,984	11,015,812.68	4.28
7	300360	汇川技术	300,000	10,603,000.00	4.03
8	300144	瑞松科技	420,000	9,970,000.00	4.02
9	002491	通威股份	680,000	9,489,500.00	3.69
10	000069	华谊集团	1,200,000	8,977,200.00	3.52

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000994	华信转债	190,000	4,352,500.00	1.70
2	000028	中信转债	20,000	2,208,000.00	0.82
3	000038	片仔癀	20,000	2,236,000.00	0.92
4	002262	惠华转债	100,000	2,001,000.00	0.80
5	600778	恒顺转债	26,000	1,989,700.00	0.81
6	300027	新康邦	70,000	1,175,200.00	0.46
7	300356	康得转债	29,000	1,791,020.20	0.71
8	000088	华联转债	20,000	1,689,200.00	0.68
9	300068	聚源转债	100,000	1,621,200.00	0.65
10	300342	森森转债	80,000	1,308,400.00	0.50

# 新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

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  
报告送出日期:2018年7月19日

**§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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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预示其未来表现,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。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	新疆前海联合国民健康混合
交易代码	004901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月28日
报告期末基金份额总额	52,116,760.60份
投资目标	本基金主要投资于国民健康主题相关行业,通过深入分析和研究,精选具有成长潜力的个股,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置策略,在宏观和微观两个层面进行资产配置,并采用自下而上的个股选择策略,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*60%+中国综合价格指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金。
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

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

**3.1 主要财务指标**

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
本期利润总额	2,471,300.66
本期净利润	-277,028.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0052
期末基金份额净值	87,140,412.50
期末基金份额净值	1.046

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,计入费用后将实际收益水平更低于所列数字。  
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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较