新疆前海联合汇盈货币市场基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2019年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国邮政储蓄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、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。本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海联合汇盈货币	
基金主代码	004699	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年5月25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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	414,569,773.16份	
基金合同存续期	不定期。	
下属分级基金的基金简称:	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B
下属分级基金的交易代码:	004699	004700
报告期末下属分级基金的份额总额	3,588,406.13份	410,981,367.03份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险,保持相对流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理的投资策略,通过对货币市场利率走势的预判,控制利率风险,在满足基金流动性需求的前提下,减少基金资产净值波动,力争获取超越比较基准的投资收益。 1.资产配置策略 本基金通过比较各类资产的风险与收益率变化,动态调整优先配置的资产类别和配置比例,在满足流动性需求的前提下择机进行杠杆操作。 2.利率债投资策略 本基金将采用“自上而下”的研究方法,通过对宏观经济走势的预判以及资本市场流动性变化的预测估算未来利率市场的走势及合理中枢,进而动态调整组合的久期策略。 3.信用债投资策略 本基金通过“自下而上”的定性和定量的研究方法分析发债主体的实际偿债能力来控制投资组合信用风险,以达到信用风险可控的目标。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
	前海联合汇盈货币A / 前海联合汇盈货币B
下属分级基金的风险收益特征	– / –

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱张斌	田东辉
	联系电话	0755-82780666	010-68858112
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-640-0099	95580
传真		0755-82780000	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

§3 主要财务指标、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		2017年5月25日(基金合同生效日)–2017年12月31日	
	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B
本期已实现收益	111,160.16	55,442,786.62	33,485.57	133,523,267.53
本期利润	111,160.16	55,442,786.62	33,485.57	133,523,267.53
本期净值收益率	3.5192%	3.7665%	2.677%	2.8257%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末	
期末基金资产净值	3,588,406.13	410,981,367.03	1,283,397.49	5,260,441,640.77
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000

注:1、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配方式是按日结转份额。

3、所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。

4、本基金的基金合同于2017年5月25日生效,截止2017年12月31日成立不满1年,故2017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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合汇盈货币A

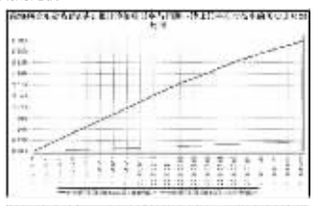
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6953%	0.0008%	0.0894%	0.0000%	0.6059%	0.0008%
过去六个月	1.5133%	0.0020%	0.1789%	0.0000%	1.3344%	0.0020%
过去一年	3.5192%	0.0024%	0.3549%	0.0000%	3.1643%	0.0024%
自基金合同生效起至今	6.2910%	0.0023%	0.5697%	0.0000%	5.7213%	0.0023%

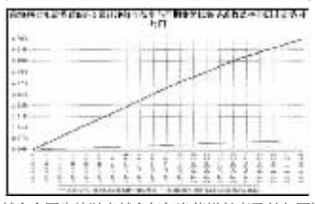
前海联合汇盈货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7567%	0.0008%	0.0894%	0.0000%	0.6673%	0.0008%
过去六个月	1.6366%	0.0020%	0.1789%	0.0000%	1.4577%	0.0020%
过去一年	3.7665%	0.0024%	0.3549%	0.0000%	3.4116%	0.0024%
自基金合同生效起至今	6.6986%	0.0023%	0.5697%	0.0000%	6.1289%	0.0023%

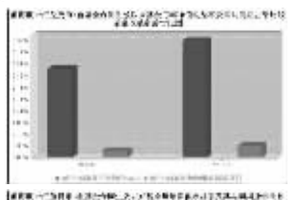
注:本基金业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

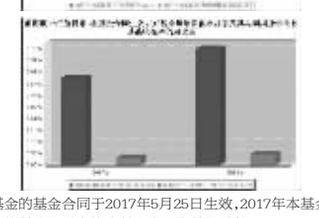
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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





注:本基金的基金合同于2017年5月25日生效,2017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

单位:人民币元

前海联合汇盈货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	110,215.20	–	944.96	111,160.16	
2017	32,994.58	–	490.99	33,485.57	
合计	143,209.78	–	1,435.95	144,645.73	

单位:人民币元

前海联合汇盈货币B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	57,380,956.64	–	-1,938,170.02	55,442,786.62	
2017	131,409,825.24	–	2,113,442.29	133,523,267.53	
合计	188,790,781.88	–	175,272.27	188,966,054.15	

§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		
敬夏奎	本基金的基金经理	2017年5月25日	–	8年	敬夏奎先生,中央财经大学金融学硕士,8年基金投资研究、交易经验。2011年7月至2016年5月任职于融通基金,历任债券交易员、固定收益部投资经理,管理公司债券专户产品。2016年7月至2011年7月任工银瑞信基金中央交易室交易员。2016年5月加入前海联合基金。现任前海联合汇盈货币兼前海联合添利债券、前海联合添鑫定开债券、前海联合弘元定开债券、前海联合泓瑞定开债券和前海联合润丰混合的基金经理。2016年8月至2019年1月曾任新疆前海联合海盈货币的基金经理。
曾婷婷	本基金的基金经理	2017年7月3日	–	7年	曾婷婷女士,北京大学硕士、中山大学双学士,CPA,7年证券、基金从业经历。 2013年4月至2015年8月任华润元大基金固定收益部研究员。2011年11月至2013年3月,任职于第一创业证券研究所。2008年10月至2011年10月任安永会计师事务所高级审计。2015年10月加入前海联合基金。现任前海联合汇盈货币兼新疆前海联合海盈货币和前海联合泳盛纯债的基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司对外公告的解聘日期;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》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,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。本报告期内,基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

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。本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

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,债市上涨的两个核心因素,国内的融资渠道收缩,宏观经济下行,以及外部的中美贸易摩擦。货币政策因上述两个因素转向宽松,债市收益率大幅下行。10年国开收益率从4.82%下行至3.64%,10年国债收益率从3.88%下行至3.22%。

金融去杠杆,防风险导致融资渠道收缩,社融增速明显下行。基本面下行压力增加,6月以来出口抢跑较为明显,一定程度上掩饰了中美贸易战对出口量的影响。投资方面,基建是固定资产的主要拖累项,制造业投资从3月以来连续7个月回升,房地产高速新开工,房地产投资增速小幅上行。整体固定资产投资受基建影响下行至5.9%。

货币政策方面,2018年上半年,央行在1月和4月进行了定向降准,以应对资金紧张和中美贸易战带来的冲击,但同时,为了缓解汇率贬值的压力,央行跟随美联储进行了公开市场操作加息。2018年下半年,经济下行的压力增加,中美贸易战升级,信用违约潮,货币政策转向“合理充裕”,央行于7月和10月再次定向降准。但宽货币并未向宽信用有效传导,社融增速持续下行,信用违约加剧。

报告期内,本基金主要以同业存单、中短期存款为主,在资金紧张时点,通过逆回购来增加超额收益。组合维持较好的静态收益,远超业绩比较基准。流动性未出现异常,满足了投资者正常的申购、赎回要求以及大额赎回申请。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期前海联合汇盈货币A的基金份额净值收益率为3.5192%,本报告期前海联合汇盈货币B的基金份额净值收益率为3.7665%,同期业绩比较基准收益率为0.3549%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年,预计前期经济下行压力将会加大,后期企稳,CPI温和不构成压力。随着出口抢跑结束,预计2019年一季度出口增速将有明显下滑,地产投资先下后上,基建加码,制造业投资保持平稳,基建投资难以对冲房地产投资的下滑,预计整体固定资产投资略低于2018年,经济数据将呈现前低后稳。但需要注意中美贸易摩擦短期内难以有所转折,中美贸易的不确定性是中国经济面临的风险点。

经济压力凸显,货币政策的宽松并未向宽信用传导。疏通货币政策的传导机制,宽信用将成为2019年政策的重心,包括专项债的加速发行等。宽货币是否能够向宽信用传导是判断债市能否转向的重要因素。但非标仍在快速下降,对宽信用的传导继续产生负面的影响。银行和债券市场的风险偏好仍然较低,宽信用很难一蹴而就,在货币政策传导机制未有效疏通前,货币政策将会保持宽松状态,降准仍将继续,降息的概率增加,对债市依然有一定的支撑。但债市目前的收益率位置以及宽信用等政策的不断落实,将会加大2019年债市的波动。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定,本基金的收益分配采取“每日分配、按日支付”的方式,即根据每日基金收益情况,以每万份基金单位收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,并每日以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益55,553,946.78元,实际分配收益55,553,946.78元。

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汇盈货币市场基金的托管过程中,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,新疆前海联合汇盈货币市场基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合汇盈货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、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》、《货币市场基金信息披露特别规定》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汇盈货币市场基金2018年年度报告中财务指标、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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师薛竞、李隐煜于2019年3月26日出具了普华永道中天审字(2019)第20839号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新疆前海联合汇盈货币市场基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	69,210,570.95	2,506,405,021.10
结算备付金	–	–
存出保证金	2,437.83	706.79
交易性金融资产	288,109,345.43	1,947,967,161.67
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	278,001,554.24	1,947,967,161.67
资产支持证券投资	10,107,791.19	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	73,622,470.43	782,623,533.94
应收证券清算款	–	2,004,492.05
应收利息	1,592,326.56	25,869,739.61
应收股利	–	–
应收申购款	10.00	100,000.00
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	432,537,161.20	5,264,970,655.16
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	–	–
卖出回购金融资产款	17,519,733.72	–
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	52,277.98	669,169.23
应付托管费	17,425.98	223,056.39
应付销售服务费	4,768.12	44,871.85
应付交易费用	18,029.48	54,586.15
应交税费	76.38	–
应付利息	9,368.16	–
应付利润	176,708.22	2,113,933.28
递延所得税负债	–	–
其他负债	169,000.00	140,000.00
负债合计	17,967,388.04	3,245,616.90
所有者权益:		
实收基金	414,569,773.16	5,261,725,038.26
未分配利润	–	–
所有者权益合计	414,569,773.16	5,261,725,038.26
负债和所有者权益总计	432,537,161.20	5,264,970,655.16

注:报告截止日2018年12月31日,新疆前海联合汇盈货币基金A类基金份额净值1.000元,新疆前海联合汇盈货币基金B类基金份额净值1.000元;基金份额总额414,569,773.16份,其中A类基金份额3,588,406.13份,B类基金份额410,981,367.03份。

7.2 利润表

会计主体:新疆前海联合汇盈货币市场基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	59,813,342.62	142,375,915.39
1.利息收入	59,762,274.87	141,618,052.82
其中:存款利息收入	21,747,596.56	70,496,827.23
债券利息收入	24,833,605.25	56,342,317.44
资产支持证券利息收入	2,273.69	–
买入返售金融资产收入	13,178,799.37	14,778,908.15
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)	47,067.75	757,862.57
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	47,067.75	757,862.57
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	–	–
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	4,000.00	–
减:二、费用	4,259,395.84	8,819,162.29
1.管理人报酬	1,944,522.96	4,324,536.62
2.托管费	650,774.74	1,441,512.26
3.销售服务费	138,815.00	290,136.16
4.交易费用	–	200.00
5.利息支出	1,318,802.91	2,613,077.25
其中:卖出回购金融资产支出	1,318,802.91	2,613,077.25
6.税金及附加	280.23	–
7.其他费用	206,200.00	149,700.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	55,553,946.78	133,556,753.10
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	55,553,946.78	133,556,753.10

注:本基金的基金合同于2017年5月25日生效,上年度可比期间为2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日止。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新疆前海联合汇盈货币市场基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1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)	5,261,725,038.26	–	5,261,725,038.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	55,553,946.78	55,553,946.78
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)	-4,847,155,265.10	–	-4,847,155,265.10
其中:1.基金申购款	769,532,578.65	–	769,532,578.65
2.基金赎回款	-5,616,687,843.75	–	-5,616,687,843.75
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)	–	-55,553,946.78	-55,553,946.78
五、期末所有者权益(基金净值)	414,569,773.16	–	414,569,773.16
项目	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017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)	210,160,335.22	–	210,160,335.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	133,556,753.10	133,556,753.10
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)	5,051,564,703.04	–	5,051,564,703.04
其中:1.基金申购款	10,466,293,954.86	–	10,466,293,954.86
2.基金赎回款	-5,414,729,251.82	–	-5,414,729,251.82
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)	–	-133,556,753.10	-133,556,753.10
五、期末所有者权益(基金净值)	5,261,725,038.26	–	5,261,725,038.26

注:本基金的基金合同于2017年5月25日生效,上年度可比期间为2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日止。

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 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的说明

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。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 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。

7.4.2.3 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。

7.4.3 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》,财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》,财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

7.4.4 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、登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮储银行”)	基金托管人
凯信恒有限公司	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
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 股票交易

无。

7.4.5.1.2 债券交易

无。

7.4.5.1.3 债券回购交易

无。

7.4.5.1.4 应支付关联方的佣金

无。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,944,522.96	4,324,536.62
其中:支付销售机构的客户维护费	1,597.99	–

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0.15%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.15%/当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	650,774.74	1,441,512.26

注:支付基金托管人邮储银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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 0.05% / 当年天数。

7.4.5.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B	合计
新疆前海联合	8,627.62	129,596.68	138,224.30
合计	8,627.62	129,596.68	138,224.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B	合计
新疆前海联合	1,910.19	288,225.97	290,136.16
合计	1,910.19	288,225.97	290,136.16

注:支付基金销售机构的销售服务费,本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,B类基金份额的年销售服务费率为0.01%。基金销售服务费每日计提,按月支付给新疆前海联合,再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。销售服务费的计算公式为:

A类基金份额日销售服务费=前一日A类基金份额的基金资产净值 X 0.25%/当年天数。

B类基金份额日销售服务费=前一日B类基金份额的基金资产净值 X 0.01%/当年天数。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮储银行	–	–	–	–	341,040,000.00	132,914.06
上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮储银行	–	–	–	–	39,200,000.00	2,899.73

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B
基金合同生效日(2017年5月25日)持有的基金份额	–	10,000,000.00
期初持有的基金份额	–	32,232,023.34
期间申购/买入总份额	–	29,208,381.54
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	10,000,000.00
期末持有的基金份额	–	51,440,404.88
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	12.4100%
项目	上年度可比期间 2017年5月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	前海联合汇盈货币A	前海联合汇盈货币B
基金合同生效日(2017年5月25日)持有的基金份额	–	10,000,000.00
期初持有的基金份额	–	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	–	46,232,023.34
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	24,000,000.00
期末持有的基金份额	–	32,232,023.34
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	0.6127%

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入。

2、本基金管理人投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

7.4.5.4.2 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。

7.4.5.5 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12月31日 | | 上年度可比期间 2017年5月25日(基