新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2019年8月24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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	前海联合添惠纯债	
基金主代码	003174	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月10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	2,922,576,522.20份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合添惠纯债A	前海联合添惠纯债C
下属分级基金的交易代码:	003174	007038
报告期末下属分级基金的份额总额	2,922,544,998.26份	31,523.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。 2、债券投资组合策略 在债券组合的构建和调整上，本基金综合运用久期调整、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。 （1）久期调整策略 在全面分析宏观经济环境与政策趋向等因素的基础上，本基金将通过调整债券资产组合的久期，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降的风险带来的资本损失，并获得较高的再投资收益。 （2）期限结构配置策略 本基金在对宏观经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形态可能变化给予方向性的判断；同时根据收益率曲线的历史趋势、未来各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，预测收益率期限结构的变化形态，从而确定合理的组合期限结构。通过采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从而达到预期收益最大化的目的。 （3）类属资产配置策略 类属资产配置策略是指现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。类属配置主要根据各部分的相对价值确定，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属，从而获取较高的总回报。 （4）收益率曲线策略 收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。 （5）杠杆策略 杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。 3、行业配置策略 债券市场所涉及行业众多，同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生，本基金分别采用以下的分析策略： （1）分散化投资：发行人涉及众多行业，本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构，避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。 （2）行业投资：本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行业的债券。 4、信用债投资策略 本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对共票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。 债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金依据对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。 5、中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。 6、资产支持证券投资策略 当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	0571-88268688

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.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

§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

基金级别	前海联合添惠纯债A	前海联合添惠纯债C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日－2019年6月30日)
本期已实现收益	63,516,487.69	715.84
本期利润	77,644,287.49	576.47
加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0099
本期基金份额净值增长率	2.27%	0.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0419	0.0626
期末基金资产净值	3,104,809,511.71	33,497.88
期末基金份额净值	1.0624	1.0626

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、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、本基金自2019年2月22日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。

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

前海联合添惠纯债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.47%	0.03%	0.23%	0.01%	0.24%	0.02%
过去三个月	0.66%	0.06%	0.68%	0.01%	－0.02%	0.05%
过去六个月	2.27%	0.06%	1.37%	0.01%	0.90%	0.05%
过去一年	5.21%	0.05%	2.78%	0.01%	2.43%	0.04%
自基金合同生效起至今	6.24%	0.05%	3.41%	0.01%	2.83%	0.04%

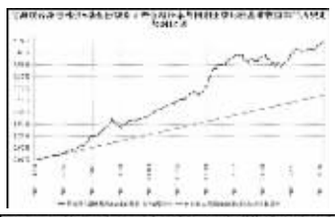
前海联合添惠纯债C

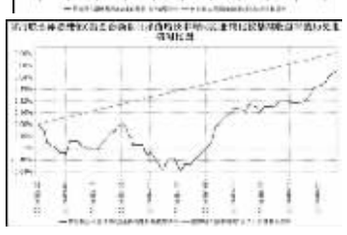
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.46%	0.02%	0.23%	0.01%	0.23%	0.01%
过去三个月	0.70%	0.06%	0.68%	0.01%	0.02%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.71%	0.06%	0.97%	0.01%	－0.26%	0.05%

注:1、本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%。

2、本基金自2019年2月22日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。

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





注:1、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。

2、本基金自2019年2月22日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。前海联合添惠纯债C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起始日为2019年2月22日。

§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22只开放式基金，包括2只货币市场基金、10只债券型基金、9只混合型基金和1只指数型基金，另管理11只专户理财产品，管理资产总规模超过341亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雅洁	本基金的基金经理	2018年4月10日	－	9年	张雅洁女士，悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士，9年证券基金投资研究经验。2013年6月至2015年9月在博时基金从事固定收益研究和投资工作，曾担任博时上证企债30ETF等基金的基金经理助理，2010年2月至2013年5月在融通基金从事信用债研究工作。2015年9月加入前海联合基金，现任前海联合永兴纯债兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添鑫定开债券、前海联合添和纯债、前海联合添惠纯债、前海联合泳祺纯债、前海联合泳盛纯债和前海联合泳益纯债的基金经理。

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

2019年1季度货币政策逐步呈现边际收紧的态势，在春节前后的宏观政策变动和中美贸易谈判进展的真空期，债券市场收益率借着过节资金充裕的东风一路下行，透支了未来经济增长略显疲弱以及降准的预期。随后2季度社融数据有所改善，资金面也回到中性宽裕的局面，债券资产进入较大幅度的市场调整期。直到5月下旬包商银行事件冲击后，信用风险溢价抬升带动利差走扩，市场机构投资者的风险偏好下降，在央行金融维稳的主导下货币资金价格创下今年以来的新低。与此同时，经济增长的数据较1季度有所回落，在基本面和资金面的双轮驱动下，带动6月以来利率债收益率曲线呈现的牛陡走势。

本基金在上半年维持高评级短久期的策略，通过持有商业银行债获取底仓票息收益，再辅以中久期利率债的波段交易，以实现通过资本利得增厚基金收益的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合添惠纯债A基金份额净值为1.0624元，本报告期基金份额净值增长率为2.27%，同期业绩比较基准收益率为1.37%;截至本报告期末前海联合添惠纯债C基金份额净值为1.0626元，本报告期基金份额净值增长率为0.71%，同期业绩比较基准收益率为0.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看债市:在包商银行事件后，货币政策承担了维持金融和社会稳定的重任，难以在短期内主动收紧;而国内财政政策对经济增速放缓的容忍度加大，暂无强刺激的动力和必要;同时通胀压力趋稳，短期内的基本面利空较少。

考虑到目前短端绝对收益率已经较低，长端资产在修复行情后继续下行的阻力也再次出现;预计在下半年，中端资产在市场多方力量博弈不明朗的环境下，突显出攻守兼备的配置和交易的相对吸引力。而在信用分层的债券市场中寻找AA+和AAA的合理利差，增持包商银行事件冲击中估值受损的普金债，通过微调提高组合静态收益将有助于控制组合在债市波动时的回撤幅度。

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会计凭证、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人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对;每日估值结果必须与托管人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

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添惠纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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，新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在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，新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金2019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:新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	547,867.54	549,258.45
结算备付金	－	－
存出保证金	－	－
交易性金融资产	4,018,584,000.00	4,676,742,000.00
其中:股票投资	－	－
基金投资	－	－
债券投资	4,018,584,000.00	4,676,742,000.00
资产支持证券投资	－	－
贵金属投资	－	－
衍生金融资产	－	－
买入返售金融资产	－	－
应收证券清算款	－	－
应收利息	72,398,188.61	48,841,708.48
应收股利	－	－
应收申购款	－	－
递延所得税资产	－	－
其他资产	－	－
资产总计	4,091,530,056.15	4,726,132,966.93
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	984,862,682.69	1,141,705,007.41
应付证券清算款	－	－
应付赎回款	－	105,807,827.43
应付管理人报酬	849,741.74	918,312.38
应付托管费	283,247.27	306,104.12
应付销售服务费	2.57	－
应付交易费用	25,801.34	72,324.94
应交税费	8,837.14	9,131.71
应付利息	553,499.56	1,378,710.60
应付利润	－	－
递延所得税负债	－	－
其他负债	103,234.25	219,435.30
负债合计	986,687,046.56	1,250,416,853.89
所有者权益:		
实收基金	2,922,576,522.20	3,345,883,725.33
未分配利润	182,266,487.39	129,832,387.71
所有者权益合计	3,104,843,009.59	3,475,716,113.04
负债和所有者权益总计	4,091,530,056.15	4,726,132,966.93

注:报告截止日2019年6月30日，前海联合添惠纯债A基金份额净值1.0624元，基金份额总额2,922,544,998.26份;前海联合添惠纯债C基金份额净值1.0626元，基金份额总额31,523.94份。前海联合添惠纯债份额总额合计为2,922,576,522.20份。

6.2 利润表

会计主体:新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月10日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	101,073,547.93	2,368,236.87
1.利息收入	83,679,407.64	1,690,114.91
其中:存款利息收入	7,005.22	863,026.95
债券利息收入	83,611,479.98	504,164.08
资产支持证券利息收入	－	－
买入返售金融资产收入	60,922.44	322,923.88
其他利息收入	－	－
2.投资收益（损失以"－"填列）	3,156,328.87	－1,148.60
其中:股票投资收益	－	－
基金投资收益	－	－
债券投资收益	3,156,328.87	－1,148.60
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）	14,127,660.43	679,270.00
4.汇兑收益（损失以"－"号填列）	－	－
5.其他收入（损失以"－"号填列）	110,150.99	0.56
减:二、费用	23,428,683.97	307,600.16
1. 管理人报酬	5,184,524.37	201,378.85
2. 托管费	1,728,174.82	57,015.66
3. 销售服务费	20.23	－
4. 交易费用	7,825.00	1,979.09
5. 利息支出	16,380,592.70	4,033.45
其中:卖出回购金融资产支出	16,380,592.70	4,033.45
6. 税金及附加	5,712.60	－
7. 其他费用	121,834.25	43,193.11
三、利润总额（亏损总额以"－"号填列）	77,644,863.96	2,060,636.71
减:所得税费用	－	－
四、净利润（净亏损以"－"号填列）	77,644,863.96	2,060,636.71

注:本基金的基金合同生效日为2018年4月10日，上年度可比期间为2018年4月10日（基金合同生效日）到2018年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	3,345,883,725.33	129,832,387.71	3,475,716,113.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	77,644,863.96	77,644,863.96
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）	－423,307,203.13	－25,210,764.28	－448,517,967.41
其中:1. 基金申购款	665,363.11	36,871.86	702,234.97
2.基金赎回款	－423,972,566.24	－25,247,636.14	－449,220,202.38
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）	2,922,576,522.20	182,266,487.39	3,104,843,009.59
项目	上年度可比期间 2018年4月10日(基金合同生效日)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）	210,562,297.08	－	210,562,297.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	2,060,636.71	2,060,636.71
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）	－2,203.55	－13.74	－2,217.29
其中:1. 基金申购款	1.97	0.01	1.98
2.基金赎回款	－2,205.52	－13.75	－2,219.27
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）	210,560,093.53	2,060,622.97	212,620,716.50

注:本基金的基金合同生效日为2018年4月10日，上年度可比期间为2018年4月10日（基金合同生效日）到2018年6月30日。

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_____ _____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")根据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]1287号《关于准予新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金注册的批复》、机构部函[2017]708号《关于新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金延期募集备案的回函》和机构部函[2018]13号《关于同意新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金延期募集备案的函》进行募集，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《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币210,509,646.44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0084号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年4月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为210,562,297.08份基金份额，其中认购资金利息折合 52,650.64 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。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将本基金分设A类和C类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，本基金的A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书中列示。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%。

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》、《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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 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。

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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
浙商银行股份有限公司（"浙商银行"）	基金托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月10日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,184,524.37	201,378.85
其中:支付销售机构的客户维护费	45.59	－

注:根据基金合同，支付基金管理人新疆前海联合基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提。根据基金份额持有人大会决议，自2018年5月16日起，管理费率降至0.30%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为:

2018年4月10日－2018年5月15日:日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

2018年5月16日起:日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月10日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,728,174.82	57,015.66

注:根据基金合同，支付基金托管人浙商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提。根据基金份额持有人大会决议，自2018年5月16日起，托管费率降至0.10%逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为:

2018年4月10日－2018年5月15日:日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

2018年5月16日起:日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添惠纯债A	前海联合添惠纯债C	合计
新疆前海联合	－	0.19	0.19
合计	－	0.19	0.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年4月10日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添惠纯债A	前海联合添惠纯债C	合计
合计	－	－	－

注:1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金份额销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下:

H＝E×0.10%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

2、本基金自2019年2月22日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码。

6.4.8.3 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 2019年1月1日至2019年6月30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