新疆前海联合添鑫一年定期开放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	前海联合添鑫定开债券	
基金主代码	003471	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年5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	
报告期末基金份额总额	102,338,947.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合添鑫定开债券A	前海联合添鑫定开债券C
下属分级基金的交易代码:	003471	003472
报告期末下属分级基金的份额总额	7,859,339.29份	94,479,608.40份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.封闭期投资策略 (1)资产配置策略 本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。 (2)债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法, 力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 1)利率预期策略 基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据, 分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势, 在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。开根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。 2)收益率曲线配置策略 收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略, 必须先预测收益率曲线变动的方向,然后根据收益率曲线形状变动的情景分析,构建组合的期限机构。 3)可转债投资策略 本基金将对发行公司的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等,并参考同类公司的估值水平,判断可转换债券的股权投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析, 判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券的内嵌期权价值。 综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。基金将通过定性和定量相结合的方法对有较好盈利能力或成长前景的上市公司发行的可转债进行重点选择,同时密切跟踪上市公司的经营状况,从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面确认上市公司的转股意愿,以选择安全性和收益性俱佳的投资品种。本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果,积极参与可转债新券的申购。 4)可交换债券投资策略 可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司(以下简称“目标公司”)的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中,债券特性与可转换债券相同,指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。 (3)股票投资策略 本基金采取自下而上的个股精选策略,以深入的基本面研究为基础,精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票。自下而上的投资策略相信,无论经济环境或行业环境如何变化,总是有一些个股能超越市场表现,获得高于市场平均水平的回报。因而,自下而上的研究方法,就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。在行业配置方面,本基金管理人将根据宏观经济形式对行业配置进行动态调整。 (4)权证投资策略 本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平, 主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。 基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。 (5)中小企业私募债券投资策略 对于中小企业私募债券,本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素,以及对基金资产流动性的影响,在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上,进行投资决策。 (6)国债期货投资策略 本基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率,更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。 (7)资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究, 预测资产池未来现金流变化; 研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线变动、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 2、开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下, 将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型基金,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	0571-88268888

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	前海联合添鑫定开债券A	前海联合添鑫定开债券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	-7,669,242.80	2,166.48
本期利润	5,792,543.20	-1,024.87
加权平均基金份额本期利润	0.0136	-0.0012
本期基金份额净值增长率	9.49%	6.88%
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	0.1006	0.0700
期末基金资产净值	8,650,221.00	101,090,221.08
期末基金份额净值	1.1006	1.0700

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合添鑫定开债券A

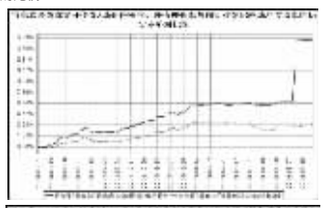
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.27%	0.99%	0.28%	0.03%	7.99%	0.96%
过去三个月	8.29%	0.59%	-0.24%	0.06%	8.53%	0.53%
过去六个月	9.49%	0.42%	0.24%	0.06%	9.25%	0.36%
过去一年	13.88%	0.30%	2.82%	0.06%	11.06%	0.24%
自基金合同生效起至今	15.10%	0.29%	3.11%	0.06%	11.99%	0.23%

前海联合添鑫定开债券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	5.94%	0.78%	0.28%	0.03%	5.66%	0.75%
过去三个月	5.87%	0.46%	-0.24%	0.06%	6.11%	0.40%
过去六个月	6.88%	0.33%	0.24%	0.06%	6.64%	0.27%
过去一年	10.80%	0.24%	2.82%	0.06%	7.98%	0.18%
自基金合同生效起至今	11.92%	0.23%	3.11%	0.06%	8.81%	0.17%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

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、本基金由原新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金于2018年5月31日转型而来。

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。

§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	2016年10月18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,现任前海联合添鑫定开债券兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添和纯债、前海联合永兴纯债、前海联合添惠纯债、前海联合冰棋纯债、前海联合冰盛纯债和前海联合冰益纯债的基金经理。
敬夏玺	本基金的基金经理	2016年11月2日	-	8年	敬夏玺先生,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。2010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。现任前海联合添鑫定开债券兼前海联合添利债券、前海联合汇盈货币、前海联合泓元定开债券、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。

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年上半年,国内经济基本面表现出很强的韧性,整体仍然保持稳中向好的态势,在积极的财政政策和稳健的货币政策环境下,上半年GDP实现了6.3%的增速,保持在合理区间运行,但在全球贸易摩擦不断不全球经济增长放缓预期下,我国的经济增长和就业稳定也面临着不小的考验。从资本市场的表现来看,权益市场较去年出现了明显的上涨,反映了基本面的回暖,同时也是市场制度不断完善、投资者风险偏好回升的表现,债券市场窄幅波动、收益率基本走平,也是对经济基本面审慎乐观的一种表现。 本基金上半年延续了去年较高的利率债仓位,并择机逐步提升转债和股票的持仓,以博取风险市场带来的超额收益。

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鑫定开债券A基金份额净值为1.1006元,本报告期基金份额净值增长率为9.49%;截至本报告期末前海联合添鑫定开债券C基金份额净值为1.0700元,本报告期基金份额净值增长率为6.88%;同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们预计在内外部复杂经济环境下,国内经济面临稳增长和保就业的压力可能较上半年大,因此政策对经济的托底在短期内仍然难以退出,财政政策会继续保持积极,货币环境有望保持中性偏宽松,我们仍预计债券市场全年将会维持上有顶下有底的区间震荡走势,但趋势上会较上半年乐观。而权益市场受益于基本面的托底政策和市场制度的完善,仍然会有结构性机会,我们也将在转债和股票上维持一定仓位,以博取超额收益,同时我们会密切关注内部基本面的各项指标以及外部环境的变化,对本基金投资策略做出适时的调整。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至报告期末,本基金可供分配利润为7,401,494.39 元。报告期内,本基金的基金管理人于2019年1月4日公告2019年度第一次分红,向截至2019年1月7日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.11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添鑫一年定期开放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,新疆前海联合添鑫一年定期开放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鑫一年定期开放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,新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金进行了1次利润分配, 分配金额为5,546,912.08元。

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鑫一年定期开放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:新疆前海联合添鑫一年定期开放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	614,838.31	1,417,742.86
结算备付金	-	54,545.45
存出保证金	-	-
交易性金融资产	6,577,197.30	487,794,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	6,577,197.30	487,794,000.00
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	-	110,890,551.34
应收证券清算款	3,059,508.04	-
应收利息	27,314.38	11,751,743.06
应收股利	-	-
应收申购款	100,825,192.66	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	111,104,050.69	611,908,582.71
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	-	98,999,731.50
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,247,891.25	-
应付管理人报酬	15,413.96	130,079.71
应付托管费	5,137.98	43,359.90
应付销售服务费	2,391.49	0.31
应付交易费用	5,311.46	1,822.90
应交税费	-	2,194.30
应付利息	-	92,977.29
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	87,462.47	205,000.00
负债合计	1,363,608.61	99,475,165.91
所有者权益:		
实收基金	102,338,947.69	504,264,760.23
未分配利润	7,401,494.39	8,168,656.57
所有者权益合计	109,740,442.08	512,433,416.80
负债和所有者权益总计	111,104,050.69	611,908,582.71

注:报告截止日2019年6月30日,前海联合添鑫定开债券A基金份额净值1.1006元,基金份额总额7,859,339.29份;前海联合添鑫定开债券C基金份额净值1.0700元,基金份额总额94,479,608.40份。前海联合添鑫定开债券份额总额合计为102,338,947.69份。

6.2 利润表

会计主体:新疆前海联合添鑫一年定期开放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5月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	6,869,943.87	5,655,497.95
1.利息收入	6,754,548.49	1,672,017.95
其中:存款利息收入	55,582.05	3,470.23
债券利息收入	6,062,083.09	1,605,804.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	636,883.35	62,743.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-13,350,319.70	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-13,350,319.70	-
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)	13,458,594.65	3,983,480.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7,120.43	-
减:二、费用	1,078,425.54	414,607.04
1.管理人报酬	649,992.32	125,251.18
2.托管费	216,664.06	41,750.38
3.销售服务费	2,393.00	0.31
4.交易费用	4,381.34	-
5.利息支出	98,982.94	231,918.44
其中:卖出回购金融资产支出	98,982.94	231,918.44
6.税金及附加	986.83	823.78
7.其他费用	105,025.05	14,862.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	5,791,518.33	5,240,890.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	5,791,518.33	5,240,890.91

注:本基金的基金合同生效日为2018年5月31日,上年度可比期间为2018年5月31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:新疆前海联合添鑫一年定期开放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)	504,264,760.23	8,168,656.57	512,433,416.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,791,518.33	5,791,518.33
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)	-401,925,812.54	-1,011,768.43	-402,937,580.97
其中:1.基金申购款	104,459,725.18	7,593,581.01	112,053,306.19
2.基金赎回款	-506,385,537.72	-8,605,349.44	-514,990,887.16
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)	-	-5,546,912.08	-5,546,912.08
五、期末所有者权益(基金净值)	102,338,947.69	7,401,494.39	109,740,442.08
项目	上年度可比期间 2018年5月31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)	504,264,735.52	-13,525,270.65	490,739,464.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,240,890.91	5,240,890.91
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)	24.64	-0.74	23.90
其中:1.基金申购款	24.64	-0.74	23.90
2.基金赎回款	-	-	-
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)	504,264,760.16	-8,284,380.48	495,980,379.68

注:本基金的基金合同生效日为2018年5月31日,上年度可比期间为2018年5月31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

新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)变更而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1821号《关于准予新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金注册的批复》核准,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,030,086.76元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1305号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》于2016年10月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,030,093.35份基金份额,其中认购资金利息折合6.59份基金份额。原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。

原基金基金份额持有人大会自2018年4月3日至2018年4月27日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,并报中国证监会备案。根据原基金基金份额持有人大会决议,《新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自2018年5月31日生效,同时《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》失效,新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金正式变更为新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金。本基金为契约型开放式,存续期限不定,原基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为490,739,464.87元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。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《新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即以封闭期内封闭运作和封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)至12个月对应日的前一日止。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)至12个月对应日的前一日止。首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)至12个月对应日的前一日止,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上最长不超过20个工作日,最短不少于5个工作日。基金管理人应在每个封闭期结束前公布开放期和下一封闭期的具体时间安排。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券等)、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、国债期货、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:在封闭期内,本基金投资于债券产的比例不低本基金投资于债券产的比例不低基金资产的80%,股票、权证等资产比例不超过基金的20%,其中权证占基金资产净值的比例为0%-3%。但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期及结束后1个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。每个交易日终在扣除国债期货合约需缴纳的易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内政府债券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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但在每个交易日终,扣除国债期货合约需缴纳的交保证金后应当持不低于一倍的现金。其中现金不包括结算备付、存出保证及应收申购款等。本基金业绩比较准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

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

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》、《新疆前海联合添鑫一年定期开放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年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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[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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 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”