新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第1号)

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

【重要提示】

新疆前海联合海盈货币市场基金(以下简称"本基金")募集的准予注册文件名称为:《关于准予新疆前海联合海盈货币市场基金注册的批复》(证监许可【2015】2800号),注册日期为:2015年12月1日。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于货币市场工具,基金收益受货币市场流动性及货币市场利率波动的影响较大,因此,本基金可能面临流动性风险以及金融市场利率波动的风险。投资本基金的风险还包括但不限于:市场风险、管理风险、职业道德风险、信用风险、合规性风险等。

本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,自主、谨慎做出投资决策,自行承担投资风险。投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本招募说明书所载内容截止日为2017年12月24日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:新疆前海联合基金管理有限公司
住所: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
设立日期:2015年8月7日
法定代表人:王晓耕
办公地址:广东省深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼
电话:0755-23695816
联系人:马运佳

基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2015】1842号文核准设立,注册资本为20000万元人民币。目前的股权结构为:深圳市钜盛华股份有限公司占30%、深圳粤商物流有限公司占25%、深圳市深粤控股股份有限公司占25%、凯信恒有限公司占20%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员基本情况

公司董事会共有6名成员,其中3名独立董事。

黄炜先生,董事长,硕士学历。1997年7月至2002年5月在工商银行广东省分行工作,担任信贷部副经理;2002年5月至2013年11月在工商银行深圳分行工作,担任机构业务部总经理,现任新疆能源产业基金(管理)有限公司董事长。2015年7月至今,任公司董事长。

孙磊先生,董事,硕士学历。曾先后任职于中国工商银行深圳红围支行、中国工商银行深圳市分行投资银行部、中信银行长沙分行投资银行部,现任杭州新天地集团有限公司董事长。2015年7月至今,任公司董事。

王晓耕女士,董事,硕士学历。曾先后任职于深圳发展银行总行国际部、大鹏证券有限责任公司经纪业务总部、《新财富》杂志社,2009年1月起担任五矿证券有限责任公司副总经理,2015年1月任新疆前海联合基金管理有限公司筹备组负责人,现任公司总经理。2015年7月至今任公司总经理、董事。

孙学致先生,独立董事,博士学历。历任吉林大学法学院教授、副院长,吉林省高级人民法院庭长助理,现任吉林功承律师事务所创始合伙人。2015年7月至今,任公司独立董事。

张东成先生,独立董事,硕士学历。1994年取得律师执业资格。曾先后任职于华夏证券和中国国际金融有限公司投行部门,以及东方昆仑律师事务所、国浩律师事务所及金杜律师事务所;现任加拿大高林律师事务所顾问。2015年7月至今,任公司独立董事。

冯梅女士,独立董事,博士学历。历任山西高校联合出版社编辑,山西财经大学副教授、中国电子信息产业发展研究院研究员、北京工商大学教授,现任北京科技大学教授。2015年7月至今,任公司独立董事。

2、监事基本情况

公司不设监事会,设监事2名。

宋粤霞女士,监事,硕士学历。历任深圳市金鹏会计师事务所文员、中国平安保险股份有限公司会计、深圳市足球俱乐部财务主管。现任凯信恒有限公司总经理、执行(常务)董事。2015年7月至今,任公司监事。

赵伟先生,监事,硕士学历。历任深圳证券通信有限公司增值业务部项目经理、中国UNIX用户协会信息技术部项目经理和厦门南鹏电子有限公司产品研发部软件工程师。现任新疆前海联合基金管理有限公司运营管理部IT经理。2016年4月至今,任公司监事。

3、公司高级管理人员

王晓耕女士,董事,总经理,简历参见董事会成员基本情况。

李华先生,督察长,硕士学历。历任北京大学经济管理系讲师、广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估有限公司董事长、天一证券有限公司华南业务总部总经理、融通基金管理有限公司监察稽核部总监、监事。2015年7月至今,任公司督察长。

刘菲先生,总经理助理,学士学历。先后任职于中国农业银行三峡分行电脑部、中国银河证券宜昌新世纪营业部电脑部、国泰君安证券深圳蔡屋围营业部电脑部、博时基金管理有限公司信息技术部等,2007年6月至2015年4月任融通基金管理有限公司信息技术部总监。2015年5月至今,任公司总经理助理。

4、本基金基金经理

张雅洁女士,悉尼大学及中央昆士兰大学金融学与会计学双硕士,8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,现任新疆前海联合海盈货币(2015年12月24日至今)兼前海联合添鑫债券(2016年10月18日至今)、前海联合添利债券(2016年11月11日至今)、前海联合添和纯债(2016年12月7日至今)和前海联合永兴纯债(2017年8月14日至今)的基金经理。

敬夏玺先生,中央财经大学金融学硕士,7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,现任新疆前海联合海盈货币(2016年8月18日至今)兼前海联合添鑫债券(2016年11月2日至今)、前海联合添利债券(2016年11月17日至今)、前海联合汇盈货币(2017年5月25日至今)和前海联合泓元定开债券(2017年12月6日至今)的基金经理。

曾婷婷女士,北京大学硕士、中山大学双学士,CPA,6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,现任新疆前海联合海盈货币(2016年9月5日至今)兼前海联合汇盈货币(2017年7月3日至今)的基金经理。

5、基金管理人投资决策委员

公司投资决策委员会包括:总经理王晓耕女士,基金经理林材先生,基金经理王静女士,基金经理张雅洁女士,总经理助理刘菲先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1、基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号(100032)
法定代表人:易会满
电话:010-66105799
传真:010-66105798
联系人:郭明
成立时间:1984年1月1日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币35,640,625.71万元
基金托管业务批准文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

2、主要人员情况

截至2017年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工218人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年6月,中国工商银行共托管证券投资基金745只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的53项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

(二)基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部"一手抓业务拓展,一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后,2015年、2016年中国工商银行资产托管部均通过ISAE3402(原SAS70)审阅,迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立"以人为本"的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1、直销机构

(1)前海联合基金网上交易平台
交易网站:www.qhlhfund.com
客服电话:400-640-0099

(2)前海联合基金直销交易平台
新疆前海联合基金管理有限公司
住所: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
法定代表人:王晓耕
办公地址:深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼
电话:0755-82785257
传真:0755-82788000
客服电话:400-640-0099
联系人:黄毅

2、其他基金销售机构情况

(1)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
电话:021-23219275
传真:021-23219000
联系人:李笑鸣
网址:http://www.htsec.com

(2)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层
法定代表人:李梅
电话:021-33388229
传真:021-33388224
联系人:李玉婷
网址:www.swhysc.com

(3)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
电话:0991-2307105
传真:0991-2301927
联系人:王怀春
网址:www.hysec.com

(4)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:李福春
电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
联系人:安岩岩
客户服务电话:4006-000-686
网址:www.nesc.cn

(5)上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
电话:021-54509998
传真:021-64385308
联系人:黄妮娟
网址:fund.eastmoney.com

(6)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号西裙楼
法定代表人:胡学勤电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:400-866-6618
联系人:程晨
网址:www.lu.com

(7)深圳众禄金融控股股份有限公司
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客服电话:4006-788-887
联系人:童彩平
网址:www.jjmmw.com

(8)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人:张冠宇
电话:010-85870662
传真:010-59200800
客服电话:400-819-9858
联系人:刘美薇
网址:www.datangwealth.com

(9)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区长阳路1687号2号楼
法定代表人:汪静波
电话:021-80359115
传真:021-80359611
客服电话:400-821-5399
联系人:李娟
网址:www.noah-fund.com

(10)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
电话:021-20324154
传真:021-20324199
客服电话:400-928-2266
联系人:张缘
网址:http://www.dtfunds.com

(11)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼b1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
联系人:钟琛
网址:www.yingmi.cn

(12)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-20613999
传真:021-68596919
客服电话:4007-006-665
联系人:陆敏
网址:www.ehowbuy.com

(13)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
电话:021-80365020
传真:021-63332523
客服电话:4006-433-389
联系人:葛佳蕊
网址:www.lingxianfund.com

(14)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
电话:010-56580660
传真:010-56580666
客服电话:400-618-0707
联系人:陈铭洲
网址:www.hongdianfund.com

(15)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
电话:88312877
传真:88312877
客户服务电话:400-001-1566
联系人:段京璐
网址:www.yilucaifu.com

(16)深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:刘鹏宇
电话:0755-83999907
传真:0755-83999926
联系人:刘勇
客服电话:0755-83999913
网址:www.jinqianwo.cn

(17)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人:张冠宇
电话:010-58845312
传真:010-58845306
联系人:张鼎
客户服务电话:400-898-0618
网址:www.chtfund.com

(18)上海万得投资顾问有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人:王廷富
电话:021-51327185
传真:021-50710161
联系人:徐亚丹

(19)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
电话:010-83363101
传真:010-83363072
联系人:文雯
公司网站:www.new-rand.cn 或 www.jrj.com.cn

(20)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
电话:010-56282140
传真:010-62680827
联系人:丁向坤
网址:www.fundzone.cn

(21)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汗青
联系电话:025-66996699-887226
联系人:王锋
网址:http://jinrong.suning.com/

(22)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座
办公地址:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座
法定代表人:庞介民
电话:0471-4972675
联系人:熊丽
网址:http://www.cnht.com.cn/

(23)中信建投证券股份有限公司
乙方:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
电话:010-85156310
传真:010-65182261
联系人:刘芸
网址:http://www.csc108.com

(24)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:陈灿辉
电话:021-38784818
传真:021-68774818
联系人:陈媛
网址:www.shhxzq.com

(25)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:李兴春
电话:021-61101685
传真:021-50583633
联系人:陈孜明
网址:www.leadfound.com.cn

(26)深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
电话:0755-66892301
传真:0755-84034477
联系人:张烨
网站:www.jfzinv.com

(27)南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人:宋时琳
电话:(025)86853969
传真:(025)86853969
联系人:王旋
网址:http://jr.tuniu.com

(28)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:010-85650628
传真:010-65884788
联系人:刘洋
网址:www.hexun.com

(29)名称:北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:江卉
电话:4000988511/ 4000888816
传真:010-89188000
联系人:徐伯宇
网址:http://kenterui.jd.com

(30)北京晟视天下投资管理有限公司
住所:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21层&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:徐晓荣
电话:010-58170876
传真:010-58170800

(31)济安财富(北京)资本管理有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65330699济安财富

(32)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶捷
注册资本:2208万元人民币
联系人:徐淼
电话:027-87006009-8015
传真:027-87006010

(33)奕丰金融服务(深圳)有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460500
传真:0755-21674453

(34)深圳市小牛投资咨询有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼
法定代表人:梁明锋
联系人:黄碧莲
电话:0755-32981999
传真:0755- 32981999-8001

(35)天津万家财富资产管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
联系人:邵玉磊
电话:18511290872
传真:010-59013707

(36)招商证券股份有限公司
住所:深圳市益田路江苏大厦38-46层
办公地址:深圳市益田路江苏大厦38-46层
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167

(37)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:深圳市益田路江苏大厦38-46层
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
电话:010-83574507
传真:010-83574807

(38)山西证券股份有限公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619

(39)平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:曹实凡
联系人:石静武
电话:021-38631117
传真:021-58991896

(40)中泰证券股份有限公司
住所:济南市市中区经七路86号
办公地址:济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
电话;021-20315290
传真:0531-68889095

(41)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52822063
传真:021-52975270

基金管理人可根据有关法律法规的要求,变更、调整本基金的销售机构,并及时公告。

(二)登记机构

机构名称:新疆前海联合基金管理有限公司
住所: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
法定代表人:王晓耕
办公地址:深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼
电话:0755-82786790
传真:0755-82789277
客服电话:400-640-0099
联系人:黄嘉宇

(三)律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华
电话:021-31358666
传真:021-31358600

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: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
办公地址: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
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:陈玲、俞伟敏

四、基金的名称

新疆前海联合海盈货币市场基金

五、基金的类型

货币市场基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

(一)基金的投资目标

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。

(二)投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:现金,通知存款,期限在一年以内(含一年)的银行存款,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的同业存单,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券,剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,剩余期限在397天以内(含397天)的非金融企业债务融资工具,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的条件下,履行适当程序后,本基金可参与其他金融工具的投资,不需召开基金份额持有人大会审议。具体投资比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

(三)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

本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、市场供需结构变化和短期资金面扰动等因素的综合分析,优先考虑安全性和流动性因素,根据各类资产的信用风险、流动性风险及经风险调整后的收益率水平,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。

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基准利率的走势及合理中枢。再结合利率债目前的收益率曲线形态以及期限利差所在历史分位来动态调整所投标的。

3、信用债投资策略

信用债的表现受到基准利率及信用利差两方面影响。本基金对于信用债仓位、评级及期限的选择均建立在对经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险分析的基础上。个券分析方面,通过自下而上的研究方法分析发债主体所在行业的基本面情况,以及发债主体企业的实际偿债能力来控制投资组合信用风险。并结合当前市场的信用利差估值水平重点挖掘被低估的可投个券。本基金将通过分散化投资来规避行业和个券的集中信用风险暴露,提高组合收益。内部评级体系通过自上而下的宏观分析,以及定性和定量的企业偿债能力分析做到对发债主体信用风险的事前防范和事后跟踪,以达到信用风险可控的目标。

4、久期管理策略

本基金根据对未来短期利率走势的研判,满足货币基金资产的高流动性需求及其相关的投资比例规定,动态调整组合的久期。当预期市场短期利率上升时,本基金将通过提高剩余期限较短债券的投资比例来降低组合久期,以减少组合利率风险;当预期市场短期利率下降时,则通过提高剩余期限较长债券的投资比例来拉长久期,以获取债券价格上升的资本利得收益。

5、债券回购策略

在回购利率过高、流动性收紧等不宜加杠杆的市场环境下,本基金将降低杠杆投资比例。在对组合进行杠杆操作时,根据资金面宽松还是收紧的预期来调整正回购借入资金的期限。当预计资金面宽松程度未来有所下降时,进行长期限正回购操作,锁定融资成本。

6、流动性管理策略

本基金作为现金管理类工具,须保证资产的安全性和流动性,根据对持有人申购赎回情况的动态预测,调整组合中高流动性资产的权重;通过管理债券组合期限结构的分布,合理匹配基金的未来现金流。在确保流动性的前提下争取超额收益。

7、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、资产支持票据(ABN)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将对市场利率、偿债条款、对应资产池的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素进行定性分析,并辅助用蒙特卡洛模拟的数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值。

8、其他金融工具的投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向,一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资,本基金将在届时相应法律法规的框架内,根据对该金融工具的研究,制定符合本基金投资目标的投资策略,在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下,谨慎投资。

(四)投资限制

1、本基金不得投资于以下金融工具:

(1)股票、权证;

(2)可转换债券、可交换债券;

(3)信用等级在AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具;

(4)以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,已进入最后一个利率调整期的除外;

(5)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后,本基金不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,平均剩余存续期不得超过240天;

(2)本基金管理人管理的全部基金持有同一公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(3)除发生巨额赎回的情形、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外,本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%;

(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(5)本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单合计不得超过基金资产净值的20%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单合计不得超过基金资产净值的5%;

(6)本基金投资于有固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的30%,但投资于有存款期限,根据协议可提前支取的银行存款,不受此限制;

(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(8)本基金应投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(9)本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%;

(10)本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例,合计不得超过10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外;

(11)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%;

(12)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%;

(13)到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%;

(14)法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。

除上述第(1)、(8)、(11)项另有约定外,因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,在上述期间内,本基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,本基金可相应调整投资比例限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人可按照取消或调整后的规定修改基金合同,无需经基金份额持有人大会审议。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规和监管部门取消上述禁止性规定的,在适用于本基金的情况下,则本基金投资不再受相关限制。

(五)投资组合平均剩余期限计算方法

1、平均剩余期限(天)的计算公式如下:

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、银行定期存款、同业存单、债券、非金融企业债务融资工具、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券和中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

投资于金融工具产生的负债包括正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用"摊余成本法"计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价;贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

(1)银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天;证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;

(2)银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;有存款期限,根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款,剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算;

(3)回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

(4)中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算;

(5)买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限;

(6)买断式回购产生的待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

(7)组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

(8)对其它金融工具,本基金管理人将基于审慎原则,根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。

平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位,小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。

(六)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化,或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

(七)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。

(八)基金投资组合报告

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,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。本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	6,758,761,389.77	45.35
	其中:债券	6,758,761,389.77	45.35
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,301,515,158.61	35.57
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,812,800,344.54	18.87
4	其他资产	30,841,800.12	0.21
5	合计	14,903,918,693.04	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.96	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	79,299,641.05	0.54
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017年7月26日	24.26	发生巨额赎回	7月27日
2	2017年7月28日	27.24	发生巨额赎回	8月4日
3	2017年8月1日	22.95	发生巨额赎回	8月4日
4	2017年8月2日	30.39	发生巨额赎回	8月4日
5	2017年8月3日	26.62	发生巨额赎回	8月4日

3、基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

(2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	45.03	0.54
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.20	-
3	60天(含)-90天	16.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	22.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.38	0.54

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	778,630,542.62	5.25
	其中:政策性金融债	778,630,542.62	5.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,980,130,847.15	40.36
8	其他	-	-
9	合计	6,758,761,389.77	45.61
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,216,473.45	0.20

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111709383	17浦发银行CD383	9,000,000	890,809,454.32	6.01
2	111709384	17浦发银行CD384	6,000,000	587,117,926.73	3.96
3	111609436	16浦发CD436	2,500,000	249,050,128.48	1.68
4	170204	17国开04	2,300,000	229,197,817.34	1.55
5	111783417	17宁波银行CD160	2,000,000	198,737,516.01	1.34
6	111717209	17光大银行CD209	2,000,000	198,306,228.38	1.34
7	111716194	17上海银行CD194	2,000,000	198,299,138.64	1.34
8	111711402	17平安银行CD402	2,000,000	196,071,109.41	1.32
9	111714262	17江苏银行CD262	2,000,000	196,046,203.39	1.32
10	111785720	17河北银行CD089	2,000,000	195,615,349.64	1.32
10	111785712	17成都银行CD146	2,000,000	195,615,349.64	1.32
10	111785723	17贵阳银行CD144	2,000,000	195,615,349.64	1.32

7、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0766%
报告期内偏离度的最低值	-0.0100%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0348%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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十名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。

9、投资组合报告附注

(1)本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

(2)本基金投资的前十名证券的发行主体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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,549.51
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	30,767,089.68
4	应收申购款	47,160.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,841,800.12

(4)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,分项之和与合计项可能存在尾差。

八、基金的业绩

基金业绩截止日为2017年9月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。下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。

新疆前海联合海盈货币A

阶段	净值收益率①	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
自基金合同生效以来至2017年9月30日	5.3445%	0.0040%	0.6290%	0.0000%	4.7155%	0.0040%

新疆前海联合海盈货币B

阶段	净值收益率①	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
自基金合同生效以来至2017年9月30日	5.8158%	0.0040%	0.6290%	0.0000%	5.1868%	0.0040%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

九、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、证券账户开户费用、银行账户维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。

管理费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额不收取销售服务费,即销售服务费率为零,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。

A类基金份额的销售服务费的计算方法如下:

H=E×A类基金份额的年销售服务费率÷当年天数
H为每日A类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日A类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述"(一)基金费用的种类"中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金费率的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费服务费等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在中国证监会指定媒介公告并报中国证监会备案。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、备查文件

1、中国证监会准予本基金募集注册的文件;

2、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》;

3、《新疆前海联合海盈货币市场基金托管协议》;

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、中国证监会要求的其他文件。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书(更新)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2017年2月18日刊登的《新疆前海联合海盈货币市场基金招募说明书(更新)(2017年第1号)》进行了更新,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新,主要补充和更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据和基金业绩的截止日期;

2、对"基金管理人"相关信息进行了更新;

3、对"基金托管人"相关信息进行了更新;

4、对"相关服务机构"相关信息进行了更新;

5、对"基金的业绩"相关信息进行了更新;

6、对"基金的投资"相关信息进行了更新;

7、在"其他应披露事项"部分,列明了前次招募说明书公布以来的其他应披露事项;

8、对部分表述进行了调整。

新疆前海联合基金管理有限公司
二〇一八年二月二日