

新疆前海联合沪深300指数型
证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 日

新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型
证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

重要提示
基金管理人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法律责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年4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。

基金合同生效日期:2016年11月30日
报告期末基金资产净值:49,705,819.76份

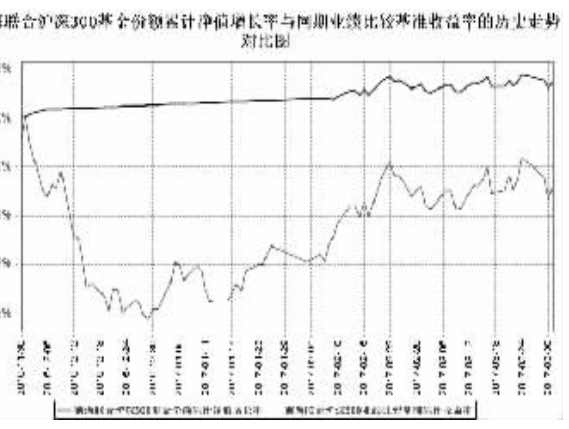
Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name) and 净值表现 (Performance). Rows include 前海联合沪深300, 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.

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。

§3.2 业绩比较基准
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



注:本基金的基金合同于2016年11月30日生效,截至本报告期末,本基金成立未满一年。按照基金合同和招募说明书的约定,本基金建仓期为6个月。截至本报告期末,建仓期尚未结束。

§4 基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table of Fund Managers with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term), 证券从业年限 (Experience), and 说明 (Remarks).

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”为根据公告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”分别指根据公告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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

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
报告期内,经济数据表现不俗,利率上行有限,改革措施陆续深化,一季度指数取得正收益,我们判断2017年经济整体保持平稳,企业盈利底部已初步探明,尽管后续改善速度可能有所下降,整体向下风险不大,局部结构改善可期。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.025元,份额累计净值为1.025元。报告期内,本基金份额净增长率为0.81%,同期业绩基准增长率为4.65%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table of Investment Portfolio with columns: 序号 (Serial No.), 项目 (Item), 金额(元) (Amount), and 占基金总资产的比例(%) (Percentage).

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

Table of Domestic Stock Portfolio by Industry with columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值(元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

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

5.3.1 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

Table of Top 10 Stocks by Fair Value with columns: 序号 (Serial No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.6 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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五名权证投资明细
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的股指期货和国债期货持仓和损益明细

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股库的股票。

5.13 其他资产构成

Table of Other Assets with columns: 序号 (Serial No.), 名称 (Name), and 金额(元) (Amount).

§6 开放式基金份额变动
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table of Major Shareholders with columns: 投资者类别 (Investor Type), 序号 (Serial No.), 持有基金份额比例(%) (Percentage), etc.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
王静女士于2017年3月20日被增聘为本基金基金经理,公告日期为2017年3月21日,公告标题为《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金经理变更公告》。

8.3 存放地点
8.4 查询方式

新疆前海联合基金管理有限公司 2017年4月21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:南京银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

重要提示
基金管理人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法律责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年4月19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。

基金合同生效日期:2016年11月30日
报告期末基金资产净值:49,172,002.17份

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name) and 净值表现 (Performance). Rows include 前海联合全民健康混合, 交易代码 (Trading Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

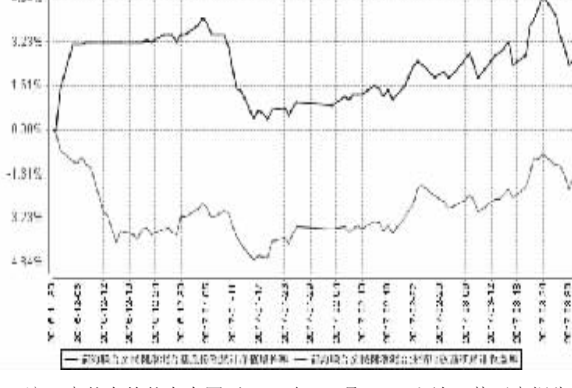
§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table of Key Financial Indicators with columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period).

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 业绩比较基准
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



注:本基金的基金合同于2016年11月30日生效,截至本报告期末,本基金成立未满一年。按照基金合同和招募说明书的约定,本基金建仓期为6个月。截至本报告期末,建仓期尚未结束。

§4 基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table of Fund Managers with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term), 证券从业年限 (Experience), and 说明 (Remarks).

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”为根据公告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”分别指根据公告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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

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
2017年一季度A股市场震荡上行,从大类资产配置角度来看,股市投资价值逐渐提升,市场呈现出显著的“政策相关”结构性机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.025元,份额累计净值为1.025元。报告期内,本基金份额净增长率为-0.97%,同期业绩基准增长率为1.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内本基金从2017年1月11日起至2017年3月5日止,连续33个交易日资产净值低于五千万元。本基金资产净值于2017年3月6日超过五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table of Investment Portfolio with columns: 序号 (Serial No.), 项目 (Item), 金额(元) (Amount), and 占基金总资产的比例(%) (Percentage).

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table of Domestic Stock Portfolio by Industry with columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值(元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

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

Table of Top 10 Stocks by Fair Value with columns: 序号 (Serial No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例(%) (Percentage).

5.4 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
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五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 报告期末本基金投资的股指期货和国债期货持仓和损益明细

5.12 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股库的股票。

5.13 其他资产构成

Table of Other Assets with columns: 序号 (Serial No.), 名称 (Name), and 金额(元) (Amount).

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.15 报告期末未持有处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动

Table of Open-Ended Fund Share Changes with columns: 报告期末基金份额总额 (Total Shares), 报告期基金份额变动 (Change), etc.

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table of Major Shareholders with columns: 投资者类别 (Investor Type), 序号 (Serial No.), 持有基金份额比例(%) (Percentage), etc.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金募集的核准;
2、《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金合同》;
3、《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;