

# 新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 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

送出日期：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人浙商股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 27 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。

本报告期自 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容.....	错误!未定义书签。
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
8.6 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.....	39

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	39
8.8 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贵金属投资明细 .....	39
8.9 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 .....	39
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
8.11 投资组合报告附注 .....	39
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	41
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
11.4 基金投资策略的改变 .....	42
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
11.8 其他重大事件 .....	43
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
13.1 备查文件目录 .....	45
13.2 存放地点 .....	45
13.3 查阅方式 .....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金	
基金简称	前海联合添鑫债券	
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	2016 年 10 月 18 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	504,287,022.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	前海联合添鑫债券 A	前海联合添鑫债券 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	504,284,791.45 份	2,230.83 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	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。
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，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	李华	陈方伟
	联系电话	0755-82780666	0571-88261139
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	chenfangwei@czbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95527
传真		0755-82780000	0571-87659965
注册地址		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	杭州市庆春路 288 号
办公地址		广东省深圳市福田区华富	杭州市庆春路 288 号

	路 1018 号中航中心 26 楼	
邮政编码	518031	310006
法定代表人	王晓耕	沈仁康

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qlhfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	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
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市福田区华富路 1018 号中航中心 26 楼

## § 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	2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	前海联合添鑫债券 A	前海联合添鑫债券 C
本期已实现收益	1,849,045.74	10.66
本期利润	-17,855,477.36	-121.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0495	-0.0435
本期加权平均净值利润率	-5.10%	-4.43%
本期基金份额净值增长率	-4.39%	-4.46%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配利润	-22,115,069.03	-99.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0439	-0.0446
期末基金资产净值	482,169,722.42	2,131.37
期末基金份额净值	0.9561	0.9554
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.39%	-4.46%

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

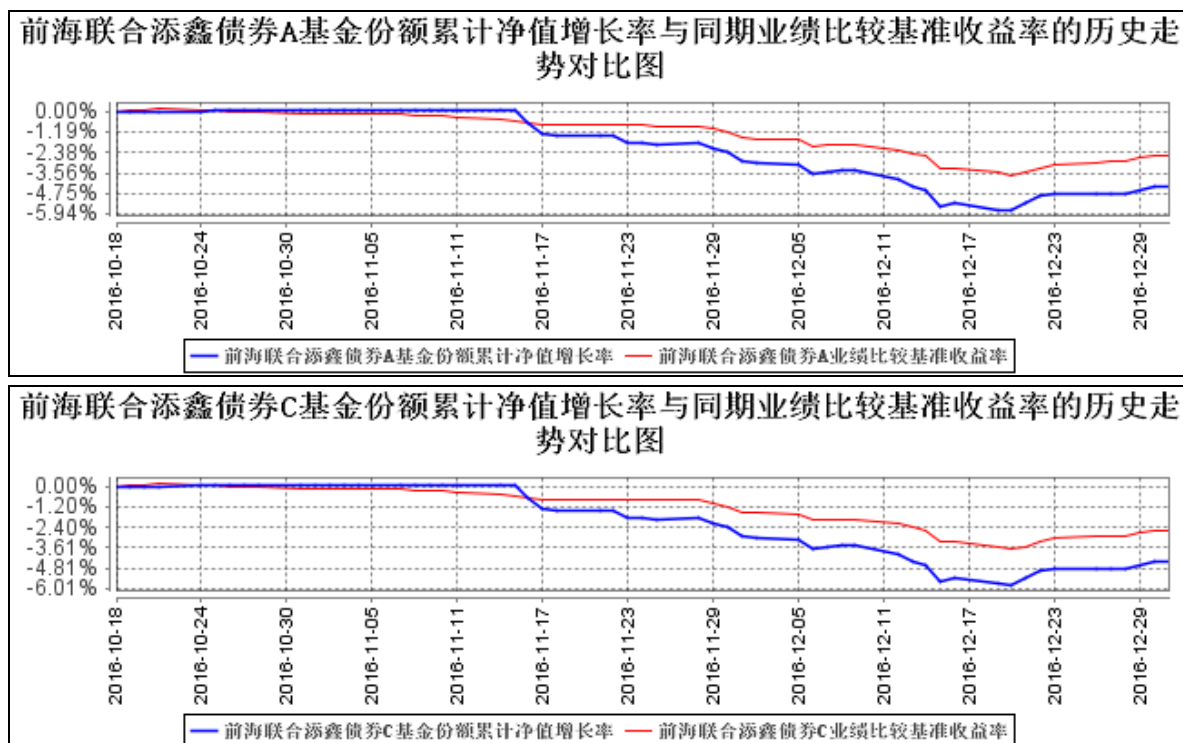
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-4.39%	0.27%	-2.54%	0.15%	-1.85%	0.12%

前海联合添鑫债券 C

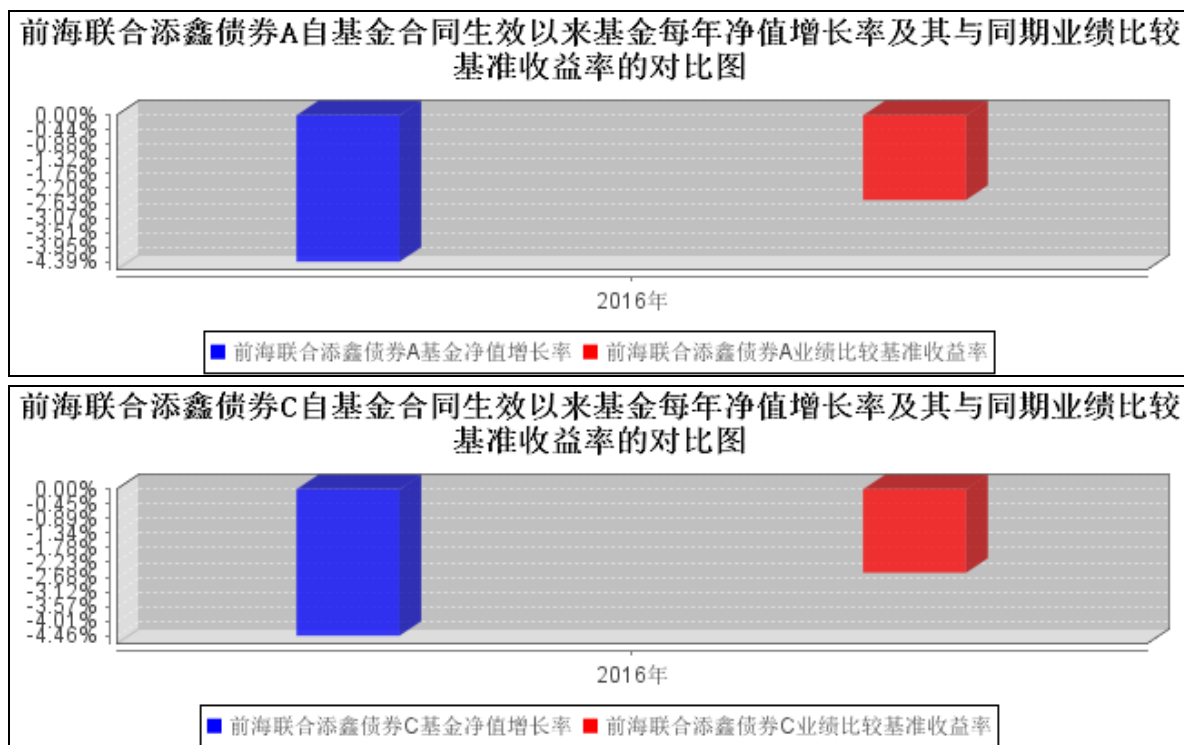
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-4.46%	0.27%	-2.54%	0.15%	-1.92%	0.12%

注：本基金的业绩表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



### 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 2016 年 10 月 18 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书说明书的约定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，建仓期尚未结束。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 8 只开放式基金，包括 1 只货币市场基金、3 只债券型基金、3 只混合型基金和 1 只指数型基金，另管理 2 只专户理财产品，管理资产总规模超过 139 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	-	7年	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。7年证券从业经验，具有基金从业资格。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。
敬夏玺	本基金的基金经理	2016年11月2日	-	6年	敬夏玺先生，中央财经大学金融学硕士，6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。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

### 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 and 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

本基金于 2016 年 10 月 18 日成立，投资策略主要以宏观经济分析为基础，把握债券市场的涨跌，配置信用债及利率债，以获取稳定的持有期回报。自本基金成立以来，国内宏观经济运行平稳，工业企业利润、PMI 等多项基本面指标企稳反弹，经济增长出现阶段性的反弹，大宗商品价格上涨带动生产资料价格指数快速反弹，间接导致通胀水平出现回升。而随着人民币的贬值速度加快，外汇占款连续流出，国内货币政策保持中性态度，货币市场出现紧平衡态势。本基金成立以来债券市场经历了较大幅度的下跌，债券市场流动性边际收紧，短端收益率大幅上行带动长端收益率出现调整，本基金也跟随市场出现了一定比例的回撤。考虑到市场对信用风险的担忧，信用利差处于历史低位，本基金配置策略上以高评级信用债及利率债配置为主，择机适度降低组合久期以规避市场继续调整的风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9561 元，份额累计净值为 0.9561 元；C 类基金份额净值为 0.9554 元，份额累计净值为 0.9554 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-4.39%，C 类基金份额净值增长率为-4.46%，同期业绩基准增长率为-2.54%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年四季度以来国内宏观经济基本面逐渐企稳，供给侧改革带来的工业品价格反弹带动工业企业利润改善以及 PPI 大幅回升并结束了连续 4 年多的负增长。纵观 2017 年全年，全年经济增速预计高于去年，通胀水平均值也会高于去年，但通胀预计不会大幅上涨，供给侧改革仍然发力，但如果需求面没有明显改善，供给收缩对经济的带动效果将减弱。债券市场在经历了去年底的大跌后，绝对收益水平已经回到近年来的均值附近，配置价值逐渐显现，但随着货币政策转向中性，债券收益率水平中枢抬升已成为事实，在经济基本面延续改善但态势不稳的预期下，债券市场预计将会在一个较高的收益水平下小幅震荡。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对

基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司业务风险全面自查，对公司各项内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

#### 4.7 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会计资格和基金从业资格，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央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种（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委员会，由副总经理、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。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

无。

#### **4.9 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，新疆前海联合添鑫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，不存在任何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，新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金未进行利润分配。

### **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添鑫债券型证券投资基金 2016 年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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20137 号

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金(以下简称“前海联合添鑫债券”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是前海联合添鑫债券的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为,上述前海联合添鑫债券的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报

表附注中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，公允反映了前海联合添鑫债券 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师：陈玲

注册会计师：陶忆

中国·上海市

2017 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,749,143.99
结算备付金		545,454.54
存出保证金		2,715.68
交易性金融资产	7.4.7.2	520,421,300.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		520,421,300.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	49,500,194.25
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	11,955,859.27
应收股利		-
应收申购款		-

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		585,174,667.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		102,639,606.04
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		122,699.01
应付托管费		40,899.70
应付销售服务费		0.62
应付交易费用	7.4.7.7	7,101.52
应交税费		-
应付利息		52,507.05
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	140,000.00
负债合计		103,002,813.94
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	504,287,022.28
未分配利润	7.4.7.10	-22,115,168.49
所有者权益合计		482,171,853.79
负债和所有者权益总计		585,174,667.73

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 0.9561 元，C 类基金份额净值 0.9554 元；基金份额总额 504,287,022.28 份，其中 A 类基金份额 504,284,791.45 份，C 类基金份额 2,230.83 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日



一、收入		-17,107,058.08
1.利息收入		2,597,597.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,998.01
债券利息收入		2,088,139.42
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		484,459.94
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-19,704,655.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	0.17
<b>减：二、费用</b>		748,541.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	326,746.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	99,391.70
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2.22
4. 交易费用	7.4.7.19	2,972.55
5. 利息支出		179,427.75
其中：卖出回购金融资产支出		179,427.75
6. 其他费用	7.4.7.20	140,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-17,855,599.22
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-17,855,599.22

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金

本报告期：2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月18日(基金合同生效日)至2016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）	200,030,093.35	-	200,030,093.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,855,599.22	-17,855,599.22
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）	304,256,928.93	-4,259,569.27	299,997,359.66
其中：1. 基金申购款	304,258,748.95	-4,259,622.96	299,999,125.99
2. 基金赎回款	-1,820.02	53.69	-1,766.33
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）	504,287,022.28	-22,115,168.49	482,171,853.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王晓耕	_____ 刘菲	_____ 黄嘉宇
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 基金基本情况

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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。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。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,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费,不收取销售服务费的,称为A类基金份额;收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,不收取认购费和申购费的,称为C类基金份额。本基金的

A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，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）。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%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。本基金的业绩比较基准为：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 2017 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016

年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 12 月 31 日	
活期存款	2,749,143.99	
定期存款	-	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
其他存款	-	
合计：	2,749,143.99	

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	8,001,600.00	7,972,800.00	-28,800.00
	银行间市场	532,124,355.62	512,448,500.00	-19,675,855.62
	合计	540,125,955.62	520,421,300.00	-19,704,655.62



资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	540,125,955.62	520,421,300.00	-19,704,655.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	49,500,194.25	-
合计	49,500,194.25	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	473.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	245.50
应收债券利息	11,926,788.87
应收买入返售证券利息	28,349.94
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	11,955,859.27

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
----	--------------------

交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	7,101.52
合计	7,101.52

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	140,000.00
合计	140,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

前海联合添鑫债券 A		
项目	本期 2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,026,886.57	200,026,886.57
本期申购	304,258,621.69	304,258,621.69
本期赎回(以“-”号填列)	-716.81	-716.81
本期末	504,284,791.45	504,284,791.45

金额单位：人民币元

前海联合添鑫债券 C		
项目	本期 2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,206.78	3,206.78
本期申购	127.26	127.26
本期赎回(以“-”号填列)	-1,103.21	-1,103.21
本期末	2,230.83	2,230.83

注：1、本基金自2016年10月12日至2016年11月11日止期间公开发售，共募集有效净认购资金200,030,086.76元。根据《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入6.59元在本基金成立后，折算为6.59份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金招募说明书》及《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年11月17日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2016

年 11 月 18 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

前海联合添鑫债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,849,045.74	-19,704,523.10	-17,855,477.36
本期基金份额交易产生的变动数	549,942.89	-4,809,534.56	-4,259,591.67
其中：基金申购款	549,945.24	-4,809,565.94	-4,259,620.70
基金赎回款	-2.35	31.38	29.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,398,988.63	-24,514,057.66	-22,115,069.03

单位：人民币元

前海联合添鑫债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10.66	-132.52	-121.86
本期基金份额交易产生的变动数	-1.70	24.10	22.40
其中：基金申购款	0.20	-2.46	-2.26
基金赎回款	-1.90	26.56	24.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8.96	-108.42	-99.46

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,203.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	788.16
其他	15,006.75
合计	24,998.01

#### 7.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,005,476.71
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,000,200.00
减:应收利息总额	5,276.71
买卖债券差价收入	-

#### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

无。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-19,704,655.62
——股票投资	-
——债券投资	-19,704,655.62
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-19,704,655.62

#### 7.4.7.17 其他收入

单位:人民币元

项目	本期
	2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	0.17
合计	0.17

#### 7.4.7.18 交易费用

单位:人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	10.05
银行间市场交易费用	2,962.50
合计	2,972.55

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	80,000.00
合计	140,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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、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
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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	326,746.92
其中：支付销售机构的客户维护费	194,937.13

注：1、根据《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的基金份额持有人大会于2016年11月30日表决通过了《关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金降低基金费率有关事项的议案》，本基金的管理费率自2016年11月30日起，由0.70%年费率降至0.30%年费率。

2、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 X 管理费费率计提，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 X 0.70% / 当年天数 (2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年11月29日)。

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数 (2016年11月30日至2016年12月31日)。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年10月18日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	99,391.70

注：1、根据《疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额

持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的基金份额持有人大会于 2016 年 11 月 30 日表决通过了《关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金降低基金费率有关事项的议案》，本基金的托管费率自 2016 年 11 月 30 日起，由 0.20% 年费率降至 0.10% 年费率。

2、支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 X 托管费率计提，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 0.20% / 当年天数 (2016 年 10 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 11 月 29 日)。

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数 (2016 年 11 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日)。

#### 7.4.10.2.3 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 2016 年 10 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添鑫债券 A	前海联合添鑫债券 C	合计
新疆前海联合	-	2.22	2.22
合计	-	2.22	2.22

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

C 类份额日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 2016 年 10 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入
浙商银行	2,749,143.99	9,203.10

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

#### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 102,639,606.04 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160206	16 国开 06	2016 年 1 月 5 日	97.44	580,000	56,515,200.00
150206	16 国开 06	2016 年 1 月 3 日	97.44	520,000	50,668,800.00
合计				1,100,000	107,184,000.00

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。



### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，属于中等风险品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 6.36%。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 102,639,606.04 元将在 2017 年 1 月 5 日前到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,749,143.99	-	-	-	2,749,143.99
结算备付金	545,454.54	-	-	-	545,454.54
存出保证金	2,715.68	-	-	-	2,715.68
交易性金融资产	28,126,800.00	274,288,000.00	218,006,500.00	-	520,421,300.00
买入返售金融资产	49,500,194.25	-	-	-	49,500,194.25
应收利息	-	-	-	11,955,859.27	11,955,859.27
资产总计	80,924,308.46	274,288,000.00	218,006,500.00	11,955,859.27	585,174,667.73
负债					
卖出回购金融资产款	102,639,606.04	-	-	-	102,639,606.04
应付管理人报酬	-	-	-	122,699.01	122,699.01
应付托管费	-	-	-	40,899.70	40,899.70
应付销售服务费	-	-	-	0.62	0.62
应付交易费用	-	-	-	7,101.52	7,101.52
应付利息	-	-	-	52,507.05	52,507.05
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	102,639,606.04	-	-	363,207.90	103,002,813.94
利率敏感度缺口	-21,715,297.58	274,288,000.00	218,006,500.00	11,592,651.37	482,171,853.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	6,461,352.11
	2. 市场利率上升 25 个基点	-6,343,247.18

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 520,421,300.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	520,421,300.00	88.93
	其中：债券	520,421,300.00	88.93
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	49,500,194.25	8.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,294,598.53	0.56

7	其他各项资产	11,958,574.95	2.04
8	合计	585,174,667.73	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	7,972,800.00	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	481,760,500.00	99.91
	其中：政策性金融债	481,760,500.00	99.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,688,000.00	6.36
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	520,421,300.00	107.93

**8.6 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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160206	16 国开 06	2,500,000	243,600,000.00	50.52
2	160418	16 农发 18	950,000	93,185,500.00	19.33
3	160207	16 国开 07	500,000	48,510,000.00	10.06
4	160310	16 进出 10	500,000	47,460,000.00	9.84
5	160210	16 国开 10	300,000	28,851,000.00	5.98

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**8.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金未参与投资国债期货。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 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。**

**8.11.2 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票库的情形。**

**8.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	2,715.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,955,859.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,958,574.95

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
前 海 联 合 添 鑫 债券 A	228	2,211,775.40	504,257,620.69	99.99%	27,170.76	0.01%
前 海 联 合 添 鑫 债券 C	80	27.89	0.00	0.00%	2,230.83	100.00%
合计	308	1,637,295.53	504,257,620.69	99.99%	29,401.59	0.01%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。



## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	前海联合添鑫债券 A	21,386.50	0.0042%
	前海联合添鑫债券 C	1,273.66	57.0935%
	合计	22,660.16	0.0045%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和部门负责人持 有本开放式基金	前海联合添鑫债券 A	0~10
	前海联合添鑫债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	前海联合添鑫债券 A	0~10
	前海联合添鑫债券 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海联合添鑫债 券 A	前海联合添鑫债 券 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 18 日）基金 份额总额	200,026,886.57	3,206.78
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	304,258,621.69	127.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	716.81	1,103.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	504,284,791.45	2,230.83

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金于 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 11 月 29 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金降低基金费率有关事项的议案》，以上议案自 2016 年 11 月 30 日起生效。本次持有人大会决议生效后，根据持有人大会通过的议案，《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》关于对基金费率的调整于 2016 年 11 月 30 日生效，新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金的基金管理人管理费率自 2016 年 11 月 30 日起由 0.70% 降至 0.30%；新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金的基金管理人托管费率自 2016 年 11 月 30 日起由 0.20% 降至 0.10%。有关详细信息参见本公司于 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 11 月 30 日发布的一系列相关公告。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 4 月 12 日，本基金管理人原职工监事毕晓南因个人原因离职，不再担任职工监事。经职工选举由赵伟担任职工监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自 2016 年 10 月 18 日基金成立以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 60,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	新增

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

#### （1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

#### （2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	10,002,000.00	100.00%	529,980,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额发售公	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 9 月 29 日

	告		
2	关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 18 日
3	新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 19 日
4	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 28 日
5	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 10 月 31 日
6	新疆前海联合基金管理有限公司关于召开新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 11 月 1 日
7	新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 11 月 17 日
8	新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2016 年 12 月 1 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

敬夏玺先生于 2016 年 11 月 2 日增聘为新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金经理，公告日期为 2016 年 11 月 4 日，公告标题为《新疆前海联合基金管理有限公司关于增聘新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金经理的公告》，本公司已将上述基金经理变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局以及中国证券投资基金业协会备案。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金托管协议》；
- 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、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司  
2017年3月31日