

新疆前海联合添和纯债债券型  
证券投资基金  
2017 年年度报告 摘要

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称            | 前海联合添和纯债        |                 |
| 基金主代码           | 003498          |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |                 |
| 基金合同生效日         | 2016 年 12 月 7 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    |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 57,090,901.00 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 前海联合添和纯债 A      | 前海联合添和纯债 C      |
| 下属分级基金的交易代码:    | 003498          | 003499          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 730.86 份        | 57,090,170.14 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   | <p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资组合策略</p> <p>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。</p> <p>3、信用债行业配置策略</p> <p>本基金将保持行业分散化投资，依据对下一阶段各行业景气度的研判，决定各行业配置比例，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。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将基于对资产支持证券基础资产质量及未来现金流的分析，结合基本面分析和数量化模型模拟，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为：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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名             | 郭明           |
|         | 联系电话           | 010-66105799 |

|        |      |                      |                     |
|--------|------|----------------------|---------------------|
|        | 电子邮箱 | service@qhlhfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 400-640-0099         | 95588               |
| 传真     |      | 0755-82780000        | 010-66105798        |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.qhlhfund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、托管人的办公地址   |

### § 3 主要财务指标、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 | 2017 年     |               | 2016 年 12 月 7 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------|---------------|---|---------------|
|               | 前海联合添和纯债 A | 前海联合添和纯债 C    | 前海联合添和纯债 A                                | 前海联合添和纯债 C    |
| 本期已实现收益       | -12.10     | 930,361.31    | 1.80                                      | 253,519.39    |
| 本期利润          | 6.67       | 920,360.71    | 1.80                                      | 253,519.39    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0066     | 0.0236        | 0.0023                                    | 0.0034        |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.76%      | 1.50%         | 0.23%                                     | 0.51%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末    |               | 2016 年末                                   |               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0082     | 0.0085        | 0.0023                                    | 0.0051        |
| 期末基金资产净值      | 745.43     | 58,240,768.69 | 781.91                                    | 50,347,734.03 |
| 期末基金份额净值      | 1.0199     | 1.0202        | 1.0023                                    | 1.0051        |

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

前海联合添和纯债 A

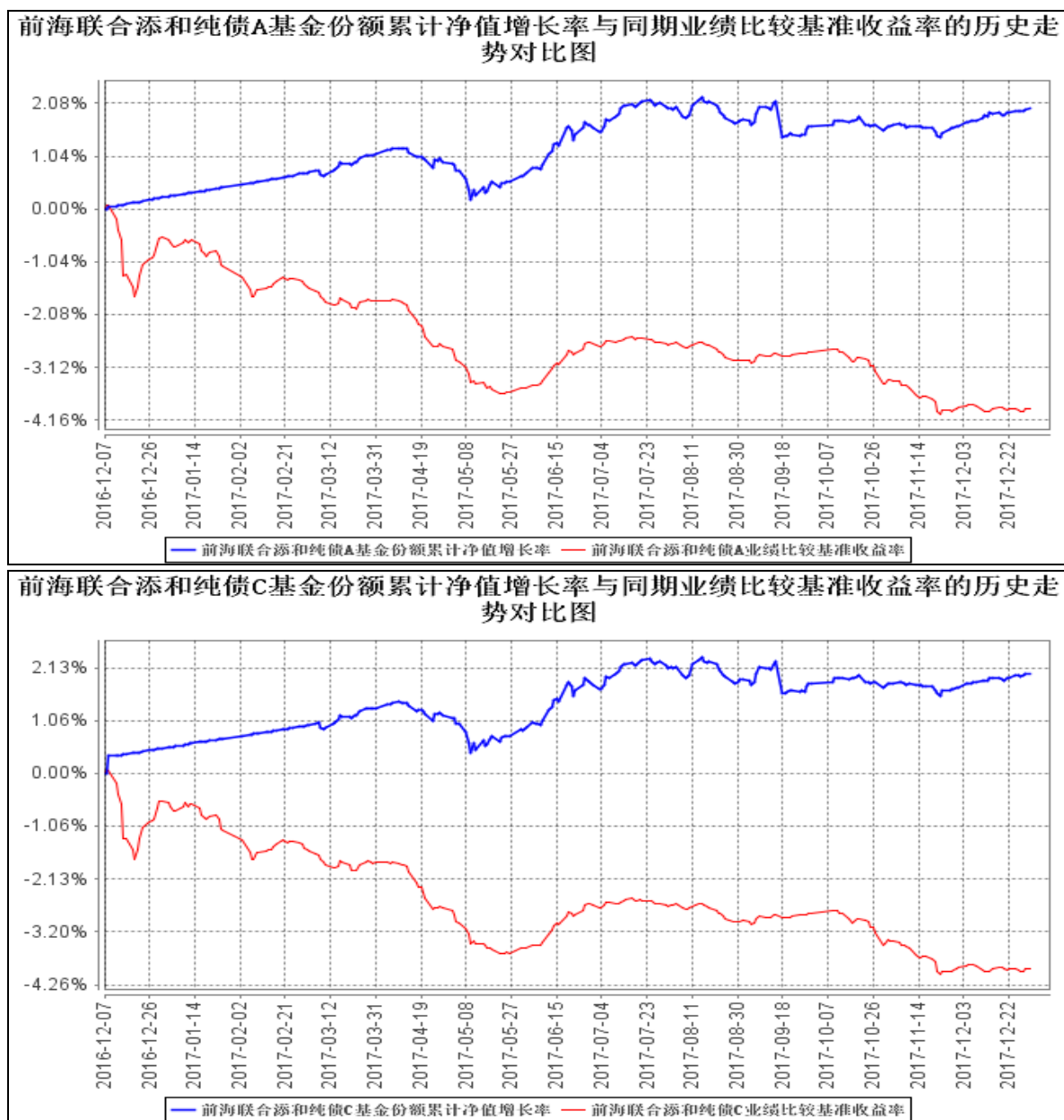
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.36%    | 0.04%       | -1.15%     | 0.06%         | 1.51% | -0.02% |
| 过去六个月      | 0.38%    | 0.08%       | -1.30%     | 0.05%         | 1.68% | 0.03%  |
| 过去一年       | 1.76%    | 0.08%       | -3.38%     | 0.06%         | 5.14% | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 1.99%    | 0.08%       | -3.93%     | 0.09%         | 5.92% | -0.01% |

前海联合添和纯债 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    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.21%    | 0.04%       | -1.15%     | 0.06%         | 1.36% | -0.02% |
| 过去六个月 | 0.24%    | 0.08%       | -1.30%     | 0.05%         | 1.54% | 0.03%  |

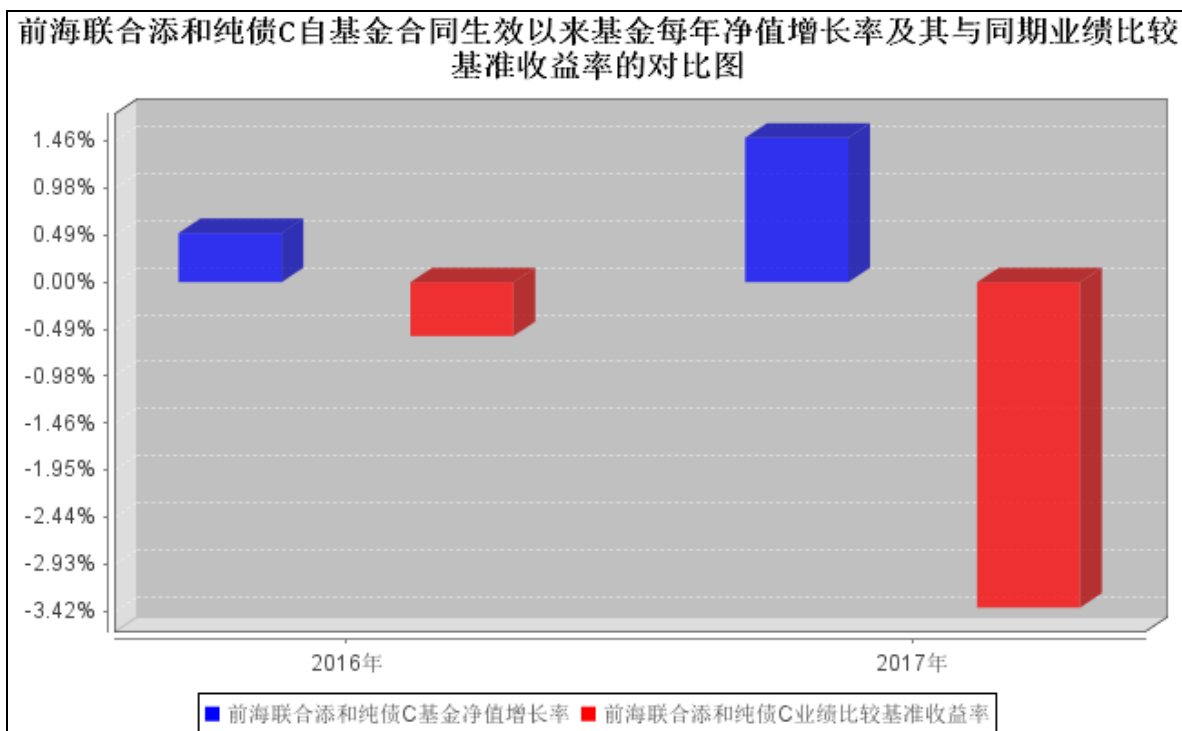
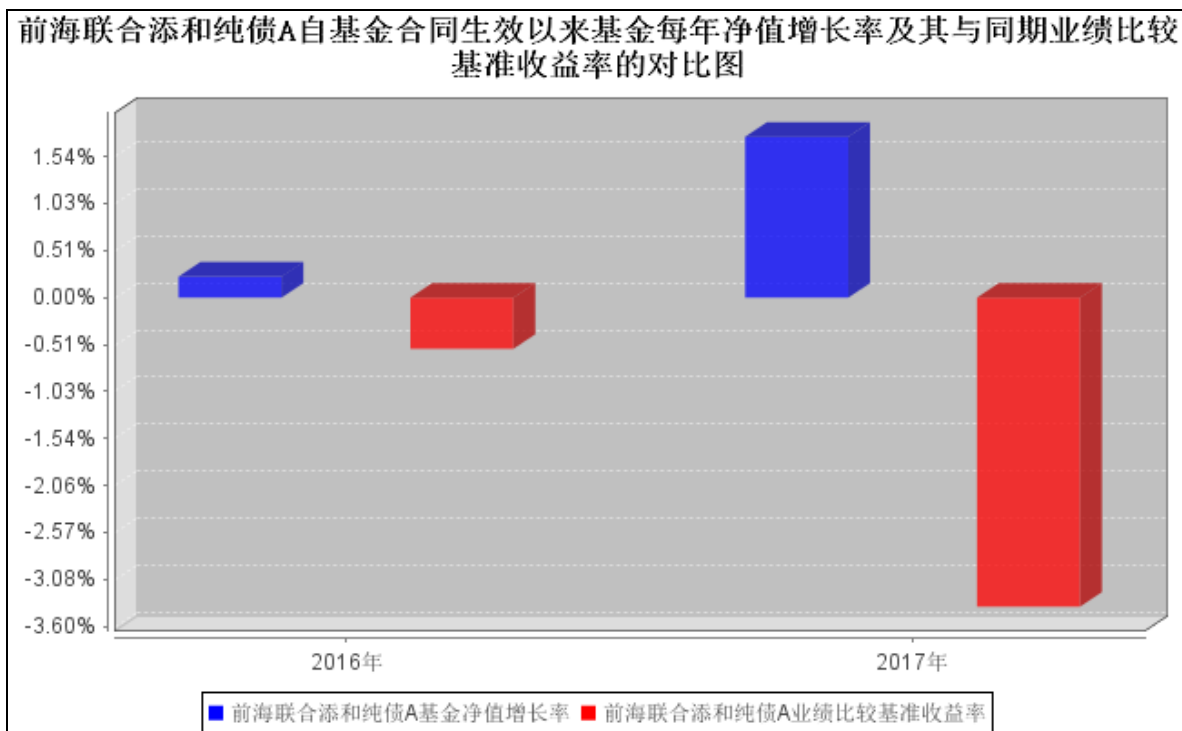
|            |       |       |        |       |       |       |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去一年       | 1.50% | 0.53% | -3.38% | 0.06% | 4.88% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.02% | 0.51% | -3.93% | 0.09% | 5.95% | 0.42% |

### 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：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

### 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



### 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13只开放式基金，包括2只货币市场基金、5只债券型基金、5只混合型基金和1只指数型基金，另管理10只专户理财产品，管理资产总规模超过385亿元人民币。

#### 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12月7日      | -    | 8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，8年证券投资基金投资研究经验。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，现任前海联合添和纯债兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添鑫债券和前海联合永兴纯债的基金经理。 |

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和分配机制，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。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

2017 年是以金融监管和去杠杆为主导的市场，资金面基本维持着中性偏紧的状态在 MPA 考核的关键时间点更是隔夜跨季资金价格急剧飙升。另一方面，由于投资者对后续经济增长韧性的预期开始相对乐观，各机构的配置动力并不强。

添和债券基金由于基金资产规模较小，故现有策略为在满足 80%债券持仓的前提下以维持流动性为主，主要配置在短久期的政策性金融债。主要以获取持有票息为主，同时寻找短期时点性的交易机会。

#### 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和纯债 A 基金份额净值为 1.0199 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%；截至本报告期末前海联合添和纯债 C 基金份额净值为 1.0202 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.50%；同期业绩比较基准收益率为-3.38%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年宏观经济的关键词可以简要概括为：容忍中低增长，质比量重要；继续金融去杠杆严监管，继续中性偏紧的货币政策；执行稳中有收的财政政策。

2018 年政府工作报告设定的 GDP 目标增速为 6.5%左右，不再要求“在实际工作中争取更好结果”，而积极财政政策力度有所下降，在实现手段方面也有了新的变化。预算赤字率由 3%调低至 2.6%，是过去 5 年来首次降低赤字率水平。

对债券市场短期而言，整体需求仍然偏弱，由于严监管去杠杆带来的部分企业不规范融资渠道和能力均承压，在此过程中将带来信用风险事件增加，短期利空因素更多些。但从中长期看，伴随去金融空转化的有效治理过程，货币政策也将逐步由偏紧回归至中性；而严控非标也将导流部分投资需求进入标准化债券的市场，这些利好因素的释放或将迎来中长期可能债市的转机。

### 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。

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和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，新疆前海联合添和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和纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，新疆前海联合添和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和纯债债券型证券投资基金 2017 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核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师薛竞、俞伟敏于 2017 年 3 月 29 日出具了普华永道中天审字(2018)第 21613 号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。2017 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日               | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日               |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| <b>资产：</b>      |                                       |  |
| 银行存款            | 53,997.38                             | 50,288,650.54                          |
| 结算备付金           | 393.59                                | -                                      |
| 存出保证金           | 1,970.60                              | -                                      |
| 交易性金融资产         | 56,068,039.18                         | -                                      |
| 其中：股票投资         | -                                     | -                                      |
| 基金投资            | -                                     | -                                      |
| 债券投资            | 56,068,039.18                         | -                                      |
| 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         | 200,264.11                            | -                                      |
| 应收利息            | 2,061,692.46                          | 103,183.42                             |
| 应收股利            | -                                     | -                                      |
| 应收申购款           | -                                     | -                                      |
| 递延所得税资产         | -                                     | -                                      |
| 其他资产            | -                                     | -                                      |
| 资产总计            | 58,386,357.32                         | 50,391,833.96                          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b><br><b>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末</b><br><b>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          | -                                     | -                                      |
| 卖出回购金融资产款       | -                                     | -                                      |
| 应付证券清算款         | -                                     | -                                      |
| 应付赎回款           | 20.39                                 | -                                      |
| 应付管理人报酬         | 6,276.24                              | 24,686.75                              |
| 应付托管费           | 2,092.08                              | 6,171.70                               |
| 应付销售服务费         | 4,183.95                              | 8,228.82                               |
| 应付交易费用          | 1,038.34                              | -                                      |
| 应交税费            | -                                     | -                                      |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 应付利息          | -             | -             |
| 应付利润          | -             | -             |
| 递延所得税负债       | -             | -             |
| 其他负债          | 131,232.20    | 4,230.75      |
| 负债合计          | 144,843.20    | 43,318.02     |
| <b>所有者权益：</b> |               |               |
| 实收基金          | 57,090,901.00 | 50,094,599.64 |
| 未分配利润         | 1,150,613.12  | 253,916.30    |
| 所有者权益合计       | 58,241,514.12 | 50,348,515.94 |
| 负债和所有者权益总计    | 58,386,357.32 | 50,391,833.96 |

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，前海联合添和纯债 A 基金份额净值 1.0199 元，基金份额总额 730.86 份；前海联合添和纯债 C 基金份额净值 1.0202 元，基金份额总额 57,090,170.14 份。前海联合添和纯债份额总额合计为 57,090,901.00 份；于 2016 年 12 月 31 日，新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0023 元，C 类基金份额净值 1.0051 元；基金份额总额 50,094,599.64 份，其中 A 类基金份额 780.15 份，C 类基金份额 50,093,819.49 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 7 日(基金合<br>同生效日)至 2016 年 12<br>月 31 日 |
|------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>      | 1,588,109.47                              | 297,039.21   |
| 1.利息收入           | 1,732,139.48                              | 146,864.94   |
| 其中：存款利息收入        | 213,186.99                                | 120,939.23   |
| 债券利息收入           | 1,031,540.67                              | -  |
| 资产支持证券利息收入       | 51,810.72                                 | -  |
| 买入返售金融资产收入       | 435,601.10                                | 25,925.71  |
| 其他利息收入           | -   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -134,427.54                               | -  |
| 其中：股票投资收益        | -   | -  |
| 基金投资收益           | -   | -  |
| 债券投资收益           | -132,109.95                               | -  |
| 资产支持证券投资收益       | -2,317.59                                 | -  |
| 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）      | -9,981.83         | -                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                 | -                 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 379.36            | 150,174.27        |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>667,742.09</b> | <b>43,518.02</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 224,317.01        | 24,686.75         |
| 2. 托管费                     | 57,156.12         | 6,171.70          |
| 3. 销售服务费                   | 79,077.58         | 8,228.82          |
| 4. 交易费用                    | 3,125.39          | -                 |
| 5. 利息支出                    | 153,333.40        | -                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 153,333.40        | -                 |
| 6. 其他费用                    | 150,732.59        | 4,430.75          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>920,367.38</b> | <b>253,521.19</b> |
| 减：所得税费用                    | -                 | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>920,367.38</b> | <b>253,521.19</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 50,094,599.64                          | 253,916.30   | 50,348,515.94  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | 920,367.38   | 920,367.38     |
| 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）      | 6,996,301.36                           | -23,670.56   | 6,972,630.80   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 51,332,153.13                          | 970,143.98   | 52,302,297.11  |
| 2. 基金赎回款                               | -44,335,851.77                         | -993,814.54  | -45,329,666.31 |
| 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                            | 57,090,901.00                          | 1,150,613.12 | 58,241,514.12  |





验字（2016）第 1629 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购或申购费用、销售服务收取方式的不同，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。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》、《新疆前海联合添和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、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，以及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。本基金不投资于股票或权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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 2018 年 3 月 29 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》、《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 12 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的财务

报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 7 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。本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 7 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和资产支持证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和资产支持证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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

本基金同一类别的每一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》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）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）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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[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)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。

(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。

### 7.4.7 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、登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）     | 基金托管人             |
| 深圳粤商物流有限公司               | 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          |
| 深圳市钜盛华股份有限公司             | 基金管理人的股东          |
| 凯信恒有限公司                  | 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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

**7.4.8.1.2 债券交易**

无。

**7.4.8.1.3 债券回购交易**

无。

**7.4.8.1.4 权证交易**

无。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年12月7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  | 224,317.01                  | 24,686.75                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 47.98                       | 0.00                                       |

注：1、根据《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和纯债债券型证券投资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2017年9月12日表决通过了《关于新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》，本基金的管理费率自2017年9月12日起，由0.60%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的约定年费率计提，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 0.60% / 当年天数(2016年12月7日(基金合同生效日)至2017年9月11日)

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数(2017年9月12日至2017年12月31日)

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年12月7日(基金合同生效日) |
|----|-----------------------------|--------------------------------|
|    |                             |                                |



|                | 月 31 日    | 至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|-----------|--------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 57,156.12 | 6,171.70           |

注：1、根据《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和纯债债券型证券投资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 2017 年 9 月 12 日表决通过了《关于新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金降低托管费率有关事项的议案》，本基金的托管费率自 2017 年 9 月 12 日起，由 0.15% 年费率降至 0.10% 年费率。

2、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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 × 0.15% / 当年天数 (2016 年 12 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 9 月 11 日)

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数 (2017 年 9 月 12 日至 2017 年 12 月 31 日)

#### 7.4.8.2.3 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日                  |            |           |
|----------------|---|------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费  |            |           |
|                | 前海联合添和纯债 A  | 前海联合添和纯债 C | 合计        |
| 新疆前海联合         | -   | 79,043.10  | 79,043.10 |
| 合计             | -   | 79,043.10  | 79,043.10 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 7 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  |            |           |
|                | 前海联合添和纯债 A  | 前海联合添和纯债 C | 合计        |
| 新疆前海联合         | -   | 8,228.82   | 8,228.82  |
| 合计             | -   | 8,228.82   | 8,228.82  |

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 0.20% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.4.2 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。

**7.4.8.5 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |          | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 7 日(基金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 |           |
|--------|--|----------|--|-----------|
|        | 期末余额                                   | 当期利息收入   | 期末余额   | 当期利息收入    |
| 中国工商银行 | 53,997.38                              | 7,919.98 | 5,288,650.54   | 18,806.23 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**7.4.10 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 2017 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 56,068,039.18 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 2017 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提

供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 56,068,039.18 | 96.03         |
|    | 其中：债券             | 56,068,039.18 | 96.03         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 54,390.97     | 0.09          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,263,927.17  | 3.88          |
| 9  | 合计                | 58,386,357.32 | 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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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初基金资产净值 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初基金资产净值 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      | -             | -             |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 55,221,830.90 | 94.82         |
|    | 其中：政策性金融债 | 55,221,830.90 | 94.82         |
| 4  | 企业债券      | 846,208.28    | 1.45          |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -             |
| 6  | 中期票据      | -             | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -             |
| 8  | 同业存单      | -             | -             |
| 9  | 其他        | -             | -             |
| 10 | 合计        | 56,068,039.18 | 96.27         |

## 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  | 150201 | 15 国开 01 | 500,000 | 49,995,000.00 | 85.84         |
| 2  | 018005 | 国开 1701  | 47,810  | 4,727,930.90  | 8.12          |
| 3  | 112154 | 12 盐湖 01 | 5,596   | 559,208.28    | 0.96          |
| 4  | 108601 | 国开 1703  | 5,000   | 498,900.00    | 0.86          |
| 5  | 122675 | PR 杭城投   | 11,480  | 287,000.00    | 0.49          |

## 8.7 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。

## 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

本基金报告期内未投资国债期货。

### 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

本基金报告期内未投资国债期货。

### 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除 12 盐湖 01 外,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。

盐湖股份于 2017 年 3 月 27 日,披露了《关于 2016 年度资本公积金转增股本预案的预披露公告》。同日盐湖股份接到深圳证券交易所《关于对青海盐湖工业股份有限公司的关注函》,深交所对盐湖股份“拟以 2016 年度资本公积金转增股本的方式向全体股东每 10 股转增股本 10 股”表示关注,要求盐湖股份:1)对于 2016 年业绩预计同比下降 30%-60%的情况下进行高送转的必要性和合理性进行说明;2)披露公司 2016 年内非经常性损益对公司净利润的贡献情况;3)向高送转预案的提议人、5%以上股东及董监高问询高送转方案披露后 6 个月内是否存在减持计划。

盐湖股份分别于 2017 年 4 月 15 日发布《关于对深圳证券交易所关注函回复的公告》和 2017 年 4 月 17 日发布《关于对深圳证券交易所关注函回复的更正公告》对深交所关注问题给予回复:1)通过公司长期经营以来的积累,公司账面积累了大量的资本公积金,且近年来公司向股东以现金方式分配的利润逐年递减,许多投资者通过各种渠道表达了希望公司进行年度分配回报股东的诉求,考虑股东诉求和公司利益的情况下拟进行公积金转增股本;2)公司 2016 年度归属于母公司净利润为 34,126.47 万元,扣除非经常性损益后归属于母公司净利润为-12,424.70 万元;3)经与会董事讨论,方案改为每 10 股转增 5 股,此方案不属于高送转的范畴。因此,无须向本次分配预案的提议人、5%以上股东及董监高问询高比例送转方案披露后 6 个月内是否存在减持计划。

基金管理人分析认为,盐湖股份事件对该公司正常经营影响很小。不影响公司对本债券基金所持有的债券到期偿付义务的履行。

本基金投资于“12 盐湖 01 (112154)”的决策程序说明:基于对盐湖股份基本面研究以及对债券市场的判断,本基金投资于“12 盐湖 01”,其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析,认为该事项对公司经营和价值应不会构成重大影响,对基金运作无影响。

#### 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。

本基金本报告期末未持有股票。

**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   | 1,970.60     |
| 2  | 应收证券清算款 | 200,264.11   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,061,692.46 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,263,927.17 |

**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  |
| 前海联合添和纯债 A | 107       | 6.83       | 0.00          | 0.00%  | 730.86    | 100.00% |
| 前海联合添和纯债 C | 122       | 467,952.21 | 57,035,430.37 | 99.90% | 54,739.77 | 0.10%   |
| 合计         | 229       | 249,305.24 | 57,035,430.37 | 99.90% | 55,470.63 | 0.10%   |

注：分级基金机构与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，分母采用各自级别的份额。对合计数，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 | 前海联合添和纯债 A | 362.25     | 49.5649% |
|                  | 前海联合添和纯债 C | 1,353.56   | 0.0024%  |
|                  | 合计         | 1,715.81   | 0.0030%  |

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 前海联合添和纯债 A | 0~10               |
|                                | 前海联合添和纯债 C | 0                  |
|                                | 合计         | 0~10               |

|                 |            |      |
|-----------------|------------|------|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 前海联合添和纯债 A | 0~10 |
|                 | 前海联合添和纯债 C | 0    |
|                 | 合计         | 0~10 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 前海联合添和纯<br>债 A | 前海联合添和纯<br>债 C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）基金份<br>额总额 | 804.00         | 200,148,471.51 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 780.15         | 50,093,819.49  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 3,322.57       | 51,328,830.56  |
| 减:本报告期基金总赎回份额                      | 3,371.86       | 44,332,479.91  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”<br>填列）       | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 730.86         | 57,090,170.14  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金于 2017 年 8 月 21 日至 2017 年 9 月 12 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和纯债债券型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》及《关于新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金降低托管费率有关事项的议案》，以上议案自 2017 年 9 月 12 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，《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金合同》关于对基金费率的调整于 2017 年 9 月 12 日生效，新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金的基金管理人管理费率自 2017 年 9 月 12 日起由 0.60% 降至 0.30%；新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金的基金管理人托管费率自 2017 年 9 月 12 日起由 0.15% 降至 0.10%。有关详细信息参见本公司于 2017 年 8 月 12 日至 2017 年 9 月 13 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

本报告期基金管理人、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

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对基金 2017 年年报进行审计，该事务所自 2016 年 12 月 7 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 |    |
| 华泰证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增 |
| 广发证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | 新增 |
| 恒泰证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 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 |
| 华泰证券 | 19,755,098.49 | 38.07%       | 71,056,000.00  | 31.81%         | -    | -            |
| 兴业证券 | 32,137,108.80 | 61.93%       | 152,300,000.00 | 68.19%         | -    | -            |
| 安信证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                    |               |               |               | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间            | 期初份额          | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 19 日   | 49,849,849.00 | -             | 43,849,849.00 | 6,000,000.00  | 10.51% |
|       | 2              | 2017 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日 | -             | 19,629,011.68 | -             | 19,629,011.68 | 34.38% |
|       | 3              | 2017 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日 | -             | 11,777,407.01 | -             | 11,777,407.01 | 20.63% |
|       | 4              | 2017 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日 | -             | 19,629,011.68 | -             | 19,629,011.68 | 34.38% |
| 个人    | -              | -                                  | -             | -             | -             | -             | -      |

#### 产品特有风险

本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，单一投资者持有基金份额比例过于集中可能引起产品的流动性风险，本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

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

2018 年 3 月 30 日