

# 新疆前海联合添鑫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：浙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。

基金托管人浙商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	504,275,676.02 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	504,273,980.30 份	1,695.72 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
	联系电话	0755-82780666
	电子邮箱	service@qhlhfund.com
客户服务电话	400-640-0099	95527
传真	0755-82780000	0571-87659965

## 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.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

## § 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 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	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	13,643,052.20	45.11	1,849,045.74	10.66
本期利润	-9,414,172.46	-43.65	-17,855,477.36	-121.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0187	-0.0225	-0.0495	-0.0435
本期基金份额净值增长率	-1.95%	-2.36%	-4.39%	-4.46%
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	-0.0625	-0.0671	-0.0439	-0.0446
期末基金资产净值	472,745,295.72	1,581.95	482,169,722.42	2,131.37
期末基金份额净值	0.9375	0.9329	0.9561	0.9554

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

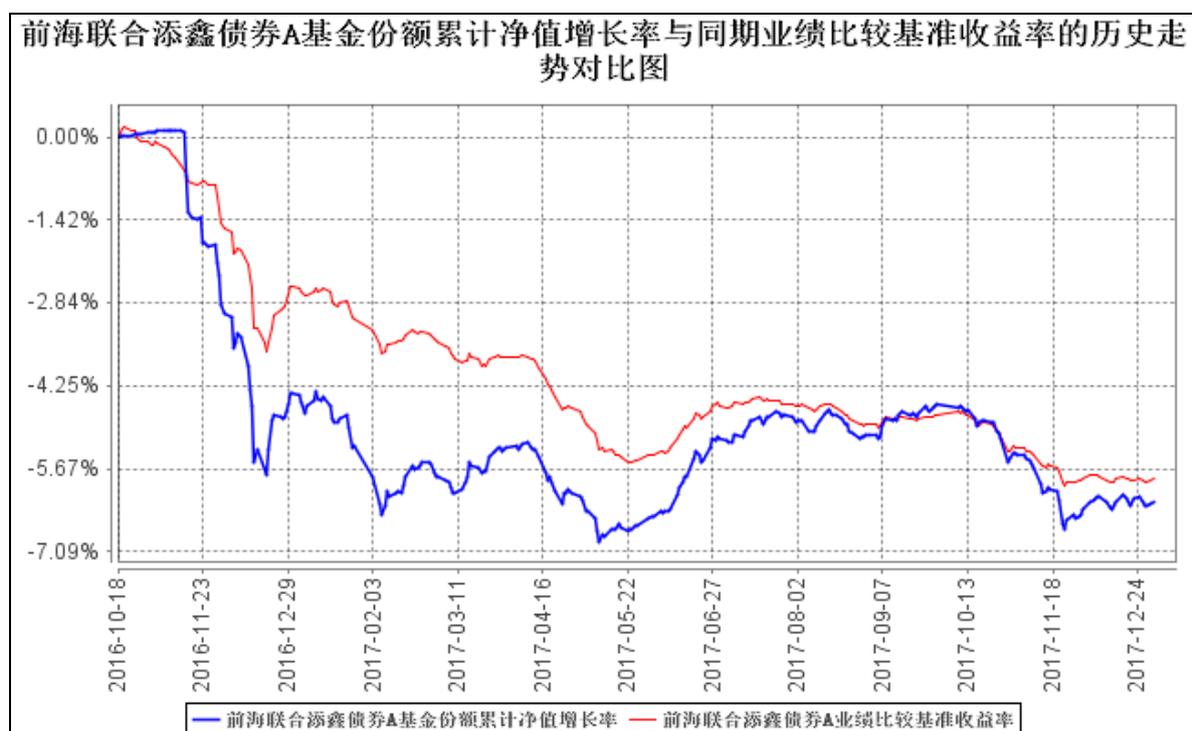
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.75%	0.11%	-1.15%	0.06%	-0.60%	0.05%
过去六个月	-1.15%	0.09%	-1.30%	0.05%	0.15%	0.04%
过去一年	-1.95%	0.12%	-3.38%	0.06%	1.43%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.25%	0.16%	-5.84%	0.09%	-0.41%	0.07%

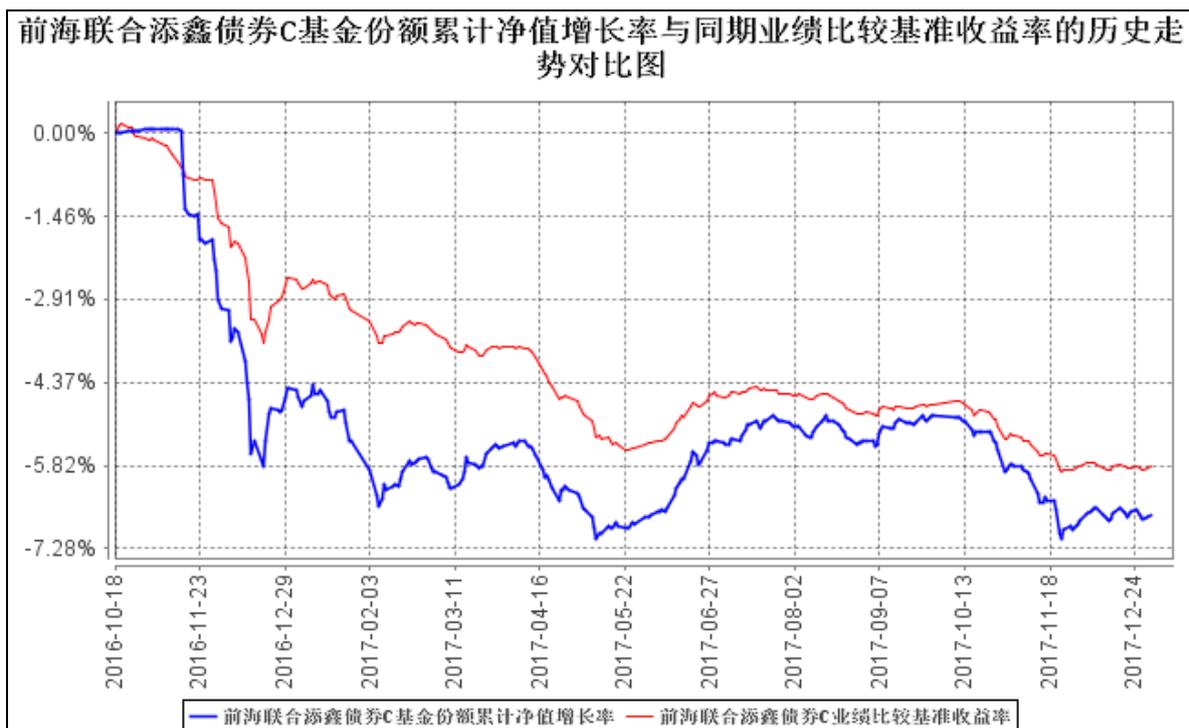
## 前海联合添鑫债券 C

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
过去三个月	-1.86%	0.11%	-1.15%	0.06%	-0.71%	0.05%
过去六个月	-1.37%	0.09%	-1.30%	0.05%	-0.07%	0.04%
过去一年	-2.36%	0.12%	-3.38%	0.06%	1.02%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.71%	0.16%	-5.84%	0.09%	-0.87%	0.07%

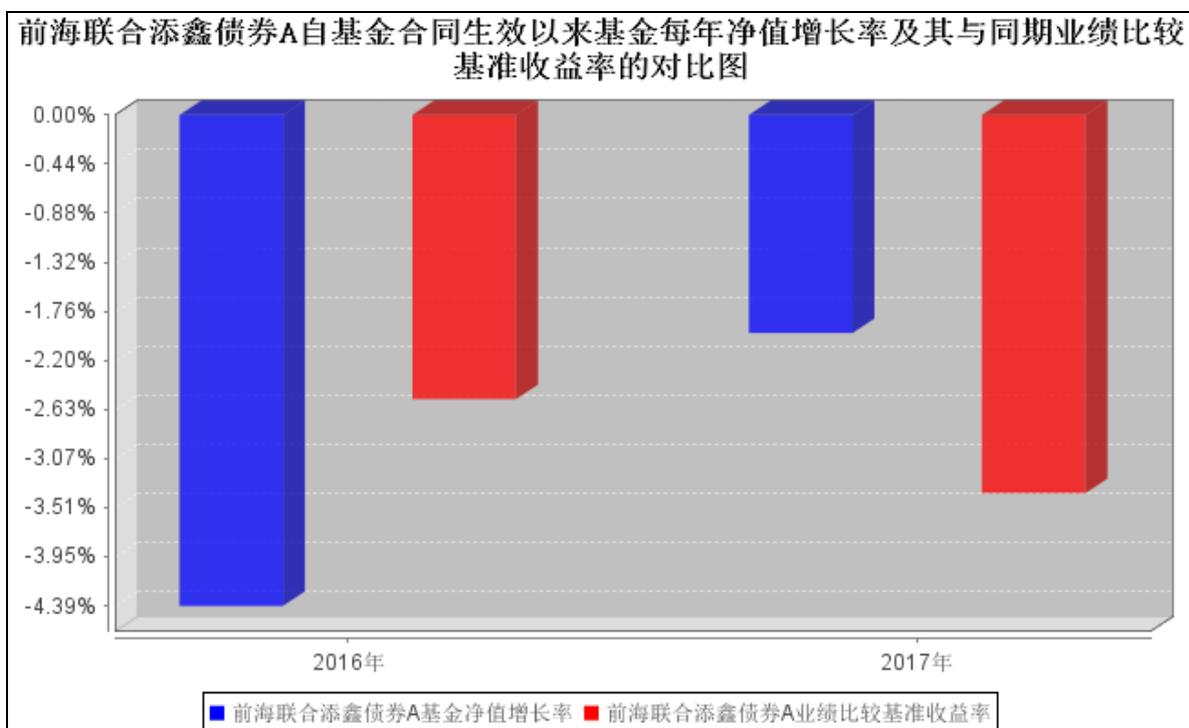
注：本基金的业绩表较基准为中债综合全价（总值）指数 收益率。

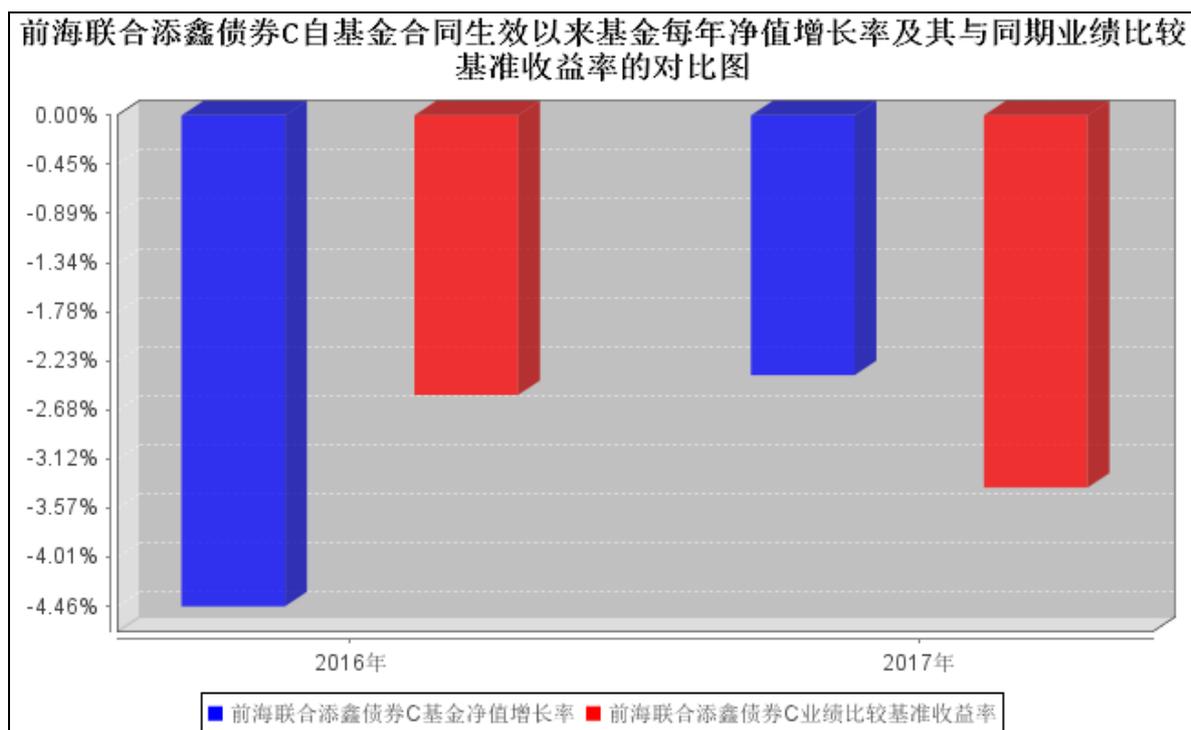
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





### 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：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。

### 3.3 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10月18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，现任前海联合添鑫债券兼新疆前海联合海盈货币、前海联合添利债券、前海联合添和纯债和前海联合永兴纯债的基金经理。
敬夏玺	本基金的基金经理	2016年11月2日	-	7年	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。现任前海联合添鑫债券兼前海联合添利债券、前海联合海盈货币、新疆前海联合海

					盈货币、前海联合泓元定开债券和前海联合泓瑞定开债券的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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。

## 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。

#### 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

回望 2017 年，国内经济企稳回升，外围经济也出现不同程度的反弹，导致国内进出口全年超预期增长，对经济增长产生正贡献。随着供给侧改革的推进，工业品价格回升，工业企业盈利得到改善。价格指数方面，PPI 全年较高的正增长，但 CPI 却维持在 2% 以下的低水平。

国内资本市场呈现股强债弱走势，权重蓝筹股全年领涨，中小市值股票表现较弱。债券市场受到基本面向好以及政策面收紧的影响，收益率大幅上行，10 年国债收益率接近 4%，10 年国开债收益率接近 5%，而短端收益率受到货币政策偏紧的影响也维持在高位，收益率曲线平坦化。

回顾本基金全年的投资操作，本基金主要持有中长端债券，组合收益随债券市场的调整比较明显，全年表现不太理想。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9375 元，份额累计净值为 0.9375 元；C 类基金份额净值为 0.9329 元，份额累计净值为 0.9329 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.95%，C 类基金份额净值增长率为-2.36%，同期业绩基准增长率为-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

展望未来，国内经济基本面会面临一些压力，固定资产投资预计在房地产投资增速回落的带动下出现回落，通胀水平可能回升，需关注回升的高度是否会影响到经济增长，在美国连续加息的背景下，外围经济复苏能否持续，出口是否还能维持去年的增长。但对国内经济总体的判断不必悲观，经济增速的小幅回落并不影响增长质量的改善，工业企业盈利能力及债务水平的改善或将持续，国内经济将保持较强的韧性。因此，权益市场仍然会有机会，但波动和分化都会加大，

同时债券市场也无需太悲观，较高绝对收益率为持有债券资产构成了保护，去年偏紧的货币政策在趋势上很难再紧，随着监管政策陆续落地，金融杠杆率的逐渐去化，资金利率或出现下降。

#### 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 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复核，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 21607 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。

## § 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,054,528.30	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	549,073,500.00	520,421,300.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		549,073,500.00	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	40,000,300.00	49,500,194.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	13,049,934.63	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		604,178,262.93	585,174,667.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 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		130,799,603.80	102,639,606.04
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9.33	-
应付管理人报酬		120,466.32	122,699.01
应付托管费		40,155.44	40,899.70
应付销售服务费		0.62	0.62
应付交易费用	7.4.7.7	19,909.67	7,101.52
应交税费		-	-
应付利息		215,240.08	52,507.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	236,000.00	140,000.00
负债合计		131,431,385.26	103,002,813.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	504,275,676.02	504,287,022.28
未分配利润	7.4.7.10	-31,528,798.35	-22,115,168.49
所有者权益合计		472,746,877.67	482,171,853.79
负债和所有者权益总计		604,178,262.93	585,174,667.73

注：报告截止日 2017 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 0.9375 元，C 类基金份额净值 0.9329 元；基金份额总额 504,275,676.02 份，其中 A 类基金份额

504273980.30 份，C 类基金份额 1695.72 份。

## 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 10 月 18 日(基金 合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-3,989,055.82	-17,107,058.08
1.利息收入	19,379,655.06	2,597,597.37
其中：存款利息收入	19,280.73	24,998.01
债券利息收入	18,672,869.42	2,088,139.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	687,504.91	484,459.94
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-311,400.00	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-311,400.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-23,057,313.42	-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）	2.54	0.17
<b>减：二、费用</b>	5,425,160.29	748,541.14
1. 管理人报酬	1,429,682.08	326,746.92
2. 托管费	476,560.62	99,391.70
3. 销售服务费	7.30	2.22
4. 交易费用	900.00	2,972.55
5. 利息支出	3,261,810.29	179,427.75
其中：卖出回购金融资产支出	3,261,810.29	179,427.75
6. 其他费用	256,200.00	140,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-9,414,216.11	-17,855,599.22

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-9,414,216.11	-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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	504,287,022.28	-22,115,168.49	482,171,853.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,414,216.11	-9,414,216.11
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）	-11,346.26	586.25	-10,760.01
其中：1. 基金申购款	27.57	-1.78	25.79
2. 基金赎回款	-11,373.83	588.03	-10,785.80
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）	504,275,676.02	-31,528,798.35	472,746,877.67
项目	上年度可比期间 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	304,256,928.93	-4,259,569.27	299,997,359.66

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
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 7.1 至 7.4 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。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用的基金份额,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/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计

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 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。

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 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 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 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) 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。

#### 7.4.6 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
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。

## 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.7.1.1 股票交易

无。

### 7.4.7.2 关联方报酬

#### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,429,682.08	326,746.92
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 2017 年 12 月 31 日)。

#### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	476,560.62	99,391.70

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 2017 年 12 月 31 日)。

#### 7.4.7.2.3 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 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		
	A 类份额	C 类份额	合计
新疆前海联合	-	7.30	7.30
合计	-	7.30	7.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	A 类份额	C 类份额	合计
新疆前海联合	-	2.22	2.22
合计	-	2.22	2.22

注：A 类基金份额不收取销售服务费。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。销售服务费的计算公式为：

C 类份额日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的 X 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

无。

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

无。

**7.4.7.4.2 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。

**7.4.7.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
浙商银行	2,054,528.30	19,167.23	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。

**7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.7.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.8 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 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 130,799,603.80 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
160602	16 国开 06	2018 年 1 月 4 日	94.77	1,000,000	94,770,000.00
160207	16 国开 07	2018 年 1 月 4 日	92.37	400,000	36,948,000.00
合计				1,400,000	131,718,000.00

**7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### 7.4.9 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 549,073,500.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 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

本基金本期及上年度可比期间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(2016 年 12 月 31 日：同)。

##### (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	固定收益投资	549,073,500.00	90.88
	其中：债券	549,073,500.00	90.88
	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	40,000,300.00	6.62
	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	2,054,528.30	0.34
7	其他各项资产	13,049,934.63	2.16
8	合计	604,178,262.93	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	469,401,500.00	99.29
	其中：政策性金融债	469,401,500.00	99.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	29,969,000.00	6.34
6	中期票据	39,961,000.00	8.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,742,000.00	2.06
9	其他	-	-
10	合计	549,073,500.00	116.15

## 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	236,925,000.00	50.12
2	160418	16 农发 18	950,000	86,136,500.00	18.22
3	160207	16 国开 07	500,000	46,185,000.00	9.77
4	160310	16 进出 10	500,000	43,750,000.00	9.25
5	160210	16 国开 10	300,000	26,403,000.00	5.59

### 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中，除 11 中远 MTN1 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。

11 中远 MTN1（2017.7.19 收到上海证券交易所《关于中远海运控股股份有限公司重大资产重组草案信息披露的事后问询函》（上证公函[2017]0841 号））。

本基金投资于“11 中远 MTN1(1182359)”的决策程序说明：基于对发债主体基本面的研究以及二级市场的判断，本基金投资于“11 中远 MTN1”债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相

关规定。基金管理人分析认为，该事件对公司正常经营影响很小，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。

### 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,049,934.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,049,934.63

### 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	203	2,484,108.28	504,257,620.69	99.9968%	16,359.61	0.0032%
前海联合添鑫债券 C	64	26.50	-	-	1,695.72	100.00%
合计	267	1,888,672.94	504,257,620.69	99.9968%	18,055.33	0.0032%

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	10,697.69	0.00%
	前海联合添鑫债券 C	153.38	9.05%
	合计	10,851.07	0.00%

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	504,284,791.45	2,230.83
本报告期基金总申购份额	26.51	1.06
减:本报告期基金总赎回份额	10,837.66	536.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	504,273,980.30	1,695.72

## § 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

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 136,000.00 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	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-

## § 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。

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