

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2017 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金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。

本报告中财务资料未经审计。

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

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添鑫债券	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	504,287,022.28 份	
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。	
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	
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月18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
1. 本期已实现收益	1,849,045.74	10.66
2. 本期利润	-17,855,477.36	-121.86
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0495	-0.0435
4. 期末基金资产净值	482,169,722.42	2,131.37
5. 期末基金份额净值	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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合添鑫债券 A

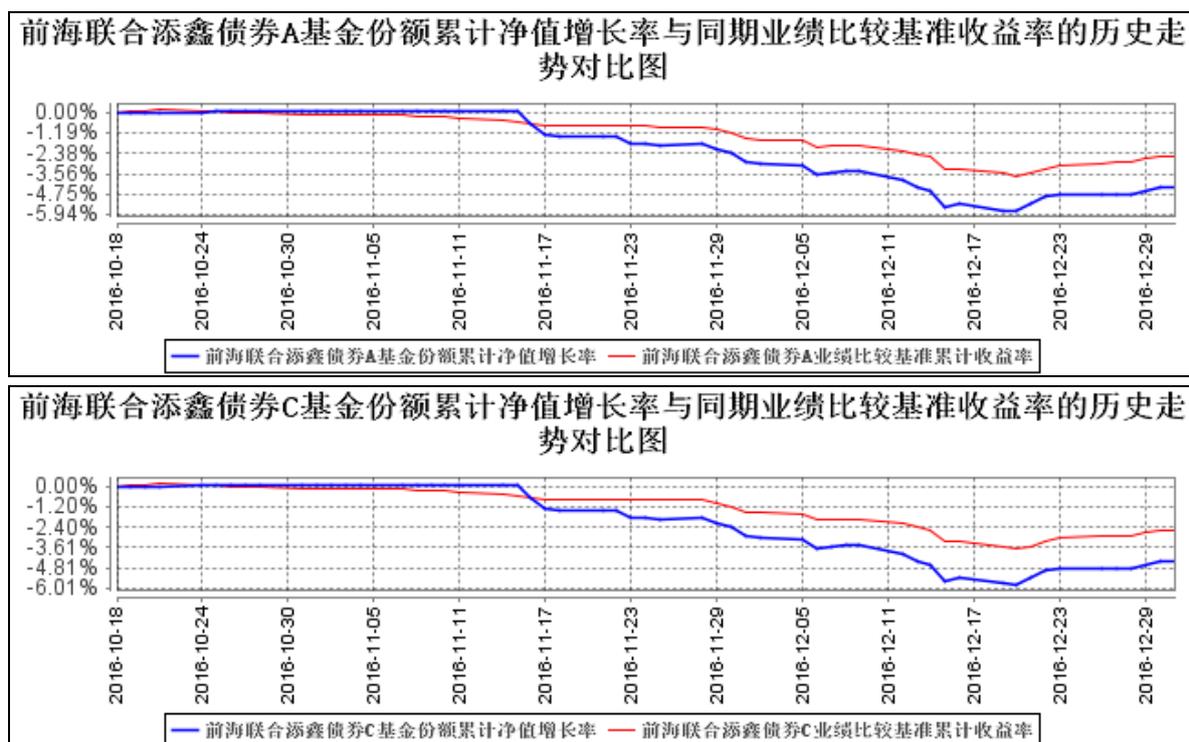
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.39%	0.27%	-2.54%	0.15%	-1.85%	0.12%

前海联合添鑫债券 C

阶段	净值增长率①	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	-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：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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观经济运行平稳，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。

4.5 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%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	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	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,294,598.53	0.56
8	其他资产	11,958,574.95	2.04
9	合计	585,174,667.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	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

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§ 6 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
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）	-	-
报告期期末基金份额总额	504,284,791.45	2,230.83

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

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。

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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合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。

9.2 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。

9.3 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 1 月 20 日