

# 新疆前海联合添利债券型发起式 证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 日

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 4 月 21 日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添利债券
交易代码	003180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	130,686,130.21 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*90%+沪深 300 指数收益率*10%。
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	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
下属分级基金的交易代码	003180	003181
报告期末下属分级基金的份额总额	45,527,830.72 份	85,158,299.49 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（2017年1月1日—2017年3月31日）	
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
1. 本期已实现收益	670,736.22	1,206,650.13
2. 本期利润	545,649.21	1,030,508.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107	0.0099
4. 期末基金资产净值	46,135,471.94	86,162,967.66
5. 期末基金份额净值	1.0133	1.0118

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

###### 前海联合添利债券 A

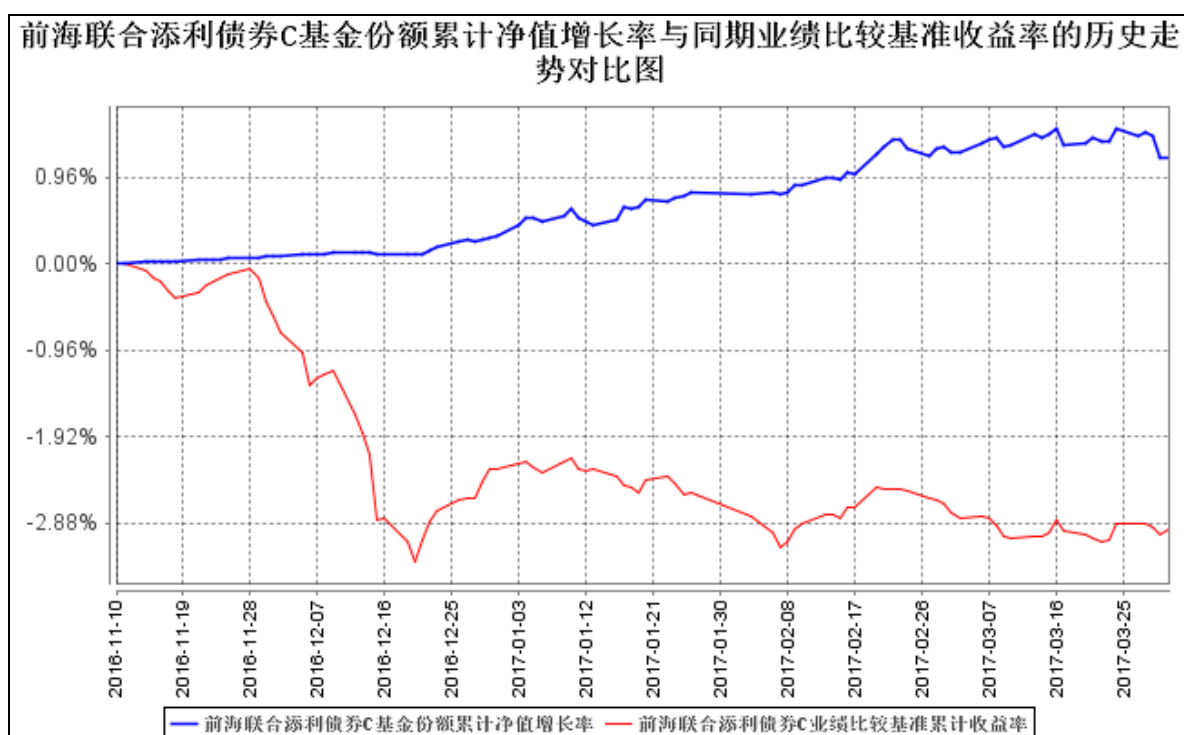
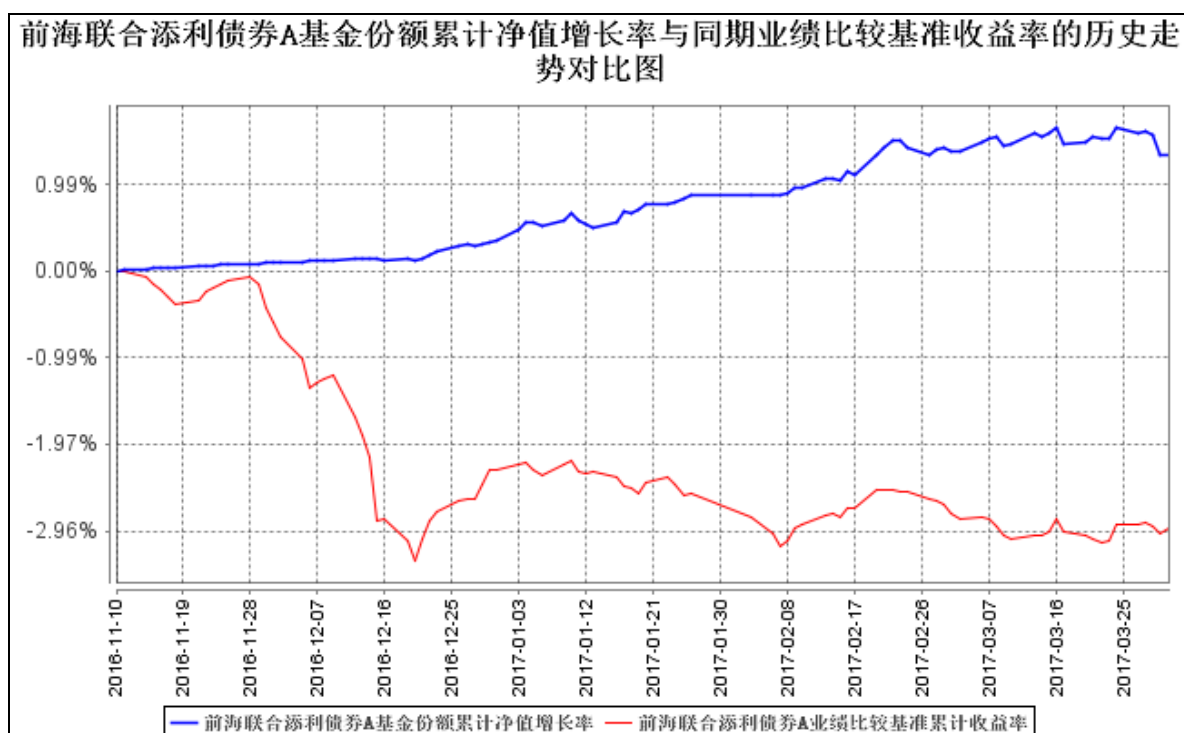
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.98%	0.08%	-0.69%	0.09%	1.67%	-0.01%

###### 前海联合添利债券 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	0.88%	0.08%	-0.69%	0.09%	1.57%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

### 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 11 月 10 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11月11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17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。
林材	本基金的基金经理	2016年11月17日	-	9年	林材先生，药学硕士，9年证券基金投资研究经验。2011年10月至2015年7月任金元顺安基金经理，2008年11月至2011年10月任民生加银基金医药行业研究员、基金经理助理。2000年7月至2003年9月曾任职于广州医药集团。

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

一季度宏观经济表现良好，但通胀水平有所回落。房地产开发投资同比及环比均维持正增长，暂未受到各地调控政策的负面影响，进出口略超预期，但消费小幅回落。开年银行放贷冲动导致信贷投放大涨，1 月份新增社融和信贷均创历史新高。PPI 维持在高位，但通胀水平从一月份 2.55% 的高点回落至 0.8%。基本面不利于债券市场，股票市场表现优于债券市场，一季度债券收益率继续上行，沪深 300 指数小幅上涨。本基金一季度采取缓步建仓策略，在债券收益率上行的过程中逐步提高基金债券仓位，并于近日完成建仓，同时在基金净值增长的同时逐步提高股票资产仓位以博取较高的收益弹性。本基金一季度获得了一定的正收益，相对表现优于业绩基准。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0133 元，份额累计净值为 1.0133 元；C 类基金份额净值为 1.0118 元，份额累计净值为 1.0118 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.98%，C 类基金份额净值增长率为 0.88%，同期业绩基准增长率为-0.69%。

### 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	7,604,000.00	4.88
	其中：股票	7,604,000.00	4.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,810,300.40	83.23
	其中：债券	129,810,300.40	83.23
	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	15,600,134.85	10.00
	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	612,330.31	0.39
8	其他资产	2,336,199.26	1.50
9	合计	155,962,964.82	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,720,000.00	2.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,951,000.00	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,933,000.00	2.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	7,604,000.00	5.75

### 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沪港通投资股票。

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000778	新兴铸管	500,000	2,720,000.00	2.06
2	600998	九州通	100,000	1,951,000.00	1.47
3	002033	丽江旅游	100,000	1,549,000.00	1.17
4	600054	黄山旅游	80,000	1,384,000.00	1.05

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

### 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	17,483,000.00	13.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	32,498,300.40	24.56
5	企业短期融资券	20,004,000.00	15.12
6	中期票据	39,833,000.00	30.11
7	可转债（可交换债）	650,000.00	0.49
8	同业存单	19,342,000.00	14.62
9	其他	-	-
10	合计	129,810,300.40	98.12

### 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	111793764	17 南京银行 CD049	200,000	19,342,000.00	14.62
2	101554024	15 金地 MTN001	100,000	10,128,000.00	7.66
3	112138	12 苏宁 01	100,000	10,050,000.00	7.60
4	101455034	14 首创 MTN003	100,000	10,043,000.00	7.59
5	011698888	16 中航租赁 SCP007	100,000	10,005,000.00	7.56



## 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	7,345.12
2	应收证券清算款	594,945.83
3	应收股利	-
4	应收利息	1,733,808.39
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,336,199.26

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
报告期期初基金份额总额	64,696,785.36	130,485,225.78
报告期期间基金总申购份额	566,885.28	7,728,607.88
减：报告期期间基金总赎回份额	19,735,839.92	53,055,534.17
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	45,527,830.72	85,158,299.49

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.66

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购或赎回本基金的情况。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,000.00	7.66%	10,004,000.00	7.66%	3年

基金管理人高级管理人员	99,408.59	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,103,408.59	7.74%	10,004,000.00	7.66%	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内不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。</p>							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添利债券型发起式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。

## 10.2 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。

## 10.3 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 4 月 21 日