

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金
招募说明书（更新）摘要
（2017年第2号）

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

【重要提示】

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）募集的准予注册文件名称为：《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》（证监许可【2016】1821号），注册日期为：2016年8月11日。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可能投资于中小企业私募债。本基金所投资的中小企业私募债券之债务人如出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

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。投资有风险，投资

者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 10 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：新疆前海联合基金管理有限公司

住所：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

设立日期：2015年8月7日

法定代表人：王晓耕

办公地址：广东省深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼

电话：0755-23695816

联系人：马运佳

基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2015】1842号文核准设立，注册资本为20000万元人民币。目前的股权结构为：深圳市钜盛华股份有限公司占30%、深圳粤商物流有限公司占25%、深圳市深粤控股股份有限公司占25%、凯信恒有限公司占20%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

公司董事会共有6名成员，其中3名独立董事。

黄炜先生，董事长，硕士学历。1997年7月至2002年5月在工商银行广东省分行工作，担任信贷部副经理；2002年5月至2013年11月在工商银行深圳分行工作，担任机构业务部总经理，现任新疆能源产业基金（管理）有限公司董事长。2015年7月至今，任公司董事长。

孙磊先生，董事，硕士学历。曾先后任职于中国工商银行深圳红围支行、中国工商银行深圳市分行投资银行部、中信银行长沙分行投资银行部，现任杭州新天地集团有限公司董事长。2015年7月至今，任公司董事。

王晓耕女士，董事，硕士学历。曾先后任职于深圳发展银行总行国际部、大鹏证券有限责任公司经纪业务总部、《新财富》杂志社，2009年1月起担任五矿证券有限责任公司副总经理，2015年1月任新疆前海联合基金管理有限公司筹备组负责人，2015年7月至今任公司总经理、董事。

孙学致先生，独立董事，博士学历。历任吉林大学法学院教授、副院长，吉林省高级人民法院庭长助理，现任吉林功承律师事务所创始合伙人。2015年7月至今，任公司独立董事。

张东成先生，独立董事，硕士学历。1994年取得律师执业资格。曾先后任职于华夏证券和中国国际金融有限公司投行部门，以及东方昆仑律师事务所、国浩律师事务所及金杜律师事务所；现任加拿大高林律师事务所顾问。2015年7月至今，任公司独立董事。

冯梅女士，独立董事，博士学历。历任山西高校联合出版社编辑，山西财经大学副教授、中国电子信息产业发展研究院研究员、北京工商大学教授，现任北京科技大学教授。2015年7月至今，任公司独立董事。

2、监事基本情况

公司不设监事会，设监事2名。

宋粤霞女士，监事，硕士学历。历任深圳市金鹏会计师事务所文员、中国平安保险股份有限公司会计、深圳市足球俱乐部财务主管。现任凯信恒有限公司总经理、执行（常务）董事。2015年7月至今，任公司监事。

赵伟先生，监事，硕士学历。历任深圳证券通信有限公司增值业务部项目经理、中国UNIX用户协会信息技术部项目经理和厦门南鹏电子有限公司产品研发部软件工程师。现任新疆前海联合基金管理有限公司运营管理部IT经理。2016年4月至今，任公司监事。

3、公司高级管理人员

王晓耕女士，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

李华先生，督察长，硕士学历。历任北京大学经济管理系讲师、广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估有限公司董事长、天一证券有限公司华南业务总部总经理、融通基金管理有限公司监察稽核部总监、监事。2015年7月至今，任公司督察长。

刘菲先生，总经理助理，学士学历。先后任职于中国农业银行三峡分行电脑部、中国银河证券宜昌新世纪营业部电脑部、国泰君安证券深圳蔡屋围营业部电脑部、博时基金管理有限公司信息技术部等，2007年6月至2015年4月任融通基金管理有限公司信息技术部总监。2015年5月至今，任公司总经理助理。

4、本基金基金经理

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（2016年10月18日至今）兼新疆前海联合海盈货币（2015年12月24日至今）、前海联合添利债券（2016年11月11日至今）、前海联合添和纯债（2016年12月7日至今）和前海联合永兴纯债（2017年8月14日至今）的基金经理。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（2016年11月2日至今）兼新疆前海联合海盈货币（2016年8月18日至今）、前海联合添利债券（2016年11月17日至今）和前海联合汇盈货币（2017年5月25日至今）的基金经理。

5、基金管理人投资决策委员

公司投资决策委员会包括：总经理王晓耕女士，基金经理林材先生，研究发展部负责人王静女士，基金经理张雅洁女士，总经理助理刘菲先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人概况

1、基本情况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：卢愿

电话：0571-88261004

传真：0571-88268688

成立时间：1993 年 04 月 16 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 17,959,696,778 元

存续期间：持续经营

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】91 号

基金托管资格批文及文号：《关于核准浙商银行股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》；证监许可【2013】1519 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。经中国人民银行批准，可以经营结汇、售汇业务。

2、主要人员情况

沈仁康先生，浙商银行党委书记、董事长、执行董事。硕士研究生。沈先生曾任浙江省青田县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；浙江省丽水市副市长，期间兼任丽水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任浙江省丽水市委常委；浙江省丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市委副

书记、代市长、市长。

刘晓春先生，浙商银行党委副书记、副董事长、执行董事、行长。本科、高级经济师。刘先生曾任中国农业银行浙江省分行金融研究所《浙江农村金融研究》编辑部副主任、国际业务部信贷科科长、国际业务部信贷部经理、营业部副总经理、国际业务部总经理，中国农业银行总行国际业务部副总经理，中国农业银行浙江省分行党委委员、副行长，中国农业银行香港分行副总经理、总经理。

（二）发展概况及财务状况

“浙商银行”是经中国银监会批准设立的全国性股份制商业银行，全称为“浙商银行股份有限公司”，英文全称为“CHINA ZHESHANG BANK CO., LTD.”，英文简称“CZBANK”。浙商银行前身为“浙江商业银行”，是一家于1993年在宁波成立的中外合资银行，2004年6月30日，经中国银监会批准，重组、更名、迁址，改制为现在的浙商银行，并于2004年8月18日正式开业，总行设在浙江省杭州市。2016年3月30日，浙商银行在港上市，股票代码为（02016.HK）。

浙商银行确立了“两最”发展总目标：到2025年左右，成为最具竞争力全国性股份制商业银行和浙江省最重要金融平台。最具竞争力是指在服务能力、风控能力、创新能力、盈利能力上具有明显竞争优势，最重要金融平台是指成为服务全国乃至全球市场、功能齐全、规模领先、业绩优良、声誉卓著的代表性金融机构。根据上述总目标，浙商银行确立了全资产经营战略：在继续做大信贷资产规模的同时，通过加强与银行同业、非银行金融机构以及类金融机构的合作，积极参与各类金融市场，实现资产经营表内与表外、本币与外币及多品种融合，为客户提供全方位、持续性金融解决方案。以尽量少耗用资源的方式，在不同阶段强化相应的战略性业务、轻资产业务和效益型业务，进而重塑银行资产负债表，以资产经营能力驱动负债，不断提升市场竞争力、扩大市场影响力。

2017年上半年，浙商银行在“两最”总目标引领下，积极调整业务结构、增收节支、严控风险，经营效益持续增长。截至2017年6月30日，浙商银行资产总额14,532.90亿元，较上年末增幅7.27%，负债总额13,674.76亿元，较上年末增幅6.22%；实现净利润56.02亿元，同比增长18.32%，年化平均总资产回报率0.80%，年化平均权益回报率16.54%。

（三）托管业务部的部门设置及员工情况

浙商银行资产托管部是总行独立的一级管理部门，根据业务条线下设业务管理中心、市场一部、市场二部、运营中心、监督中心，保证了托管业务前、中、后台的完整与独立。截至 2017 年 9 月 30 日，资产托管部从业人员共 39 名。

浙商银行资产托管部遵照法律法规要求，根据业务的发展模式、运营方式以及内部控制、风险防范等各方面发展的需要，制定了一系列完善的内部管理制度，包括业务管理、操作规程、基金会计核算、清算管理、信息披露、内部稽核监控、内控与风险防范、信息系统管理、保密与档案管理、重大可疑情况报告及应急处理等制度，系统性地覆盖了托管业务开展的方方面面，能够有效地控制、防范托管业务的政策风险、操作风险和经营风险。

（四）证券投资基金托管业务经营情况

中国证监会、银监会于 2013 年 11 月 13 日核准浙商银行开办证券投资基金托管业务，批准文号：证监许可[2013]1519 号。

截至 2017 年 9 月 30 日，浙商银行托管证券投资基金 15 只，规模合计 531.44 亿元，且目前已经与数十家公募基金管理公司达成托管合作意向。

（五）基金托管人内部控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

浙商银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制

约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

4、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

(1) 前海联合基金网上交易平台

交易网站: www.qlhfund.com

客服电话: 400-640-0099

(2) 直销机构: 新疆前海联合基金管理有限公司

住所: 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

法定代表人: 王晓耕

办公地址: 深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼

电话: (0755) 82785257

传真: (0755) 82788000

客服电话: 400-640-0099

联系人: 黄毅

(二) 登记机构

机构名称: 新疆前海联合基金管理有限公司

住所: 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

法定代表人: 王晓耕

办公地址: 深圳市福田区华富路1018号中航中心26楼

电话: 0755-82786790

传真: 0755-82789277

客服电话: 400-640-0099

联系人: 黄嘉宇

(三) 律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

注册地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人: 俞卫锋

联系人: 陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

(四) 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：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

办公地址：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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陶忆

经办注册会计师：陈玲、陶忆

四、基金的名称

新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

（一）基金的投资目标

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。

（二）投资范围

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）。

基金的投资组合比例为：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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

（三）投资策略

1、资产配置策略

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。

2、债券投资策略

债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

(1) 利率预期策略

基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

(2) 收益率曲线配置策略

收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略，必须先预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限机构。

(3) 可转债投资策略

本基金将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的内嵌期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。基金将通过定性和定量相结合的方法对有较好盈利能力或成长前景的上市公司发行的可转债进行重点选择，同时密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面确认上市公司的转股意愿，以选择安全性和收益性俱佳的投资品种。本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。

3、股票投资策略

本基金采取自下而上的个股精选策略，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票。自下而上的投资策略相信，无论经济环境或行业环境如何变化，总是有一些个股能超越市场表现，

获得高于市场平均水平的回报。因而，自下而上的研究方法，就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。在行业配置方面，本基金管理人将根据宏观经济形式对行业配置进行动态调整。

4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

5、中小企业私募债券投资策略

对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。

6、国债期货投资策略

本基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

7、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线变动、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；

- (2) 本基金投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；
- (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%；
- (4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (13) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (15) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (16) 本基金投资国债期货后，应遵守如下限制：
 - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基

金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值，不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

3) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(17) 本基金投资于中小企业私募债券比例合计不高于基金资产净值的 10%；

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

3、关联交易原则

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（五）业绩比较基准

1、本基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

2、中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人经和基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以变更本基金业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

（六）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。

（七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人、股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（八）基金投资组合报告

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，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。本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	551,205,000.00	83.16
	其中：债券	551,205,000.00	83.16
	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	99,950,389.93	15.08
	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	1,899,200.42	0.29
8	其他资产	9,782,349.12	1.48
9	合计	662,836,939.47	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（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。

（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。

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。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	480,652,000.00	99.89
	其中：政策性金融债	480,652,000.00	99.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,023,000.00	6.24
6	中期票据	40,530,000.00	8.42
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	551,205,000.00	114.56

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	240,000,000.00	49.88
2	160418	16 农发 18	950,000	89,965,000.00	18.70
3	160207	16 国开 07	500,000	47,490,000.00	9.87
4	160310	16 进出 10	500,000	45,705,000.00	9.50
5	160210	16 国开 10	300,000	27,504,000.00	5.72

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

10、投资组合报告附注

(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。

(2) 关于本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库及相关投资决策程序的说明。

本基金本报告期末未持有股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,782,349.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,782,349.12

(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) 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。

(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。

八、基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 9 月 30 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。下述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

前海联合添鑫债券 A

阶段	净值收 益率①	净值收益 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 效以来至 2017 年 9 月 30 日	-4.58%	0.17%	-4.74%	0.09%	0.16%	0.08%

前海联合添鑫债券 C

阶段	净值收 益率①	净值收益 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 效以来至 2017 年 9 月 30 日	-4.94%	0.17%	-4.74%	0.09%	-0.20%	0.08%

九、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金份额销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

目。

（四）基金费率的调整

根据相关法律法规及中国证监会的有关规定，基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况并履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率或提高销售服务费等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在中国证监会指定媒介公告并报中国证监会备案。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》；
- 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、中国证监会要求的其他文件。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2017 年 6 月 20 日刊登的《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金招募说明书更新（2017 年第 1 号）》进行了更新，并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据和基金业绩的截止日期；
- 2、对“基金管理人”相关信息进行了更新；
- 3、对“基金托管人”相关信息进行了更新；
- 4、对“相关服务机构”相关信息进行了更新；
- 5、在“基金的投资”部分，披露了本基金最近一期投资组合报告的内容；
- 6、在“基金的业绩”部分，披露了基金自基金合同生效以来的投资业绩；
- 7、在“其他应披露事项”部分，列明了前次招募说明书公布以来的其他应披露事项；
- 8、对部分表述进行了调整。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇一七年十二月一日