

新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
（2019 年第 1 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：南京银行股份有限公司

## 【重要提示】

新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金由新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金转型而来。

新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2016】113号文)注册募集。基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金于2016年11月21日至2016年11月28日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月30日生效。

自2018年2月5日至2018年2月25日新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金降低基金费率有关事项的议案》、《关于新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金修改投资范围及投资组合限制有关事项的议案》及《关于新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金新增自动清盘条款有关事项的议案》,内容包括新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金调整基金投资目标、投资范围、投资策略以及修订基金合同等,并更名为“新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金”。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2018年2月26日起,由《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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做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券。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。

本基金为混合型证券投资基金,预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中中高预期收益和预期风险水平的投资品种。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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 2 月 26 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 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

成立日期：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：0755-23695903

联系人：钟红艳

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7名成员，其中3名独立董事。

黄炜先生，董事长，硕士研究生。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。

邓清泉先生，副董事长，硕士研究生。曾先后任职于重庆华华塑料有限公司、中信实业银行重庆分行、健桥证券股份有限公司、云南国际信托投资公司、中信证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、平安银行股份有限公司、平安信托有限责任公司；现任深圳市钜盛华股份有限公司副总裁。

孙磊先生，董事，硕士研究生。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。

王晓耕女士，董事，硕士研究生。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。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独立管理人。

冯梅女士，独立董事，博士。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。

张卫国先生，独立董事，博士。曾先后任职于宁夏师范学院、宁夏大学、西安交通大学；2004年至今任职于华南理工大学，历任华南理工大学经济与贸易学院副院长，华南理工大学工商管理学院副院长、常务副院长，现任华南理工大学工商管理学院院长、教授、博士生导师。

## 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，大学本科。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。

赵伟先生，监事，硕士研究生。先后任职于厦门南鹏电子有限公司、深圳证券通信有限公司，担任软件工程师、项目经理等职，2015年1月参加新疆前海联合基金管理有限公司筹备组，2015年8月起任新疆前海联合基金管理有限公司信息技术部IT工程师。

## 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。

邱张斌先生，督察长，硕士研究生。历任安永会计师事务所审计经理，银华基金管理有限公司监察稽核部监察员，大成基金管理有限公司监察稽核部执行总监及大成创新资本管理有限公司副总经理兼监察稽核与风险管理部总监。2018年10月加入新疆前海联合基金管理有限公司。2018年12月至今，任公司督察长。

刘菲先生，总经理助理，大学本科。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月加入新疆前海联合基金管理有限公司筹备组，2015年8月至今，任公司总经理助理。

周明先生，总经理助理，硕士研究生。先后任职于日本电信电话有限公司(日本)研发部，深圳市联想信息产品有限公司开发部，融通基金管理有限公司监察稽核部，乾坤期货有限公司合规部。2015年8月加入新疆前海联合基金管理有限公司，历任风险管理部副总经理，产品开发部副总经理兼机构业务部、渠道业务部副总经理。2018年6月至今，任公司总经理助理。

#### 4、本基金基金经理

林材先生，硕士研究生，具有11年证券基金从业经验。曾任金元顺安基金管理有限公司基金经理，民生加银基金管理有限公司基金经理助理，德邦证券医药行业核心分析师，上海医药工业研究院行业研究员等，具备丰富的基金投资管理组合经验。2015年9月加入前海联合基金，现任前海联合泓鑫混合（2016年11月30日至今）兼前海联合新思路混合（2016年11月11日至今）、前海联合沪深300（2016年11月30日至今）、前海联合国民健康混合（2016年12月29日至今）、前海联合添利债券（2016年11月17日至今）和前海联合研究优选混合（2018年7月25日至今）的基金经理。

何杰先生，经济数学理学硕士研究生，8年证券、基金投资研究经验，于2018年3月加入前海联合基金，任职于权益投资部。2013年5月至2018年2月任职于前海人寿保险股份有限公司资产管理中心，历任研究员、投资助理、投资经理。2010年3月至2013年3月任华创证券股份有限责任公司研究所研究员。现任前海联合泓鑫混合（2018年4月12日至今）兼前海联合研究优选混合（2018年8月7日至今）、前海联合润丰混合（2018年10月9日至今）、前海联合新思路混合（2018年12月18日至今）和前海联合先进制造混合（2019年1月24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，基金经理张雅洁女士，基金经理王静女士，基金经理黄海滨先生，基金经理敬夏玺先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：南京银行股份有限公司

住所：南京市中山路 288 号

法定代表人：胡升荣

成立时间：1996 年 2 月 6 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可〔2014〕405 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：848220.7924 万元人民币

存续期间：持续经营

### (二) 基金托管业务经营情况

#### 1、托管业务概况

南京银行成立于 1996 年 2 月 8 日，是一家具有由国有股份、中资法人股份、外资股份及众多个人股份共同组成独立法人资格的股份制商业银行，实行一级法人体制。南京银行历经两次更名，先后于 2001 年、2005 年引入国际金融公司和法国巴黎银行入股，在全国城商行中率先启动上市辅导程序并于 2007 年成功上市。目前注册资本为 84.82 亿元，下辖 17 家分行，185 家营业网点，员工总数 8600 余人。

南京银行坚持走差异化、特色化、精细化的发展道路，努力做成中小银行中的一流品牌，将中小企业和个人业务作为战略业务重点推进，丰富业务产品体系，倾力满足中小企业与个人融资需求，业务品牌影响力不断扩大。自 2007 年设立第一家异地分行以来，跨区域经营不断推进，先后设立了泰州、北京、上海、杭州、扬州、无锡、南通、苏州、常州、盐城、南京、镇江、宿迁、连云港、江北新区、徐州、淮安 17 家分行，机构战略布局持续深化。

2014 年 4 月 9 日，南京银行获得证监会和银监会联合批复的证券投资基金托管业务资格。取得资格后，南京银行充分发挥基金公司、资产管理等牌照齐全的优势，持续加强与金融市场、投资银行等业务的条线联动优，托管产品种类不断丰富，目前可以开展公募基金托管、银行理财托管、基金公司专户产品托管、

基金子公司专户/专项产品托管、证券公司定向/集合资产管理计划托管、信托计划保管、私募基金托管、保险资金托管等业务。截止到 2018 年 6 月 30 日, 南京银行托管产品组合数超过 2500 只, 托管规模超 16000 亿。

## 2、资产托管部组织架构和人员配置情况

经董事会审议通过, 南京银行于 2013 年 10 月 28 日成立了独立的一级部门---资产托管部, 下设业务运营部、业务一部、业务二部、内控稽核部、综合管理部、研究开发部六个内设部门。

目前, 南京银行资产托管部共有 54 人, 其中从事会计核算、资金清算、投资监督、信息披露、内控稽核的人员 30 人, 市场营销 14 人。相较同期获批基金托管资格的其他银行, 南京银行在托管运营上配备较强的人力。

## 3、托管系统情况

南京银行托管业务系统建设由深圳市赢时胜信息技术股份有限公司承建, 使用了其最新版本的资产托管业务系统, 能支持目前市场上大多数公募基金的托管业务。该系统采用了基于 EJB 技术的 B/S 结构, 支持远程接入功能, 能够实现与基金管理人、基金注册登记机构、证券登记结算机构等相关业务机构的系统安全对接, 具有良好的安全性、稳定性、开放性和可扩展性, 且与本行的其他业务系统严格分离。

我部开发建设了自己的“鑫托管”业务系统。2016 年 10 月, 我行自主研发的“鑫托管”系统上线, 解决了清算系统问题, 大大提升了划款效率。2017 年 5 月, “鑫托管”系统二期功能上线, 实现了全业务流程系统操作, 同时推出了“鑫托管”托管网银系统, 客户可以通过托管网银实时查询托管账户资金余额、托管产品处理进度, 可以通过托管网银系统进行指令录入、划款材料上传等。2018 年 2 月, “鑫托管”系统推出深证通、专线渠道, 实现与管理人指令系统直联。2018 年 5 月, 推出“鑫托管”系统微信服务号, 管理人可通过微信端实时查询托管账户资金余额、托管指令处理进度等。 下阶段, 将持续推动系统建设, 优化业务流程, 提升营运效率。一是着力完善“鑫托管”系统功能, 使鑫托管系统成为集业务处理、数据管理、绩效考核、内控管理、客户关系管理于一体的托管业务综合平台; 二是实现“鑫托管”系统直联中债登、上清所以及中证登业务系统, 进一步优化交易确认和监督流程, 满足客户交易时效性要求; 三是建设“鑫

托管”大数据平台，对业务数据进行深入分析利用，更好为客户服务。

### (三) 基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章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

南京银行资产托管部由业务运营部、业务一部、业务二部、内控稽核部、综合管理部、研究开发部六个部门组成。资产托管部内设独立、专职的内控稽核部，配备内控稽核人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。其他各业务部门在各自职责范围内执行风险控制制度，落实具体的风险控制措施。同时，总行风险部对托管业务的风险控制工作进行指导和监督。

#### 3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有内设部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则：资产托管部设立独立的内控稽核部，该部门保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各内设部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管行资产与基金资产严格分开；托管业务日常运作部门与研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则：内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反

馈和纠正。

(7) 审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险, 审慎经营, 保证托管资产的安全与完整为出发点; 托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则, 在新增业务时, 做到先期完成相关制度建设。

(8) 责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人, 并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### 4、内部控制制度及措施

(1) 制度建设: 建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构: 前后台分离, 不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估: 内控稽核部负责托管业务的内控监督工作, 制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间: 业务操作区相对独立, 实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理: 进行定期的业务与职业道德培训, 使员工树立风险防范与控制理念。

(6) 应急预案: 制定完备的《应急预案》, 并组织员工定期演练; 建立异地灾备中心, 保证业务不中断。

#### (四) 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。基金管理人对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

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,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、直销机构

(1) 前海联合基金网上交易平台

交易网站: [www.qlhfund.com](http://www.qlhfund.com)

客服电话: 400-640-0099

(2) 前海联合基金直销交易平台

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) 82785257

传真: (0755) 82788000

客服电话: 400-640-0099

联系人: 余伟维

##### 2、其他基金销售机构情况

(1) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路689号

办公地址: 上海市广东路689号

法定代表人: 周杰

电话: 021-23219275

传真: 021-23219000

联系人: 李笑鸣

网址: <http://www.htsec.com>

(2) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：李梅

电话： 021-33388229

传真： 021-33388224

联系人： 李玉婷

网址： [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(3) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦  
20楼2005室

法定代表人：韩志谦

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：王怀春

网址： [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(4) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：李福春

电话： 0431-85096517

传真： 0431-85096795

联系人：安岩岩

客户服务电话:4006-000-686

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(5) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

电话:021-54509998

传真:021-64385308

联系人: 张崎

网址: [fund.eastmoney.com](http://fund.eastmoney.com)

(6) 上海陆金所资产管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号西裙楼

法定代表人: 胡学勤

电话: 021-20665952

传真: 021-22066653

客服电话: 400-866-6618

联系人: 程晨

网址: [www.lu.com](http://www.lu.com)

(7) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

客服电话: 4006-788-887

联系人: 童彩平

网址: [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(8) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人: 张冠宇

电话: 010-85870662

传真: 010-59200800

客服电话: 400-819-9858

联系人: 刘美薇

网址: [www.datangwealth.com](http://www.datangwealth.com)

（9）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

电话：021-80359115

传真：021-80359611

客服电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（10）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 b1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

联系人：钟琛

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

（11）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客服电话：4007-006-665

联系人：陆敏

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（12）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

电话：021-80365020

传真：021-63332523

客服电话：4006-433-389

联系人：葛佳蕊

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

（13）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

电话：010-56580660

传真：010-56580666

客服电话：400-618-0707

联系人：陈铭洲

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

（14）一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：88312877

传真：88312877

客户服务电话：400-001-1566

联系人：段京璐

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

（15）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418

室

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

联系人：刘勇

客服电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

（16）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：张冠宇

电话：010-58845312

传真：010-58845306

联系人：陈霞

客户服务电话:400-898-0618

网址:www.chtfund.com

（17）上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

电话：021-51327185

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

（18）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：马勇

电话：010-83363101

传真：010-83363072

联系人: 文雯

公司网站: [www.new-rand.cn](http://www.new-rand.cn) 或 [www.jrj.com.cn](http://www.jrj.com.cn)

(19) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

电话: 010-56282140

传真: 010-62680827

联系人: 丁向坤

网址: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(20) 恒泰证券股份有限公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址: 内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人: 庞介民

电话: 0471-4972675

联系人: 熊丽

网址: <http://www.cnht.com.cn/>

(21) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人: 王常青

电话: 010-85156310

传真: 010-65182261

联系人: 刘芸

网址: <http://www.csc108.com>

(22) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人: 李兴春

电话：021-61101685

传真：021-50583633

联系人：陈孜明

网址：[www.leadfound.com.cn](http://www.leadfound.com.cn)

（23）深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

电话：0755-66892301

传真：0755-84034477

联系人：张烨

网站：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

（24）南京途牛金融信息服务有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号

办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号

法定代表人：宋时琳

电话：（025）86853969

传真：（025）86853969

联系人：王旋

网址：<http://jr.tuniu.com>

（25）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：010-85650628

传真：010-65884788

联系人：刘洋

网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

（26）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

网址：<http://kenterui.jd.com>

(27) 北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：徐晓荣

电话：010-58170876

传真：010-58170800

(28) 济安财富（北京）资本管理有限公司

住所：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699 济安财富

(29) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

注册资本：2208 万元人民币

联系人：徐淼

电话: 027-87006009-8015

传真: 027-87006010

(30) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人: TAN YIK KUAN

联系人: 叶健

电话: 0755-89460500

传真: 0755-21674453

(31) 深圳市小牛投资咨询有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址: 深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼

法定代表人: 梁明锋

联系人: 黄碧莲

电话: 0755-32981999

传真: 0755-32981999-8001

(32) 天津万家财富资产管理有限公司

住所: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人: 李修辞

联系人: 邵玉磊

电话: 18511290872

传真: 010-59013707

(33) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市益田路江苏大厦38-46层

办公地址: 深圳市益田路江苏大厦38-46层

法定代表人: 霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

（34）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：深圳市益田路江苏大厦 38-46 层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-83574507

传真：010-83574807

（35）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

（36）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：石静武

电话：021-38631117

传真：021-58991896

（37）中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：0531-68889095

（38）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

（39）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层  
5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

传真：010-85712195

传真：021-52975270

（40）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：陈灿辉

电话：021-38784818

传真：021-68774818

联系人：陈媛

网址：[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

（41）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：王连志

电话：0755-82558323

传真：0755-82558166

联系人：刘志斌

网址：www.essence.com

（42）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：冷飞

电话：021-50810687

传真：021-58300279

网址：www.wacai.com

（43）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：田为奇

联系人：吴卫东

电话：021-68889082

传真：021-68889283

网址：www.pytz.cn

（44）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汗青

联系电话：025-66996699-887226

联系人：王锋

网址：jinrong.suning.com

## (45) 北京植信基金销售有限公司

注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人: 于龙

电话: 010-56075718

传真: 010-67767615

联系人: 张喆

网址: <https://www.zhixin-inv.com>

## (46) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人: 陈柏青

联系人: 韩爱彬

客服电话: 4000-766-123

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

## (47) 北京植信基金销售有限公司

注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人: 于龙

电话: 010-56075718

传真: 010-67767615

联系人: 张喆

网址: <https://www.zhixin-inv.com>

## (48) 深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址: 深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人: 杨艳平

电话: 0755-22676026

传真: 0755-26640652

联系人：胡闻智

网址：[www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

(49) 上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

电话：021-60907378

传真：021-60907397

联系人：黄志鹏

网址：[www.youyufund.com](http://www.youyufund.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，变更、调整本基金的销售机构，并及时公告。

## (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：0755-25129526

传真：0755-82789277

客服电话：400-640-0099

联系人：陈艳

## (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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507  
单元 01 室

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：李隐煜

经办注册会计师：薛竞、李隐煜

#### 四、基金的名称

新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金

## 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

在严格控制风险的基础上,通过对不同资产类别的优化配置及组合精选,力求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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等)、资产支持证券、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、股指期货、国债期货、货币市场工具、权证以及经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相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%;

基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

### (三) 投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,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。

在大类资产配置中,本基金主要考虑(1)宏观经济指标,包括国际经济和国内经济的GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等,以判断阶段性的最优资产;(2)微观经济指标,包括市场资金供求状况、不同类别资产的盈利变化情况及盈利预期等;(3)市场方面指标,包括市场成交量、估值水平、股票及债券市场的涨跌及预期收益率以及反映投资人情绪的技术指标等;(4)政策因素,包括宏观政策、资本市场相关政策和整个行业相关政策等的出台对市场的影响等。

## 2、股票投资策略

### (1) 行业配置策略

本基金管理人在进行行业配置时,将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中,基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。

#### 1) 自上而下的行业配置

自上而下的行业配置策略是指通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化特征以及在国民经济中所处的位置,确定在当前宏观背景下适宜投资的重点行业。

#### 2) 自下而上的行业配置

自下而上的行业配置策略是指从行业的成长能力、盈利趋势、价格动量、市场估值等因素来确定基金重点投资的行业。对行业的具体分析主要包括以下方面:

##### A、景气分析

行业的景气程度可通过观测销量、价格、产能利用率、库存、毛利率等关键指标进行跟踪。行业的景气程度与宏观经济、产业政策、竞争格局、科技发展与技术进步等因素密切相关。

##### B、财务分析

行业财务分析的主要目的是评价行业的成长性、成长的可持续性以及盈利质量,同时也是对行业景气分析结论的进一步确认。财务分析考量的关键指标主要包括净资产收益率、主营业务收入增长率、毛利率、净利率、存货周转率、应收

账款周转率、经营性现金流状况、债务结构等等。

### C、估值分析

结合上述分析,本基金管理人将根据各行业的不同特点确定适合该行业的估值方法,同时参考可比国家类似行业的估值水平,来确定该行业的合理估值水平,并将合理估值水平与市场估值水平相比较,从而得出该行业高估、低估或中性的判断。估值分析中还将运用行业估值历史比较、行业间估值比较等相对估值方法进行辅助判断。

此外,本基金还将运用数量化方法对上述行业配置策略进行辅助,并在适当情形下对行业配置进行战术性调整,使用的方法包括行业动量与反转策略,行业间相关性跟踪与分析等。

#### (2) 优选个股策略

本基金构建股票组合的步骤是:根据定量与定性分析确定股票初选库;基于公司基本面全面考量、筛选优势企业,运用现金流贴现模型等估值方法,分析股票内在价值;结合风险管理,构建股票组合并对其进行动态调整。

##### 1) 确定股票初选库

本基金将采用定量与定性分析相结合的方式确定股票初选库。定量分析方面,基金管理人将综合考虑个股的价值程度、成长能力、盈利趋势、价格动量等量化指标对个股进行初选。为克服纯量化策略的缺点,投研团队还将根据行业景气程度、个股基本面预期等基本面分析指标,结合对相关上市公司实地调研结果,提供优质个股组合并纳入股票初选库。

##### 2) 股票基本面分析

本基金严格遵循“价格/内在价值”的投资理念。虽然证券的市场价格波动不定,但随着时间的推移,价格一定会反映其内在价值。

个股基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。基本面分析的目的是从定性和定量两个方面考量行业竞争趋势、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素,业务发展的关键点等,从而明确财务预测(包括现金流贴现模型输入变量)的重要假设条件,并对这些假设的可靠性加以评估。

A、价值评估。分析师根据一系列历史和预期的财务指标,结合定性方法,

分析公司盈利稳固性,判断相对投资价值。主要指标包括:EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率、ROE、经营利润率和净利润率等。

B、成长性评估。主要基于收入、EBITDA、净利润等的预期增长率来评价公司盈利的持续增长前景。

C、现金流预测。通过对影响公司现金流各因素的前瞻性地估计,得到公司未来自由现金流量。

D、行业所处阶段及其发展前景的评估。沿着典型的技术生命周期,产业的发展一般经历创新期、增长繁荣期I、震荡期、增长繁荣期II 和技术成熟期。其中增长繁荣期I 和增长繁荣期II 是投资的黄金期。

### 3) 现金流贴现股票估值模型

用现金流贴现模型等方法对股票估值是基本面分析中的重要内容。本基金采用的现金流贴现模型是一个多阶段自由现金流折现模型,其中,自由现金流的增长率被分成四个阶段。

A、初始阶段:这个阶段现金流的增长率会受到内外部因素的影响。外部因素包括总体经济状况和其他因素,比如货币政策、税收政策、产业政策对收入和成本的影响等等。公司内部因素包括新产品的引入导致的市场份额变化、业务重整、以及资金面变化,比如债务削减和资本回购。

B、正常阶段:在初始阶段结束时,我们假设公司处于一个正常的经济环境中,既非繁荣也非衰退,公司达到了可持续的长期增长水平。现在,公司现金流的增长速度和所在的行业增长速度基本一致。

C、变迁阶段:在这个阶段,公司资本支出比率、权益回报、盈利增长和BETA值都向市场平均水平靠拢。这是市场竞争的结果,因为高额的利润会吸引新的进入者,竞争越来越激烈,新进入者不断挤压利润空间,直到整个行业利润水平跌落到市场平均水平,在这个水平上,不会再有新的进入者。

D、终极阶段:在最后阶段,资本支出比率、BETA 和现金流增长率都等于市场平均水平。

模型最后得到股票的内在价值,即四阶段现金流的现值总和。

市场价格与内在价值的差额是基金买入或卖出股票的依据。市场价格低于内在价值的幅度,表明股票的吸引力大小。本基金在使用现金流贴现模型方法的同

时,还将考虑中国股票市场特点和某些行业或公司的具体情况。在实践中,现金流量贴现模型可能有应用效果不理想的情形,为此,我们不排除选用其它合适的估值方法,如P/E、P/B、EV/EBITDA、PE/G、P/RNAV等。

#### 4) 构建及调整投资组合

本基金结合多年的研究经验,在充分评估风险的基础上,将分析师最有价值的研究成果引入,评估股票价格与内在价值偏离幅度的可靠性,买入估值更具吸引力的股票,卖出估值吸引力下降的股票,构建股票投资组合,并对其进行调整。

### 3、债券投资策略

在选择债券品种时,第一,综合考虑发债主体的信用水平、主营业务情况、发展情况、财务指标、国家政策和市场机遇等因素进行动态调整;第二,根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;第三,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;第四,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

对于可转债投资,本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上,采用定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好,以及基础股票基本面优良的品种进行投资。本基金还将密切关注转换溢价率等指标,积极捕捉相关套利机会。

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。

### 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:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

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、股指期货投资策略

为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。

#### 6、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### (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) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%;
- (2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;
- (3) 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%;
- (4) 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%;本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
- (5) 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%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 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;

(13) 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;

(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) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(16) 本基金参与股指期货交易, 须遵循以下投资比例限制:

1) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;

2) 在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

3) 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指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 20%；

4) 所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(17) 本基金参与国债期货交易, 须遵循以下投资比例限制:

1) 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) 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) 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) 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%；

(18) 本基金参与股指期货或国债期货交易, 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%。其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等；

(19) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(21) 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。

除第(2)、(12)、(15)、(20)项以外, 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。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述投资组合比例限制,如适用于本基金,基金管理人可按照取消或调整后的规定修改基金合同,无需经基金份额持有人大会审议。

## 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或调整上述限制,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或按调整后的规定执行。

## 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

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合全价指数收益率\*50%。

沪深 300 指数是中证指数有限公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数,科学地反映了我国证券市场的整体业绩表

现,具有一定的权威性和市场代表性,业内也普遍采用。因此,沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。中债综合全价指数能够较好地反映债券市场变动的全貌,适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者上述基准指数停止计算编制或更改指数名称,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

本基金为混合型证券投资基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

#### (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、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
- 2、有利于基金资产的安全与增值;
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利,保护基金份额持有人的利益;
- 4、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。基金托管人南京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 2018 年 12 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	97,179,222.90	46.54
	其中:股票	97,179,222.90	46.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,064,000.00	9.61

	其中：债券	20,064,000.00	9.61
	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	82,000,150.00	39.27
	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	8,100,292.46	3.88
8	其他资产	1,455,078.68	0.70
9	合计	208,798,744.04	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

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	75,581,520.00	36.47
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	-	-
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	21,547,557.10	10.40
J	金融业	50,145.80	0.02
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	-	-
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	97,179,222.90	46.89

### (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。

### (3) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603517	绝味食品	492,000	16,290,120.00	7.86
2	300760	迈瑞医疗	105,000	11,468,100.00	5.53
3	000977	浪潮信息	700,000	11,144,000.00	5.38
4	300349	金卡股份	670,000	10,787,000.00	5.20
5	002332	仙琚制药	1,670,000	10,237,100.00	4.94
6	600570	恒生电子	180,000	9,356,400.00	4.51
7	600845	宝信软件	447,926	9,339,257.10	4.51
8	600563	法拉电子	180,000	7,585,200.00	3.66
9	601233	桐昆股份	600,000	5,856,000.00	2.83
10	300271	华宇软件	190,000	2,851,900.00	1.38

### 3、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	20,064,000.00	9.68
	其中:政策性金融债	20,064,000.00	9.68
4	企业债券	-	-
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	20,064,000.00	9.68

### 4、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	180209	18国开09	200,000	20,064,000.00	9.68

注:本基金报告期末仅持有上述债券。

### 5、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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五名贵金属投资 明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7、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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

#### 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）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。

##### （3）期末其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	456,000.40
2	应收证券清算款	641,312.69
3	应收股利	-
4	应收利息	357,201.44
5	应收申购款	564.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,455,078.68

##### （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。

##### （5）期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（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 2018 年 12 月 31 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。

前海联合泓鑫混合

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
自基金合 同生效起 至 2018 年 12 月 31 日	-8.09%	1.15%	-11.72%	0.67%	3.63%	0.48%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合全价指数收益率\*50%。

## 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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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按前一日 C 类基金份额资产净值的 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 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的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付给登记机构。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(《基金合同》生效前的费用根据《新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定执行);
- 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) 费用调整

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调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率和提高基金销售服务费率,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变更注册的文件；
- 2、《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合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 2018 年 10 月 10 日刊登的《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（2018 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、对“基金份额的申购和赎回”相关信息进行了更新；
- 6、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；
- 7、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；
- 8、对“基金的费用与税收”相关信息进行了更新；
- 9、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；
- 10、对部分表述进行了调整。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇一九年四月十一日