

新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券
证券投资基金
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添鑫 3 个月定开债券
交易代码	003471
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 18 日
报告期末基金份额总额	49,088,368.81 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	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、判断未来大类资产表现，确定在债券资产和股票资产之间的配置比例。在严格控制风险的前提下，发掘和利用潜在投资机会，力争获取超越比较基准的投资收益。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
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，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 3 个月定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	2,016,325.23 份	47,072,043.58 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（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	前海联合添鑫3个月定开债券A	前海联合添鑫3个月定开债券C
1. 本期已实现收益	105,499.74	2,329,675.59
2. 本期利润	103,089.91	2,159,820.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0505	0.0452
4. 期末基金资产净值	2,409,298.43	54,407,598.53
5. 期末基金份额净值	1.1949	1.1558

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 3 个月定开债券 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	4.23%	0.34%	-1.48%	0.08%	5.71%	0.26%
过去六个月	5.95%	0.29%	-2.50%	0.10%	8.45%	0.19%
自基金合同生效起至今	5.50%	0.29%	-2.31%	0.10%	7.81%	0.19%

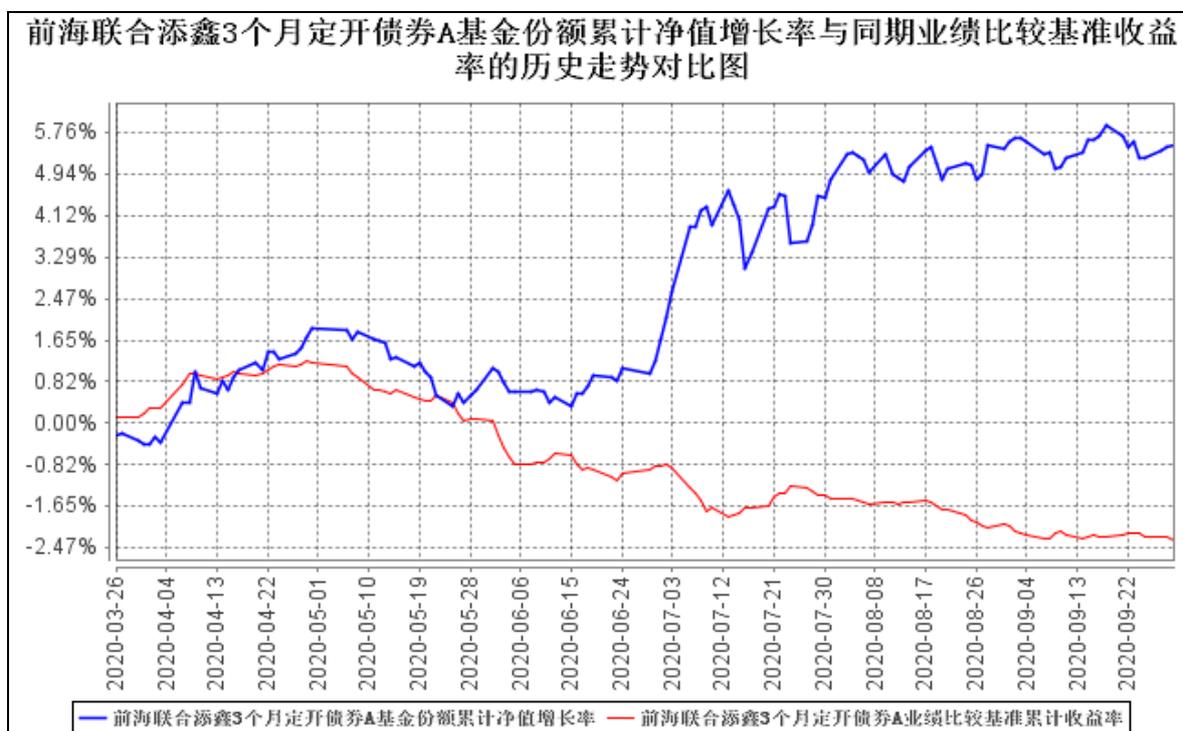
前海联合添鑫 3 个月定开债券 C

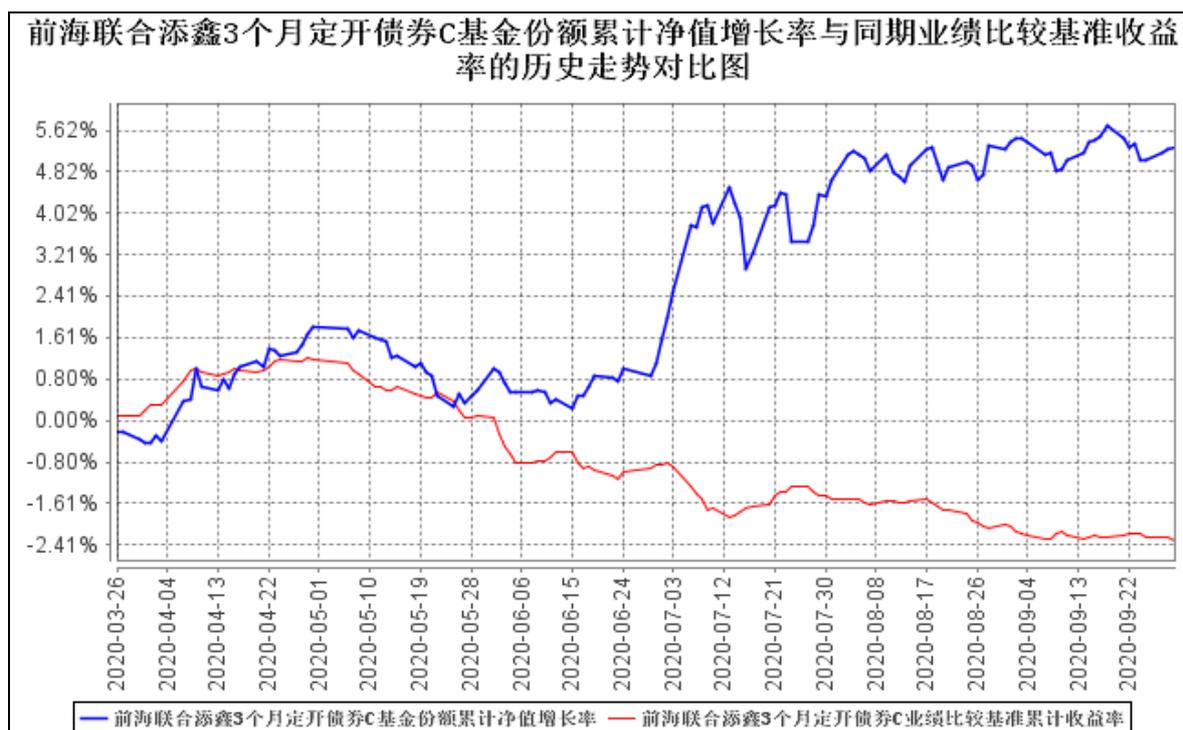
阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	4.13%	0.34%	-1.48%	0.08%	5.61%	0.26%
过去六个月	5.74%	0.29%	-2.50%	0.10%	8.24%	0.19%
自基金合同生效起至今	5.28%	0.29%	-2.31%	0.10%	7.59%	0.19%

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。

3.2.2 自基金转型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：本基金转型日期为2020年3月26日，截至报告期末，本基金转型未满一年。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
敬夏玺	本基金的基金经理	2016年11月2日	-	10年	敬夏玺先生，中央财经大学金融学硕士，10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。现任新疆前海联合添鑫3个月定期开放债券型证券投资基金兼新疆前海联合泓元纯债定期开放债券型

				发起式证券投资基金、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、新疆前海联合淳安纯债 3 年定期开放债券型证券投资基金、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金、新疆前海联合汇盈货币市场基金和新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 1 月曾任新疆前海联合海盈货币市场基金的基金经理，2018 年 9 月至 2019 年 12 月曾任新疆前海联合润丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 3 月曾任新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的基金经理，2017 年 5 月至 2020 年 3 月曾任新疆前海联合汇盈货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	---

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

2020 年三季度国内经济逐步走出疫情影响，各项经济指标延续了环比修复的态势，但整体上看同比增长动能仍有不足。而相比于全球其他主要经济体，我国的经济修复表现十分强劲，比较优势较为明显。三季度资本市场表现为股强债弱，股票市场放量上涨，债券市场延续跌势。市场表现的原因主要在于国内经济基本面反弹的绝对和相对优势，国内货币政策出现微调，资金利率从疫情期间的极低水平回到了疫情前的常态化水平，但与疫情前相比暂未出现大幅的收紧。展望未来一个季度，经济的环比复苏仍然在进行中，预计股票市场的表现会优于债券市场，但股票市场可能维持结构性分化的特征。

本基金三季度在债券底仓部分主要持有高评级债券和利率债，可转债维持偏低的配置，主要从股票仓位部分寻找投资机会，股票仓位在基金合同约定的比例范围内维持在中高水平，沿着疫情发展和经济复苏的主线进行配置。未来一个季度我们仍将延续目前的配置思路，同时密切关注经济基本面的边际变化及全球疫情的发展情况，对组合进行动态的调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合添鑫 3 个月定开债券 A 基金份额净值为 1.1949 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.23%；截至本报告期末前海联合添鑫 3 个月定开债券 C 基金份额净值为 1.1558 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.13%；同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

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	6,232,760.00	10.93
	其中：股票	6,232,760.00	10.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,669,128.90	85.33
	其中：债券	48,669,128.90	85.33
	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	500,000.00	0.88
	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	1,164,549.07	2.04
8	其他资产	472,665.18	0.83
9	合计	57,039,103.15	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	3,222,965.00	5.67
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	597,472.00	1.05
H	住宿和餐饮业	425,004.00	0.75
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,000.00	0.23
J	金融业	1,327,399.00	2.34
K	房地产业	111,230.00	0.20
L	租赁和商务服务业	245,234.00	0.43
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	171,456.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	6,232,760.00	10.97

5.2.2 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通过港股通机制投资港股。

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	600887	伊利股份	14,500	558,250.00	0.98
2	000333	美的集团	6,800	493,680.00	0.87
3	002594	比亚迪	3,500	406,840.00	0.72
4	601336	新华保险	5,700	353,856.00	0.62
5	600309	万华化学	5,000	346,500.00	0.61
6	600036	招商银行	9,000	324,000.00	0.57
7	601066	中信建投	6,500	323,830.00	0.57
8	002241	歌尔股份	7,000	283,010.00	0.50
9	601021	春秋航空	6,000	270,000.00	0.48
10	601888	中国中免	1,100	245,234.00	0.43

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,509,750.00	22.02
	其中：政策性金融债	10,007,000.00	17.61
4	企业债券	13,055,100.00	22.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,104,278.90	40.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,669,128.90	85.66

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	100,000	10,007,000.00	17.61
2	132013	17 宝武 EB	49,000	5,029,850.00	8.85
3	136623	16 国君 G4	50,000	4,997,500.00	8.80
4	136671	16 中车 01	40,000	4,006,800.00	7.05
5	132006	16 皖新 EB	30,230	3,298,093.00	5.80

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	103,758.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	368,906.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	472,665.18

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

1	132013	17 宝武 EB	5,029,850.00	8.85
2	132006	16 皖新 EB	3,298,093.00	5.80
3	132007	16 凤凰 EB	3,076,161.00	5.41
4	132015	18 中油 EB	2,988,300.00	5.26
5	132011	17 浙报 EB	2,807,448.00	4.94
6	132004	15 国盛 EB	2,648,764.30	4.66
7	132008	17 山高 EB	1,545,000.00	2.72
8	110034	九州转债	343,710.00	0.60
9	110065	淮矿转债	312,576.00	0.55
10	113021	中信转债	262,475.00	0.46
11	113011	光大转债	259,204.00	0.46
12	110038	济川转债	239,551.60	0.42
13	110033	国贸转债	185,266.00	0.33
14	113008	电气转债	107,880.00	0.19

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	前海联合添鑫 3 个月定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月 定开债券 C
报告期期初基金份额总额	2,644,091.49	94,134,448.37
报告期期间基金总申购份额	6,995.72	12,763.04
减：报告期期间基金总赎回份额	634,761.98	47,075,167.83
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	2,016,325.23	47,072,043.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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者赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	1	20200701-20200930	46,728,971.96	-	-	46,728,971.96	95.19%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内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。							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 8 月 15 日发布公告，刘菲先生自 2020 年 8 月 15 日起不再担任公司总经理助理兼首席信息官。

§ 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一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放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净值信息及其他临时公告。

9.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件存放于基金管理人处。

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

2020 年 10 月 28 日