

新疆前海联合添利债券型发起式  
证券投资基金  
2021 年第 1 季度报告

2021 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：2021 年 4 月 22 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 2021 年 4 月 20 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 2021 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 11 日
报告期末基金份额总额	95,037,466.12 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，通过采取利率预期策略、收益率曲线配置策略、可转债投资策略等积极投资策略，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，发掘和利用潜在投资机会，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	93,695,744.88 份	1,341,721.24 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（2021年1月1日—2021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	2,724,776.77	37,306.15
2. 本期利润	1,738,824.82	22,918.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0186	0.0176
4. 期末基金资产净值	107,236,202.99	1,576,358.52
5. 期末基金份额净值	1.1445	1.1749

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	1.64%	0.45%	-0.07%	0.17%	1.71%	0.28%
过去六个月	3.51%	0.37%	1.82%	0.14%	1.69%	0.23%
过去一年	11.08%	0.40%	1.83%	0.14%	9.25%	0.26%
过去三年	11.66%	0.34%	8.02%	0.14%	3.64%	0.20%
自基金合同生效起至今	14.45%	0.30%	5.19%	0.13%	9.26%	0.17%

前海联合添利债券 C

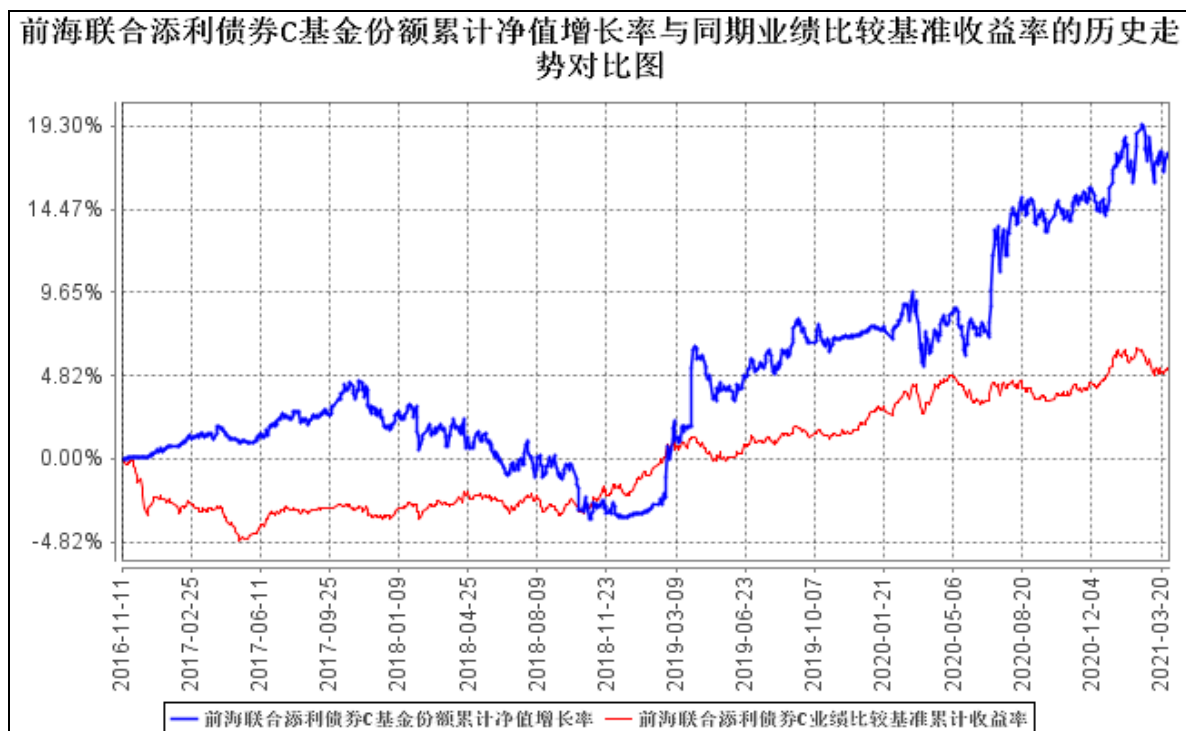
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.55%	0.44%	-0.07%	0.17%	1.62%	0.27%

过去六个月	3.31%	0.36%	1.82%	0.14%	1.49%	0.22%
过去一年	10.71%	0.40%	1.83%	0.14%	8.88%	0.26%
过去三年	15.29%	0.36%	8.02%	0.14%	7.27%	0.22%
自基金合同生效起至今	17.49%	0.31%	5.19%	0.13%	12.30%	0.18%

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





### 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		
林材	本基金的基金经理	2016年11月17日	—	13年	林材先生，理学硕士，13年证券投资基金投资研究经验。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。2015年9月加入前海联合基金。现任新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金兼新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金和新疆前海联合科

					技先锋混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合研究优选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 7 月曾任新疆前海联合新思路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 7 月曾任新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 3 月新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
黄浩东	本基金的基金经理, 固定收益部总经理	2019 年 12 月 17 日	-	9 年	黄浩东先生, 清华大学管理学学士及管理学硕士, 9 年证券投资研究经验。2011 年 7 月至 2019 年 8 月任职于东莞证券股份有限公司深圳分公司, 历任研究员、投资经理、副总经理兼投资经理。2019 年 8 月加入前海联合基金。现任新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金兼新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合添泽债券型证券投资基金、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金和新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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

回顾 2021 年一季度，境内外疫苗全面开始接种，全球经济延续复苏趋势，大宗商品走势强劲。国内供给端和出口趋势良好，而需求则还没有明显提升。核心 CPI 触底回升和 PPI 持续向好，一度引发了市场的担忧，但 CPI 同比基数不高，目前不是主要矛盾。猪周期下行背景下，通胀预期会比较温和上升，央行预计会根据通胀数据相机而动。

回顾一季度货币政策，央行除了 1 月底防止股市和房市过热收紧了流动性外，其他时间都维持流动性的合理宽裕。货币政策中性继续为主要方向，货币政策预计将保持流动性合理宽裕，努力服务实体经济。

权益市场一季度行情出现比较大的波动，绩优白马股高估值受到了市场的冲击出现比较大的回调。

本基金一季度维持中等杠杆操作，转债仓位随着行情变化逐步加仓，股票仓位则维持在合同约定范围内的中高水平。

#### 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利债券 A 基金份额净值为 1.1445 元，本报告期基金份额净值增长

率为 1.64%；截至本报告期末前海联合添利债券 C 基金份额净值为 1.1749 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%；同期业绩比较基准收益率为-0.07%。

#### 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	16,441,028.24	14.81
	其中：股票	16,441,028.24	14.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,683,479.06	82.58
	其中：债券	91,683,479.06	82.58
	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	-	-
	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	1,564,188.99	1.41
8	其他资产	1,330,114.37	1.20
9	合计	111,018,810.66	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	9,201,064.00	8.46
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	1,263,560.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	478,800.00	0.44
J	金融业	949,700.00	0.87



K	房地产业	1,299,580.00	1.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	280,400.00	0.26
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	1,294,140.00	1.19
R	文化、体育和娱乐业	1,673,784.24	1.54
S	综合	-	-
	合计	16,441,028.24	15.11

### 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	002044	美年健康	50,000	771,000.00	0.71
2	300083	劲胜智能	56,000	749,280.00	0.69
3	300144	宋城演艺	30,000	643,200.00	0.59
4	002415	海康威视	10,800	603,720.00	0.55
5	002597	金禾实业	15,000	591,000.00	0.54
6	000333	美的集团	7,000	575,610.00	0.53
7	000681	视觉中国	37,000	538,350.00	0.49
8	600066	宇通客车	35,000	502,250.00	0.46
9	300251	光线传媒	41,088	492,234.24	0.45
10	601336	新华保险	10,000	485,500.00	0.45

### 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	7,993,600.00	7.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,737,282.45	5.27
	其中：政策性金融债	5,737,282.45	5.27
4	企业债券	16,805,414.54	15.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	61,147,182.07	56.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,683,479.06	84.26

### 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	132011	17 浙报 EB	97,900	9,769,441.00	8.98
2	019649	21 国债 01	80,000	7,993,600.00	7.35
3	108604	国开 1805	57,059	5,737,282.45	5.27
4	132008	17 山高 EB	51,330	5,354,232.30	4.92
5	136874	16 华泰 G4	50,000	5,035,000.00	4.63

## 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

1. 国开 1805 发债主体被监管处罚事件：

(1) 2020 年 10 月 26 日，根据京汇罚〔2020〕32、33 号，因违反银行交易记录管理规定、违规开展外汇交易，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条、第四十九条，国家开发银行被国家外汇管理局北京外汇管理部处以合计 120 万元的罚款。

(2) 2020 年 12 月 25 日，根据银保监罚决字〔2020〕67 号，因为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况等案由，国家开发银行被银保监会处以 4880 万元的罚款。

(3) 2020 年 4 月 1 日-2021 年 3 月 31 日，国家开发银行海南省分行及浙江省分行由于擅自提供对外担保；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规行为，被当地外汇管理局、银保监局等监管机构处以罚款合计 4511.16 万元，并

没收违法所得 1097.91 万元。

基金管理人经审慎分析，认为国家开发银行资产规模大，经营情况良好，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对国家开发银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于国家开发银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对国家开发银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 2.16 华泰 G4 发债主体被监管处罚事件：

2020 年 11 月 23 日，根据江苏证监局[2020]112 号，因 2019 年 8 月存在重大信息安全事件未报告，根据《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》第五十七条的规定，江苏证监局决定对华泰证券采取出具警示函的行政监管措施。

基金管理人经审慎分析，认为华泰证券资产规模大，经营情况良好，且华泰证券主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，该事项对华泰证券自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于华泰证券的决策程序说明：基于华泰证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于华泰证券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对华泰证券经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 3. 浦发转债发债主体被监管处罚事件：

(1) 2020 年 4 月 16 日，根据银保监消保发〔2020〕4 号，浦发银行代理销售的私募产品出现延期兑付的问题，引发多起消费者投诉，经查存在准入环节未对所代理的产品进行充分分析，尽职调查不到位，与相关监管规定不符；在向部分客户销售所代理的产品时，未按照监管要求，在网点专门区域销售代销产品并录音录像，而是采用上门服务模式等问题，被银保监会消费者权益保护局通报。

(2) 2020 年 8 月 10 日，根据沪银保监银罚决字〔2020〕12 号，因 2013 至 2019 年间存在未按专营部门制规定开展同业业务；同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目等案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等，浦发银行被上海银保监局责令整改，并处以 2100 万元的罚款。

(3) 2020 年 12 月 11 日，根据上海汇管罚字【2020】20200007 号，因违反公正、公平、诚

信原则，违规开展外汇市场交易；违反银行交易记录管理规定，根据《外汇管理条例》第四十七条第（五）项 以及《外汇管理条例》第四十七条第（五）项，上海外汇管理局责令浦发银行限期改正并处罚款 140 万元人民币。

基金管理人经审慎分析，认为浦发银行资产规模大，经营情况良好，且浦发银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对浦发银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于浦发银行的决策程序说明：基于浦发银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于浦发银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对浦发银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 4. 苏银转债发债主体被监管处罚事件：

2020 年 12 月 30 日，根据苏银保监罚决字〔2020〕88 号，因个人贷款资金用途管控不严；发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款等违法违规事由，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，江苏银保监局对江苏银行处以 240 万元人民币的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为江苏银行资产规模大，经营情况良好，且江苏银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对江苏银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于江苏银行的决策程序说明：基于江苏银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于江苏银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对江苏银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

### 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	5,543.20
2	应收证券清算款	626,367.18
3	应收股利	-
4	应收利息	687,871.38
5	应收申购款	10,332.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计		1,330,114.37
---	----	--	--------------

#### 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	132011	17 浙报 EB	9,769,441.00	8.98
2	132008	17 山高 EB	5,354,232.30	4.92
3	132006	16 皖新 EB	4,190,982.60	3.85
4	110059	浦发转债	3,697,200.00	3.40
5	110053	苏银转债	3,156,720.00	2.90
6	113021	中信转债	1,789,590.00	1.64
7	110068	龙净转债	1,283,184.00	1.18
8	132018	G 三峡 EB1	1,262,307.20	1.16
9	113011	光大转债	1,219,000.00	1.12
10	128081	海亮转债	1,184,064.75	1.09
11	110031	航信转债	1,058,100.00	0.97
12	110038	济川转债	1,004,693.70	0.92
13	110063	鹰 19 转债	984,557.20	0.90
14	110056	亨通转债	838,406.40	0.77
15	128105	长集转债	826,339.50	0.76
16	128122	兴森转债	791,045.88	0.73
17	110051	中天转债	745,232.60	0.68
18	110033	国贸转债	737,673.60	0.68
19	128071	合兴转债	730,380.00	0.67
20	110065	淮矿转债	726,600.00	0.67
21	113033	利群转债	700,420.00	0.64
22	123056	雪榕转债	675,935.00	0.62
23	113549	白电转债	667,027.20	0.61
24	128107	交科转债	600,600.00	0.55
25	110045	海澜转债	599,520.00	0.55
26	110062	烽火转债	592,872.00	0.54
27	110060	天路转债	560,100.00	0.51
28	128083	新北转债	554,270.40	0.51
29	110034	九州转债	549,200.00	0.50
30	110073	国投转债	526,100.10	0.48
31	127016	鲁泰转债	516,449.78	0.47
32	110064	建工转债	484,450.00	0.45
33	123048	应急转债	484,065.00	0.44
34	113525	台华转债	458,234.00	0.42
35	110041	蒙电转债	426,840.00	0.39
36	128064	司尔转债	419,668.56	0.39

37	128057	博彦转债	417,690.00	0.38
38	113039	嘉泽转债	413,920.00	0.38
39	128126	赣锋转 2	405,825.00	0.37
40	110052	贵广转债	390,160.00	0.36
41	128117	道恩转债	390,160.00	0.36
42	113034	滨化转债	354,810.00	0.33
43	113584	家悦转债	350,315.00	0.32
44	128128	齐翔转 2	328,230.00	0.30
45	113563	柳药转债	325,611.00	0.30
46	110057	现代转债	312,840.00	0.29
47	132015	18 中油 EB	303,660.00	0.28
48	128131	崇达转 2	296,580.00	0.27
49	113601	塞力转债	285,870.00	0.26
50	110048	福能转债	242,520.00	0.22
51	110047	山鹰转债	233,420.00	0.21
52	127012	招路转债	209,700.40	0.19
53	123007	道氏转债	205,500.00	0.19
54	113024	核建转债	204,036.00	0.19
55	128022	众信转债	203,660.00	0.19
56	128129	青农转债	197,382.82	0.18
57	113017	吉视转债	188,000.00	0.17
58	113508	新风转债	180,165.00	0.17
59	113550	常汽转债	175,650.00	0.16
60	132007	16 凤凰 EB	166,796.00	0.15
61	128033	迪龙转债	154,510.00	0.14
62	128096	奥瑞转债	119,750.00	0.11
63	127011	中鼎转债	113,410.00	0.10
64	113013	国君转债	111,020.00	0.10
65	110067	华安转债	109,020.00	0.10
66	113026	核能转债	105,980.00	0.10
67	113027	华钰转债	99,810.00	0.09
68	123002	国祯转债	80,386.20	0.07
69	110061	川投转债	65,215.00	0.06
70	123033	金力转债	57,685.00	0.05
71	113602	景 20 转债	57,425.00	0.05
72	123050	聚飞转债	55,910.00	0.05

### 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	93,743,721.79	1,280,353.18
报告期期间基金总申购份额	74,776.64	108,346.72
减：报告期期间基金总赎回份额	122,753.55	46,978.66
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	93,695,744.88	1,341,721.24

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 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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	4,268.61	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	4,268.61	0.00	-	-	-

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

3、本基金于 2016 年 11 月 11 日成立，截至 2019 年 11 月 11 日，本基金成立满 3 年。本基金管理

人于 2019 年 12 月 11 日申请赎回本基金发起式基金份额 10004000 份。基金管理人的赎回行为符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第十二条第二款有关发起式基金份额锁定期的规定。

## § 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	1	20210101-20210331	92,661,657.00	-	-	92,661,657.00	97.50%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及各基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，就旗下 15 只公募基金投资范围新增存托凭证并对相关法律文件进行修订，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 1 月 30 日发布的相关公告。

2、本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及各基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本基金管理人就旗下 25 只证券投资基金增加侧袋机制相关内容并相应对相关法律文件进行修订，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的相关公告。



## § 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净值信息及其他临时公告。

### 10.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

### 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

2021 年 4 月 22 日