

新疆前海联合添泽债券型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 07 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7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2021年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添泽债券
基金主代码	009349
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年06月04日
报告期末基金份额总额	1,180,160,894.65份
投资目标	本基金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	本基金充分发挥管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产配置进行动态管理。综合信用分析、久期控制、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，同时关注一级市场投资机会，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。

业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
下属分级基金的交易代码	009349	009350
报告期末下属分级基金的份额总额	1,180,160,111.47 份	783.18 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 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）	
	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
1. 本期已实现收益	4,023,379.88	3.59
2. 本期利润	5,538,986.34	18.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0074	0.0093
4. 期末基金资产净值	1,205,359,072.22	796.52
5. 期末基金份额净值	1.0214	1.0170

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

前海联合添泽债券 A 净值表现

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	1.14%	0.04%	0.45%	0.03%	0.69%	0.01%
过去六个月	1.63%	0.03%	0.66%	0.04%	0.97%	-0.01%
过去一年	2.09%	0.05%	-0.12%	0.05%	2.21%	0.00%
自基金合同 生效起至今	2.14%	0.05%	-0.45%	0.06%	2.59%	-0.01%

前海联合添泽债券 C 净值表现

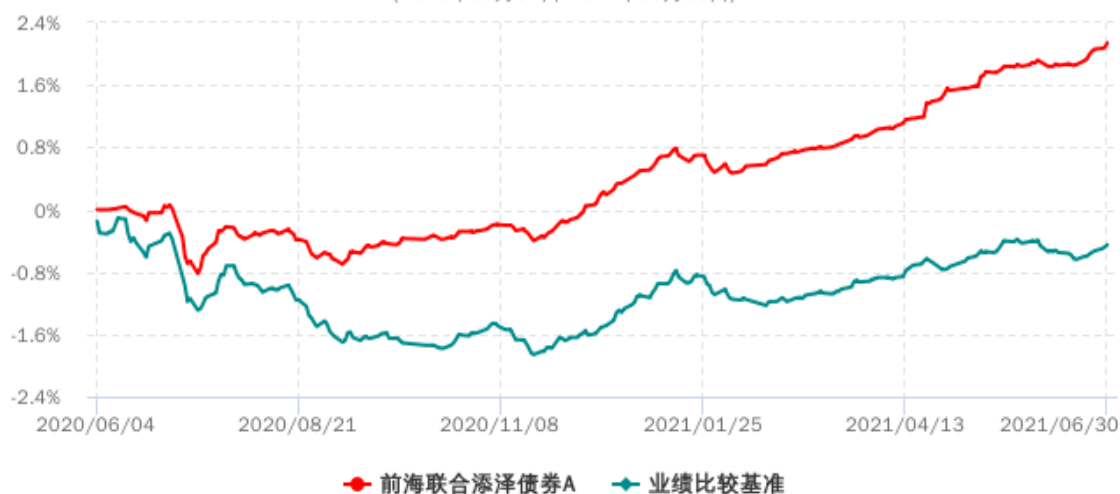
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	1.06%	0.04%	0.45%	0.03%	0.61%	0.01%
过去六个月	1.44%	0.04%	0.66%	0.04%	0.78%	0.00%
过去一年	1.69%	0.05%	-0.12%	0.05%	1.81%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.70%	0.05%	-0.45%	0.06%	2.15%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%。

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

前海联合添泽债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年06月04日-2021年06月30日)



前海联合添泽债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年06月04日-2021年06月30日)



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至报告期末，本基金建仓期结束未满 1 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	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
黄浩东	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2020-06-04	-	9 年	黄浩东先生，硕士研究生，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，现任固定收益部总经理、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2019 年 12 月 17 日起任职）、新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）、新疆前海联合添泽债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 6 月 4 日起任职）、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 6 月 8 日起任职）、新疆前海联合泰瑞纯债

					债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 8 月 13 日起任职）和新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理（自 2021 年 5 月 7 日起任职）。
--	--	--	--	--	--

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”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2021 年二季度，利率市场在经济复苏背景下，收益率仍然缓慢下行。究其原因，这还是利率债供给偏慢，主流机构欠配和流动性充裕造成的，虽然通胀依然温和上行。同时

信用债收益率整体下行，部分低等级城投品种也出现下行。这反应了流动性充裕情况下，机构开始通过下沉风险偏好寻求收益。而流动性宽松是贯穿二季度市场的主脉络。

本基金在二季度维持中等久期的策略，通过持有信用债和利率债获取底仓票息收益，再辅以转债的进攻性交易操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添泽债券 A 基金份额净值为 1.0214 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%；截至报告期末前海联合添泽债券 C 基金份额净值为 1.0170 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,324,467,028.20	98.10
	其中：债券	1,324,467,028.20	98.10
	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	4,856,716.67	0.36

	合计		
8	其他资产	20,776,779.39	1.54
9	合计	1,350,100,524.26	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	964,150,000.00	79.99
	其中：政策性金融债	863,515,000.00	71.64
4	企业债券	40,264,000.00	3.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,533,028.20	2.37
8	同业存单	291,520,000.00	24.19
9	其他	-	-
10	合计	1,324,467,028.20	109.88

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	200313	20 进出 13	2,000,000	201,820,000.00	16.74
2	210202	21 国开 02	2,000,000	200,180,000.00	16.61
3	200207	20 国开 07	1,800,000	180,504,000.00	14.98
4	210212	21 国开 12	1,200,000	120,420,000.00	9.99
5	112103060	21 农业银行 CD060	1,000,000	97,180,000.00	8.06

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股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

1.21 国开 02、20 国开 07、21 国开 12、21 国开 06 发债主体受监管处罚情况：

(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 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日，国家开发银行海南省分行、浙江省分行、陕西省分行以及广西壮族自治区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、人行等监管机构处以罚款合计 4505.91 万元，并没收违法所得 1102.66 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。

2.20 进出 13、19 进出 08 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 2 月 7 日，根据闽银保监罚决字〔2021〕13 号，中国进出口银行福建省分行由于发放无指定用途固定资产贷款，被福建银保监局处以罚款 50 万元。

(2) 2021 年 4 月 22 日, 根据琼银保监罚决字[2021]11 号, 中国进出口银行海南省分行由于贷款“三查”不到位, 被海南银保监局处以 50 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析, 认为中国进出口银行资产规模大, 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, 上述事项对中国进出口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。

本基金投资于中国进出口银行的决策程序说明: 基于中国进出口银行基本面研究以及二级市场的判断, 本基金投资于中国进出口银行, 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, 认为上述事项对中国进出口银行经营和价值应不会构成重大影响, 对基金运作无影响。

3.20 华夏银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况:

(1) 2020 年 7 月 13 日, 根据银保监罚决字〔2020〕24 号, 因内控制度执行不到位, 严重违反审慎经营规则; 生产系统存在重大风险隐患, 严重违反审慎经营规则等案由, 依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第(五)项规定和相关审慎经营规则, 银保监会对华夏银行处以 110 万元的罚款。

(2) 2020 年 10 月 20 日, 根据京汇罚〔2020〕27、28 号, 因违反银行交易记录管理规定; 违规开展外汇掉期业务、外汇即期业务和外汇远期业务, 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, 华夏银行被国家外汇管理局北京外汇管理部处以合计 160 万元的罚款。

(3) 2021 年 5 月 17 日, 根据银保监罚决字〔2021〕19 号, 因违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产; 贷前审查及贷后管理不严等违法违规事由, 依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则, 银保监会对华夏银行处以 9830 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析, 认为华夏银行资产规模大, 经营情况良好, 且华夏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, 该事项对华夏银行自身信用基本面影响很小, 对其短期流动性影响影响很小。

本基金投资于华夏银行的决策程序说明: 基于华夏银行基本面研究以及二级市场的判断, 本基金投资于华夏银行, 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, 认为该事项对华夏银行经营和价值应不会构成重大影响, 对基金运作无影响。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,434.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,759,344.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,776,779.39

5.11.4 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	113011	光大转债	1,618,120.00	0.13
2	110051	中天转债	1,511,162.80	0.13
3	110052	贵广转债	1,214,520.00	0.10
4	110048	福能转债	908,344.00	0.08
5	128114	正邦转债	893,947.12	0.07
6	110073	国投转债	815,364.70	0.07
7	113549	白电转债	814,278.20	0.07
8	110043	无锡转债	788,760.00	0.07
9	128108	蓝帆转债	721,500.00	0.06
10	110064	建工转债	691,040.00	0.06
11	110038	济川转债	660,261.30	0.05
12	128107	交科转债	651,360.00	0.05
13	128071	合兴转债	638,880.00	0.05
14	113033	利群转债	611,220.00	0.05

15	132018	G 三峡 EB1	600,600.00	0.05
16	123063	大禹转债	567,000.00	0.05
17	110062	烽火转债	555,512.40	0.05
18	127015	希望转债	544,200.00	0.05
19	110060	天路转债	541,900.00	0.04
20	128037	岩土转债	537,150.00	0.04
21	113584	家悦转债	512,252.00	0.04
22	127020	中金转债	456,352.00	0.04
23	128081	海亮转债	454,840.00	0.04
24	128105	长集转债	433,360.00	0.04
25	110067	华安转债	429,680.00	0.04
26	113563	柳药转债	428,920.00	0.04
27	113601	塞力转债	417,041.70	0.03
28	128117	道恩转债	415,576.00	0.03
29	113569	科达转债	397,700.00	0.03
30	113542	好客转债	372,360.80	0.03
31	110053	苏银转债	364,080.00	0.03
32	110057	现代转债	358,910.10	0.03
33	123048	应急转债	344,730.00	0.03
34	113039	嘉泽转债	343,530.00	0.03
35	127025	冀东转债	320,910.00	0.03
36	123056	雪榕转债	310,320.00	0.03
37	123028	清水转债	304,680.00	0.03
38	110068	龙净转债	301,920.00	0.03
39	110056	亨通转债	279,534.40	0.02
40	128057	博彦转债	246,320.00	0.02
41	128064	司尔转债	240,360.00	0.02
42	127024	盈峰转债	220,020.00	0.02
43	123002	国祯转债	217,320.00	0.02

44	110034	九州转债	216,480.00	0.02
45	113610	灵康转债	215,740.00	0.02
46	113043	财通转债	213,380.00	0.02
47	110076	华海转债	212,940.00	0.02
48	128140	润建转债	212,111.92	0.02
49	123068	弘信转债	209,636.60	0.02
50	128083	新北转债	206,780.00	0.02
51	123077	汉得转债	190,296.36	0.02
52	128035	大族转债	175,190.40	0.01
53	110045	海澜转债	122,793.00	0.01
54	123050	聚飞转债	115,940.00	0.01
55	113013	国君转债	112,810.00	0.01
56	113044	大秦转债	109,084.60	0.01
57	123053	宝通转债	106,950.00	0.01
58	128129	青农转债	106,860.00	0.01
59	127013	创维转债	105,250.00	0.01
60	123059	银信转债	105,230.00	0.01
61	113024	核建转债	103,494.70	0.01
62	128131	崇达转 2	10,280.00	0.00
63	132008	17 山高 EB	1,046.20	0.00

5.11.5 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。

5.11.6 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

	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
--	------------	------------

报告期期初基金份额总额	100,000,277.85	1,791.21
报告期期间基金总申购份额	1,475,084,263.50	988.41
减：报告期期间基金总赎回份额	394,924,429.88	1,996.44
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	1,180,160,111.47	783.18

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	20210518-20210630	-	737,027,319.18	146,972,369.20	590,054,949.98	50.00%
机构	2	20210518-20210630	-	737,027,319.18	146,972,369.20	590,054,949.98	50.00%

				18			
机构	3	20210401-202 10420	99,999 ,000.0 0	-	99,999, 000.00	-	-
机构	4	20210421-202 10517	-	490,34 3.76	490,343 .76	-	-
机构	5	20210421-202 10517	-	490,34 3.76	490,343 .76	-	-
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资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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泽债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添泽债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添泽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，其他备查文件等文本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

二〇二一年七月二十一日