

新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 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:2022 年 01 月 24 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2022年1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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添和纯债
基金主代码	003498
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 07 日
报告期末基金份额总额	148,446,582.39 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。本基金综合运用久期调整、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。首先，本基金在宏观周期研究的基础上，决定整体组合的久期、期限结构、类属资产结构、杠杆率策略；其次，本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，决定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；然后，本基金通过息差策略、个券挖掘策略的补充获得超额收益；最后，通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。通过甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，力争增加组合的绝对超额收益。

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，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	前海联合添和纯债 A	前海联合添和纯债 C
下属分级基金的交易代码	003498	003499
报告期末下属分级基金的份额总额	4,265,595.32 份	144,180,987.07 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 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日）	
	前海联合添和纯债 A	前海联合添和纯债 C
1. 本期已实现收益	27,873.95	815,296.61
2. 本期利润	52,464.93	1,794,829.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0123	0.0138
4. 期末基金资产净值	4,524,522.98	147,515,936.13
5. 期末基金份额净值	1.0607	1.0231

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

前海联合添和纯债 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	1.19%	0.04%	0.60%	0.05%	0.59 %	-0.0 1%
过去六个月	2.59%	0.04%	1.44%	0.05%	1.15 %	-0.0 1%
过去一年	4.36%	0.04%	2.10%	0.05%	2.26 %	-0.0 1%
过去三年	25.87%	0.43%	3.37%	0.07%	22.5 0%	0.36 %
过去五年	34.95%	0.33%	4.65%	0.07%	30.3 0%	0.26 %
自基金合同 生效起至今	35.26%	0.33%	4.06%	0.07%	31.2 0%	0.26 %

前海联合添和纯债 C 净值表现

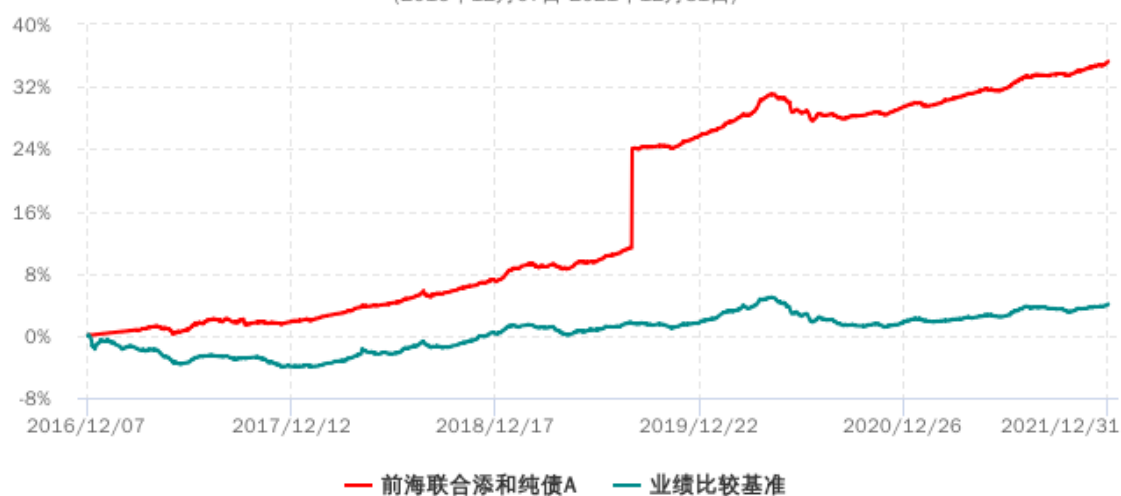
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	1.15%	0.04%	0.60%	0.05%	0.55 %	-0.0 1%
过去六个月	2.33%	0.04%	1.44%	0.05%	0.89 %	-0.0 1%
过去一年	3.82%	0.04%	2.10%	0.05%	1.72 %	-0.0 1%
过去三年	11.71%	0.06%	3.37%	0.07%	8.34 %	-0.0 1%
过去五年	18.90%	0.06%	4.65%	0.07%	14.2 5%	-0.0 1%
自基金合同 生效起至今	19.51%	0.06%	4.06%	0.07%	15.4 5%	-0.0 1%

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。

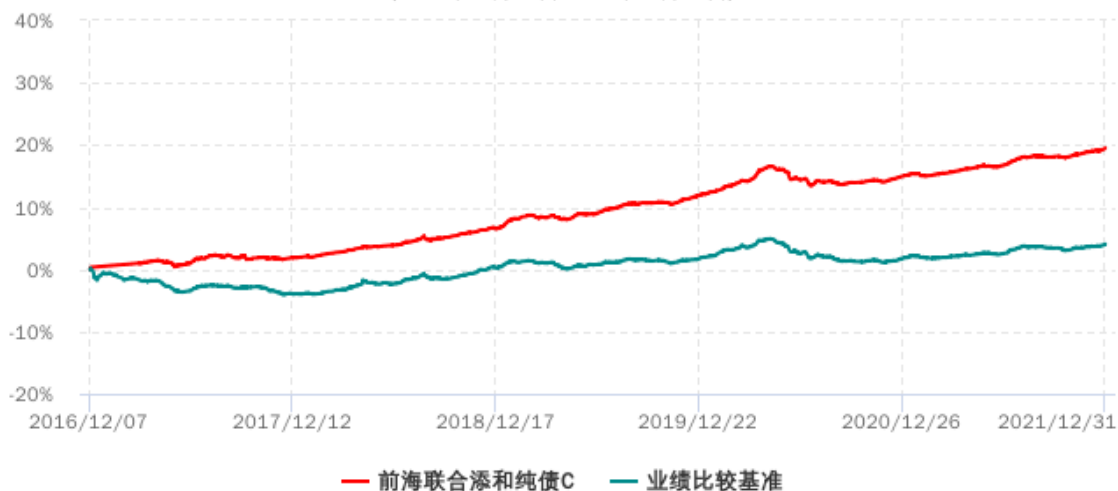
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

前海联合添和纯债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

(2016年12月07日-2021年12月31日)



前海联合添和纯债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
(2016年12月07日-2021年12月31日)



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		
曾婷婷	本基金的基金经理	2020-03-26	-	10年	曾婷婷女士，北京大学 MBA，CPA，10 年证券投资基金投资研究经验。曾任安永会计师事务所深圳分所高级审计、第一创业证券研究所研究所合规经理、华润元大基金管理有限公司固定收益部研究员、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理（自 2017 年 7 月 3 日至 2021 年 5 月 17 日）、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 7 月 5 日至 2021 年 5 月 17 日）、新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 1

				月 24 日至 2021 年 12 月 10 日) 和新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 3 月 26 日至 2021 年 12 月 22 日)。现任新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2016 年 9 月 5 日起任职)、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理 (自 2019 年 12 月 24 日起任职) 和新疆前海联合添和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)。
--	--	--	--	--

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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 4 季度，经济数据显示基本面有较大的下行压力，投资继续下滑，消费疲弱，出口也有所下滑。4 季度房地产信贷政策略有放松，但目前对房地产政策更多是前期的纠偏，并非转向。中央经济工作会议指出，当前我国经济发展面临需求收缩，供给冲击，预期转弱

三重压力。基本面的下行压力对债市有一定支撑。

政策加强对冲经济下行，货币政策中性偏松。2021 年 12 月 15 日下调金融机构存款准备金 0.5 个百分点。1 年 LPR 小幅下调 5BP，5 年 LPR 不动。宽货币是宽信用的必要条件。在美联储加息前，国内货币政策仍有一定的宽松空间。

CPI 回升的方向比较确定，PPI 预计将进入下降区间，PPI-CPI 的剪刀差开始收敛，目前判断 CPI 在明年是一个回升的态势，但需求端疲弱，CPI 回升幅度有限，对货币政策的影响较小。

在基本面和货币政策偏友好的前提下，4 季度债券市场收涨，其中中端收益率下行幅度大于长端和短端。

报告期内，本基金主要配置银行债，在保证组合安全性的前提下，有较好的票息保护。同时运用杠杆和交易策略，以实现增厚基金收益的目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添和纯债 A 基金份额净值为 1.0607 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.60%；截至报告期末前海联合添和纯债 C 基金份额净值为 1.0231 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.60%。

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	192,724,000.00	98.64
	其中：债券	192,724,000.00	98.64
	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	423,324.63	0.22
8	其他资产	2,237,084.77	1.14
9	合计	195,384,409.40	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	192,724,000.00	126.76
	其中：政策性金融债	20,023,000.00	13.17
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	192,724,000.00	126.76

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	2028038	20 中国银行二级 01	100,000	10,373,000.00	6.82
2	2028044	20 广发银行二级 01	100,000	10,364,000.00	6.82
3	1828010	18 建设银行二级 01	100,000	10,360,000.00	6.81
4	2028024	20 中信银行二级	100,000	10,240,000.00	6.74
5	2128012	21 浦发银行 01	100,000	10,201,000.00	6.71

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. 20 中国银行二级 01 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 5 月 17 日，根据银保监罚决字（2021）11 号，因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；违规向关系人发放信用贷款；向无资金缺口企业发放流动资金贷款等违法违规事由，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，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则，中国银行被银保监会处以 8761.36 万元的罚没款。

基金管理人经审慎分析，认为中国银行资产规模大，经营情况良好，且中国银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述事项对中国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。

本基金投资于中国银行的决策程序说明：基于中国银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国银行，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，认为该事项对中国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. 18 建设银行二级 01 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 8 月 13 日，根据银罚字（2021）22 号，因内占压财政存款或者资金；违反账户管理规定，建设银行被人民银行警告，并处以 388 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为建设银行净资产规模大，经营情况良好，且建设银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例低，上述事项对建设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。

本基金投资于建设银行的决策程序说明：基于建设银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于建设银行，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，认为上述事项对建设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 中信银行二级发债主体受监管处罚情况：

2021 年 3 月 17 日，根据银保监罚决字〔2021〕5 号，因客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则以及《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，中信银行被银保监会处以 450 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为中信银行资产规模大，经营情况良好，且中信银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述事项对中信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。

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

4.21 浦发银行 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 4 月 23 日，根据沪银保监罚决字〔2021〕29 号，因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务，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、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》(银监发〔2016〕24 号)(三十九)，上海银保监局对浦发银行采取责令改正的行政处罚，并罚款 760 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日，根据银保监罚决字〔2021〕27 号，因监管发现的问题屡查屡犯；配合现场检查不力；内部控制制度修订不及时等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，银保监会对浦发银行处以罚款 6920 万元。

(3) 2021 年 11 月 15 日，根据上海汇管罚字〔2021〕3121210802 号，因银行卡境外交易信息报送错误，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条第(二)项，浦发银行被国家外汇管理局上海市分局责令整改、警告，并处以 6 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为浦发银行净资产规模较大，经营情况良好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且浦发银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述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，认为上述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。

5.21 平安银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 5 月 28 日，根据云银保监罚决字〔2021〕34 号，因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项，平安银行被中国银保监会云南监管局处以 210 万元的罚款。

(2) 2021 年 9 月 29 日，根据深外管检〔2021〕40 号，因违规办理转口贸易收付汇 2. 违规办理个人财产对外转移等违法违规事由，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条(第一项)、(第二项)(第三项)(第五项)，第十八条(第一项)、(第二项)、(第五项)，第四十九条，平安银行被国家外汇管理局深圳市分局责令整改、警告，并处以罚款 187 万元，没收违法所得 1.58 万元。

基金管理人经审慎分析，认为平安银行资产规模大，经营情况良好，且平安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，该事项对平安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。

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

6.21 杭州银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 1 月 12 日，根据杭银处罚字〔2021〕6 号，因经收的海关税款存在延压情况；零余额账户退库资金存在被占压情况，根据《金融违法行为处罚办法》，杭州银行被中国人民银行杭州中心支行给予警告，并处罚款 25 万元。

(2) 2021 年 5 月 18 日，根据浙银保监罚决字〔2021〕25 号，因房地产项目融资业务不审慎；流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金等违法违规行为，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、第四十八条第（二）项，杭州银行被浙江银保监局处以罚款 250 万元。

基金管理人经审慎分析，认为杭州银行净资产规模较大，经营情况良好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且杭州银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对杭州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。

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

7.21 杭州银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 7 月 21 日，根据闽汇罚〔2021〕5 号，因违规办理内保外贷业务；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料等违法违规事由，国家外汇管理局福建分局对兴业银行采取责令改正、给予警告的行政处罚，并罚款 300 万元，没收违法所得 0.11 万元。

(2) 2021 年 8 月 13 日，根据银罚字〔2021〕26 号，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，人民银行对兴业银行处以罚款 5 万元。

基金管理人经审慎分析，认为兴业银行净资产规模较大，经营情况良好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且兴业银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对兴业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。

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

8.20 渤海银行 01 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 5 月 17 日，根据银保监罚决字〔2021〕13 号，由于地方政府购买服务项目贷款不合规；违规向资本金不足的房地产项目发放贷款等违法违规事由，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，渤海银行被银保监会处以 9720 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为渤海银行净资产规模较大，经营情况良好，实力较强，且渤海银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力强，该事项对渤海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。

本基金投资于渤海银行的决策程序说明：基于渤海银行基本面研究以及二级市场的判断，本

基金投资于渤海银行，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，认为该事项对渤海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	1,225.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,231,629.67
5	应收申购款	4,229.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,237,084.77

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

	前海联合添和纯债 A	前海联合添和纯债 C
报告期期初基金份额总额	4,373,787.30	652,712.66
报告期期间基金总申购份额	597,810.30	144,272,928.23
减：报告期期间基金总赎回份额	706,002.28	744,653.82
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	4,265,595.32	144,180,987.07

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
个人	1	20211015-20211231	-	74,568,270.24	-	74,568,270.24	50.23%
个人	2	20211015-20211231	-	69,045,351.50	-	69,045,351.50	46.51%
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。

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和纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添和纯债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
二〇二二年一月二十四日