

新疆前海联合添泽债券型证券投资基金

2022 年第 1 季度报告

2022 年 03 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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2022 年 04 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022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	1,668,967,549.93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，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	1,668,967,109.09份	440.84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（2022 年 01 月 01 日-2022 年 03 月 31 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	17,543,371.94	3.75
2. 本期利润	6,437,990.10	0.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0020
4. 期末基金资产净值	1,759,069,572.39	460.46
5. 期末基金份额净值	1.0540	1.0445

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	0.37%	0.09%	0.10%	0.06%	0.27%	0.03%
过去六个月	2.07%	0.07%	0.70%	0.05%	1.37%	0.02%
过去一年	4.37%	0.05%	1.96%	0.05%	2.41%	0.00%
自基金合同 生效起至今	5.40%	0.05%	1.06%	0.06%	4.34%	-0.01%

前海联合添泽债券 C 净值表现

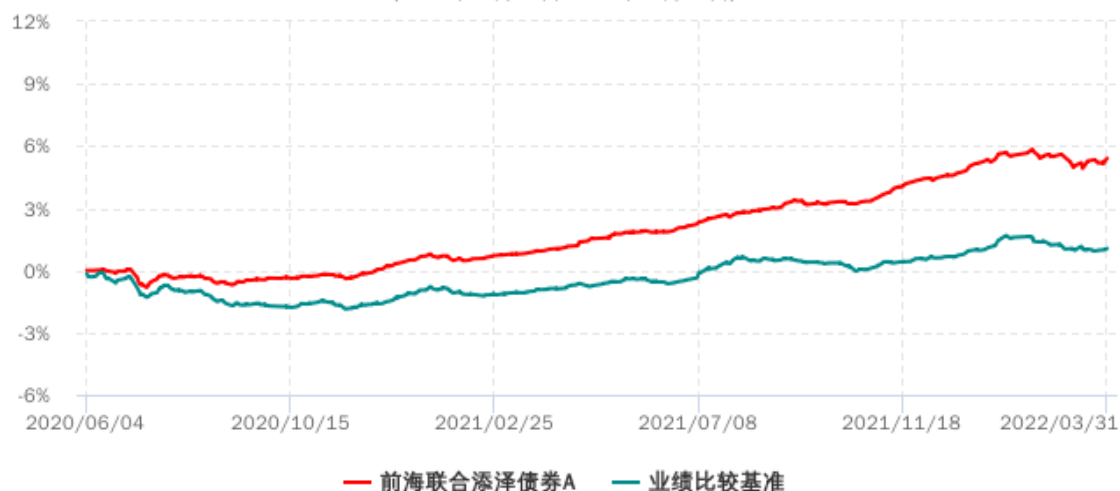
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	0.19%	0.09%	0.10%	0.06%	0.09%	0.03%
过去六个月	1.76%	0.07%	0.70%	0.05%	1.06%	0.02%
过去一年	3.80%	0.05%	1.96%	0.05%	1.84%	0.00%
自基金合同 生效起至今	4.45%	0.05%	1.06%	0.06%	3.39%	-0.01%

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%。

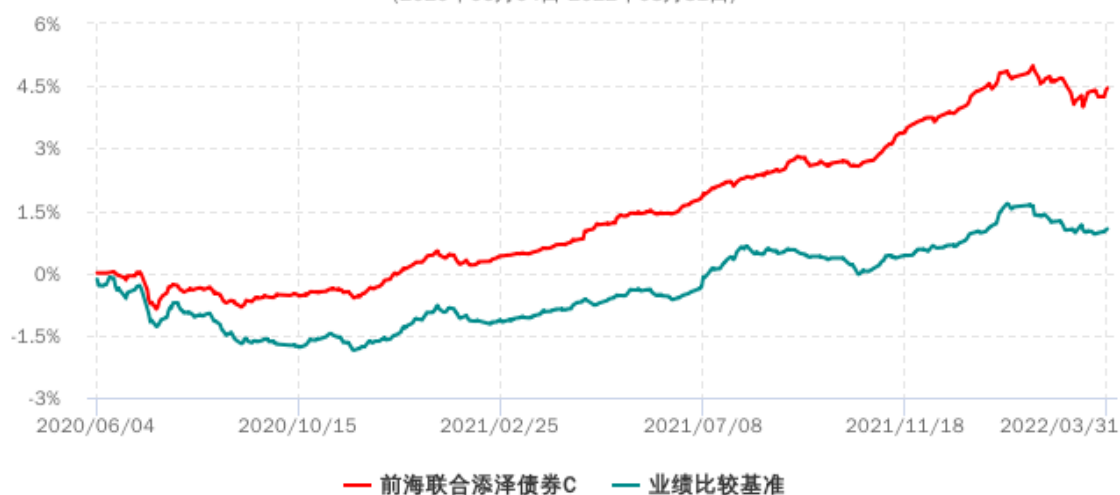
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准

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-2022年03月31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-2022年03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		

黄浩东	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2020-06-04	-	10 年	黄浩东先生，清华大学硕士，10 年证券基金投资研究经验。曾任东莞证券股份有限公司深圳分公司研究员、投资经理、副总经理兼投资经理。现任新疆前海联合基金管理有限公司固定收益部总经理、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）、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）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基金经理（自 2021 年 8 月 20 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所公开竞价，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

回顾 2022 年一季度市场主要关注境内境外两个方面。境内方面，市场关注稳增长和经济数据。年初降息叠加投资者对经济的悲观预期，债券市场出现一波上涨，但接下来的社融数据和地产放松政策则逐步推高债券收益率。2 月 PMI 公布进一步超预期，同时央行未进一步降准降息，市场开始出现比较大的回调。三月份深圳和长春一度封城，经济数据偏空，债市又开始新一轮博弈降息。境外方面，主线是美国加息，叠加俄乌冲突，美债收益率持续上行，中美利差逐步缩小到历史低位。

回顾 2022 年一季度货币政策偏宽松，1 月 MLF 和 OMO 均降息 10BP。

回顾 2022 年一季度市场，国债收益率短端下行，长端上行；国开债收益率整体上行；信用债收益率整体上行，短端相对长端上行幅度较多。

回顾 2022 年一季度股票市场，整体下行，各主要指数都下跌较大，只有少数行业有正收益表现。

回顾 2022 年一季度转债市场，一月初溢价历史高位后，整体随着股市急速下滑。

本基金 2022 年一季度在基金合同约定范围内转债仓位先降后升维持在较低比例，纯债部分利率债逐步置换为信用债。

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 1.0540 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%；截至报告期末前海联合添泽债券 C 基金份额净值为 1.0445 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.10%。

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	1,786,050,767.46	99.56
	其中：债券	1,786,050,767.46	99.56
	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	3,845,820.15	0.21
8	其他资产	3,985,987.72	0.22
9	合计	1,793,882,575.33	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	31,416,817.81	1.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,282,755,681.38	72.92
	其中：政策性金融债	368,577,906.85	20.95
4	企业债券	77,183,126.30	4.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,971,386.31	2.95
7	可转债（可交换债）	263,023,698.56	14.95
8	同业存单	79,700,057.10	4.53
9	其他	-	-
10	合计	1,786,050,767.46	101.53

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	200207	20 国开 07	1,500,000	154,106,917.81	8.76
2	2028025	20 浦发银行二级 01	1,000,000	104,374,208.22	5.93
3	200313	20 进出 13	1,000,000	103,162,493.15	5.86
4	2128032	21 兴业银行二级 01	1,000,000	102,706,334.25	5.84
5	175915	21 中财 G1	1,000,000	100,785,238.36	5.73

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 国开 07、21 国开 12 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字（2022）8 号，由于监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送中存在未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家开发银行被银保监会处以 440 万元的罚款。

(2) 2021 年 4 月 1 日-2022 年 3 月 31 日，国家开发银行大连市分行、广西壮族自治区分行、陕西省分行由于未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定履行大额交易和可疑交易报告义务等违法违规行为，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 164.75 万元，并没收违法所得 4.75 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 华夏银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 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。

(2) 2021 年 8 月 13 日，根据银罚字（2021）25 号，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，华夏银行人民银行处以罚款 486 万元。

(3) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字（2022）19 号，由于监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送中存在漏报不良贷款余额 EAST 数据；逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，华夏银行被银保监会处以 460 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，上述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，认为上述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。

3.20 交通银行 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 4 月 1 日-2022 年 3 月 31 日，交通银行北京分行、新疆维吾尔自治区分行、河北省分行等 18 家分支机构由于理财业务投资运作管理不规范、个人消费贷款业务贷后风控措施严重不到位、个人消费贷款挪用于购房、投资等禁止性领域、向资本金不足且未取得施工许可证项目发放贷款、同业投资资金违规投向股权投资领域等违法违规行为，被当地外汇管理局、银保监局、证监局、人行等监管机构处以警告、罚款等行政处罚，罚款合计 832.5 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日, 根据银保监罚决字〔2021〕28 号, 由于理财业务和同业业务制度不健全; 理财业务数据与事实不符等违法违规事由, 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, 交通银行被银保监会处以 4100 万元的罚款。

(3) 2021 年 8 月 13 日, 根据银罚字〔2021〕23 号, 由于违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等违法违规事由, 交通银行被人民银行处以罚款 62 万元。

(4) 2021 年 10 月 20 日, 根据上海汇管罚字〔2021〕3111210701 号, 因未按规定办理内存外贷业务; 未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务等违法违规事由, 依据《外汇管理条例》第四十三条、《外汇管理条例》第四十七条第(一)项等规定, 交通银行被国家外汇管理局上海市分局警告, 并处以罚款 340 万元, 没收违法所得 82.32 万元。

(5) 2022 年 3 月 21 日, 根据银保监罚决字〔2022〕15 号, 由于监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送中存在漏报不良贷款余额 EAST 数据; 逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差; 漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为, 依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 交通银行被银保监会处以 420 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析, 认为交通银行净资产规模大, 经营情况良好, 实力很强, 且交通银行主体评级为市场最高的 AAA 评级, 实力很强, 上述罚款占其净利润及净资产的比例很低, 上述事项对交通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。

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

4.20 进出 13 发债主体受监管处罚情况:

(1) 2021 年 4 月 1 日-2022 年 3 月 31 日, 中国进出口银行新疆维吾尔自治区分行、天津分行、海南省分行等 3 家分支机构由于未有效监督贷款资金用途, 信贷资金未按约定用途使用, 严重违反审慎经营规则; 贷款“三查”不到位等违法违规事由, 被当地银保监局处以罚款合计 140 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日, 根据银保监罚决字〔2021〕31 号, 因违规投资企业股权; 个别高管人员未经核准实际履职; 监管数据漏报错报等违法违规事由, 依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则, 中国进出口银行被银保监会处以罚款 7345.6 万元。

(3) 2022 年 3 月 21 日, 根据银保监罚决字〔2022〕9 号, 由于监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送中存在漏报不良贷款余额 EAST 数据; 逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差; 漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为, 依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 中国进出口银行被银保监会处以 420 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。

5.20 浦发银行二级 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，由于 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），浦发银行被上海银保监局责令整改，并处以 760 万元的罚款。

(2) 2021 年 7 月 13 日，根据银保监罚决字〔2021〕27 号，由于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行为，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，浦发银行被银保监会处以 6920 万元的罚款。

(3) 2021 年 11 月 15 日，根据上海汇管罚字〔2021〕3121210802 号，由于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处以 6 万元的罚款。

(4) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕25 号，由于监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送中存在漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，浦发银行被银保监会处以 420 万元的罚款。

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，上述罚款占其净资产及净利润的比例很低，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。

6.21 兴业银行二级 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。

(3) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕22 号，由于监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送中存在漏报不良贷款余额 EAST 数据；逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，兴业银行被银保监会处以 350 万元的罚款。

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。

7.20 中信银行二级发债主体受监管处罚情况：

2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕17 号，由于监管标准化数据（EAST）系

统数据质量及数据报送中存在漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中信银行被银保监会处以 290 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，上述罚款占其净资产及净利润的比例很低，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。

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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,383.71
2	应收证券清算款	3,960,604.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,985,987.72

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	110059	浦发转债	18,998,926.03	1.08
2	113044	大秦转债	14,670,228.08	0.83
3	113042	上银转债	13,616,944.38	0.77
4	110073	国投转债	12,796,806.57	0.73
5	110067	华安转债	6,557,778.08	0.37
6	128129	青农转债	5,987,964.00	0.34
7	113050	南银转债	5,850,459.04	0.33
8	128037	岩土转债	5,070,003.95	0.29
9	110045	海澜转债	5,069,619.59	0.29
10	123039	开润转债	5,008,612.19	0.28
11	123090	三诺转债	4,881,180.82	0.28
12	123096	思创转债	4,684,552.42	0.27
13	113605	大参转债	4,587,507.62	0.26
14	128117	道恩转债	4,410,442.22	0.25
15	128074	游族转债	3,928,126.36	0.22

16	113033	利群转债	3,922,200.00	0.22
17	110076	华海转债	3,876,403.42	0.22
18	123104	卫宁转债	3,835,114.53	0.22
19	110068	龙净转债	3,823,601.10	0.22
20	113563	柳药转债	3,671,098.99	0.21
21	123076	强力转债	3,651,721.64	0.21
22	123119	康泰转 2	3,592,048.50	0.20
23	123077	汉得转债	3,175,076.63	0.18
24	128108	蓝帆转债	3,106,046.19	0.18
25	113519	长久转债	3,030,661.23	0.17
26	110062	烽火转债	2,952,531.37	0.17
27	123116	万兴转债	2,949,237.67	0.17
28	113627	太平转债	2,919,805.89	0.17
29	127041	弘亚转债	2,836,553.70	0.16
30	123010	博世转债	2,762,725.98	0.16
31	123113	仙乐转债	2,682,570.86	0.15
32	110053	苏银转债	2,663,116.27	0.15
33	123056	雪榕转债	2,440,325.84	0.14
34	128083	新北转债	2,416,724.11	0.14
35	128071	合兴转债	2,347,234.32	0.13
36	127024	盈峰转债	2,316,648.22	0.13
37	113610	灵康转债	2,278,912.88	0.13
38	123023	迪森转债	2,276,245.58	0.13
39	127025	冀东转债	2,265,830.61	0.13
40	110063	鹰 19 转债	2,261,100.27	0.13
41	132018	G 三峡 EB1	2,057,204.36	0.12
42	127032	苏行转债	2,012,220.27	0.11
43	128105	长集转债	2,002,210.11	0.11
44	113569	科达转债	1,764,606.99	0.10
45	113606	荣泰转债	1,744,017.91	0.10
46	113622	杭叉转债	1,622,342.05	0.09
47	123101	拓斯转债	1,616,292.54	0.09
48	113045	环旭转债	1,588,072.97	0.09
49	123099	普利转债	1,570,361.89	0.09
50	113516	苏农转债	1,531,993.01	0.09
51	128125	华阳转债	1,509,790.68	0.09
52	123122	富瀚转债	1,473,634.41	0.08
53	110057	现代转债	1,466,040.00	0.08
54	123117	健帆转债	1,432,650.72	0.08
55	128123	国光转债	1,410,246.41	0.08
56	128131	崇达转 2	1,407,911.75	0.08
57	113601	塞力转债	1,387,332.16	0.08
58	113584	家悦转债	1,339,188.77	0.08

59	113542	好客转债	1,288,471.23	0.07
60	128015	久其转债	1,241,310.82	0.07
61	113043	财通转债	1,210,149.55	0.07
62	127022	恒逸转债	1,191,150.52	0.07
63	127021	特发转 2	1,132,889.73	0.06
64	113623	凤 21 转债	1,080,353.97	0.06
65	128135	洽洽转债	1,054,630.70	0.06
66	123065	宝莱转债	1,015,777.95	0.06
67	113625	江山转债	951,342.03	0.05
68	128022	众信转债	950,382.47	0.05
69	123002	国祯转债	948,424.88	0.05
70	113532	海环转债	889,422.47	0.05
71	128023	亚太转债	889,324.27	0.05
72	127020	中金转债	838,398.39	0.05
73	113549	白电转债	830,131.92	0.05
74	128133	奇正转债	820,178.26	0.05
75	110043	无锡转债	817,626.66	0.05
76	128119	龙大转债	733,347.29	0.04
77	128114	正邦转债	699,419.28	0.04
78	128122	兴森转债	682,116.99	0.04
79	127005	长证转债	682,073.42	0.04
80	128090	汽模转 2	680,989.32	0.04
81	127033	中装转 2	617,610.39	0.04
82	127028	英特转债	610,374.56	0.03
83	113024	核建转债	568,573.29	0.03
84	110060	天路转债	564,298.63	0.03
85	127035	濮耐转债	555,751.47	0.03
86	128107	交科转债	529,609.53	0.03
87	113030	东风转债	477,399.45	0.03
88	113013	国君转债	447,589.26	0.03
89	127036	三花转债	442,726.12	0.03
90	123125	元力转债	425,721.31	0.02
91	128081	海亮转债	384,500.29	0.02
92	110064	建工转债	373,510.68	0.02
93	128021	兄弟转债	364,858.84	0.02
94	110052	贵广转债	362,761.81	0.02
95	113017	吉视转债	352,356.99	0.02
96	128035	大族转债	345,298.11	0.02
97	123108	乐普转 2	339,276.58	0.02
98	123124	晶瑞转 2	331,169.84	0.02
99	113578	全筑转债	320,505.04	0.02
100	110079	杭银转债	244,945.26	0.01
101	113588	润达转债	231,937.48	0.01

102	127016	鲁泰转债	217,207.51	0.01
103	113596	城地转债	198,349.64	0.01
104	127015	希望转债	58,592.15	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

	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
报告期期初基金份额总额	1,669,064,207.67	440.84
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	97,098.58	-
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	1,668,967,109.09	440.84

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	20220101-20220331	834,337,732.86	-	-	834,337,732.86	49.99%
	2	20220101-20220331	834,337,732.86	-	-	834,337,732.86	49.99%
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
二〇二二年四月二十二日