

新疆前海联合添泽债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 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:2023 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2023年4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2023年1月1日起至2023年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	788,466,492.99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	788,390,560.63 份	75,932.36 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（2023 年 01 月 01 日-2023 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	7,203,383.06	462.94
2. 本期利润	23,321,306.80	1,312.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0168	0.0149
4. 期末基金资产净值	818,047,652.31	77,735.03
5. 期末基金份额净值	1.0376	1.0237

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	1.65%	0.08%	0.29%	0.03%	1.36%	0.05%
过去六个月	0.90%	0.10%	-0.27%	0.06%	1.17%	0.04%
过去一年	3.24%	0.09%	0.74%	0.05%	2.50%	0.04%
自基金合同 生效起至今	8.81%	0.07%	1.81%	0.05%	7.00%	0.02%

###### 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	1.64%	0.08%	0.29%	0.03%	1.35%	0.05%
过去六个月	0.88%	0.10%	-0.27%	0.06%	1.15%	0.04%
过去一年	2.84%	0.09%	0.74%	0.05%	2.10%	0.04%

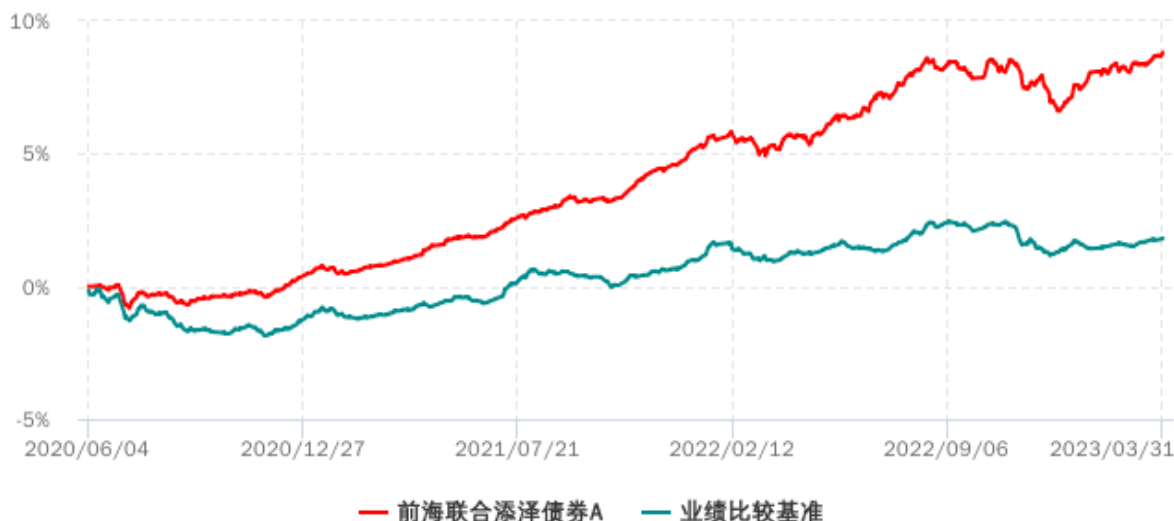
自基金合同 生效起至今	7.42%	0.07%	1.81%	0.05%	5.61%	0.02%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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

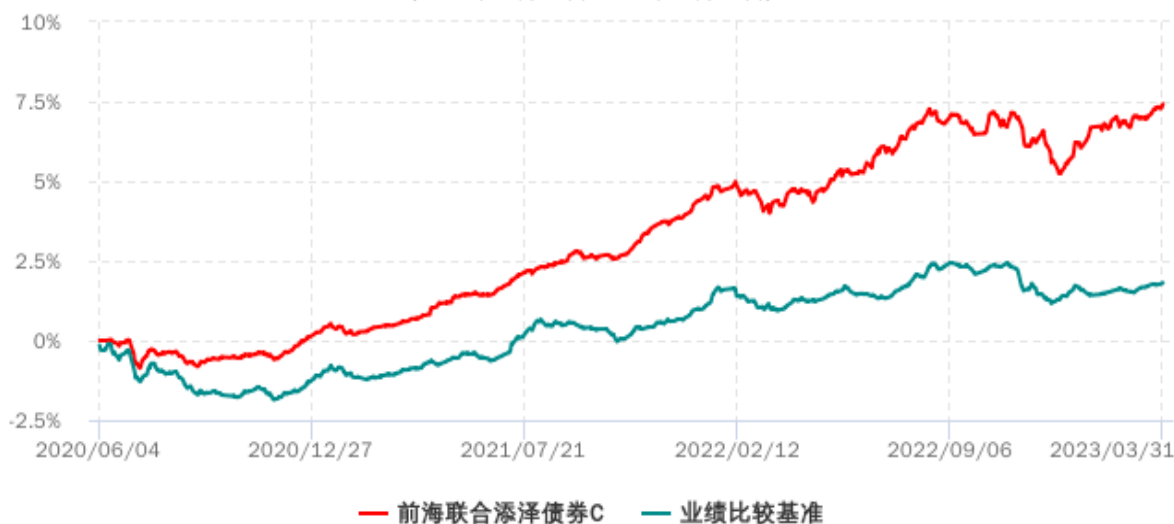
前海联合添泽债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年06月04日-2023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-2023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		
孙连玉	本基金的基金经理，创新业务部负责人	2022-09-01	-	7 年	孙连玉先生，北京大学硕士，7 年证券投资基金投资研究经验。曾任中国中投证券有限责任公司研究员、新疆前海联合基金管理有限公司研究员和新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理(自 2020 年 10 月 14 日至 2022 年 2 月 14 日)。现任新疆前海联合基金管理有限公司创新业务部负责人、新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 6 月 25 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 2022 年 7 月 9 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 2022 年 9 月 1 日起任职)和新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 9 月 1 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。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 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

随着疫情的高峰期逐步走过，疫情对于经济的影响逐渐减弱，2023 年 1 季度经济整体呈现逐步恢复趋势，但居民收入增速及消费信心的恢复需要时间，消费需求恢复总体偏弱，虽然投资韧性仍在，但总需求谈不上强劲，经济总体仍处于弱复苏状态。

资本市场也跟随上述经济预期的波动而变化，1 月份，随着疫情高峰逐步走过，市场对于经济的预期明显好转，股票市场出现明显上涨而债券市场转跌。但春节期间消费恢复力度不足，2 月份后经济相关高频数据仍然不强，市场对于经济复苏强度的担忧上升，2、3 月份股市转为震荡中小幅回落，债市则震荡中小幅走强。

转债市场在去年 4 季度受利率上行影响，转股溢价率压缩后，1 季度未再继续压缩转股溢价率，转债市场主要跟随股票市场波动变化，整体上也呈现 1 月份较快上涨，2、3 月份震荡中小幅回落的走势。

报告期内，本基金对于市场的观点未有明显变化，因此未对转债资产占比和纯债资产久期做明显调整，各类资产占比和纯债资产久期变化不大。

### 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 1.0376 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；截至报告期末前海联合添泽债券 C 基金份额净值为 1.0237 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 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	802,300,248.14	97.88
	其中：债券	802,300,248.14	97.88
	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	17,340,207.05	2.12
8	其他资产	21,962.74	0.00
9	合计	819,662,417.93	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	29,393,706.52	3.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	416,703,005.50	50.93

	其中：政策性金融债	161,629,986.31	19.76
4	企业债券	61,319,541.37	7.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,617,547.95	1.30
7	可转债（可交换债）	284,266,446.80	34.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	802,300,248.14	98.07

### 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	230401	23 农发 01	600,000	60,148,734.25	7.35
2	113042	上银转债	558,970	59,204,417.83	7.24
3	220406	22 农发 06	500,000	50,640,726.03	6.19
4	110059	浦发转债	336,850	35,764,518.10	4.37
5	2122023	21 江苏租赁债 02	300,000	31,153,563.29	3.81

### 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

#### 1.23 农发 01、22 农发 06 发债主体受监管处罚情况：

2022 年 8 月 30 日，根据迪银保监罚决字〔2022〕1 号，由于未依法履行职责，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，中国农业发展银行迪庆藏族自治州分行被迪庆银保监分局处以 39 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为中国农业发展银行资产规模大，经营情况较好，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，上述事项对中国农业发展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。

本基金投资于中国农业发展银行的决策程序说明：基于中国农业发展银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国农业发展银行，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农业发展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. 浦发转债发债主体受监管处罚情况：

（1）2022 年 9 月 2 日，根据上海汇管罚字〔2022〕3111220601 号，由于违规经营，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条第三项、第四十三条、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 1267.69 万元的罚款。

（2）2022 年 9 月 1 日，根据温银保监罚决字〔2022〕32 号，由于未依法履行职责，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，浦发银行温州分行被温州银保监分局处以 90 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。

## 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	21,952.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,962.74

## 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	113042	上银转债	59,204,417.83	7.24
2	110059	浦发转债	35,764,518.10	4.37
3	113044	大秦转债	14,996,468.56	1.83
4	110073	国投转债	8,198,004.88	1.00
5	110067	华安转债	6,561,583.26	0.80
6	113043	财通转债	4,911,879.11	0.60
7	127005	长证转债	4,841,611.28	0.59
8	110045	海澜转债	4,762,661.90	0.58
9	113052	兴业转债	4,245,689.22	0.52
10	123099	普利转债	4,109,658.85	0.50
11	127024	盈峰转债	3,655,999.43	0.45
12	123119	康泰转 2	3,374,154.73	0.41
13	113033	利群转债	3,186,216.00	0.39
14	110076	华海转债	2,971,622.93	0.36
15	110062	烽火转债	2,967,711.79	0.36
16	123104	卫宁转债	2,861,887.77	0.35
17	113050	南银转债	2,831,966.94	0.35
18	113605	大参转债	2,822,497.53	0.34
19	110063	鹰 19 转债	2,671,983.24	0.33
20	127032	苏行转债	2,645,974.75	0.32
21	128035	大族转债	2,475,053.32	0.30
22	123010	博世转债	2,429,214.74	0.30
23	128037	岩土转债	2,271,659.57	0.28
24	128105	长集转债	2,243,233.33	0.27

25	113516	苏农转债	2,226,726.38	0.27
26	128108	蓝帆转债	2,221,305.40	0.27
27	110043	无锡转债	2,214,524.57	0.27
28	127041	弘亚转债	2,181,340.24	0.27
29	113057	中银转债	2,105,165.21	0.26
30	127044	蒙娜转债	2,056,197.55	0.25
31	113062	常银转债	1,997,915.79	0.24
32	110081	闻泰转债	1,977,920.05	0.24
33	113633	科沃转债	1,970,442.13	0.24
34	113013	国君转债	1,948,268.42	0.24
35	113644	艾迪转债	1,948,003.53	0.24
36	113519	长久转债	1,904,352.88	0.23
37	123076	强力转债	1,896,916.14	0.23
38	123117	健帆转债	1,790,385.69	0.22
39	113623	凤 21 转债	1,789,951.74	0.22
40	113053	隆 22 转债	1,780,398.26	0.22
41	113563	柳药转债	1,728,621.70	0.21
42	127047	帝欧转债	1,720,162.85	0.21
43	127022	恒逸转债	1,675,659.48	0.20
44	127025	冀东转债	1,655,314.85	0.20
45	127020	中金转债	1,604,716.64	0.20
46	113601	塞力转债	1,535,502.74	0.19
47	123113	仙乐转债	1,477,993.19	0.18
48	123056	雪榕转债	1,466,245.22	0.18
49	113024	核建转债	1,459,866.04	0.18
50	113604	多伦转债	1,427,244.95	0.17
51	128136	立讯转债	1,403,519.97	0.17
52	110053	苏银转债	1,342,377.86	0.16
53	128131	崇达转 2	1,314,967.42	0.16
54	127046	百润转债	1,236,296.39	0.15
55	113606	荣泰转债	1,219,215.16	0.15
56	110060	天路转债	1,218,192.53	0.15
57	110088	淮 22 转债	1,197,861.64	0.15
58	123108	乐普转 2	1,195,004.81	0.15
59	127012	招路转债	1,178,097.45	0.14
60	113058	友发转债	1,163,947.43	0.14
61	113542	好客转债	1,140,533.00	0.14
62	113616	韦尔转债	1,120,038.02	0.14
63	110082	宏发转债	1,113,128.24	0.14
64	128074	游族转债	1,057,917.44	0.13
65	128125	华阳转债	1,017,076.46	0.12
66	110057	现代转债	996,762.00	0.12
67	128129	青农转债	995,243.04	0.12

68	110047	山鹰转债	972,031.97	0.12
69	113056	重银转债	969,385.79	0.12
70	127016	鲁泰转债	909,067.06	0.11
71	123115	捷捷转债	907,792.31	0.11
72	128123	国光转债	888,837.78	0.11
73	127033	中装转 2	879,851.71	0.11
74	128071	合兴转债	872,581.92	0.11
75	113584	家悦转债	854,688.21	0.10
76	113627	太平转债	823,038.14	0.10
77	128097	奥佳转债	809,567.72	0.10
78	113602	景 20 转债	798,137.14	0.10
79	113037	紫银转债	762,338.76	0.09
80	113625	江山转债	722,499.78	0.09
81	110086	精工转债	713,683.43	0.09
82	128081	海亮转债	699,939.78	0.09
83	127040	国泰转债	699,629.75	0.09
84	110077	洪城转债	634,847.22	0.08
85	110085	通 22 转债	621,333.24	0.08
86	123122	富瀚转债	617,664.93	0.08
87	113045	环旭转债	614,883.85	0.08
88	113048	晶科转债	614,427.37	0.08
89	113549	白电转债	596,629.06	0.07
90	128119	龙大转债	591,377.32	0.07
91	127056	中特转债	581,717.55	0.07
92	128048	张行转债	576,608.89	0.07
93	110079	杭银转债	572,055.41	0.07
94	127015	希望转债	546,635.09	0.07
95	123101	拓斯转债	538,238.47	0.07
96	123002	国祯转债	487,142.89	0.06
97	127049	希望转 2	467,284.57	0.06
98	113532	海环转债	399,441.96	0.05
99	110083	苏租转债	375,580.18	0.05
100	128133	奇正转债	324,968.51	0.04
101	113641	华友转债	292,029.98	0.04
102	110064	建工转债	289,570.66	0.04
103	123124	晶瑞转 2	241,617.43	0.03
104	113049	长汽转债	239,452.41	0.03
105	127045	牧原转债	228,200.80	0.03
106	113017	吉视转债	184,988.22	0.02
107	128083	新北转债	140,547.14	0.02
108	128135	洽洽转债	125,448.10	0.02

## 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	1,576,775,514.01	49,608.03
报告期期间基金总申购份额	3,301.77	126,356.98
减：报告期期间基金总赎回份额	788,388,255.15	100,032.65
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	788,390,560.63	75,932.36

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	1	20230101-20230322	788,379,859.87	-	788,379,859.87	-	-

构	2	20230101-20230331	788,379,859.87	-	-	788,379,859.87	99.99%
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  
二〇二三年四月二十二日