

新疆前海联合添泽债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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:2024 年 07 月 19 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2024年07月16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2024年04月01日起至2024年06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	3,500,268.45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	1,876,469.82份	1,623,798.63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（2024 年 04 月 01 日-2024 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	-11,569.96	-16,069.26
2. 本期利润	7,736.29	-48,308.78
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0040	-0.0188
4. 期末基金资产净值	2,032,531.52	1,735,371.05
5. 期末基金份额净值	1.0832	1.0687

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	0.88%	0.17%	1.02%	0.07%	-0.14%	0.10%
过去六个月	2.70%	0.16%	2.34%	0.06%	0.36%	0.10%
过去一年	3.48%	0.14%	3.18%	0.05%	0.30%	0.09%
过去三年	11.21%	0.10%	6.48%	0.05%	4.73%	0.05%
自基金合同 生效起至今	13.59%	0.09%	6.00%	0.05%	7.59%	0.04%

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	0.88%	0.17%	1.02%	0.07%	-0.14%	0.10%
过去六个月	2.68%	0.16%	2.34%	0.06%	0.34%	0.10%
过去一年	3.48%	0.14%	3.18%	0.05%	0.30%	0.09%
过去三年	10.27%	0.10%	6.48%	0.05%	3.79%	0.05%
自基金合同 生效起至今	12.14%	0.09%	6.00%	0.05%	6.14%	0.04%

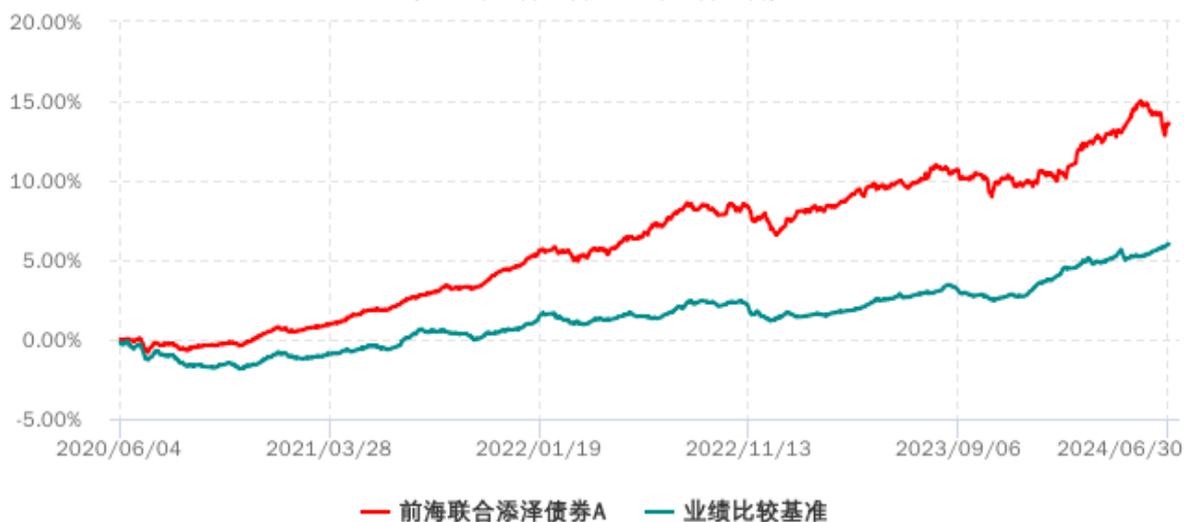
注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行

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-2024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-2024年06月30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	-	8 年	孙连玉先生，北京大学硕士，8 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、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) 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 日至 2023 年 9 月 13 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) 和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)。

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

2024 年二季度，经济基本上，国内呈现社会预期偏弱，有效需求不足的状态。偏弱的社会预期下，居民消费恢复偏慢，地产政策放松对于地产销售的提振作用也不明显，居民端有效需求明显不足。而 2024 年二季度出口维持了较强态势，高新技术产业也保持了较高的增长，带动制造业投资维持较高增速，企业端需求好于居民端。上半年政府端财政发力略不及预期，但从往年经验看，全年赤字率已定的情况下，下半年财政可能提速，从而助力全年经济增长目标的完成。

2024 年二季度，纯债市场继续上涨，但波动略有增大。一方面，经济基本上，预期偏弱，需求不足；另一方面，在经济转型过程中，融资需求也有所下降，居民和企业资产也有从存款向理财、基金转移的迹象，导致债券配置需求有所增加，基本面和债券配置需求共同推动债市上涨。而与此同时，央行 2024 年二季度持续关注长期利率风险，对市场形成了一定的影响，导致收益率下行过程中，波动略有加大，但总体看二季度纯债市场仍处于上涨过程中，整体表现较优。

2024 年二季度，可转债市场波动较大，总体小幅上涨。二季度，可转债市场总体节奏虽与权益市场接近，但总体表现优于权益市场，主要是 4、5 月份的上涨中，可转债的溢价率有所抬升，6 月虽然出现了明显的回落，但总体看，二季度可转债市场仍实现了小幅上涨。

报告期内，纯债资产方面，在央行持续关注长期利率风险的情况下，本基金保持了较低的纯债资产持仓久期。而考虑到各类政策对权益市场的呵护仍在，权益市场总体风险不是很大，本基金二季度可转债仓位未做明显调整。

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 1.0832 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.88%，同期业绩比较基准收益率为 1.02%；截至报告期末前海联合添泽债券 C 基金份额净

值为 1.0687 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 0.88%,同期业绩比较基准收益率为 1.02%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末,本基金基金资产净值连续 60 个工作日以上低于 5000 万元。本基金管理人已向证监会报告持续运作本基金。

§ 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	3,625,062.71	93.77
	其中:债券	3,625,062.71	93.77
	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	50,000.00	1.29
	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	155,354.27	4.02
8	其他资产	35,346.43	0.91
9	合计	3,865,763.41	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	1,935,042.22	51.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	1,690,020.49	44.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,625,062.71	96.21

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	019727	23 国债 24	11,000	1,120,009.45	29.73
2	019723	23 国债 20	4,000	409,787.73	10.88
3	019740	24 国债 09	3,000	301,025.59	7.99
4	113042	上银转债	1,740	197,791.90	5.25
5	110059	浦发转债	1,180	130,124.94	3.45

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. 上银转债发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2023 年 11 月 15 日，根据沪金罚决字[2023]51-[2023]52 号，由于违规经营，上海银行被国家金融监管总局上海监管局两次均罚款 690 万元，合计罚款 1380 万元。

(2) 2023 年 11 月 27 日，根据上海汇管罚字[2023]3111220301 号，由于未尽审核办理股权转让购付汇业务，上海银行被国家外汇管理局上海市分局罚款 70 万元，没收违法所得 257.23 万元，罚没款合计 327.23 万元。

(3) 2023 年 12 月 28 日，根据沪金罚决字[2023]81 号，由于未依法履行职责，上海银行被国家金融监管总局上海监管局罚款 145 万元。

(4) 2024 年 5 月 30 日，根据沪金罚决字[2024]43 号，由于境外机构重大投资事项未经行政许可，上海银行被国家金融监管总局上海监管局罚款 80 万元。

本基金对上海银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

2. 浦发转债发债主体受到监管部门处罚情况：

浦发银行多家分行，因违规经营，未依法履行责任等，受到当地国家金融监管局等监管机构的罚款。

本基金对浦发银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

3. 惠城转债发债主体受到监管部门处罚情况：

2023 年 12 月 15 日，根据青开消行罚决字(2023)第 0215 号，因未依法履行职责，惠城环保被青岛经济技术开发区消防救援大队处以罚款 3.8 万元。

本基金对惠城环保所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	10,810.52
2	应收证券清算款	20,015.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,520.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	35,346.43

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	197,791.90	5.25
2	110059	浦发转债	130,124.94	3.45
3	110073	国投转债	45,460.66	1.21
4	110067	华安转债	41,038.52	1.09
5	123118	惠城转债	39,008.18	1.04
6	113043	财通转债	36,681.13	0.97
7	113052	兴业转债	32,465.30	0.86
8	127045	牧原转债	21,302.88	0.57
9	113021	中信转债	21,267.59	0.56
10	113044	大秦转债	20,445.07	0.54
11	127016	鲁泰转债	20,386.34	0.54
12	113058	友发转债	19,802.49	0.53
13	128081	海亮转债	19,531.05	0.52
14	127024	盈峰转债	19,199.84	0.51
15	113050	南银转债	18,811.81	0.50
16	113623	凤 21 转债	18,576.92	0.49
17	110085	通 22 转债	17,980.39	0.48
18	127037	银轮转债	16,515.80	0.44
19	128048	张行转债	16,426.89	0.44
20	127049	希望转 2	15,525.39	0.41
21	127022	恒逸转债	15,331.29	0.41
22	110063	鹰 19 转债	14,602.81	0.39
23	113048	晶科转债	14,176.03	0.38
24	113060	浙 22 转债	13,761.26	0.37
25	113062	常银转债	13,458.87	0.36
26	110062	烽火转债	12,925.27	0.34

27	127032	苏行转债	12,570.30	0.33
28	113065	齐鲁转债	12,539.74	0.33
29	113033	利群转债	12,199.08	0.32
30	110076	华海转债	11,946.26	0.32
31	128121	宏川转债	11,862.11	0.31
32	110060	天路转债	11,719.85	0.31
33	113662	豪能转债	11,281.60	0.30
34	123101	拓斯转债	11,278.04	0.30
35	127035	濮耐转债	11,197.50	0.30
36	127086	恒邦转债	11,176.80	0.30
37	110075	南航转债	11,158.57	0.30
38	113602	景 20 转债	11,049.00	0.29
39	113658	密卫转债	10,964.31	0.29
40	110079	杭银转债	10,869.05	0.29
41	127020	中金转债	10,840.35	0.29
42	127054	双箭转债	10,826.72	0.29
43	128133	奇正转债	10,788.04	0.29
44	113549	白电转债	10,763.96	0.29
45	113045	环旭转债	10,691.02	0.28
46	118023	广大转债	10,635.90	0.28
47	123090	三诺转债	10,513.91	0.28
48	123119	康泰转 2	10,395.84	0.28
49	127041	弘亚转债	10,368.53	0.28
50	113563	柳药转债	10,336.94	0.27
51	118013	道通转债	10,278.21	0.27
52	128136	立讯转债	10,277.91	0.27
53	123158	宙邦转债	10,234.32	0.27
54	128135	洽洽转债	10,217.26	0.27
55	128083	新北转债	10,115.37	0.27
56	113616	韦尔转债	10,104.14	0.27
57	123088	威唐转债	10,070.20	0.27
58	110082	宏发转债	10,054.73	0.27
59	123224	宇邦转债	10,052.54	0.27
60	118038	金宏转债	10,037.65	0.27
61	113606	荣泰转债	10,028.00	0.27
62	123115	捷捷转债	9,966.21	0.26
63	127085	韵达转债	9,909.09	0.26
64	113516	苏农转债	9,898.18	0.26
65	113037	紫银转债	9,882.29	0.26
66	123076	强力转债	9,836.68	0.26
67	113056	重银转债	9,761.33	0.26
68	128071	合兴转债	9,743.27	0.26
69	127046	百润转债	9,738.25	0.26

70	113627	太平转债	9,720.84	0.26
71	128130	景兴转债	9,705.55	0.26
72	113644	艾迪转债	9,689.29	0.26
73	113059	福莱转债	9,613.08	0.26
74	127083	山路转债	9,611.71	0.26
75	113633	科沃转债	9,607.22	0.25
76	128129	青农转债	9,578.28	0.25
77	113661	福 22 转债	9,571.98	0.25
78	128097	奥佳转债	9,567.64	0.25
79	111004	明新转债	9,563.75	0.25
80	123108	乐普转 2	9,562.12	0.25
81	113584	家悦转债	9,558.23	0.25
82	127015	希望转债	9,554.20	0.25
83	113647	禾丰转债	9,381.91	0.25
84	127025	冀东转债	9,313.74	0.25
85	123124	晶瑞转 2	9,211.47	0.24
86	113053	隆 22 转债	9,157.53	0.24
87	113641	华友转债	9,132.03	0.24
88	127040	国泰转债	9,080.17	0.24
89	123117	健帆转债	9,075.70	0.24
90	113049	长汽转债	8,944.55	0.24
91	110064	建工转债	8,926.69	0.24
92	110081	闻泰转债	8,919.20	0.24
93	113532	海环转债	8,910.76	0.24
94	128131	崇达转 2	8,866.12	0.24
95	113024	核建转债	8,828.66	0.23
96	123113	仙乐转债	8,800.00	0.23
97	118034	晶能转债	8,786.08	0.23
98	127089	晶澳转债	8,757.23	0.23
99	127056	中特转债	8,747.08	0.23
100	127061	美锦转债	8,711.66	0.23
101	128125	华阳转债	8,705.97	0.23
102	113542	好客转债	8,690.22	0.23
103	113625	江山转债	8,681.26	0.23
104	123122	富瀚转债	8,666.49	0.23
105	123010	博世转债	8,628.20	0.23
106	113605	大参转债	8,588.68	0.23
107	110047	山鹰转债	8,530.18	0.23
108	118031	天 23 转债	8,356.61	0.22
109	110086	精工转债	8,022.01	0.21
110	123099	普利转债	4,528.34	0.12

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	1,483,736.15	260,116.71
报告期期间基金总申购份额	977,806.87	7,869,077.19
减：报告期期间基金总赎回份额	585,073.20	6,505,395.27
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	1,876,469.82	1,623,798.63

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

单位：份

	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,399,160.8	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,399,160.8	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	39.9730	-

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	20240401-20240521 20240613-20240630	1,399,160.8	-	-	1,399,160.8	39.97%
个人	1	20240513-20240528 20240531-20240612	-	1,974,349.77	1,974,349.77	-	-
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
二〇二四年七月十九日