

新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券投资基金

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:浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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	前海联合添鑫 3 个月定开债
基金主代码	003471
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 18 日
报告期末基金份额总额	16,958,248.26 份
投资目标	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	1、封闭期投资策略本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、判断未来大类资产表现，确定在债券资产和股票资产之间的配置比例。在严格控制风险的前提下，发掘和利用潜在投资机会，力争获取超越比较基准的

	投资收益。2、开放期投资策略开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。	
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，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	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 C
下属分级基金的交易代码	003471	003472
报告期末下属分级基金的份额总额	12,427,358.87 份	4,530,889.39 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）	
	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 C
1. 本期已实现收益	70,337.94	9,235.30
2. 本期利润	209,830.66	77,407.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0212	0.0162
4. 期末基金资产净值	15,329,150.56	5,389,804.14
5. 期末基金份额净值	1.2335	1.1896

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

前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	1.48%	0.22%	0.45%	0.03%	1.03%	0.19%
过去六个月	0.43%	0.25%	0.65%	0.04%	-0.22%	0.21%
过去一年	7.60%	0.27%	-0.20%	0.06%	7.80%	0.21%
自基金转型 日起至今	8.91%	0.26%	-1.05%	0.07%	9.96%	0.19%

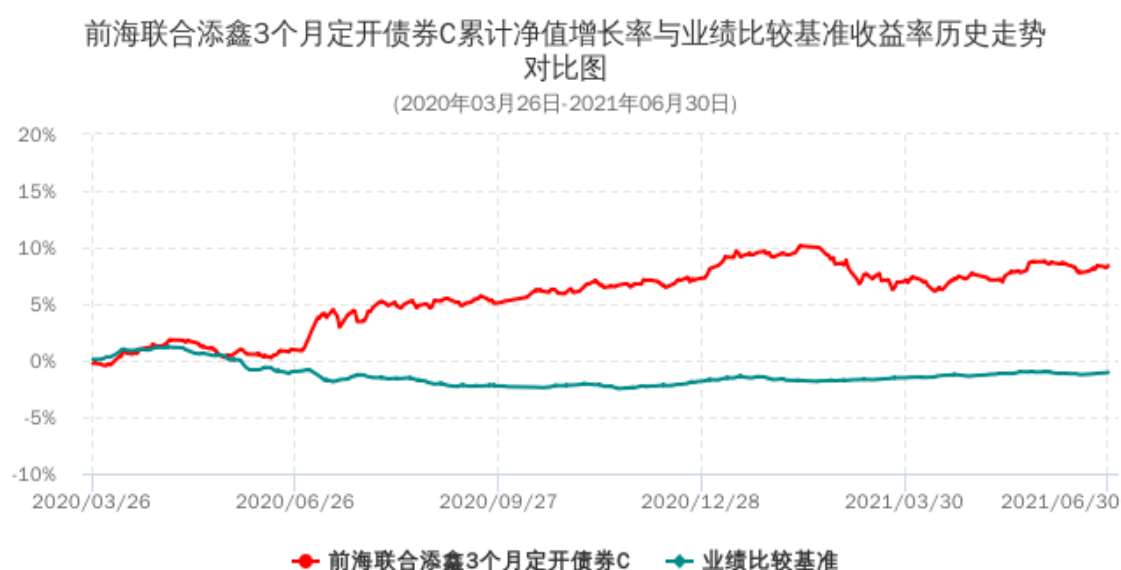
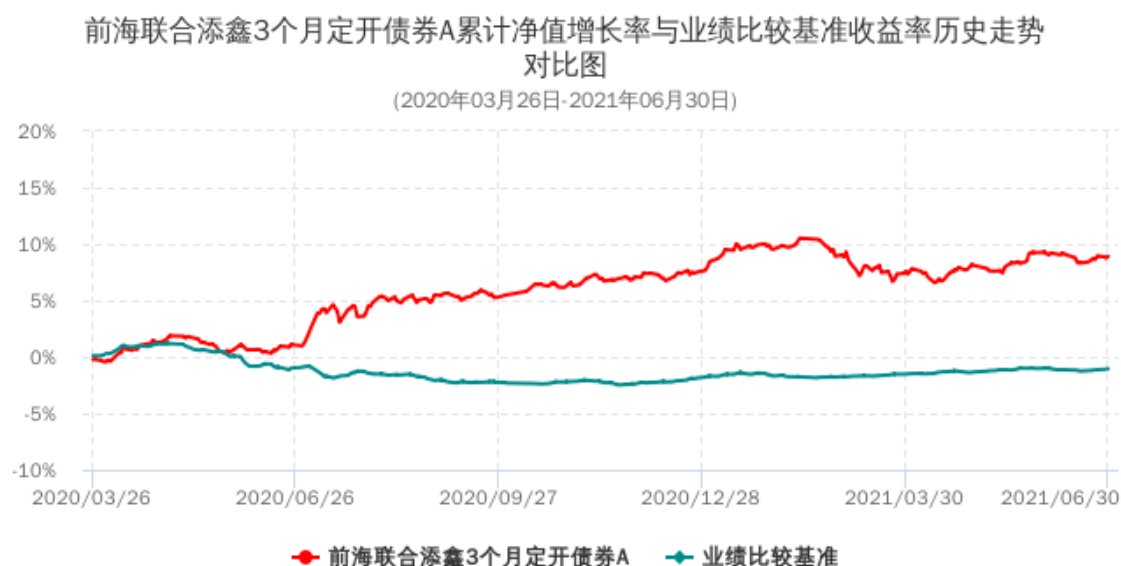
前海联合添鑫 3 个月定开债券 C 净值表现

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	1.38%	0.22%	0.45%	0.03%	0.93%	0.19%
过去六个月	0.23%	0.25%	0.65%	0.04%	-0.42%	0.21%
过去一年	7.17%	0.27%	-0.20%	0.06%	7.37%	0.21%
自基金转型 日起至今	8.36%	0.26%	-1.05%	0.07%	9.41%	0.19%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

2、本基金由新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型后的基金合同于2020年3月26日生效。

3.2.2 自基金转型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



注：本基金由新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为2020年3月26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		
敬夏玺	本基金的基金经理	2016-11-02	-	10 年	敬夏玺先生，硕士研究生，10 年基金投资研究交易经验。2011 年 7 月至 2016 年 5 月任职于融通基金，历任债券交易员、固定收益部投资经理，管理公司债券专户产品。2010 年 7 月至 2011 年 7 月任工银瑞信基金中央交易室交易员。2016 年 5 月加入前海联合基金，现任新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 2 日起任职）、新疆前海联合泓元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2017 年 12 月 6 日起任职）、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 3 月 7

				<p>日起任职)、新疆前海联合淳安纯债 3 年定期开放债券型证券投资基金基金经理 (自 2019 年 11 月 26 日起任职)、新疆前海联合泳益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)、新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 5 月 21 日起任职)、新疆前海联合泓旭纯债 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2020 年 7 月 23 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 2020 年 8 月 26 日起任职)。</p> <p>曾任新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2016 年 8 月 18 日至 2019 年 1 月 23 日)、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 2016 年 11 月 17 日至 2020 年 3 月 25 日)、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理 (自 2017 年 5 月 25 日至 2020 年 3 月 25 日)、新疆前海联合润丰灵活配置</p>
--	--	--	--	--

					混合型证券投资基金基金经理（自2018年9月20日至2019年12月30日）和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日至2021年1月29日）。
--	--	--	--	--	--

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

2021年二季度，国内经济基本面延续了复苏格局，但各地零星的疫情反复造成了当地

短暂的经济休整，整体来看经济仍然有较明显的结构性，餐饮旅游等服务业仍受到零星疫情和海外疫情反复的影响未能完全恢复，而大宗商品的持续上涨对中游制造业产生了一定的压制。国内经济恢复的不均衡性，总量的货币政策难以明显收紧，导致债券市场收益率小幅下行，短端资金面维持在较为宽松的状态，股票市场也出现了反弹，其中医药、新能源等成长股表现较好。本基金在债券仓位的配置上维持中短久期高等级债券的配置思路，适度提升了组合久期，股票仓位的配置上维持合同约定范围内中性偏高的仓位，结构上进行了适度的调整，在市场趋势性机会不大的背景下，做好涨幅较大个股的获利了结以及前期表现较差的优质个股的左侧配置。

展望未来一个季度，基本面同比增速的基数效应逐步消退，经济增速最快的阶段已经过去，受大宗商品价格维持高位的影响，通胀仍然有较强的预期，短期内货币政策预计松紧难变，债券市场暂无大的调整风险，股票市场仍然偏结构性，债券的配置上将维持一定的杠杆和久期操作，股票的配置上继续寻找结构性机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添鑫 3 个月定开债券 A 基金份额净值为 1.2335 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.48%，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鑫 3 个月定开债券 C 基金份额净值为 1.1896 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.38%，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

本报告期内，本基金从 2021 年 1 月 22 日起至 2021 年 6 月 30 日止，连续 104 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。本基金管理人已经于 2021 年 5 月 7 日向证监会申请持续运作。

§ 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	3,188,171.40	15.19
	其中：股票	3,188,171.40	15.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,825,359.60	80.15

	其中：债券	16,825,359.60	80.15
	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	200,000.00	0.95
	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	252,565.46	1.20
8	其他资产	525,566.09	2.50
9	合计	20,991,662.55	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,541,179.00	7.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	353,780.00	1.71
H	住宿和餐饮业	159,460.00	0.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	224,440.00	1.08
J	金融业	607,857.60	2.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	150,050.00	0.72

M	科学研究和技术服务业	112,744.80	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,660.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,188,171.40	15.39

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	7,440	243,957.60	1.18
2	600600	青岛啤酒	1,900	219,735.00	1.06
3	600660	福耀玻璃	3,900	217,815.00	1.05
4	600309	万华化学	2,000	217,640.00	1.05
5	601021	春秋航空	3,600	204,840.00	0.99
6	600887	伊利股份	5,300	195,199.00	0.94
7	000333	美的集团	2,700	192,699.00	0.93
8	600031	三一重工	6,600	191,862.00	0.93
9	600754	锦江酒店	2,800	159,460.00	0.77
10	688111	金山办公	400	157,920.00	0.76

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	10,664,050.00	51.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,447,905.40	21.47
	其中：政策性金融债	4,447,905.40	21.47
4	企业债券	400,120.00	1.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,313,284.20	6.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,825,359.60	81.21

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	019649	21 国债 01	39,000	3,902,730.00	18.84
2	019645	20 国债 15	35,000	3,510,850.00	16.95
3	018006	国开 1702	29,030	2,937,255.40	14.18
4	019640	20 国债 10	20,260	2,026,000.00	9.78
5	018082	农发 1902	15,000	1,510,650.00	7.29

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. 国开 1702 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. 农发 1902 发债主体受监管处罚情况：

2020 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日，中国农业发展银行浙江省分行、托克托县支行等 21 家分支机构由于项目调查审查不尽职；未能通过有效的内控措施发现并纠正员工违规保管客户物品的行为等违法违规行为，被当地银保监局、外汇管理局等监管机构处以警告、罚款等行政处罚，罚款金额合计 645 万元。

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，认为该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。

3.16 国君 G4 发债主体受监管处罚情况：

2020 年 11 月 10 日，根据沪证监决〔2020〕173 号，因在信息技术管理方面存在未按规定对信息系统故障进行应急报告，客户信息管控不足、且内部审计未充分遵循业务合规原则等方面的问题，根据《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》第五十七条的规定，上海证监局决定对国泰君安证券采取出具警示函的行政监管措施。

基金管理人经审慎分析，认为国泰君安证券资产规模大，经营情况良好，且国泰君安证券主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述事项对国泰君安证券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。

本基金投资于国泰君安证券的决策程序说明：基于国泰君安证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于国泰君安证券，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，认为该事项对国泰君安证券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	16,959.55
2	应收证券清算款	300,035.55
3	应收股利	-
4	应收利息	208,570.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	525,566.09

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	132008	17 山高 EB	388,140.20	1.87
2	132009	17 中油 EB	308,700.00	1.49
3	132004	15 国盛 EB	306,900.00	1.48
4	110053	苏银转债	218,448.00	1.05

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

	前海联合添鑫 3 个月定开债 券 A	前海联合添鑫 3 个月定开债 券 C
报告期期初基金份额总额	5,758,862.72	5,021,880.74

报告期期间基金总申购份额	8,393,497.43	23,880.22
减：报告期期间基金总赎回份额	1,725,001.28	514,871.57
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	12,427,358.87	4,530,889.39

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

前海联合添鑫 3 个月定开债券 A

单位：份

持有的本基金份额_本期期初	398,899.68
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
持有的本基金份额	398,899.68
持有的本基金份额占总份额比例（%）	2.35

前海联合添鑫 3 个月定开债券 C

单位：份

持有的本基金份额_本期期初	1,248,855.22
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
持有的本基金份额	1,248,855.22
持有的本基金份额占总份额比例（%）	7.36

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	20210510-20210630	-	8,203,298.06	-	8,203,298.06	48.37%
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鑫一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放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。

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