

# 新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

## 2021 年中期报告

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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 其他指标 .....	11
§ 4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	17
§ 5 托管人报告 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	18

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	18
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	18
6.1 资产负债表 .....	18
6.2 利润表 .....	20
6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	22
6.4 报表附注 .....	24
§ 7 投资组合报告 .....	50
7.1 期末基金资产组合情况 .....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
7.6 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 .....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	57
7.8 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贵金属投资明细 .....	57
7.9 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 .....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	58
§ 8 基金份额持有人信息 .....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	64
§ 9 开放式基金份额变动 .....	65
§ 10 重大事件揭示 .....	65
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4 基金投资策略的改变 .....	66

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	前海联合添利债券	
基金主代码	003180	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 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	
报告期末基金份额总额	94,893,799.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
下属分级基金的交易代码	003180	003181
报告期末下属分级基金的份 额总额	93,713,371.31 份	1,180,427.96 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，通过采取利率预期策略、收益率曲线配置策略、可转债投资策略等积极投资

	策略，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，发掘和利用潜在投资机会，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限 公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	邱张斌	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95588
传真		0755-82780000	010-66105798
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发 区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518031	100140
法定代表人		吴昱村	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www.qhlfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限 公司	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华 润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）	
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
本期已实现收益	4,212,309.70	55,653.80
本期利润	3,617,212.46	46,958.94
加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.0369
本期加权平均净值利润率	3.36%	3.13%
本期基金份额净值增长率	3.43%	3.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	13,247,955.97	201,265.25
期末可供分配基金份额利润	0.1414	0.1705
期末基金资产净值	109,134,926.10	1,409,745.00
期末基金份额净值	1.1646	1.1943



3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	16.46%	19.43%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 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

#### 前海联合添利债券 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.21%	0.21%	-0.24%	0.09%	0.03%	0.12%
过去三个月	1.76%	0.24%	0.77%	0.10%	0.99%	0.14%
过去六个月	3.43%	0.35%	0.70%	0.14%	2.73%	0.21%
过去一年	11.81%	0.39%	2.31%	0.13%	9.50%	0.26%
过去三年	16.09%	0.33%	8.98%	0.13%	7.11%	0.20%
自基金合同生效起至今	16.46%	0.29%	6.01%	0.13%	10.45%	0.16%

#### 前海联合添利债券 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去一个 月	-0.25%	0.21%	-0.24%	0.09%	-0.01%	0.12%
过去三个 月	1.65%	0.24%	0.77%	0.10%	0.88%	0.14%
过去六个 月	3.22%	0.35%	0.70%	0.14%	2.52%	0.21%
过去一年	11.37%	0.39%	2.31%	0.13%	9.06%	0.26%
过去三年	19.86%	0.36%	8.98%	0.13%	10.88%	0.23%
自基金合 同生效起 至今	19.43%	0.31%	6.01%	0.13%	13.42%	0.18%

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\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

前海联合添利债券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  
(2016年11月11日-2021年06月30日)



前海联合添利债券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  
(2016年11月11日-2021年06月30日)



### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经中国证监会证监许可【2015】1842号文批准,于2015年8月7日成立。公司注册资本2亿元人民币,股东结构为:深圳市钜盛华股份有限公司(30%)、深圳粤商物流有限公司(25%)、深圳市深粤控股股份有限公司(25%)、凯信恒有限公司(20%)。本公司总部位于广东省深圳市,已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末,本公司旗下共管理34只开放式基金,包括2只货币市场基金、18只债券型基金、12只混合型基金、1只指数型基金和1只基金中基金(FOF),另管理12只专户理财产品,管理资产总规模超过364亿元人民币。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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	2019-12-17	-	9 年	黄浩东先生，硕士研究生，9 年证券投资研究经验。2011 年 7 月至 2019 年 8 月任职于东莞证券股份有限公司深圳分公司，历任研究员、投资经理、副总经理兼投资经理。2019 年 8 月加入前海联合基金，现任固定收益部总经理、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）。
林材	本基金的基金经理（已离任）	2016-11-17	2021-05-07	13 年	林材先生，硕士研究生，13 年证券基金投资研究经验。2011 年 10 月至 2015 年 7 月任金元顺安基金经理，2008 年 11 月至 2011 年 10 月任民生加银基金医药行业研究员、基金经理助理。2000 年 7 月至 2003 年 9 月曾任职于广州医药集团。2015 年 9 月加入前海联合基金，现任新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 12 月 29 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

				<p>年 4 月 20 日起任职)和新疆前海联合产业趋势混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 17 日起任职)。曾任新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 11 日至 2020 年 7 月 6 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 2021 年 5 月 6 日)、新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 30 日至 2019 年 9 月 17 日)、新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 30 日至 2020 年 7 月 6 日)、新疆前海联合研究优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 7 月 25 日至 2019 年 9 月 26 日)、新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 18 日至 2021 年 3 月 4 日)和新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金经理(自 2020</p>
--	--	--	--	---

					年 2 月 18 日至 2021 年 7 月 16 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。

#### 4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年上半年，一季度境内外疫苗全面开始接种，全球经济延续复苏趋势，大宗商品走势强劲。国内供给端和出口趋势良好，而需求则还没有明显提升。核心 CPI 触底回升和 PPI 持续向好，一度引发了市场的担忧，但 CPI 同比基数不高，不是此期间主要矛盾。二季度，利率市场在经济复苏背景下，收益率仍然缓慢下行。究其原因，这还是利率债供给偏慢，主流机构欠配和流动性充裕造成的，虽然通胀依然温和上行。同时信用债收益率整体下行，部分低等级城投品种也出现下行。这反应流动性充裕情况下，机构开始通过下沉风险偏好寻求收益。而流动性宽松是贯穿上半年季度市场的主脉络。

本基金在上半年维持中等杠杆操作，纯债部分获得基础票息，转债仓位随着转债行情变化变动，股票仓位维持在合同约定范围内的中高仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添利债券 A 基金份额净值为 1.1646 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%；截至报告期末前海联合添利债券 C 基金份额净值为 1.1943 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，经济走势依然很难看清。地产、基建明显往下走，而出口则是主要变量，国内通胀虽然仍然维持温和上涨，需求则有下滑风险。大宗商品在政府干预下价格将回落，经济基本面总体来看对债市利空因素不多。从利率债供给看，下半年供给应该会回升，这将对债券上涨带来负面效用。境外因素也是下半年主要变量，美联储退出 QE 逐步提上日程，虽然加息料不会在年内实施，但预期依然会对收益率带影响。信用债角度来看，信用利差均下行至历史低位，投资空间有限，静待市场调整后再进行配置。

目前，权益市场分化严重，部分行业的估值偏贵，行业分化依然很严重。本基金选择风险收益比相对较高的个股进行配置。转债仍然是重点配置方向，坚持长期看好转债投资价值，但回避高溢价品种。

本基金将择机调整股票的配置结构，根据市场变化动态调整转债仓位。



#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体:新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	84,989.95	633,697.92
结算备付金		491,536.11	1,574,332.13
存出保证金		5,898.20	13,282.23
交易性金融资产	6.4.7.2	120,286,609.89	138,519,727.56
其中：股票投资		15,516,663.76	20,056,688.16
基金投资		-	-
债券投资		104,769,946.13	118,463,039.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		261,035.45	-
应收利息	6.4.7.5	1,121,408.35	954,853.10
应收股利		-	-
应收申购款		39.99	29.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		122,251,517.94	141,695,922.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		11,200,000.00	34,000,000.00

应付证券清算款		298,634.88	291,848.92
应付赎回款		7,377.46	101,388.77
应付管理人报酬		63,457.42	63,058.39
应付托管费		18,130.70	18,016.67
应付销售服务费		474.63	498.50
应付交易费用	6.4.7.7	11,292.02	7,741.74
应交税费		2,165.58	4,338.91
应付利息		6,614.99	-5,499.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,699.16	180,076.03
负债合计		11,706,846.84	34,661,468.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	94,893,799.27	95,024,074.97
未分配利润	6.4.7.10	15,650,871.83	12,010,379.69
所有者权益合计		110,544,671.10	107,034,454.66
负债和所有者权益总计		122,251,517.94	141,695,922.92

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 94,893,799.27 份，其中前海联合添利债券 A 基金份额净值 1.1646 元，基金份额总额 93,713,371.31 份；其中前海联合添利债券 C 基金份额净值 1.1943 元，基金份额总额 1,180,427.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

一、收入		4,525,562.70	1,266,006.42
1. 利息收入		968,606.22	2,076,933.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,433.67	31,856.59
债券利息收入		948,599.55	2,003,857.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,573.00	41,219.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,160,475.26	590,507.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,303,380.81	488,198.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,726,418.92	-100,873.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	130,675.53	203,183.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-603,792.10	-1,401,638.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17.1	273.32	202.95
<b>减：二、费用</b>		861,391.30	1,493,375.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	378,987.34	492,625.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	108,282.04	140,750.25

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	2, 975. 83	265, 716. 10
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	54, 164. 17	148, 187. 60
5. 利息支出		217, 156. 68	333, 326. 51
其中：卖出回购金融资产支出		217, 156. 68	333, 326. 51
6. 税金及附加		2, 151. 48	3, 891. 66
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	97, 673. 76	108, 877. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3, 664, 171. 40	-227, 368. 97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3, 664, 171. 40	-227, 368. 97

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	95, 024, 074. 97	12, 010, 379. 69	107, 034, 454. 66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3, 664, 171. 40	3, 664, 171. 40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-130, 275. 70	-23, 679. 26	-153, 954. 96
其中：1. 基金申购款	378, 151. 98	62, 179. 20	440, 331. 18

2. 基金赎回款	-508,427.68	-85,858.46	-594,286.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	94,893,799.27	15,650,871.83	110,544,671.10
项 目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	133,459,893.58	10,076,438.08	143,536,331.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-227,368.97	-227,368.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-37,342,256.43	-5,795,483.34	-43,137,739.77
其中：1. 基金申购款	92,933,729.16	4,352,321.51	97,286,050.67
2. 基金赎回款	-130,275,985.59	-10,147,804.85	-140,423,790.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	96,117,637.15	4,053,585.77	100,171,222.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吴昱村

吴昱村

陈艳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1743号《关于准予新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 369,170,390.64 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1332 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 369,274,591.57 份基金份额,其中认购资金利息折合 104,200.93 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,004,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金根据认(申)购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费,不收取销售服务费的,称为 A 类基金份额;收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,不收取认购费和申购费的,称为 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银



行存款)、同业存单、国债期货、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%,其中权证占基金资产净值的比例为 0%-3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号(年度报告和中期报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	84,989.95
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	84,989.95

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		14,713,349.47	15,516,663.76	803,314.29
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	104,267,300.79	104,769,946.13	502,645.34
	银行间市场	-	-	-
	合计	104,267,300.79	104,769,946.13	502,645.34
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		118,980,650.26	120,286,609.89	1,305,959.63

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	79.48

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	199.08
应收债券利息	1,118,749.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,377.83
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.43
合计	1,121,408.35

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,292.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,292.02

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15.40
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	29,876.39

预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	98,699.16

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 前海联合添利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	93,743,721.79	93,743,721.79
本期申购	196,509.50	196,509.50
本期赎回（以“-”号填列）	-226,859.98	-226,859.98
本期末	93,713,371.31	93,713,371.31

##### 前海联合添利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,280,353.18	1,280,353.18
本期申购	181,642.48	181,642.48
本期赎回（以“-”号填列）	-281,567.70	-281,567.70
本期末	1,180,427.96	1,180,427.96

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 前海联合添利债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,039,220.11	2,770,166.66	11,809,386.77

本期利润	4,212,309.69	-595,097.24	3,617,212.45
本期基金份额交易产生的变动数	-3,573.83	-1,470.60	-5,044.43
其中：基金申购款	24,247.45	5,322.60	29,570.05
基金赎回款	-27,821.28	-6,793.20	-34,614.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,247,955.97	2,173,598.82	15,421,554.79

## 前海联合添利债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	162,221.37	38,771.55	200,992.92
本期利润	55,653.81	-8,694.86	46,958.95
本期基金份额交易产生的变动数	-16,609.93	-2,024.90	-18,634.83
其中：基金申购款	27,173.40	5,435.75	32,609.15
基金赎回款	-43,783.33	-7,460.65	-51,243.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	201,265.25	28,051.79	229,317.04

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,040.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,338.97
其他	54.24
合计	14,433.67

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	17,654,506.06
减：卖出股票成本总额	15,351,125.25
买卖股票差价收入	2,303,380.81

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,726,418.92
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,726,418.92

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	97,379,542.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	94,180,603.81
减：应收利息总额	1,472,519.69
买卖债券差价收入	1,726,418.92

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入



无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	130,675.53
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	130,675.53

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-603,792.10
——股票投资	-2,140,223.45
——债券投资	1,536,431.35
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-603,792.10

#### 6.4.7.17.1 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	273.32
合计	273.32

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	49,364.17
银行间市场交易费用	4,800.00
交易基金产生的费用	-
合计	54,164.17

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	190.00
账户维护费	23,100.00
合计	97,673.76

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

当期发生的基金应支付的管 理费	378,987.34	492,625.71
其中：支付销售机构的客户 维护费	4,640.44	10,226.34

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计  
提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	108,282.04	140,750.25

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年  
费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 的各关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C	合计
新疆前海联合基 金管理有限公司	-	9.44	9.44
中国工商银行股 份有限公司	-	2,726.57	2,726.5 7
合计	-	2,736.01	2,736.0

			1
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C	合计
新疆前海联合基金 管理有限公司	-	260,415.52	260,415 .52
中国工商银行股 份有限公司	-	4,514.52	4,514.5 2
合计	-	264,930.04	264,930 .04

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值  $\times$  0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

## 前海联合添利债券 C

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）持有的基金份额	10,004,000.00	10,004,000.00
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	-	-

注：本基金管理人投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国工商银行股份有限公司	84,989.95	1,040.46	112,453.66	8,527.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

无。

**6.4.12 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 11,200,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入抵押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。



## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发

行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,003,500.00	998,700.00
合计	5,003,500.00	998,700.00

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	70,273,819.19	88,671,597.32
AAA 以下	28,484,011.01	23,119,138.81
未评级	1,008,615.93	5,673,603.27
合计	99,766,446.13	117,464,339.40

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 11,200,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为

一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他

主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	84,989.95	-	-	-	84,989.95
结算备付金	491,536.11	-	-	-	491,536.11
存出保证金	5,898.20	-	-	-	5,898.20
交易性金融 资产	14,499,357. 93	82,244,254. 03	8,026,334.1 7	15,516,663. 76	120,286,609 .89
应收证券清 算款	-	-	-	261,035.45	261,035.45
应收利息	-	-	-	1,121,408.3 5	1,121,408.3 5

应收申购款	-	-	-	39.99	39.99
资产总计	15,081,782.19	82,244,254.03	8,026,334.17	16,899,147.55	122,251,517.94
负债					
卖出回购金 融资产款	11,200,000.00	-	-	-	11,200,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	298,634.88	298,634.88
应付赎回款	-	-	-	7,377.46	7,377.46
应付管理人 报酬	-	-	-	63,457.42	63,457.42
应付托管费	-	-	-	18,130.70	18,130.70
应付销售服 务费	-	-	-	474.63	474.63
应付交易费 用	-	-	-	11,292.02	11,292.02
应交税费	-	-	-	2,165.58	2,165.58
应付利息	-	-	-	6,614.99	6,614.99
其他负债	-	-	-	98,699.16	98,699.16
负债总计	11,200,000.00	-	-	506,846.84	11,706,846.84
利率敏感度 缺口	3,881,782.19	82,244,254.03	8,026,334.17	16,392,300.71	110,544,671.10
上年度末 2020年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	633,697.92	-	-	-	633,697.92
结算备付金	1,574,332.1	-	-	-	1,574,332.1

	3				3
存出保证金	13,282.23	-	-	-	13,282.23
交易性金融资产	46,686,289.25	67,568,868.87	4,207,881.28	20,056,688.16	138,519,727.56
应收利息	-	-	-	954,853.10	954,853.10
应收申购款	-	-	-	29.98	29.98
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,907,601.53	67,568,868.87	4,207,881.28	21,011,571.24	141,695,922.92
负债					
卖出回购金融资产款	34,000,000.00	-	-	-	34,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	291,848.92	291,848.92
应付赎回款	-	-	-	101,388.77	101,388.77
应付管理人报酬	-	-	-	63,058.39	63,058.39
应付托管费	-	-	-	18,016.67	18,016.67
应付销售服务费	-	-	-	498.50	498.50
应付交易费用	-	-	-	7,741.74	7,741.74
应付利息	-	-	-	-5,499.67	-5,499.67
应交税费	-	-	-	4,338.91	4,338.91
其他负债	-	-	-	180,076.03	180,076.03
负债总计	34,000,000.00	-	-	661,468.26	34,661,468.26
利率敏感度缺口	14,907,601.53	67,568,868.87	4,207,881.28	20,350,102.98	107,034,454.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	463,351.02	606,333.39
	市场利率上升 25 个基点	-462,264.35	-605,264.16

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不



超过基金资产的 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 14.04% (2020 年 12 月 31 日：18.74%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,516,663.76	14.04	20,056,688.16	18.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,516,663.76	14.04	20,056,688.16	18.74

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,516,663.76	12.69
	其中：股票	15,516,663.76	12.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	104,769,946.13	85.70
	其中：债券	104,769,946.13	85.70
	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	576,526.06	0.47
8	其他各项资产	1,388,381.99	1.14
9	合计	122,251,517.94	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	9,956,831.00	9.01
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	470,708.40	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	874,347.00	0.79
J	金融业	968,970.00	0.88
K	房地产业	527,600.00	0.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	266,203.00	0.24
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	993,383.08	0.90
R	文化、体育和娱乐业	1,458,621.28	1.32
S	综合	-	-
	合计	15,516,663.76	14.04

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	7,700	718,025.00	0.65
2	002044	美年健康	77,900	709,669.00	0.64
3	002415	海康威视	10,800	696,600.00	0.63
4	300144	宋城演艺	40,500	680,400.00	0.62
5	002597	金禾实业	18,000	624,600.00	0.57
6	600031	三一重工	19,000	552,330.00	0.50
7	300083	创世纪	50,000	547,500.00	0.50
8	000333	美的集团	7,500	535,275.00	0.48
9	300415	伊之密	22,000	473,000.00	0.43
10	002460	赣锋锂业	3,900	472,251.00	0.43
11	600161	天坛生物	13,500	462,375.00	0.42
12	300251	光线传媒	42,088	454,971.28	0.41
13	600699	均胜电子	17,000	433,840.00	0.39
14	600690	海尔智家	16,000	414,560.00	0.38
15	600585	海螺水泥	9,000	369,450.00	0.33
16	600048	保利地产	30,000	361,200.00	0.33
17	601318	中国平安	5,500	353,540.00	0.32
18	000681	视觉中国	25,000	323,250.00	0.29
19	601336	新华保险	7,000	321,370.00	0.29
20	300003	乐普医疗	10,000	321,200.00	0.29
21	601021	春秋航空	5,536	314,998.40	0.28
22	603345	安井食品	1,200	304,824.00	0.28
23	000001	平安银行	13,000	294,060.00	0.27
24	600438	通威股份	6,500	281,255.00	0.25
25	600309	万华化学	2,500	272,050.00	0.25
26	603259	药明康德	1,700	266,203.00	0.24
27	002812	恩捷股份	1,000	234,100.00	0.21

28	002508	老板电器	5,000	232,500.00	0.21
29	300408	三环集团	5,000	212,100.00	0.19
30	002756	永兴材料	3,500	207,865.00	0.19
31	600519	贵州茅台	100	205,670.00	0.19
32	000661	长春高新	500	193,500.00	0.18
33	603882	金域医学	1,200	191,724.00	0.17
34	000895	双汇发展	6,000	190,800.00	0.17
35	002007	华兰生物	5,000	183,400.00	0.17
36	688388	嘉元科技	2,000	181,920.00	0.16
37	600079	人福医药	6,000	169,620.00	0.15
38	600089	特变电工	13,000	167,050.00	0.15
39	601155	新城控股	4,000	166,400.00	0.15
40	600588	用友网络	4,700	156,322.00	0.14
41	002352	顺丰控股	2,300	155,710.00	0.14
42	688363	华熙生物	500	138,930.00	0.13
43	603799	华友钴业	1,200	137,040.00	0.12
44	603416	信捷电气	2,000	126,940.00	0.11
45	601012	隆基股份	1,400	124,376.00	0.11
46	300750	宁德时代	200	106,960.00	0.10
47	300285	国瓷材料	2,000	97,500.00	0.09
48	600110	诺德股份	8,000	97,440.00	0.09
49	300760	迈瑞医疗	200	96,010.00	0.09
50	002475	立讯精密	2,000	92,000.00	0.08
51	300015	爱尔眼科	1,296	91,990.08	0.08

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300083	创世纪	625,910.00	0.58
2	002044	美年健康	519,251.00	0.49
3	002460	赣锋锂业	459,050.00	0.43
4	002597	金禾实业	437,012.00	0.41
5	000681	视觉中国	402,750.00	0.38
6	600570	恒生电子	351,775.00	0.33
7	688063	派能科技	310,000.00	0.29
8	600161	天坛生物	298,048.00	0.28
9	300003	乐普医疗	295,870.00	0.28
10	000001	平安银行	294,193.00	0.27
11	300144	宋城演艺	289,500.00	0.27
12	603345	安井食品	274,937.00	0.26
13	600383	金地集团	257,020.00	0.24
14	300251	光线传媒	246,960.00	0.23
15	603885	吉祥航空	243,500.00	0.23
16	000895	双汇发展	241,230.00	0.23
17	300015	爱尔眼科	216,093.00	0.20
18	002415	海康威视	212,799.00	0.20
19	002756	永兴材料	210,828.00	0.20
20	600519	贵州茅台	208,101.00	0.19

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600176	中国巨石	760,005.00	0.71

2	600486	扬农化工	651,076.00	0.61
3	600519	贵州茅台	629,709.00	0.59
4	600690	海尔智家	609,159.00	0.57
5	600309	万华化学	601,026.00	0.56
6	600066	宇通客车	591,225.00	0.55
7	002597	金禾实业	585,785.00	0.55
8	002460	赣锋锂业	550,000.00	0.51
9	600887	伊利股份	532,912.00	0.50
10	600009	上海机场	516,404.00	0.48
11	300144	宋城演艺	494,207.00	0.46
12	000961	中南建设	484,560.00	0.45
13	300015	爱尔眼科	459,906.00	0.43
14	002415	海康威视	408,430.00	0.38
15	601021	春秋航空	403,074.80	0.38
16	000338	潍柴动力	394,760.00	0.37
17	300083	创世纪	369,940.00	0.35
18	300251	光线传媒	365,032.00	0.34
19	600438	通威股份	352,790.00	0.33
20	000581	威孚高科	339,270.00	0.32

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,661,498.97
卖出股票收入（成交）总额	17,654,506.06

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,003,500.00	4.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,008,615.93	0.91
	其中：政策性金融债	1,008,615.93	0.91
4	企业债券	39,927,826.62	36.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	58,830,003.58	53.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	104,769,946.1	94.78
		3	

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112729	18 申宏 02	100,000	10,302,000.00	9.32
2	163927	20 东债 01	100,000	10,058,000.00	9.10
3	163290	20 海通 02	100,000	9,967,000.00	9.02
4	132011	17 浙报 EB	97,900	9,838,950.00	8.90
5	132008	17 山高 EB	51,330	5,370,144.6	4.86



---

				0	
--	--	--	--	---	--

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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 海通 02 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2020 年 9 月-2021 年 4 月，海通证券保荐业务信息披露存在不充分或者错误；作为推荐挂牌主办券商，未勤勉尽责，对挂牌公司内控情况、股权情况等核查不充分，违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 170 号）第五条的规定以及其他法规，证监会 5 次对海通证券采取出具警示函的行政监督管理措施。

(2) 2021 年 3 月 30 日，根据沪证监决〔2021〕40 号，因在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响；司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失；投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失等违法违规事由，上海证监局责令海通证券自处罚决定作出之日起 1 年内每 3 个月开展一次内部合规检查，自处罚决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

基金管理人经审慎分析，认为海通证券资产规模大，经营情况良好，且海通证券主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述事项对海通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。

本基金投资于海通证券的决策程序说明：基于海通证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于海通证券，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，认为该事项对海通证券经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 2. 苏银转债发债主体受监管处罚情况：

2020 年 12 月 30 日，根据苏银保监罚决字〔2020〕88 号，因个人贷款资金用途管控不严；发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款等违法违规事由，根据《中华人民共和国银行业监

督管理法》第四十六条第（五）项，江苏银保监局对江苏银行处以 240 万元人民币的罚款。基金管理人经审慎分析，认为江苏银行资产规模大，经营情况良好，且江苏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，该事项对江苏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。

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

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,898.20
2	应收证券清算款	261,035.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,121,408.35
5	应收申购款	39.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,388,381.99

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	132011	17 浙报 EB	9,838,950.00	8.90
2	132008	17 山高 EB	5,370,144.60	4.86
3	132015	18 中油 EB	2,986,722.50	2.70
4	110053	苏银转债	2,184,480.00	1.98
5	110068	龙净转债	1,268,064.00	1.15
6	132018	G 三峡 EB1	1,242,040.80	1.12
7	113011	光大转债	1,155,800.00	1.05
8	110056	亨通转债	1,027,700.00	0.93
9	128081	海亮转债	1,024,185.97	0.93
10	110038	济川转债	1,019,258.70	0.92
11	113021	中信转债	950,130.00	0.86
12	110051	中天转债	918,640.00	0.83
13	128071	合兴转债	905,080.00	0.82
14	110043	无锡转债	901,440.00	0.82
15	110045	海澜转债	893,040.00	0.81
16	110060	天路转债	857,285.80	0.78
17	110059	浦发转债	819,440.00	0.74
18	113569	科达转债	815,770.00	0.74
19	128107	交科转债	814,200.00	0.74
20	128105	长集转债	812,550.00	0.74
21	113033	利群转债	801,600.00	0.73
22	113044	大秦转债	737,864.70	0.67
23	110063	鹰 19 转债	707,940.00	0.64
24	113549	白电转债	707,884.80	0.64
25	123056	雪榕转债	672,360.00	0.61
26	128140	润建转债	657,193.80	0.59
27	110073	国投转债	647,337.10	0.59
28	110064	建工转债	641,680.00	0.58
29	132009	17 中油 EB	618,429.00	0.56

30	113601	塞力转债	608,820.00	0.55
31	128064	司尔转债	601,621.08	0.54
32	110062	烽火转债	595,952.00	0.54
33	113542	好客转债	592,737.60	0.54
34	123048	应急转债	569,953.60	0.52
35	128083	新北转债	567,611.10	0.51
36	128114	正邦转债	552,389.36	0.50
37	110034	九州转债	541,200.00	0.49
38	110048	福能转债	534,320.00	0.48
39	110041	蒙电转债	520,478.40	0.47
40	127016	鲁泰转债	520,300.00	0.47
41	128129	青农转债	515,920.08	0.47
42	113525	台华转债	508,390.80	0.46
43	110052	贵广转债	506,050.00	0.46
44	113532	海环转债	501,000.00	0.45
45	123063	大禹转债	453,600.00	0.41
46	113584	家悦转债	398,965.50	0.36
47	113039	嘉泽转债	343,530.00	0.31
48	113563	柳药转债	320,617.70	0.29
49	128117	道恩转债	304,080.00	0.28
50	123002	国祯转债	297,728.40	0.27
51	132007	16 凤凰 EB	272,327.40	0.25
52	123068	弘信转债	271,550.00	0.25
53	128131	崇达转 2	257,000.00	0.23
54	110057	现代转债	223,620.00	0.20
55	127020	中金转债	220,497.00	0.20
56	127024	盈峰转债	220,020.00	0.20
57	127015	希望转债	217,680.00	0.20
58	128040	华通转债	216,200.00	0.20

59	128037	岩土转债	214,860.00	0.19
60	127012	招路转债	209,778.80	0.19
61	113024	核建转债	200,841.20	0.18
62	128095	恩捷转债	180,310.00	0.16
63	123028	清水转债	164,527.20	0.15
64	110076	华海转债	160,769.70	0.15
65	123077	汉得转债	153,630.00	0.14
66	128108	蓝帆转债	120,250.00	0.11
67	113013	国君转债	112,810.00	0.10
68	110067	华安转债	107,420.00	0.10
69	113026	核能转债	105,730.00	0.10
70	128022	众信转债	105,500.00	0.10
71	123059	银信转债	105,230.00	0.10
72	123076	强力转债	100,870.00	0.09
73	128124	科华转债	52,550.00	0.05
74	113610	灵康转债	32,361.00	0.03
75	132022	20 广版 EB	3,008.10	0.00

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合添利债券 A	305	307,256.96	92,661,657.00	98.88%	1,051,714.31	1.12%
前海联合添利债券 C	797	1,481.09	-	-	1,180,427.96	100.00%
合计	1,060	89,522.45	92,661,657.00	97.65%	2,232,142.27	2.35%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合添利债券 A	223.35	0.0002%
	前海联合添利债券 C	4,565.89	0.3868%
	合计	4,789.24	0.0050%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海联合添利债券 A	0~10
	前海联合添利债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合添利债券 A	0
	前海联合添利债券 C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	11.12	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11.12	0.00%	-	-	-

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

3. 本基金于 2016 年 11 月 11 日成立，截至 2019 年 11 月 11 日，本基金成立满 3 年。本基金管理人于 2019 年 12 月 11 日申请赎回本基金发起式基金份额 10,004,000.00 份。基金管理人的赎回行为符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第十二条第二款有关发起式基金份额锁定期的规定。



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	75,506,812.05	293,767,779.52
本报告期期初基金份额总额	93,743,721.79	1,280,353.18
本报告期基金总申购份额	196,509.50	181,642.48
减：本报告期基金总赎回份额	226,859.98	281,567.70
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	93,713,371.31	1,180,427.96

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，王晓耕女士自 2021 年 4 月 15 日起不再担任公司总经理职务，张永任先生自 2021 年 4 月 15 日起代为履行公司总经理职责；吴昱村先生自 2021 年 5 月 26 日起担任公司总经理，张永任先生不再代为履行总经理职责；邹文庆先生自 2021 年 6 月 21 日起担任公司总经理助理。

2、经 2021 年 4 月 12 日召开的公司股东会 2021 年第 1 次临时会议与会股东一致审议通过，段军山先生接替孙学致先生担任公司独立董事。

3、经 2021 年 4 月 17 日召开的公司股东会 2021 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，王晓耕女士辞去公司第二届董事会董事职务。

4、经 2021 年 5 月 28 日召开的公司股东会 2021 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，聘任吴昱村先生担任公司第二届董事会董事。

5、经 2021 年 6 月 28 日召开的公司股东会 2021 年定期会议与会股东一致审议通过，乔宗利先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由孙莉女士担任公司第二届董事会董事。

经 2021 年 7 月 16 日召开的公司第二届董事会 2021 年第 10 次临时会议与会董事一致审议通过，孙莉女士担任公司第二届董事会副董事长。

6、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### **10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### **10.4 基金投资策略的改变**

本基金于 2021 年 1 月 30 日公告投资范围新增存托凭证，投资策略相应增加“存托凭证投资策略”，相关内容请参见 2021 年 1 月 30 日公告。

### **10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

因业务开展需要，经本公司董事会 2021 年第 3 次临时会议审议通过并经全体独立董事同意，本基金自 2021 年 5 月 28 日起，改聘致同会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已通知基金托管人或经基金托管人同意。

### **10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### **10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东兴证券 股份有限 公司	1	757,29 1.00	2.50%	553.81	2.04%	-
中信建投 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	1	960,96 3.00	3.18%	702.75	2.58%	-
兴业证券 股份有限 公司	1	3,573, 140.00	11.81%	3,327. 69	12.24%	-
华创证券 有限责任 公司	2	3,561, 706.80	11.77%	3,316. 99	12.20%	-
华泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	1	3,228, 870.00	10.67%	2,361. 22	8.68%	-

安信证券 股份有限 公司	1	12,832 ,710.6 0	42.41%	11,950 .99	43.95%	-
广发证券 股份有限 公司	1	5,345, 453.66	17.67%	4,978. 06	18.31%	-
恒泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第2点规定执行；

（2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2. 本报告期内增加交易单元：五矿证券股份有限公司。本报告期内退租交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交	占当期债	成交	占当期债	成交	占当期权	成交	占当期基

	金额	券成交总 额的比例	金额	券回购成 交总额的 比例	金额	证成交总 额的比例	金额	金成交总 额的比例
东兴 证券 股份 有限 公司	1,455 ,437. 73	0.87%	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿 证券 有限 公司	771,7 15.07	0.46%	-	-	-	-	-	-
兴业 证券 股份 有限 公司	52,18 4,859 .71	31.12%	86,60 0,000 .00	6.58%	-	-	-	-
华创 证券 有限 责任 公司	10,42 8,626 .91	6.22%	43,70 0,000 .00	3.32%	-	-	-	-
华泰	10,41	6.21%	-	-	-	-	-	-

证券 股份 有限 公司	1,745 .21							
华金 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券 有限 责任 公司	9,340 ,824. 49	5.57%	457,3 00,00 0.00	34.77%	-	-	-	-
安信 证券 股份 有限 公司	41,44 5,392 .93	24.71%	74,90 0,000 .00	5.69%	-	-	-	-
广发 证券 股份 有限 公司	41,65 6,849 .75	24.84%	652,7 00,00 0.00	49.63%	-	-	-	-
恒泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海联合添利债券基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-01-22
2	前海联合基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修订相关法律文件的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-01-30
3	前海联合基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销柜台首次申购及追加申购单笔最低金额的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-02-27
4	关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-20
5	前海联合基金管理有限公司关于旗下部分基金根据侧袋机制指引修订相关法律文件的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-29
6	前海联合添利债券基金 2020 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-30
7	前海联合添利债券基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-04-22
8	前海联合添利债券型基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-05-07

		人网站	
9	前海联合基金管理有限公司 基金改聘会计师事务所公告 (一)	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-06-01

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20210101 -20210630	92,661,657.00	-	-	92,661,657.00	97.65%
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》



等法律法规及各基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本基金管理人就旗下 25 只证券投资基金（包括本基金）增加侧袋机制相关内容并相应对相关法律文件进行修订，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添利债券型发起式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资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等存放于基金管理人处。

### 12.3 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

二〇二一年八月三十日