

新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 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:2022 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2022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2022年4月1日起至2022年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添鑫 3 个月定开债券
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	13,498,054.44 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	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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</p>

	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 个月定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	9,895,887.54 份	3,602,166.90 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 04 月 01 日-2022 年 06 月 30 日）	
	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
1. 本期已实现收益	75,752.20	22,376.40
2. 本期利润	350,752.68	118,462.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0354	0.0329
4. 期末基金资产净值	12,114,420.68	4,235,645.98
5. 期末基金份额净值	1.2242	1.1759

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	2.98%	0.30%	0.29%	0.04%	2.69%	0.26%
过去六个月	-1.17%	0.36%	0.38%	0.05%	-1.55%	0.31%
过去一年	-0.75%	0.33%	1.83%	0.05%	-2.58%	0.28%

自基金转型 日起至今	8.09%	0.29%	0.76%	0.06%	7.33%	0.23%
---------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

## 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	2.88%	0.30%	0.29%	0.04%	2.59%	0.26%
过去六个月	-1.37%	0.37%	0.38%	0.05%	-1.75%	0.32%
过去一年	-1.15%	0.33%	1.83%	0.05%	-2.98%	0.28%
自基金转型 日起至今	7.11%	0.29%	0.76%	0.06%	6.35%	0.23%

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

前海联合添鑫3个月定开债券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03月26日-2022年06月30日)



前海联合添鑫3个月定开债券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03月26日-2022年06月30日)



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		
张文	本基金的基金经理	2021- 08-20	-	9 年	张文先生，硕士，9 年证券基金投资研究经验。曾任中山证券有限责任公司固定收益部交易员、第一创业证券股份有限公司资产管理部高级交易经理、深圳慈曜资产管理有限公司交易管理部交易主管、新疆前海联合基金管理有限公司基金经理助理、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 20 日至 2021

				<p>年 9 月 14 日) 和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 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 1 月 5 日)。现任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 2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 28 日起任职)、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 2020 年 10 月 29 日起任职)、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理 (自 2020 年 12 月 1 日起任职)、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2021 年 5 月 18 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 2021 年 8 月 20 日起任职)、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 2021 年 8 月 20 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 2021 年 8 月 20 日起任职)、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)、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理 (自 2022 年 3 月 5 日起任职) 和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 3 月 5 日起任职)。</p>
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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。

##### 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

2022 年二季度，宏观经济受到疫情严重冲击后，一揽子政策措施出台，经济修复环比加快。国内方面，二季度经济表现基本确定为年内底部位置，后续修复斜率取决于政策力度及疫情发展。从最新数据来看，生产端需求端稳定修复，出口重回两位数增长，基建投资和制造业投资仍有韧性，地产投资和销售也有低位企稳迹象，消费低位反弹，但仍明显低于此次疫情冲击之前的水平。通胀数据符合预期，PPI-CPI 剪刀差明显回落，社融结构也有所改善。国际方面，美联储加息节奏偏快，此外俄乌持续冲突及相关制裁影响，欧美经济体通胀压力较大，海外经济增长面临较大不确定性。

资金面方面，流动性较宽松，5 月 5 年期 LPR 调降 15bp，央行月末时点也加大公开市场投放力度，资金价格下行明显。债市方面，利率债现券收益小幅震荡，整季来看，季初季末现券收益率基本持平，十年国债收益率收于 2.82% 左右，但信用利差收窄 15bp 左右，中证转债指数涨 4.61% 收于 418.62 点，转股溢价率压缩，但可转债整体处于历史偏高位置。股市方面，4 月底以后市场呈 V 型反弹，电新、汽车、食品饮料、有色等板块涨幅显著，上证 50、中证 500、创业板三季度收益分别为 4.9%、2.05%、5.68%。

报告期内，本基金有所调仓，在基金合同约定范围内增加了权益资产比重，提高了弹性品种仓位，增加了低价可转债的仓位，纯债仓位略有降低。未来一个季度会根据基本面、资金面、市场情绪的变化，优化大类资产结构，努力挖掘有稳定回报的股票资产，合理配置纯债、可转债、可交债资产，在控制好回撤的基础上为投资者努力提供更好的持有体验。

#### 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 1.2242 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 2.98%,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鑫 3 个月定开债券 C 基金份额净值为 1.1759 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 2.88%,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

本报告期内,本基金从 2021 年 1 月 22 日起至 2022 年 6 月 30 日止,连续 346 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。本基金管理人于 2021 年 5 月 7 日向证监会申请持续运作,并于 2021 年 8 月 26 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议通过了《关于对新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金进行持续营销的议案》。自前述议案有效通过日起,截至 2021 年 11 月 26 日,本基金已连续 60 个工作日低于 5000 万元,本基金管理人于 2021 年 12 月 8 日向证监会再次申请持续运作本基金,并于 2022 年 5 月 24 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于对新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金进行持续营销的议案》。

### § 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	2,733,000.20	16.64
	其中:股票	2,733,000.20	16.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,240,328.00	80.59
	其中:债券	13,240,328.00	80.59
	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	360,000.00	2.19
	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	43,760.09	0.27
8	其他资产	51,701.43	0.31
9	合计	16,428,789.72	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	17,441.00	0.11
B	采矿业	89,416.00	0.55
C	制造业	1,707,717.20	10.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,461.00	0.52
E	建筑业	112,872.00	0.69
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	70,609.00	0.43
H	住宿和餐饮业	65,200.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	184,599.00	1.13
J	金融业	226,866.00	1.39
K	房地产业	93,580.00	0.57
L	租赁和商务服务业	23,293.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	41,596.00	0.25
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,350.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	2,733,000.20	16.72

### 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	600660	福耀玻璃	1,700	71,077.00	0.43
2	002594	比亚迪	200	66,698.00	0.41
3	300059	东方财富	2,520	64,008.00	0.39
4	300274	阳光电源	600	58,950.00	0.36
5	300750	宁德时代	100	53,400.00	0.33
6	600754	锦江酒店	800	50,320.00	0.31
7	600690	海尔智家	1,700	46,682.00	0.29
8	002271	东方雨虹	900	46,323.00	0.28
9	603198	迎驾贡酒	700	45,598.00	0.28
10	002460	赣锋锂业	300	44,610.00	0.27

### 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	3,060,094.71	18.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,466,529.07	15.09
	其中：政策性金融债	1,232,231.81	7.54
4	企业债券	1,711,504.48	10.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,002,199.74	36.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,240,328.00	80.98

### 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	127910	19 铁道 03	10,000	1,045,908.36	6.40
2	122260	13 中信 02	10,000	1,027,256.44	6.28
3	019658	21 国债 10	10,000	1,019,049.32	6.23
4	019664	21 国债 16	10,000	1,016,462.19	6.22
5	113021	中信转债	6,700	732,845.27	4.48

### 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 1803 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 8 月 23 日，根据大银保监罚决字〔2021〕35、37 号，由于贷中贷后管理不尽职，导致贷款资金回流借款人；贷款“三查”不到位，贷款资金被挪用，导致贷款形成不良，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，国家开发银行大连市分行被大连银保监局处以合计 50 万元的罚款。

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. 浦发转债发债主体受监管处罚情况：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

### 3. 上银转债发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 7 月 2 日，根据沪银保监罚决字〔2021〕72 号，由于 2018-2020 年间同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则；经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项，上海银行被上海银保监局处以 460 万元的罚款。

(2) 2021 年 11 月 19 日，根据沪银保监罚决字〔2021〕174 号，由于未按规定报送统计报表，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条、《中华人民共和国商业银行法》第八十条、《银行业监管统计管理暂行办法》第三十六条，上海银行被上海银保监局处以 20 万元的罚款。

(3) 2022 年 2 月 14 日，根据沪银保监罚决字〔2022〕13 号，由于 2015 年 3 月至 7 月，该行同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，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，上海银行被上海银保监局处以 240 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为上海银行资产规模大，经营情况良好，且上海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。

本基金投资于上海银行的决策程序说明：基于上海银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于上海银行，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，认为上述事项对上海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. 光大转债发债主体受监管处罚情况：

(1) 2022 年 1 月 19 日，根据京汇罚〔2022〕5 号，由于违反外汇登记管理规定，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条，光大银行被国家外汇管理局北京外汇管理部处以 2.5 万元的罚款。

(2) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕18 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，光大银行被银保监会处以 490 万元的罚款。

(3) 2022 年 5 月 4 日，根据银保监罚决字〔2022〕31 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》第二十一条、第四十六条，光大银行被银保监会处以 400 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为光大银行资产规模大，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，上述事项对光大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。

本基金投资于光大银行的决策程序说明：基于光大银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于光大银行，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，认为上述事项对光大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. 中信转债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。

#### 6. 13 中信 02 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 12 月 7 日，根据深外管检[2021]44 号，由于 QDII 超额度汇出；国际收支统计漏申报；B 股客户非同名账户取款等违法违规行为，违反了《合格境内机构投资者境外证券投资外汇管理规定》第六条；《国际收支统计申报办法》第七条、第十条等法规规定，中信证券被国家外汇管理局深圳市分局责令整改，并处以罚款 101 万元，没收违法所得 81 万元。

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

本基金投资于中信证券的决策程序说明：基于中信证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中信证券，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，认为该事项对中信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	4,111.72
2	应收证券清算款	47,589.71
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	51,701.43

### 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	113021	中信转债	732,845.27	4.48
2	113011	光大转债	638,007.95	3.90
3	110059	浦发转债	577,693.28	3.53
4	113042	上银转债	472,838.79	2.89
5	113044	大秦转债	316,268.44	1.93
6	110053	苏银转债	119,680.51	0.73
7	113033	利群转债	98,486.51	0.60
8	110075	南航转债	97,885.95	0.60
9	128145	日丰转债	91,801.27	0.56
10	128081	海亮转债	89,499.60	0.55
11	127028	英特转债	84,842.78	0.52
12	113610	灵康转债	81,140.68	0.50
13	127012	招路转债	79,958.97	0.49
14	128075	远东转债	79,908.33	0.49
15	123063	大禹转债	78,074.70	0.48
16	123060	苏试转债	76,339.73	0.47
17	113579	健友转债	75,990.74	0.46
18	123002	国祯转债	70,680.00	0.43
19	110060	天路转债	69,251.51	0.42
20	110063	鹰 19 转债	67,868.71	0.42
21	110047	山鹰转债	67,865.92	0.42
22	123050	聚飞转债	65,425.48	0.40
23	123048	应急转债	65,057.06	0.40
24	128037	岩土转债	64,237.85	0.39

25	127047	帝欧转债	63,722.24	0.39
26	123125	元力转债	58,997.66	0.36
27	127033	中装转 2	57,851.64	0.35
28	128119	龙大转债	55,859.86	0.34
29	123056	雪榕转债	54,152.67	0.33
30	127035	濮耐转债	52,696.41	0.32
31	110077	洪城转债	52,354.20	0.32
32	123077	汉得转债	50,463.73	0.31
33	113602	景 20 转债	48,407.59	0.30
34	113542	好客转债	44,544.82	0.27
35	127024	盈峰转债	43,116.77	0.26
36	123116	万兴转债	41,668.81	0.25
37	127016	鲁泰转债	34,992.58	0.21
38	110045	海澜转债	34,932.38	0.21
39	127041	弘亚转债	34,382.38	0.21
40	128136	立讯转债	34,318.56	0.21
41	123078	飞凯转债	34,090.81	0.21
42	113605	大参转债	33,411.42	0.20
43	127040	国泰转债	32,249.34	0.20
44	128021	兄弟转债	31,464.60	0.19
45	128128	齐翔转 2	30,158.85	0.18
46	127044	蒙娜转债	29,374.94	0.18
47	128105	长集转债	28,540.94	0.17
48	128083	新北转债	26,060.11	0.16
49	128135	洽洽转债	25,600.81	0.16
50	110079	杭银转债	25,056.48	0.15
51	123103	震安转债	24,933.95	0.15
52	110064	建工转债	24,772.60	0.15
53	127020	中金转债	23,482.67	0.14
54	128131	崇达转 2	23,090.12	0.14
55	113623	凤 21 转债	22,944.41	0.14
56	123101	拓斯转债	22,406.77	0.14
57	128074	游族转债	22,255.18	0.14
58	123113	仙乐转债	22,019.20	0.13
59	113024	核建转债	21,557.91	0.13
60	128133	奇正转债	21,435.44	0.13
61	123096	思创转债	21,245.03	0.13
62	123073	同和转债	18,188.05	0.11
63	113601	塞力转债	17,125.59	0.10
64	113039	嘉泽转债	16,760.50	0.10
65	128017	金禾转债	16,049.29	0.10
66	127025	冀东转债	14,923.83	0.09
67	127036	三花转债	14,165.63	0.09

68	127049	希望转 2	13,509.72	0.08
69	123107	温氏转债	13,129.30	0.08
70	127045	牧原转债	12,899.98	0.08
71	113635	升 21 转债	12,797.35	0.08
72	113532	海环转债	12,191.59	0.07
73	127017	万青转债	12,164.52	0.07
74	110057	现代转债	12,088.92	0.07
75	113516	苏农转债	11,950.48	0.07
76	123099	普利转债	11,939.67	0.07
77	128071	合兴转债	11,796.92	0.07
78	113549	白电转债	11,737.97	0.07
79	113045	环旭转债	11,659.22	0.07
80	123119	康泰转 2	11,620.08	0.07
81	128123	国光转债	11,600.01	0.07
82	123109	昌红转债	11,514.97	0.07
83	113017	吉视转债	11,457.15	0.07
84	113606	荣泰转债	11,371.44	0.07
85	123010	博世转债	11,181.68	0.07
86	110062	烽火转债	10,884.25	0.07
87	113584	家悦转债	10,500.70	0.06
88	128108	蓝帆转债	10,181.45	0.06
89	128124	科华转债	9,986.04	0.06
90	113596	城地转债	9,712.45	0.06
91	113534	鼎胜转债	9,661.29	0.06
92	128097	奥佳转债	7,136.77	0.04
93	111000	起帆转债	6,824.50	0.04
94	113619	世运转债	6,404.65	0.04
95	113048	晶科转债	6,389.78	0.04
96	123075	贝斯转债	6,269.35	0.04

#### 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	9,943,614.35	3,622,611.96
报告期期间基金总申购份额	58.66	1,760.97
减：报告期期间基金总赎回份额	47,785.47	22,206.03
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	9,895,887.54	3,602,166.90

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	398,899.68
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	398,899.68
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.9552

前海联合添鑫 3 个月定开债券 C

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,248,855.22
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	1,248,855.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.2521

### 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	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

别							
机构	1	20220401-20220630	8,203,29 8.06	-	-	8,203,29 8.06	60.77%
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

本报告期内，本基金管理人经与本基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于对新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金进行持续营销的议案》。该议案于 2022 年 5 月 24 日表决通过。有关详细信息请参见本基金管理人于 2022 年 4 月 23 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》以及 2022 年 5 月 25 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## § 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。
- 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

二〇二二年七月二十一日