

# 新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金

2022 年中期报告

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2022 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	38

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>46</b>
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 .....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金	
基金简称	前海联合泰瑞纯债	
基金主代码	008636	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 08 月 13 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,962,309,349.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合泰瑞纯债 A	前海联合泰瑞纯债 C
下属分级基金的交易代码	008636	008703
报告期末下属分级基金的份额总额	1,962,010,165.88 份	299,183.98 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准收益。
投资策略	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金采用期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等积极的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用潜在投资机会，实现组合资产的增值。
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。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹文庆（代履职）	田东辉
	联系电话	0755-82780666	010-68858113
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	tiantonghui@psbc.com
客户服务电话		400-640-0099	95580

传真	0755-82780000	010-68858120
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	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518057	100808
法定代表人	邹文庆（代履职）	刘建军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qlhfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 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（2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日）	
	前海联合泰瑞纯债 A	前海联合泰瑞纯债 C
本期已实现收益	34,087,629.82	4,544.74
本期利润	29,361,507.37	3,828.76
加权平均基金份额本期利润	0.0150	0.0128
本期加权平均净值利润率	1.43%	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.43%	1.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	107,021,085.39	13,837.84
期末可供分配基金份额利润	0.0545	0.0463
期末基金资产净值	2,071,772,724.53	313,437.99
期末基金份额净值	1.0559	1.0476
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	5.59%	4.76%

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、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

#### 前海联合泰瑞纯债 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	0.08%	0.03%	-0.24%	0.03%	0.32%	0.00%
过去三个月	0.94%	0.03%	0.29%	0.04%	0.65%	-0.01%
过去六个月	1.43%	0.03%	0.38%	0.05%	1.05%	-0.02%
过去一年	3.30%	0.03%	1.83%	0.05%	1.47%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.59%	0.03%	2.39%	0.05%	3.20%	-0.02%

#### 前海联合泰瑞纯债 C 净值表现

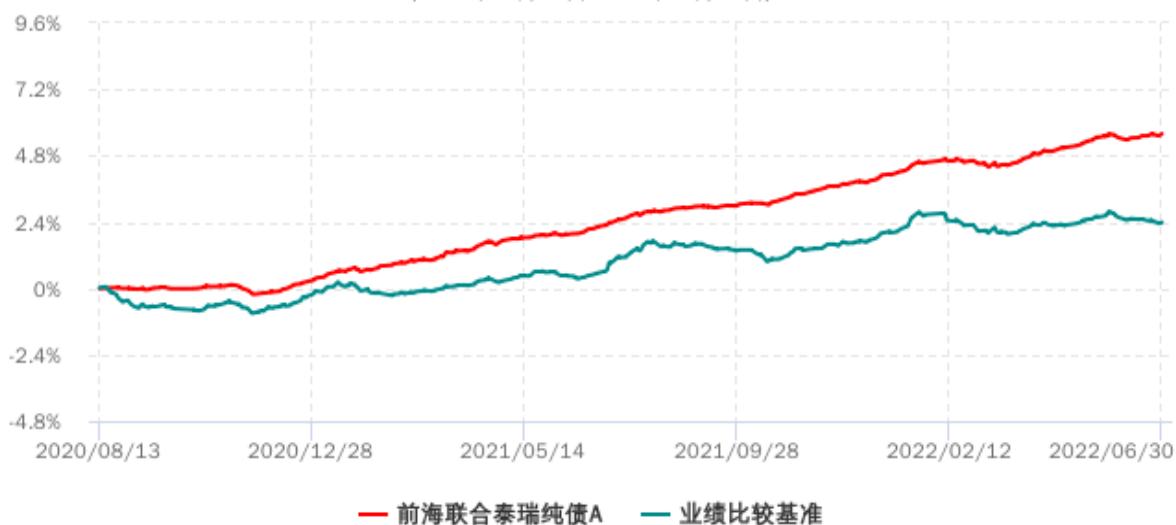
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.04%	0.03%	-0.24%	0.03%	0.28%	0.00%
过去三个月	0.83%	0.03%	0.29%	0.04%	0.54%	-0.01%
过去六个月	1.24%	0.03%	0.38%	0.05%	0.86%	-0.02%
过去一年	2.89%	0.03%	1.83%	0.05%	1.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.76%	0.03%	2.39%	0.05%	2.37%	-0.02%

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。

### 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

前海联合泰瑞纯债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08月13日-2022年06月30日)



前海联合泰瑞纯债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08月13日-2022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30只开放式基金，包括2只货币市场基金、13只债券型基金、13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3只专户理财产品，管理资产总规模超过265亿元人民币。

#### 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	2020-08-13	-	10年	黄浩东先生，清华大学硕士，10年证券投资基金投资研究经验。曾任东莞证券股份有限公司深圳分公司研究员、投资经理、副总经理兼投资经理和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日至2022年6月22日）和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日至2022年7月8日）。现任新疆前海联合基金管理有限公司固定收益部总经理、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)。
--	--	--	--	--	--

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。

3、黄浩东先生自 2022 年 7 月 9 日起不再担任本基金基金经理，孙连玉先生自 2022 年 7 月 9 日起担任本基金基金经理。

#### 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 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 2022 年上半年，经济压力尽显。首先是上半年全国疫情反复，生产及消费无法正常进行；其次地产投资和销售都出现比较大的衰退；最后外部环境压力增大，俄乌战争，美联储加息，全球通胀加剧。年初降息叠加投资者对经济的悲观预期，债券市场出现一波上涨，但接下来的社融数据和地产放松政策则逐步推高债券收益率。二月 PMI 公布进一步超预期，同时央行未进一步降准降息，市场开始出现比较大的回调。三月份深圳和长春一度封城，经济数据偏空，债市又开始新一轮博弈

降息。四五月上海封城，经济活动受到很大影响。五月上海复工复产后，各种促销费促生产措施让经济压力有所缓解，地产销售环比出现了比较好的恢复，而出口增速反弹，短期内经济动能有所恢复。

回顾 2022 年上半年，货币政策保持宽松以应对疫情冲击和经济低迷，期间资金价格长期在低位。

回顾 2022 年上半年，债券收益率在低位震荡上行，期间长端收益率下行受到稳增长压制，本身收益率偏低吸引力不足，上行又被疫情和长时间的低资金价格牵制。

2022 年上半年本基金在基金合同约定范围内，以利率债和银行债为主要投资方向，保持低杠杆操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合泰瑞纯债 A 基金份额净值为 1.0559 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；截至报告期末前海联合泰瑞纯债 C 基金份额净值为 1.0476 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看债市：经济在上海疫情后开始进入恢复期，但是奥密克戎病毒传染性强，反复传播概率大，现阶段防控政策下很难长期维持无疫情状态，经济很难恢复到去年的状态。猪肉近期价格上涨，大宗商品的通胀压力都会在三季度逐步体现，2022 年三季度 CPI 存在一定压力。美国应对通胀不断加息，中美利差倒挂给货币政策带来压力。短期资金利率会朝着政策利率中枢靠近，不再会长期维持在极端低位。预计三季度债券收益率在区间内波动，投资应把握住经济复苏和疫情反复这两主线操作。

本基金在 2022 年下半年将会在基金合同约定范围内根据市场变化情况在基金合同约定范围内调整持仓久期和持仓组合。

#### 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帐务处理；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，由运营分管高管、投研分管高管、基金运营部负责人、研究发展部负责人、信用研究部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人及其他指定人员组成，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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	69,963.73	1,553,266.77
结算备付金		2,667,097.45	230,527.33
存出保证金		39,638.97	19,014.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,121,423,755.30	2,542,038,591.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,121,423,755.30	2,542,038,591.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	20,370,230.56
债权投资（若有）		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资（若有）		-	-
其他权益工具投资（若有）		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	40,025,191.49
资产总计		2,124,200,455.45	2,604,236,821.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		51,307,393.54	560,070,634.89
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	10.38
应付管理人报酬		510,441.32	519,145.53
应付托管费		170,147.13	173,048.51
应付销售服务费		102.91	104.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,273.33	837.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	117,934.70	751,114.53
负债合计		52,114,292.93	561,514,896.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,962,309,349.86	1,962,309,392.85
其他综合收益（若有）		-	-
未分配利润	6.4.7.8	109,776,812.66	80,412,532.38
净资产合计		2,072,086,162.52	2,042,721,925.23
负债和净资产总计		2,124,200,455.45	2,604,236,821.86

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,962,309,349.86 份。其中前海联合泰瑞纯债 A 基金份额净值 1.0559 元，基金份额总额 1,962,010,165.88 份；前海联合泰瑞纯债 C 基金份额净值 1.0476 元，基金份额总额 299,183.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		34,555,436.30	6,546,944.85
1. 利息收入		166,472.11	5,124,147.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,942.24	20,733.85
债券利息收入		-	4,899,329.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		130,529.87	204,083.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,115,802.59	221,405.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	39,115,802.59	221,405.42
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,726,838.43	1,201,392.09
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	0.03	-
<b>减：二、营业总支出</b>		5,190,100.17	889,631.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,061,334.33	536,250.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,020,444.84	178,750.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	618.00	881.72
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		994,441.50	127,709.36
其中：卖出回购金融资产支出		994,441.50	127,709.36
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		5,401.35	18.24
8. 其他费用	6.4.7.19	107,860.15	46,022.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		29,365,336.13	5,657,313.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		29,365,336.13	5,657,313.16
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		29,365,336.13	5,657,313.16

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,962,309,392.85	-	80,412,532.38	2,042,721,925.23
加：会计政策变更（若有）	-	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-	-

其他（若有）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,962,309.39 2.85	-	80,412,532.3 8	2,042,721.92 5.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-42.99	-	29,364,280.2 8	29,364,237.2 9
（一）、综合收益总额	-	-	29,365,336.1 3	29,365,336.1 3
（二）、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）	-42.99	-	-1,055.85	-1,098.84
其中：1. 基金申购款	97,591.93	-	4,342.81	101,934.74
2. 基金赎回款	-97,634.92	-	-5,398.66	-103,033.58
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益（若有）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,962,309.34 9.86	-	109,776,812. 66	2,072,086.16 2.52
	<b>上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日</b>			
<b>项目</b>	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	21,207,920.1 1	-	79,339.71	21,287,259.8 2
加：会计政策变更（若有）	-	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-	-
其他（若有）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	21,207,920.1 1	-	79,339.71	21,287,259.8 2
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,452,684.12 5.45	-	32,624,762.5 1	1,485,308.88 7.96
（一）、综合收益总额	-	-	5,657,313.16	5,657,313.16
（二）、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）	1,452,684.12 5.45	-	26,967,449.3 5	1,479,651.57 4.80
其中：1. 基金申购款	1,473,890.81 3.79	-	27,107,325.6 9	1,500,998.13 9.48
2. 基金赎回款	-21,206,688. 34	-	-139,876.34	-21,346,564. 68
（三）、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）	-	-	-	-



列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益(若有)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,473,892,045.56	-	32,704,102.22	1,506,596,147.78

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：

邹文庆	党刚	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

新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金(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[2019]2431 号《关于准予新疆前海联合泰瑞纯债债券型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《新疆前海联合泰瑞纯债债券型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 201,206,726.09 元,业经致同会计师事务所(特殊普通合伙)验字(2020)第 441ZC00287 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 201,211,151.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,425.06 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》,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、申购费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 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》、《新疆前海联合泰瑞纯债债券型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,包括国内依法发行和上市的国债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、地方政府债、企业债、公司债(含证券公司短期公司债券)、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、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)、货币市场工具、同业存单、国债期货、信用衍生品等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相关规定)。

本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

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 2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号—套期会计（修订）》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报（修订）》（以下统称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金

融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

#### 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[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。对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 2022 年 06 月 30 日
活期存款	69,963.73
等于：本金	69,922.07
加：应计利息	41.66
减：坏账准备（若有）	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备（若有）	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备（若有）	-
合计	69,963.73

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	424,490,468.61	8,171,524.67	432,927,309.67	265,316.39
	银行间市场	1,660,494,876.89	26,020,445.63	1,688,496,445.63	1,981,123.11
	合计	2,084,985,345.50	34,191,970.30	2,121,423,755.30	2,246,439.50
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,084,985,345.50	34,191,970.30	2,121,423,755.30	2,246,439.50	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,374.55
其中：交易所市场	-
银行间市场	4,374.55
应付利息	-
预提费用	113,560.15
合计	117,934.70

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 前海联合泰瑞纯债 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,962,010,187.80	1,962,010,187.80
本期申购	97,567.97	97,567.97
本期赎回（以“-”号填列）	-97,589.89	-97,589.89
本期末	1,962,010,165.88	1,962,010,165.88

##### 前海联合泰瑞纯债 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	299,205.05	299,205.05
本期申购	23.96	23.96
本期赎回（以“-”号填列）	-45.03	-45.03
本期末	299,183.98	299,183.98

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 前海联合泰瑞纯债 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
本期期初	72,934,441.53	7,467,664.66	80,402,106.19
本期利润	34,087,629.82	-4,726,122.45	29,361,507.37
本期基金份额交易产生的变动数	-985.96	-68.95	-1,054.91
其中：基金申购款	4,313.48	28.29	4,341.77
基金赎回款	-5,299.44	-97.24	-5,396.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,021,085.39	2,741,473.26	109,762,558.65

##### 前海联合泰瑞纯债 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
本期期初	9,294.03	1,132.16	10,426.19
本期利润	4,544.74	-715.98	3,828.76
本期基金份额交易产生的变动数	-0.93	-0.01	-0.94
其中：基金申购款	0.99	0.05	1.04
基金赎回款	-1.92	-0.06	-1.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,837.84	416.17	14,254.01

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	16,369.12
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	19,287.51
其他	285.61
合计	35,942.24

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	32,439,592.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,676,210.19
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	39,115,802.59

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,738,431,742.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,702,540,541.07
减：应计利息总额	29,199,759.43
减：交易费用	15,231.78
买卖债券差价收入	6,676,210.19

## 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

无。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,726,838.43
——股票投资	-
——债券投资	-4,726,838.43
——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	-4,726,838.43

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	0.03
合计	0.03

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用	18,600.00
合计	107,860.15

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

### 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
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

中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
----------------	-------

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,061,334.33	536,250.11
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管	1,020,444.84	178,750.03

费		
---	--	--

注：支付基金托管人中国邮储银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 0.10% / 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合泰瑞纯债 A	前海联合泰瑞纯债 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	618	618
合计	-	618	618
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	前海联合泰瑞纯债 A	前海联合泰瑞纯债 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	881.72	881.72
合计	-	881.72	881.72

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 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 X 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

##### 前海联合泰瑞纯债 A

份额单位：份

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 01 月
----	---------------------------	---------------------

	年 06 月 30 日	01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2020 年 08 月 13 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	689,822.63	-
报告期间申购/买入总份额	-	689,822.63
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	689,822.63	689,822.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	0.05%

## 前海联合泰瑞纯债 C

份额单位：份

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2020 年 08 月 13 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	298,626.32	-
报告期间申购/买入总份额	-	298,626.32
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	298,626.32	298,626.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	98.32%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	69,963.73	16,369.12	1,589,003.00	16,564.97

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2022 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 2022 年 06 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 51,307,393.54 元，于 2022 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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

本基金为债券型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、地方政府债、企业债、公司债（含证券公司短期公司债券）、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、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）、货币市场工具、同业存单、国债期货、信用衍生品等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相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

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邮储银行。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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	39,440,750.00
合计	-	39,440,750.00

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、政策性金融债。

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	389,360,000.00
合计	-	389,360,000.00

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	1,197,867,997.83	759,599,000.00
AAA 以下	104,256,917.81	50,195,000.00
未评级	819,298,839.66	1,303,443,841.20
合计	2,121,423,755.30	2,113,237,841.20

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 51,300,000.00 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，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发行的证券不得超过该证券的 10%(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 2022 年 06 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 2022 年 06 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 2022 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	69,963.73	-	-	-	69,963.73
结算备付金	2,667,097.45	-	-	-	2,667,097.45
存出保证金	39,638.97	-	-	-	39,638.97
交易性金融资产	835,979,378.76	1,124,453,628.52	160,990,748.02	-	2,121,423,755.30
资产总计	838,756,078.91	1,124,453,628.52	160,990,748.02	-	2,124,200,455.45
负债					
卖出回购金融资产款	51,307,393.54	-	-	-	51,307,393.54
应付管理人报酬	-	-	-	510,441.32	510,441.32
应付托管费	-	-	-	170,147.13	170,147.13
应付销售服务费	-	-	-	102.91	102.91
应付交易费用	-	-	-	4,374.55	4,374.55
应交税费	-	-	-	8,273.33	8,273.33
其他负债	-	-	-	113,560.15	113,560.15
负债总计	51,307,393.54	-	-	806,899.39	52,114,292.93
利率敏感度缺口	787,448,685.37	1,124,453,628.52	160,990,748.02	-806,899.39	2,072,086,162.52
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,553,266.77	-	-	-	1,553,266.77
结算备付金	230,527.33	-	-	-	230,527.33
存出保证金	19,014.51	-	-	-	19,014.51
交易性金融资产	898,263,396.20	1,583,169,000.00	60,606,195.00	-	2,542,038,591.20
买入返售金融资产	20,370,230.56	-	-	-	20,370,230.56
其他资产	-	-	-	40,025,191.49	40,025,191.49

资产总计	920,436,435.37	1,583,169,000.00	60,606,195.00	40,025,191.49	2,604,236,821.86
负债					
卖出回购金融资产款	560,070,634.89	-	-	-	560,070,634.89
应付赎回款	-	-	-	10.38	10.38
应付管理人报酬	-	-	-	519,145.53	519,145.53
应付托管费	-	-	-	173,048.51	173,048.51
应付销售服务费	-	-	-	104.97	104.97
应付交易费用	-	-	-	42,411.16	42,411.16
应交税费	-	-	-	837.82	837.82
其他负债	-	-	-	708,703.37	708,703.37
负债总计	560,070,634.89	-	-	1,444,261.74	561,514,896.63
利率敏感度缺口	360,365,800.48	1,583,169,000.00	60,606,195.00	38,580,929.75	2,042,721,925.23

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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	10,727,430.07	9,618,707.81
	2. 市场利率上升 25 个基点	-10,596,254.77	-9,529,872.71

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,121,423,755.3	2,542,038,591.20
第三层次	-	-
合计	2,121,423,755.3	2,542,038,591.20

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### 6.4.15 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,121,423,755 .30	99.87
	其中：债券	2,121,423,755 .30	99.87
	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	2,737,061.18	0.13
8	其他各项资产	39,638.97	0.00
9	合计	2,124,200,455 .45	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 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

本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	130,742,195.83	6.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,887,704,987.41	91.10
	其中：政策性金融债	688,556,643.83	33.23
4	企业债券	30,957,952.88	1.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	72,018,619.18	3.48
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,121,423,755.30	102.38

## 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	200305	20 进出 05	2,500,000	254,553,287.67	12.28
2	188962	21 海通 10	1,200,000	122,811,747.95	5.93
3	1828011	18 中国银行二级 02	1,000,000	106,359,961.64	5.13
4	200313	20 进出 13	1,000,000	104,145,205.48	5.03
5	1928037	19 交通银行 02	1,000,000	102,468,493.15	4.95

## 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 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 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 进出 05、20 进出 13 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 7 月 1 日-2022 年 6 月 30 日，中国进出口银行新疆维吾尔自治区分行、天津分行等 2 家分支机构由于未有效监督贷款资金用途，信贷资金未按约定用途使用，严重违反审慎经营规则；未严格落实“实贷实付”，被当地银保监局处以罚款合计 90 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日，根据银保监罚决字〔2021〕31 号，因违规投资企业股权；个别高管人员未经核准实际履职；监管数据漏报错报等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国进出口银行被银保监会处以罚款 7345.6 万元。

(3) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕9 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，中国进出口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，认为中国进出口银行资产规模大，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，上述事项对中国进出口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。

本基金投资于中国进出口银行的决策程序说明：基于中国进出口银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国进出口银行，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进出口银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

2.15 国开 18 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。

#### 3.21 海通 10 发债主体受监管处罚情况:

(1) 2021 年 9 月 7 日, 根据《中国证券监督管理委员会立案告知书》(证监立案字 0152021022 号) 及《中国证券监督管理委员会调查通知书》(证监调查字 0152021061 号), 因海通证券在开展西南药业股份有限公司 (现奥瑞德光电股份有限公司) 财务顾问业务的持续督导工作期间未勤勉尽责, 涉嫌违法违规, 根据《中华人民共和国证券法》等法律法规, 中国证监会决定对海通证券进行立案并调查。

(2) 2021 年 10 月 14 日, 根据重庆证监局《行政处罚决定书》((2021) 5 号), 由于上述 (1) 事项, 海通证券被重庆证监局责令改正, 没收财务顾问业务收入 100 万元, 并处以 300 万元罚款。

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。

#### 4.19 交通银行 02 发债主体受监管处罚情况:

(1) 2021 年 7 月 1 日-2022 年 6 月 30 日, 交通银行北京分行、新疆维吾尔自治区分行、河北省分行等 6 家分支机构由于理财业务投资运作管理不规范、个人消费贷款业务贷后风控措施严重不到位、个人消费贷款挪用于购房、投资等禁止性领域、向资本金不足且未取得施工许可证项目发放贷款、同业投资资金违规投向股权投资领域等违法违规行为, 被当地外汇管理局、银保监局等监管机构处以警告、罚款等行政处罚, 罚款合计 433 万元。

(2) 2021 年 7 月 13 日, 根据银保监罚决字〔2021〕28 号, 由于理财业务和同业业务制度不健

全；理财业务数据与事实不符等违法违规事由，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，交通银行被银保监会处以 4100 万元的罚款。

(3) 2021 年 8 月 13 日，根据银罚字〔2021〕23 号，由于违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等违法违规事由，交通银行被人民银行处以罚款 62 万元。

(4) 2021 年 10 月 20 日，根据上海汇管罚字〔2021〕3111210701 号，因未按规定办理内存外贷业务；未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务等违法违规事由，依据《外汇管理条例》第四十三条、《外汇管理条例》第四十七条第（一）项等规定，交通银行被国家外汇管理局上海市分局警告，并处以罚款 340 万元，没收违法所得 82.32 万元。

(5) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕15 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，交通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，认为交通银行净资产规模大，经营情况良好，实力很强，且交通银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，上述事项对交通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。

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

#### 5.18 建设银行二级 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 8 月 13 日，根据银罚字〔2021〕22 号，由于内占压财政存款或者资金；违反账户管理规定，建设银行被人民银行警告，并处以 388 万元的罚款。

(2) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕14 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，建设银行被银保监会处以 470 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为建设银行净资产规模大，经营情况良好，且建设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比例低，上述事项对建设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。

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

#### 6.20 农业银行小微债 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 12 月 8 日，根据银保监罚决字〔2021〕38 号，因制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重，根据《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；《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，农业银行被银保监会处以罚款 150 万元。

(2) 2022 年 3 月 21 日，根据银保监罚决字〔2022〕12 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，农业银行被银保监会处以 480 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为农业银行净资产规模很大，经营情况良好，上述罚款占其净资产及净利润比例低，且农业银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述事项对农业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。

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

#### 7.18 中国银行二级 02 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〕13 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，中国银行被银保监会处以 480 万元的罚款。

(2) 2022 年 5 月 26 日，根据银保监罚决字〔2022〕29 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，中国银行被银保监会处以 200 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为中国银行资产规模大，经营情况良好，且中国银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，上述事项对中国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。

本基金投资于中国银行的决策程序说明：基于中国银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国银行，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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

#### 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	39,638.97
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,638.97

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

#### 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
前海联合泰瑞纯债 A	178	11,022,529.02	1,962,008,912.71	100%	1,253.17	0%
前海联合泰瑞纯债 C	94	3,182.81	298,626.32	99.81%	557.66	0.19%
合计	223	8,799,593.50	1,962,307,539.03	100%	1,810.83	0%

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	前海联合泰瑞纯债 A	398.96	0%
	前海联合泰瑞纯债 C	148.49	0.0496%
	合计	547.45	0%

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	前海联合泰瑞纯债 A	0~10
	前海联合泰瑞纯债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合泰瑞纯债 A	0~10
	前海联合泰瑞纯债 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合泰瑞纯债 A	前海联合泰瑞纯债 C
基金合同生效日（2020年08月13日）基金份额总额	201,006,196.93	204,954.22
本报告期期初基金份额总额	1,962,010,187.80	299,205.05
本报告期基金总申购份额	97,567.97	23.96
减：本报告期基金总赎回份额	97,589.89	45.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,962,010,165.88	299,183.98

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、以下为基金管理人变动信息：

本报告期内，公司吴昱村先生因个人原因无法履行总经理职务，经公司第二届董事会 2022 年第 5 次临时会议审议通过，邹文庆先生自 2022 年 5 月 11 日起代为履行公司总经理、法定代表人职责，代为履职的时间将遵照法律法规和监管机构的有关要求执行。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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，深圳证监局对基金管理人采取责令改正的行政监管措施，并对相关高级管理人员采取出具警示函等行政监管措施。基金管理人高度重视，已按法律法规和监管要求及时进行了整改，并已提交整改报告。

本报告期内，基金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	
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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, 新租交易单元: 无, 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	20,421,194.52	5.79%	100,000.00	0.00%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	332,399,066.61	94.21%	2,586,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	前海联合基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-04
2	关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下公募基金产品开通转托管业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-10
3	前海联合泰瑞纯债债券型证券	证券时报、中国证监会基金电	2022-01-24

	投资基金 2021 年第四季度报告及提示性公告	子披露网站及基金管理人网站	
4	新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告及提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-03-30
5	新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金 2022 年第一季度报告及提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-22
6	新疆前海联合基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-13

## § 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	20220101-20220630	980,659,545.04	-	-	980,659,545.04	49.97%
	2	20220101-20220630	980,659,545.04	-	-	980,659,545.04	49.97%
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

无。

## § 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泰瑞纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合泰瑞纯债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。

## 12.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人住所外，其他备查文件等文本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

二〇二二年八月三十日