

# 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:浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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	6
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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<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	15
6.3 净资产(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	45
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	45
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	45

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	13,498,054.44 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

注：新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金于 2020 年 3 月 26 日转型为新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金。

### 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	<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，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
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。

## 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹文庆（代履职）	朱巍
	联系电话	0755-82780666	0571-87659806
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95527
传真		0755-82780000	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区延安路 368 号
邮政编码		518057	310006
法定代表人		邹文庆（代履职）	张荣森（代为履行法定代表人职责）

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于 2022 年 1 月 14 日以书面传签方式召开第六届董事会 2022 年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.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（2022 年 01 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
本期已实现收益	154,012.04	45,633.64
本期利润	-146,073.59	-59,826.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0147	-0.0166
本期加权平均净值利润率	-1.22%	-1.43%
本期基金份额净值增长率	-1.17%	-1.37%
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	2,218,533.14	633,479.08
期末可供分配基金份额利润	0.2242	0.1759
期末基金资产净值	12,114,420.68	4,235,645.98
期末基金份额净值	1.2242	1.1759
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	8.09%	7.11%

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

#### 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	2.22%	0.25%	-0.24%	0.03%	2.46%	0.22%
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	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	2.19%	0.25%	-0.24%	0.03%	2.43%	0.22%
过去三个月	2.88%	0.30%	0.29%	0.04%	2.59%	0.26%

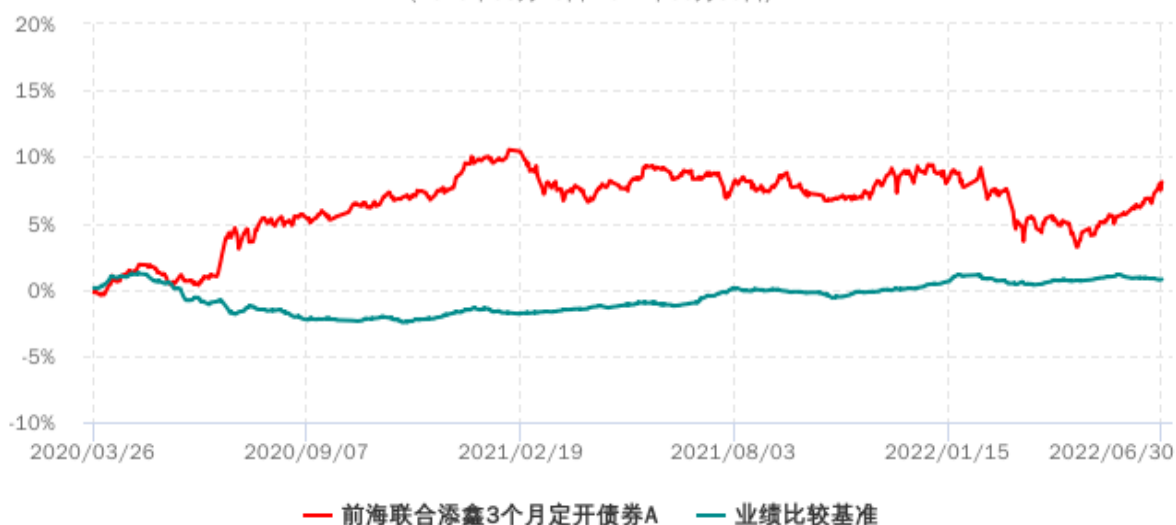
过去六个月	-1.37%	0.37%	0.38%	0.05%	-1.75%	0.32%
过去一年	-1.15%	0.33%	1.83%	0.05%	-2.98%	0.28%
自基金转型 日起至今	7.11%	0.29%	0.76%	0.06%	6.35%	0.23%

注：本基金的业绩表较基准为中债综合全价（总值）指数收益率。

### 3.2.2 自基金转型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

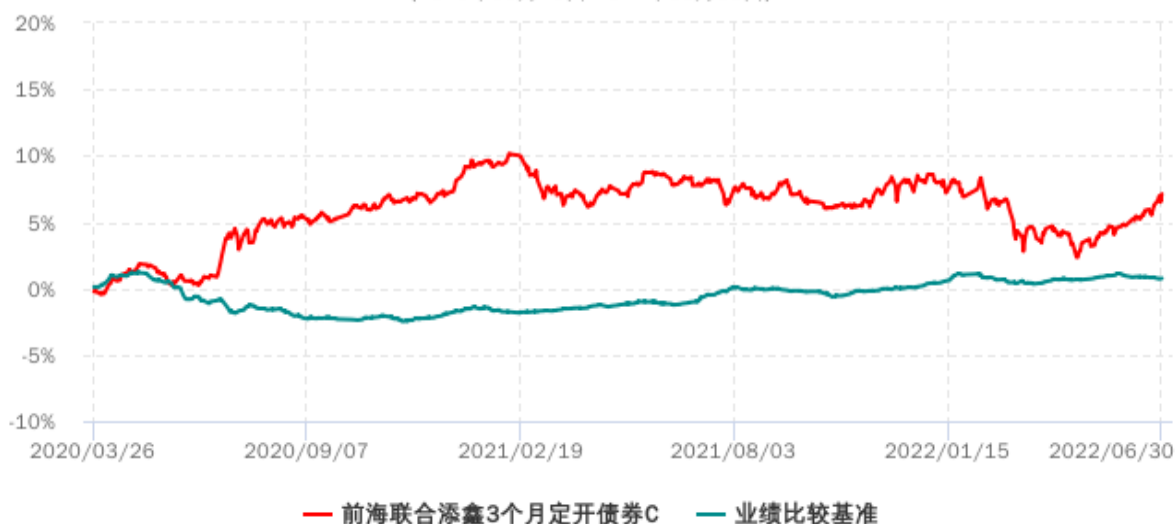
前海联合添鑫3个月定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(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		
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年9月14日）、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）和新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金

				<p>基金经理（自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 7 月 27 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。

#### 4.1.3 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

2022 年上半年，中国经济稳增长预期、海外货币政策转向、俄乌冲突、本土疫情等因素先后冲击了宏观基本面。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，二季度经济数据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。从近期数据来看，生产端需求端稳定修复，出口重回较快增长区间，基建投资和制造业投资仍有韧性，地产投资和消费低位徘徊，消费低位反弹，但仍低于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，2022 年 1 月降息，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，资金价格二季度下行明显。债市方面，利率债现券收益小幅震荡，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，各等级信用债和同业存单收益率下行较多，信用利差明显收窄，中证转债指数跌 4.07% 收于 418.62 点，可转债整体估值处于历史偏高位置。股市方面，一季度市场大跌，4 月底以后呈 V 型反弹，电新、汽车等板块反弹显著，上证 50、中证 500、创业板上半年收益分别为 -6.6%、-12.3%、-15.4%。

报告期内，本基金股票仓位在基金合同约定的比例范围内动态调整，一季度整体减仓，二季度增加了成长股仓位，可转债方面，增加了低价可转债的仓位，纯债仓位略有降低。

#### 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 -1.17%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%；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 -1.37%，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

展望 2022 年下半年，疫情发展是基本面的主线。预计经济渐进修复，但斜率有所降低，基建投资和制造业投资有所发力，地产投资和消费缓慢修复，净出口的韧性有一定变数，通胀温和上涨。美联储加息节奏渐趋平稳，中国央行仍以稳为主，货币政策整体稳健，流动性保持合理充裕，节奏上跟随基本面变化。利率债投资价值有所提高，信用债品种的信用风险不大，转债资产的回报有所分化，权益市场方面以结构行情为主，流动性压力不大，板块轮动加快，需要精选个股并做好仓位管理。

2022 年下半年，本基金将根据基本面、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和可转债资产，合理配置纯债资产，通过均衡配置的思路实现净值增长，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。

#### 4.6 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

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 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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。

#### 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

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鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 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复核，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：新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放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	18,832.18	602,145.65
结算备付金		24,927.91	56,063.79
存出保证金		4,111.72	8,144.87
交易性金融资产	6.4.7.2	15,973,328.20	15,059,147.15
其中：股票投资		2,733,000.20	1,558,334.40
基金投资		-	-
债券投资		13,240,328.00	13,500,812.75
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	360,000.00	1,400,000.00
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		47,589.71	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	6.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	158,525.63
资产总计		16,428,789.72	17,284,033.09
<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		-	-
应付清算款		32,604.75	496,008.67
应付赎回款		-	25,330.11
应付管理人报酬		9,269.66	10,425.75
应付托管费		1,324.23	1,489.37
应付销售服务费		1,372.43	1,627.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		201.17	315.07
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	33,950.82	71,563.68
负债合计		78,723.06	606,760.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	13,498,054.44	13,600,132.34
其他综合收益（若有）		-	-
未分配利润	6.4.7.7	2,852,012.22	3,077,140.71
净资产合计		16,350,066.66	16,677,273.05
负债和净资产总计		16,428,789.72	17,284,033.09

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 13,498,054.44 份。其中前海联合添鑫 3 个月定期开债券 A 基金份额净值 1.2242 元，基金份额总额 9,895,887.54 份；前海联合添鑫 3 个月定期开债券 C 基金份额净值 1.1759 元，基金份额总额 3,602,166.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放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>		-112,486.12	930,884.67
1. 利息收入		4,257.72	233,282.31
其中：存款利息收入	6.4.7.8	839.60	15,028.77
债券利息收入		-	195,526.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,418.12	22,726.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		288,796.31	1,953,766.03
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-53,742.00	1,831,109.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	322,094.87	93,276.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	20,443.44	29,379.72
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）	6.4.7.15	-405,545.64	-1,257,131.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5.49	967.71
<b>减：二、营业总支出</b>		93,413.84	183,963.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	55,996.55	72,125.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,999.51	10,303.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,299.76	24,133.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-173.55	3,231.32
其中：卖出回购金融资产支出		-173.55	3,231.32
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		211.87	74.04
8. 其他费用	6.4.7.18	21,079.70	74,095.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-205,899.96	746,921.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-205,899.96	746,921.18
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-205,899.96	746,921.18

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。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放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）	13,600,132.34	-	3,077,140.71	16,677,273.05
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）	13,600,132.34	-	3,077,140.71	16,677,273.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,077.90	-	-225,128.49	-327,206.39



(一)、综合收益总额	-	-	-205,899.96	-205,899.96
(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)	-102,077.90	-	-19,228.53	-121,306.43
其中: 1. 基金申购款	1,824.47	-	271.49	2,095.96
2. 基金赎回款	-103,902.37	-	-19,500.02	-123,402.39
(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)	13,498,054.44	-	2,852,012.22	16,350,066.66
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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)	48,714,031.58	-	9,171,944.80	57,885,976.38
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)	48,714,031.58	-	9,171,944.80	57,885,976.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-31,755,783.32	-	-5,411,238.36	-37,167,021.68
(一)、综合收益总额	-	-	746,921.18	746,921.18
(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)	-31,755,783.32	-	-6,158,159.54	-37,913,942.86
其中: 1. 基金申购款	16,240,164.12	-	3,623,217.18	19,863,381.30
2. 基金赎回款	-47,995,947.44	-	-9,781,376.72	-57,777,324.16
(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)	16,958,248.26	-	3,760,706.44	20,718,954.70

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。

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

新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“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(以下简称“前海联合添鑫一年定开债券基金”)转型而来,前海联合添鑫一年定开债券基金由新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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]1821号《关于准予新前海联合添鑫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《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金为契约型开放式基金,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 200,030,086.76 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 1305 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,030,093.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 6.59 份基金份额。原基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

原基金基金份额持有人大会自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 4 月 27 日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,并报中国证监会备案。根据原基金基金份额持有人大会决议,《新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自 2018 年 5 月 31 日生效,同时《新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金基金合同》失效,新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金正式变更为新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金。

前海联合添鑫一年定开债券基金为契约型定期开放式,存续期限不定,原基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值 490,739,464.87 元,已于前海联合添鑫一年定开债券基金的基金合同生效日全部转为前海联合添鑫一年定开债券基金的基金资产净值。前海联合添鑫一年定开债券基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

前海联合添鑫一年定开债券基金基金份额持有人大会自 2020 年 1 月 23 日至 2020 年 2 月 25 日以通讯方式召开,会议审议通过《关于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有关事项的议案》,并报中国证监会备案。根据前海联合添鑫一年定开债券基金基金份额持有人大会决议,《新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金合同》自 2020 年 3 月 26 日起生效,同

时《新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金合同》失效，新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金正式变更为新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，前海联合添鑫一年定开债券基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为 109,033,647.33 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《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》，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。本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置对应的基金代码。由于基金费用的不同，本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《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》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即以封闭期内封闭运作和封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。本基金的封闭期为自本基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）至 3 个月对应日的前一日止。本基金的首个封闭期为自本基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）至 3 个月对应日的前一日止。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至 3 个月对应日的前一日止，以此类推。该对应日不存在的，则该对应日为该对应日对应月度的最后一个工作日。该对应日为非工作日的，则顺延至下一个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 1 个工作日，基金管理人应在每个封闭期结束前公布开放期和下一封闭期的具体时间安排。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，为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）、可交换债券等）、债券回购、银行存款（包含协议存款、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、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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等资产比例不超过基金资产的 20%。但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，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的投资比例不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但在每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金

一倍的现金。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[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 2022 年 06 月 30 日
活期存款	18,832.18
等于：本金	18,818.58
加：应计利息	13.60
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	18,832.18

##### 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	2,721,925.05	-	2,733,000.20	11,075.15	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,154,385.00	151,150.53	13,240,328.00	-65,207.53
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,154,385.00	151,150.53	13,240,328.00	-65,207.53
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	15,876,310.05	151,150.53	15,973,328.20	-54,132.38
----	---------------	------------	---------------	------------

#### 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 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	360,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	360,000.00	-

##### 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 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	1,719.00
其中：交易所市场	1,719.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	32,231.82
合计	33,950.82

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	9,956,660.65	9,956,660.65
本期申购	63.50	63.50
本期赎回（以“-”号填列）	-60,836.61	-60,836.61
本期末	9,895,887.54	9,895,887.54

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	3,643,471.69	3,643,471.69
本期申购	1,760.97	1,760.97
本期赎回（以“-”号填列）	-43,065.76	-43,065.76
本期末	3,602,166.90	3,602,166.90

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

## 6.4.7.7 未分配利润

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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
本期期初	2,579,588.76	-202,678.33	2,376,910.43
本期利润	154,012.04	-300,085.63	-146,073.59
本期基金份额交易产生的变动数	-16,127.44	3,823.74	-12,303.70
其中：基金申购款	16.94	-4.48	12.46
基金赎回款	-16,144.38	3,828.22	-12,316.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,717,473.36	-498,940.22	2,218,533.14

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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
本期期初	774,206.28	-73,976.00	700,230.28
本期利润	45,633.64	-105,460.01	-59,826.37
本期基金份额交易产生的变动数	-8,912.46	1,987.63	-6,924.83
其中：基金申购款	385.46	-126.43	259.03
基金赎回款	-9,297.92	2,114.06	-7,183.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	810,927.46	-177,448.38	633,479.08

## 6.4.7.8 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	488.74
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	290.11
其他	60.75



合计	839.60
----	--------

#### 6.4.7.9 股票投资收益

##### 6.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,308,327.99
减：卖出股票成本总额	1,358,133.60
减：交易费用	3,936.39
买卖股票差价收入	-53,742.00

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 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	180,461.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	141,633.81
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	322,094.87

##### 6.4.7.10.2 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	10,846,120.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,560,398.72
减：应计利息总额	143,947.77
减：交易费用	139.83
买卖债券差价收入	141,633.81

##### 6.4.7.10.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.10.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.11 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 6.4.7.11.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.11.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,443.44
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	20,443.44
----	-----------

## 6.4.7.15 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	-405,545.64
——股票投资	-12,136.95
——债券投资	-393,408.69
——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	-405,545.64

## 6.4.7.16 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	5.49
合计	5.49

## 6.4.7.17 信用减值损失

无。

## 6.4.7.18 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	2,479.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他费用	18,600.00
合计	21,079.70

## 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
浙商银行股份有限公司	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	55,996.55	72,125.29

其中：支付销售机构的客户维护费	3,279.93	11,652.85
-----------------	----------	-----------

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 X 管理费费率计提，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 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费	7,999.51	10,303.62

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 X 托管费率计提，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		
	前海联合添鑫 3 个月定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定开债券 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	7,529.07	7,529.07
合计	-	7,529.07	7,529.07
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		
	前海联合添鑫 3 个月定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定开债券 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	20,836.23	20,836.23
合计	-	20,836.23	20,836.23

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自有资金投资本基金的情况

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 A

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（2016 年 10 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	398,899.68	-
报告期间申购/买入总份额	-	398,899.68
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	398,899.68	398,899.68
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.96%	2.35%

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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（2016 年 10 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,248,855.22	-
报告期间申购/买入总份额	-	1,248,855.22
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	1,248,855.22	1,248,855.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.25%	7.36%

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
浙商银行股份有限公司	18,832.18	488.74	41,705.02	3,308.57

注：本基金的银行存款由基金托管人浙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——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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688400	凌云光	2022 年 06 月 28 日	-	新股流通受限	21.93	21.93	500	10,965.00	10,965.00	-

##### 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

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、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。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浙商银行。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 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	2,908,747.22	850,800.00
合计	2,908,747.22	850,800.00

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

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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	6,092,131.31	7,661,679.00
AAA 以下	2,855,870.17	3,354,271.25
未评级	1,383,579.30	1,634,062.50
合计	10,331,580.78	12,650,012.75

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于约定开放日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于开放期内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 06 月 30 日，本基金所承担的全部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》且于基金开放期内按照《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%，于开放期内，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 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%。

于开放期内，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，本基金处于封闭期。

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	18,832.18	-	-	-	18,832.18
结算备付金	24,927.91	-	-	-	24,927.91
存出保证金	4,111.72	-	-	-	4,111.72
交易性金融资产	10,599,746.92	1,573,038.78	1,067,542.30	2,733,000.20	15,973,328.20
买入返售金融资产	360,000.00	-	-	-	360,000.00
应收清算款	-	-	-	47,589.71	47,589.71
资产总计	11,007,618.73	1,573,038.78	1,067,542.30	2,780,589.91	16,428,789.72
负债					
应付清算款	-	-	-	32,604.75	32,604.75
应付管理人报酬	-	-	-	9,269.66	9,269.66
应付托管费	-	-	-	1,324.23	1,324.23
应付销售服务费	-	-	-	1,372.43	1,372.43
应付交易费用	-	-	-	1,719.00	1,719.00
应交税费	-	-	-	201.17	201.17
其他负债	-	-	-	32,231.82	32,231.82

负债总计	-	-	-	78,723.06	78,723.06
利率敏感度缺口	11,007,618.73	1,573,038.78	1,067,542.30	2,701,866.85	16,350,066.66
上年度末 2021 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	602,145.65	-	-	-	602,145.65
结算备付金	56,063.79	-	-	-	56,063.79
存出保证金	8,144.87	-	-	-	8,144.87
交易性金融资产	7,715,910.76	3,940,582.49	1,844,319.50	1,558,334.40	15,059,147.15
买入返售金融资产	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应收申购款	-	-	-	6.00	6.00
其他资产	-	-	-	158,525.63	158,525.63
资产总计	9,782,265.07	3,940,582.49	1,844,319.50	1,716,866.03	17,284,033.09
负债					
应付清算款	-	-	-	496,008.67	496,008.67
应付赎回款	-	-	-	25,330.11	25,330.11
应付管理人报酬	-	-	-	10,425.75	10,425.75
应付托管费	-	-	-	1,489.37	1,489.37
应付销售服务费	-	-	-	1,627.39	1,627.39
应付交易费用	-	-	-	1,596.98	1,596.98
应交税费	-	-	-	315.07	315.07
其他负债	-	-	-	69,966.70	69,966.70
负债总计	-	-	-	606,760.04	606,760.04
利率敏感度缺口	9,782,265.07	3,940,582.49	1,844,319.50	1,110,105.99	16,677,273.05

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
	市场利率下降 25 个基点	87,705.47	123,577.59

	市场利率上升 25 个基点	-86,654.77	-121,722.64
--	---------------	------------	-------------

#### 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%，股票等资产比例不超过基金资产的 20%。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。

#### 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 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	2,733,000.20	16.72	1,558,334.40	9.34
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	2,733,000.20	16.72	1,558,334.40	9.34

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 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 16.72%（2021 年 12 月 31 日：9.34%），因此除市场利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(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	8,724,234.94	6,760,312.15
第二层次	7,249,093.26	8,298,835.00
第三层次	-	-
合计	15,973,328.20	15,059,147.15

###### 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	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	其他各项资产	51,701.43	0.31
9	合计	16,428,789.72	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	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

### 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	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
11	601669	中国电建	5,500	43,285.00	0.26
12	002508	老板电器	1,200	43,236.00	0.26
13	601166	兴业银行	2,100	41,790.00	0.26
14	600900	长江电力	1,800	41,616.00	0.25
15	603259	药明康德	400	41,596.00	0.25
16	600600	青岛啤酒	400	41,568.00	0.25
17	601633	长城汽车	1,100	40,744.00	0.25
18	000858	五粮液	200	40,386.00	0.25
19	688111	金山办公	200	39,424.00	0.24
20	603444	吉比特	100	38,800.00	0.24
21	600309	万华化学	400	38,796.00	0.24
22	603799	华友钴业	390	37,291.80	0.23
23	600048	保利发展	2,000	34,920.00	0.21
24	002061	浙江交科	5,000	34,800.00	0.21
25	603345	安井食品	200	33,574.00	0.21
26	601318	中国平安	700	32,683.00	0.20
27	601012	隆基股份	480	31,982.40	0.20
28	300760	迈瑞医疗	100	31,320.00	0.19
29	600887	伊利股份	800	31,160.00	0.19
30	002709	天赐材料	500	31,030.00	0.19
31	603833	欧派家居	200	30,136.00	0.18
32	603035	常熟汽饰	1,800	29,736.00	0.18



33	600779	水井坊	300	27,762.00	0.17
34	000983	山西焦煤	2,000	26,780.00	0.16
35	600348	华阳股份	1,700	26,282.00	0.16
36	300496	中科创达	200	26,096.00	0.16
37	603816	顾家家居	460	26,049.80	0.16
38	603885	吉祥航空	1,400	25,186.00	0.15
39	002812	恩捷股份	100	25,045.00	0.15
40	000596	古井贡酒	100	24,966.00	0.15
41	600585	海螺水泥	700	24,696.00	0.15
42	000002	万科A	1,200	24,600.00	0.15
43	603589	口子窖	400	23,444.00	0.14
44	600426	华鲁恒升	800	23,360.00	0.14
45	601888	中国中免	100	23,293.00	0.14
46	603606	东方电缆	300	22,980.00	0.14
47	300122	智飞生物	200	22,202.00	0.14
48	601555	东吴证券	3,100	21,483.00	0.13
49	601677	明泰铝业	900	21,420.00	0.13
50	300763	锦浪科技	100	21,300.00	0.13
51	002258	利尔化学	900	21,258.00	0.13
52	600483	福能股份	1,500	21,105.00	0.13
53	600036	招商银行	500	21,100.00	0.13
54	601636	旗滨集团	1,600	20,400.00	0.12
55	601696	中银证券	1,500	19,950.00	0.12
56	600406	国电南瑞	720	19,440.00	0.12
57	001979	招商蛇口	1,400	18,802.00	0.11
58	002304	洋河股份	100	18,315.00	0.11
59	000333	美的集团	300	18,117.00	0.11
60	000930	中粮科技	2,000	18,080.00	0.11
61	600438	通威股份	300	17,958.00	0.11
62	600570	恒生电子	400	17,416.00	0.11
63	002597	金禾实业	400	17,332.00	0.11
64	002126	银轮股份	1,500	17,175.00	0.11
65	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.10
66	603982	泉峰汽车	700	17,073.00	0.10
67	600009	上海机场	300	17,010.00	0.10
68	002555	三七互娱	800	16,984.00	0.10
69	002895	川恒股份	500	16,905.00	0.10
70	000651	格力电器	500	16,860.00	0.10
71	002352	顺丰控股	300	16,743.00	0.10
72	600845	宝信软件	300	16,380.00	0.10
73	601186	中国铁建	2,000	15,800.00	0.10
74	300144	宋城演艺	1,000	15,350.00	0.09
75	601155	新城控股	600	15,258.00	0.09

76	600031	三一重工	800	15,248.00	0.09
77	600258	首旅酒店	600	14,880.00	0.09
78	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.09
79	600985	淮北矿业	1,000	14,560.00	0.09
80	600104	上汽集团	800	14,248.00	0.09
81	600023	浙能电力	4,000	13,880.00	0.08
82	300083	创世纪	1,200	13,800.00	0.08
83	300569	天能重工	1,200	13,800.00	0.08
84	002080	中材科技	500	13,750.00	0.08
85	300124	汇川技术	200	13,174.00	0.08
86	603997	继峰股份	1,200	13,056.00	0.08
87	600435	北方导航	1,500	12,930.00	0.08
88	601117	中国化学	1,300	12,233.00	0.07
89	601222	林洋能源	1,400	11,690.00	0.07
90	601021	春秋航空	200	11,670.00	0.07
91	600741	华域汽车	500	11,500.00	0.07
92	601058	赛轮轮胎	1,000	11,270.00	0.07
93	000625	长安汽车	650	11,258.00	0.07
94	002714	牧原股份	200	11,054.00	0.07
95	002459	晶澳科技	140	11,046.00	0.07
96	688400	凌云光	500	10,965.00	0.07
97	002415	海康威视	300	10,860.00	0.07
98	300580	贝斯特	500	10,410.00	0.06
99	002624	完美世界	700	10,059.00	0.06
100	002497	雅化集团	300	9,795.00	0.06
101	300014	亿纬锂能	100	9,750.00	0.06
102	601658	邮储银行	1,800	9,702.00	0.06
103	300142	沃森生物	200	9,678.00	0.06
104	002372	伟星新材	400	9,616.00	0.06
105	000400	许继电气	500	9,600.00	0.06
106	002798	帝欧家居	1,000	9,500.00	0.06
107	600926	杭州银行	600	8,988.00	0.05
108	300850	新强联	100	8,903.00	0.05
109	002179	中航光电	140	8,864.80	0.05
110	600199	金种子酒	300	8,505.00	0.05
111	600027	华电国际	2,000	7,860.00	0.05
112	002648	卫星化学	300	7,755.00	0.05
113	300911	亿田智能	100	7,685.00	0.05
114	600547	山东黄金	400	7,424.00	0.05
115	600489	中金黄金	1,000	7,390.00	0.05
116	000778	新兴铸管	1,500	7,230.00	0.04
117	002142	宁波银行	200	7,162.00	0.04
118	600938	中国海油	400	6,980.00	0.04

119	601390	中国中铁	1,100	6,754.00	0.04
120	300498	温氏股份	300	6,387.00	0.04
121	000876	新希望	400	6,120.00	0.04
122	002832	比音勒芬	142	3,578.40	0.02
123	603306	华懋科技	100	3,390.00	0.02

## 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	600900	长江电力	540,257.43	3.24
2	002061	浙江交科	79,119.50	0.47
3	600754	锦江酒店	47,947.00	0.29
4	601633	长城汽车	44,803.00	0.27
5	300274	阳光电源	42,805.00	0.26
6	603198	迎驾贡酒	42,630.00	0.26
7	688111	金山办公	39,260.00	0.24
8	300750	宁德时代	38,050.00	0.23
9	600600	青岛啤酒	37,466.00	0.22
10	002508	老板电器	37,270.00	0.22
11	601318	中国平安	36,920.00	0.22
12	601696	中银证券	34,935.00	0.21
13	600745	闻泰科技	34,430.00	0.21
14	002271	东方雨虹	33,159.00	0.20
15	601677	明泰铝业	32,997.00	0.20
16	001979	招商蛇口	32,634.00	0.20
17	603035	常熟汽饰	31,045.00	0.19
18	600887	伊利股份	30,217.00	0.18
19	603799	华友钴业	28,650.00	0.17
20	300059	东方财富	28,298.16	0.17

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	600900	长江电力	506,499.67	3.04
2	300059	东方财富	148,918.92	0.89
3	600660	福耀玻璃	42,595.00	0.26
4	002061	浙江交科	41,822.00	0.25

5	603606	东方电缆	28,908.00	0.17
6	002812	恩捷股份	27,750.00	0.17
7	000519	中兵红箭	26,520.00	0.16
8	601677	明泰铝业	25,060.00	0.15
9	002594	比亚迪	24,630.00	0.15
10	600036	招商银行	24,290.00	0.15
11	002049	紫光国微	21,850.00	0.13
12	600745	闻泰科技	21,020.00	0.13
13	000568	泸州老窖	21,008.00	0.13
14	600483	福能股份	20,100.00	0.12
15	000002	万科A	19,479.00	0.12
16	300014	亿纬锂能	18,001.00	0.11
17	600763	通策医疗	17,000.00	0.10
18	601615	明阳智能	16,170.00	0.10
19	601696	中银证券	14,765.00	0.09
20	002271	东方雨虹	14,475.00	0.09

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	2,544,936.35
卖出股票收入（成交）总额	1,308,327.99

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	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

#### 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	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

### 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. 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，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。

### 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	4,111.72
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,701.43

### 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	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

#### 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
前海联合添鑫 3 个月定开债券 A	374	26,459.59	8,602,197.74	86.93%	1,293,689.80	13.07%
前海联合添鑫 3 个月定开债券 C	260	13,854.49	3,277,827.18	91.00%	324,339.72	9.00%
合计	605	22,310.83	11,880,024.92	88.01%	1,618,029.52	11.99%

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	占基金总份额比例
----	------	--------	----------

		(份)	
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 A	39.38	0.0004%
	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 C	137.73	0.0038%
	合计	177.11	0.0013%

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

不存在本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理持有本开放式基金的情况。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 A	前海联合添鑫 3 个月定期开债券 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 18 日）基金份额总额	4,887,551.24	94,168,142.51
本报告期期初基金份额总额	9,956,660.65	3,643,471.69
本报告期基金总申购份额	63.50	1,760.97
减：本报告期基金总赎回份额	60,836.61	43,065.76
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	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。

## § 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，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

金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## 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	
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	252,73 3.00	7.92%	184.81	7.92%	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	1,192, 888.32	37.39%	872.33	37.39%	-
西南证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	1	1,744, 877.67	54.69%	1,275. 98	54.69%	-

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、本报告期内新增交易单元：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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
----	------	--------	------	------

名称	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
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	4,855,810.98	26.26%	5,700,000.00	34.23%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3,962,095.20	21.43%	3,230,000.00	19.40%	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

长江 证券 股份 有限 公司	9,670 ,024. 53	52.30%	7,720 ,000. 00	46.37%	-	-	-	-
----------------------------	----------------------	--------	----------------------	--------	---	---	---	---

## 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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-04
3	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-10
4	前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第四季度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-24
5	新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-03-30
6	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开放申购、赎回及转换业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-03-31
7	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 1 季度报告及提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-22
8	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-23
9	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第一次提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-25
10	前海联合基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-25



	关销售业务的公告		
11	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第二次提示性公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-26
12	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-09
13	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-09
14	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-13
15	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	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-25

## § 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	8,203,298.06	-	-	8,203,298.06	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。

### 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