

新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 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:2023 年 07 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添瑞一年持有混合
基金主代码	011290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 04 月 20 日
报告期末基金份额总额	49,300,767.97 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场走势等方面，对各类市场的投资机会和风险特征等因素进行综合研判，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行比例配置并对配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合添瑞一 年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011290	011291
报告期末下属分级基金的份额总额	45,268,112.75 份	4,032,655.22 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年04月01日-2023年06月30日)	
	前海联合添瑞一年 持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混 合 C
1. 本期已实现收益	-1,456,860.02	-149,399.56
2. 本期利润	-1,072,879.95	-109,541.94
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0242	-0.0256
4. 期末基金资产净值	44,912,488.19	3,961,583.80
5. 期末基金份额净值	0.9921	0.9824

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。

3.2 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

前海联合添瑞一年持有混合 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-2.42%	0.24%	-0.28%	0.16%	-2.14%	0.08%
过去六个月	-1.61%	0.26%	0.89%	0.16%	-2.50%	0.10%
过去一年	-7.06%	0.32%	-1.81%	0.19%	-5.25%	0.13%
自基金合同 生效起至今	-0.79%	0.27%	-2.34%	0.22%	1.55%	0.05%

前海联合添瑞一年持有混合 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	-2.52%	0.25%	-0.28%	0.16%	-2.24%	0.09%
过去六个月	-1.81%	0.26%	0.89%	0.16%	-2.70%	0.10%
过去一年	-7.48%	0.32%	-1.81%	0.19%	-5.67%	0.13%
自基金合同生效起至今	-1.76%	0.27%	-2.34%	0.22%	0.58%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

前海联合添瑞一年持有混合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

(2021年04月20日-2023年06月30日)



前海联合添瑞一年持有混合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

(2021年04月20日-2023年06月30日)



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日期	离任日期		
孟晓婧	本基金的基金经理	2022-08-05	-	12 年	孟晓婧女士，中国人民银行金融研究所硕士，12 年证券投资基金投资研究经验。曾任安邦保险资产管理有限公司投资部行业研究员、世纪证券有限责任公司研究所行业分析师、前海人寿保险股份有限公司资产管理中心行业研究员和新疆前海联合基金管理有限公司专户投资部投资经理。现任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 2022 年 7 月 29 日起任职）和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 2022 年 8 月 5 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相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合

有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

本报告期内，两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2023 年二季度，经济弱复苏逐渐兑现，但整体表现低于市场此前的预期。今年 4 月以来，随着信贷、地产、消费等多项经济数据开始走弱，市场对于全年经济增长预期开始下修。但从当下时点来看，债券、商品、汇率等多项金融资产价格已逼近 2022 年 10 月低点。经过 2023 上半年的调整，总量经济相关资产的风险溢价处于历史极值水平，一致悲观的预期隐含了指数进一步深度调整的空间并不大。

在此背景下，股票市场主要指数在今年二季度表现普遍差强人意。本产品在今年 5 月降低权益仓位，等待宏观和产业趋势明朗化后的投资机会，此外加强个股研究；债券收益率震荡，可转债市场表现一般，因此固收仓位多以流动性较好的国债，以及有估值保护的偏债转债为主，附以一定弹性标的增加组合收益，以上操作均在基金合同约定范围内完成。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添瑞一年持有混合 A 基金份额净值为 0.9921 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.42%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%；截至报告期末前海联合添瑞一年持有混合 C 基金份额净值为 0.9824 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.52%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内出现连续二十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,967,190.00	8.09
	其中：股票	3,967,190.00	8.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,582,000.45	86.84
	其中：债券	42,582,000.45	86.84
	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	1,599,399.89	3.26
	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	873,089.57	1.78
8	其他资产	14,334.34	0.03
9	合计	49,036,014.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	126,990.00	0.26
C	制造业	2,851,650.00	5.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	181,300.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	474,200.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	264,950.00	0.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	68,100.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,967,190.00	8.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	700	1,183,700.00	2.42
2	000858	五粮液	2,500	408,925.00	0.84
3	601006	大秦铁路	44,000	326,920.00	0.67
4	002371	北方华创	900	285,885.00	0.58
5	603816	顾家家居	7,000	267,050.00	0.55
6	603345	安井食品	1,500	220,200.00	0.45
7	000568	泸州老窖	1,000	209,570.00	0.43
8	601318	中国平安	4,500	208,800.00	0.43
9	601816	京沪高铁	28,000	147,280.00	0.30
10	601857	中国石油	17,000	126,990.00	0.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,876,715.40	7.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,024,160.56	63.48
	其中：政策性金融债	31,024,160.56	63.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,681,124.49	15.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,582,000.45	87.13

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	210203	21 国开 03	200,000	20,698,393.44	42.35
2	210406	21 农发 06	100,000	10,325,767.12	21.13

3	019638	20 国债 09	28,000	2,865,618.96	5.86
4	019694	23 国债 01	10,000	1,011,096.44	2.07
5	127041	弘亚转债	3,000	352,505.75	0.72

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

21 农发 06 发债主体受监管处罚情况：

2022 年 8 月 30 日，根据迪银保监罚决字（2022）1 号，由于未依法履行职责，依据《中华人民

《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，中国农业发展银行迪庆藏族自治州分行被迪庆银保监局处以 39 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为中国农业发展银行资产规模大，经营情况良好，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，上述事项对中国农业发展银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于中国农业发展银行的决策程序说明：基于中国农业发展银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国农业发展银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对中国农业发展银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,394.18
2	应收证券清算款	900.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,334.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127041	弘亚转债	352,505.75	0.72
2	113569	科达转债	333,434.38	0.68
3	127024	盈峰转债	320,343.76	0.66
4	113584	家悦转债	318,856.44	0.65
5	123101	拓斯转债	278,679.36	0.57
6	110076	华海转债	275,545.55	0.56
7	123117	健帆转债	268,543.84	0.55
8	113563	柳药转债	260,411.51	0.53
9	128105	长集转债	260,107.19	0.53
10	123099	普利转债	247,582.47	0.51
11	123104	卫宁转债	240,229.03	0.49
12	128071	合兴转债	239,040.86	0.49
13	123124	晶瑞转 2	238,239.51	0.49

14	113627	太平转债	229,989.32	0.47
15	113605	大参转债	226,204.66	0.46
16	113606	荣泰转债	223,209.59	0.46
17	113048	晶科转债	218,342.22	0.45
18	110073	国投转债	216,359.51	0.44
19	123113	仙乐转债	213,900.00	0.44
20	128108	蓝帆转债	200,503.56	0.41
21	113043	财通转债	186,964.68	0.38
22	113044	大秦转债	173,274.25	0.35
23	128037	岩土转债	168,080.14	0.34
24	123010	博世转债	166,791.33	0.34
25	113033	利群转债	156,823.77	0.32
26	110062	烽火转债	149,716.44	0.31
27	113057	中银转债	130,306.79	0.27
28	127020	中金转债	126,725.01	0.26
29	113549	白电转债	124,669.59	0.26
30	113045	环旭转债	116,996.49	0.24
31	128131	崇达转 2	115,990.96	0.24
32	113542	好客转债	113,798.08	0.23
33	110082	宏发转债	113,499.59	0.23
34	113623	凤 21 转债	113,154.11	0.23
35	113532	海环转债	112,235.07	0.23
36	110081	闻泰转债	111,728.16	0.23
37	128125	华阳转债	111,026.44	0.23
38	113519	长久转债	62,270.53	0.13
39	127066	科利转债	60,797.70	0.12
40	127050	麒麟转债	52,121.70	0.11
41	113052	兴业转债	50,856.53	0.10

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合添瑞一年持	前海联合添瑞一年持
--	-----------	-----------

	有混合 A	有混合 C
报告期期初基金份额总额	40,866,533.40	4,728,007.73
报告期期间基金总申购份额	5,954,944.34	5,262.73
减：报告期期间基金总赎回份额	1,553,364.99	700,615.24
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	45,268,112.75	4,032,655.22

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	前海联合添瑞一年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	5,954,933.49	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,954,933.49	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	12.0788	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2023-04-24	5,954,933.49	6,000,000	-
合计			5,954,933.49	6,000,000	

注：1、本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率与本基金法律文件的规定一致。

2、本基金招募说明书约定，本基金 A 类基金份额单笔申购金额大于等于 500 万时，申购费按笔收取，每笔 1000 元。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 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	1	20230401-20230630	30,000,000	-	-	30,000,000	60.85%

构							
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司
二〇二三年七月二十一日