

# 新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月27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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.12 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</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 .....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	45
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	前海联合添利债券	
基金主代码	003180	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,387,574.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
下属分级基金的交易代码	003180	003181
报告期末下属分级基金的份 额总额	2,396,661.59 份	990,912.91 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，通过采取利率预期策略、收益率曲线配置策略、可转债投资策略等积极投资策略，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，发掘和利用潜在投资机会，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	新疆前海联合基金管理有限公	中国工商银行股份有限公司

	司		
信息披露负责人	姓名	邹文庆（代履职）	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-640-0099	95588	
传真	0755-82780000	010-66105798	
注册地址	新疆乌鲁木齐经济技术开发区 维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海 华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	518057	100140	
法定代表人	邹文庆（代履职）	廖林	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
本期已实现收益	-114,761.45	105,122.01
本期利润	-350,944.32	14,716.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0201	0.0139
本期加权平均净值利润率	-1.78%	1.20%
本期基金份额净值增长率	1.28%	1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	343,046.17	166,038.35
期末可供分配基金份额利润	0.1431	0.1676

期末基金资产净值	2,739,707.76	1,156,951.26
期末基金份额净值	1.1431	1.1676
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2024年06月30日）	
基金份额累计净值增长率	20.13%	22.58%

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

##### 前海联合添利债券 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.17%	0.15%	0.25%	0.05%	-0.42%	0.10%
过去三个月	1.21%	0.21%	0.75%	0.07%	0.46%	0.14%
过去六个月	1.28%	0.20%	2.31%	0.09%	-1.03%	0.11%
过去一年	0.91%	0.16%	1.96%	0.09%	-1.05%	0.07%
过去三年	3.15%	0.28%	2.00%	0.11%	1.15%	0.17%
自基金合同生效起至今	20.13%	0.29%	8.13%	0.12%	12.00%	0.17%

##### 前海联合添利债券 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.16%	0.15%	0.25%	0.05%	-0.41%	0.10%
过去三个月	1.22%	0.21%	0.75%	0.07%	0.47%	0.14%
过去六个月	1.28%	0.20%	2.31%	0.09%	-1.03%	0.11%
过去一年	0.90%	0.16%	1.96%	0.09%	-1.06%	0.07%
过去三年	2.64%	0.28%	2.00%	0.11%	0.64%	0.17%
自基金合同生效起至今	22.58%	0.30%	8.13%	0.12%	14.45%	0.18%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

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

前海联合添利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年11月11日-2024年06月30日)



前海联合添利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年11月11日-2024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27只产品，包括货币型、债券型、混合型和FOF等类型。

#### 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（助理）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	2022-07-29	-	13年	孟晓婧女士，中国人民银行金融研究所硕士，13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。

#### 4.1.3 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。

本报告期内，两两组合间单日、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合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 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 2024 年上半年，国内权益市场表现差强人意，固收方面中美利差走扩，海外主要国家进入降息周期。

权益市场方面，A 股在上半年表现一波三折。市场先是在宏观数据支撑下逐步上行，后又在企业盈利预期下修后开始回落。资金集中于红利和大盘类资产，小微盘和成长赛道的表现持续较差，市场风格分化逐步拉大。

固收市场方面，一季度市场对于经济增长预期较为悲观，再加上年初降准降息落地资金面宽松等因素，10 年期国债收益率一度下行至 2.23% 低点。随后央行多次提示长端利率风险，地产政策工具频出，10 年期国债收益率小幅回调后围绕 2.3% 低位窄幅震荡。6 月半年末资金面平稳，二季度经济数据有所走弱，长端利率再度向下运行突破前期低点至 2.21%。

在此背景下，本基金基于流动性考虑，主要持仓利率债；可转债持仓以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。权益方面，2024 年 2 月前维持低股票仓位，有效控制回撤；3-5 月重仓红利及资源类股票，给净值带来正贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添利债券 A 基金份额净值为 1.1431 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%；截至报告期末前海联合添利债券 C 基金份额净

值为 1.1676 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 1.28%,同期业绩比较基准收益率为 2.31%。

#### 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 2024 年下半年,全球流动性有望宽松,外需有支撑,地产拖累收窄,企业盈利增速有望翻正,市场估值缓慢修复。

债券市场展望:信用周期难启、利率下行未完,资金利率和短端收益率仍有下行空间。

权益市场展望:整体估值水平更有吸引力,更多关注基本面改善、估值合理能率先走出阿尔法的行业龙头。

可转债市场展望:可转债目前估值相对合理,部分品种已经具备配置价值。长期看好可转债投资价值。

本基金将根据市场变化,在基金合同约定范围内动态调整利率债,关注符合投资标准的信用债标的,并同时动态调整可转债及股票仓位。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人的基金估值由基金会计负责,基金会计以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;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

截至本报告期末，本基金基金资产净值连续 60 个工作日以上低于 5000 万元。本基金管理人已向证监会报告持续运作本基金。

### § 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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——新疆前海联合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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	46,876.39	172,148.85
结算备付金		18,177.93	922,199.75

存出保证金		7,906.66	7,491.55
交易性金融资产	6.4.7.2	3,892,495.59	86,496,221.10
其中：股票投资		255,137.00	4,243,940.00
基金投资		-	-
债券投资		3,637,358.59	82,252,281.10
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	-	11,498,620.94
应收清算款		-	936,299.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,965,456.57	100,032,981.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	877,559.32
应付赎回款		3,451.28	2,773.28
应付管理人报酬		2,240.53	58,683.76
应付托管费		640.15	16,766.80
应付销售服务费		9.60	11.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14.53	267.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	62,441.46	189,138.35
负债合计		68,797.55	1,145,200.26
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	3,387,574.50	87,598,213.05
未分配利润	6.4.7.8	509,084.52	11,289,568.28
净资产合计		3,896,659.02	98,887,781.33
负债和净资产总计		3,965,456.57	100,032,981.59

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,387,574.50 份。其中前海联合添利债券 A 基金份额净值 1.1431 元，基金份额总额 2,396,661.59 份；前海联合添利债券 C 基金份额净值 1.1676 元，基金份额总额 990,912.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-229,038.97	864,725.44
1. 利息收入		22,092.54	70,684.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,399.35	5,468.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,693.19	65,215.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		75,405.76	-1,563,680.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-493,453.65	-2,965,334.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	566,541.41	1,341,004.35
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	2,318.00	60,649.21
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	-326,588.36	2,357,658.17
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	51.09	63.71
<b>减：二、营业总支出</b>		107,188.83	558,219.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	72,936.14	360,517.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,838.93	103,005.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	61.22	103.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		47.84	1,033.02
8. 其他费用	6.4.7.19	13,304.70	93,559.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-336,227.80	306,506.18

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-336,227.80	306,506.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-336,227.80	306,506.18

### 6.3 净资产变动表

会计主体：新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	87,598,213.05	11,289,568.28	98,887,781.33
二、本期期初净资产	87,598,213.05	11,289,568.28	98,887,781.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-84,210,638.55	-10,780,483.76	-94,991,122.31
（一）、综合收益总额	-	-336,227.80	-336,227.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-84,210,638.55	-10,444,255.96	-94,654,894.51
其中：1. 基金申购款	1,395,595.52	176,642.28	1,572,237.80
2. 基金赎回款	-85,606,234.07	-10,620,898.24	-96,227,132.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	3,387,574.50	509,084.52	3,896,659.02
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	91,101,638.19	11,844,186.82	102,945,825.01
二、本期期初净资产	91,101,638.19	11,844,186.82	102,945,825.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-450,619.70	231,139.62	-219,480.08
（一）、综合收益总额	-	306,506.18	306,506.18
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-450,619.70	-75,366.56	-525,986.26
其中：1. 基金申购款	143,788.58	22,962.31	166,750.89
2. 基金赎回款	-594,408.28	-98,328.87	-692,737.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	90,651,018.49	12,075,326.44	102,726,344.93

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

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、国债期货、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的20%,其中权证占基金资产净值的比例为0%-3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。



本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 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、《资产管理产品相关会计处理规定》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净资产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

基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发

教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	46,876.39
等于：本金	46,859.96
加：应计利息	16.43
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
合计	46,876.39

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	214,902.27	-	255,137.00	40,234.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,562,129.02	48,072.70	3,637,358.59	27,156.87
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,562,129.02	48,072.70	3,637,358.59	27,156.87
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,777,031.29	48,072.70	3,892,495.59	67,391.60	

## 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

无余额。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 6.4.7.5 其他资产

无。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	878.76
其中：交易所市场	878.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,562.70
合计	62,441.46

## 6.4.7.7 实收基金

## 前海联合添利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,437,309.79	86,437,309.79
本期申购	1,348,956.62	1,348,956.62
本期赎回（以“-”号填列）	-85,389,604.82	-85,389,604.82
本期末	2,396,661.59	2,396,661.59

## 前海联合添利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,160,903.26	1,160,903.26
本期申购	46,638.90	46,638.90
本期赎回（以“-”号填列）	-216,629.25	-216,629.25
本期末	990,912.91	990,912.91

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

## 前海联合添利债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,818,714.29	1,293,468.32	11,112,182.61
本期期初	9,818,714.29	1,293,468.32	11,112,182.61
本期利润	-114,761.45	-236,182.87	-350,944.32
本期基金份额交易产生的变动数	-9,201,384.40	-1,216,807.72	-10,418,192.12
其中：基金申购款	144,472.13	24,558.78	169,030.91
基金赎回款	-9,345,856.53	-1,241,366.50	-10,587,223.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	502,568.44	-159,522.27	343,046.17

## 前海联合添利债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润
----	-------	-------	-------

			合计
上年度末	159,603.38	17,782.29	177,385.67
本期期初	159,603.38	17,782.29	177,385.67
本期利润	105,122.01	-90,405.49	14,716.52
本期基金份额交易产生的变动数	-31,353.84	5,290.00	-26,063.84
其中：基金申购款	9,358.14	-1,746.77	7,611.37
基金赎回款	-40,711.98	7,036.77	-33,675.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,371.55	-67,333.20	166,038.35

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,997.53
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	3,330.23
其他	71.59
合计	5,399.35

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	11,813,924.16
减：卖出股票成本总额	12,282,016.98
减：交易费用	25,360.83
买卖股票差价收入	-493,453.65

#### 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	177,462.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	389,078.70
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	566,541.41

##### 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	86,876,081.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,382,503.87
减：应计利息总额	1,102,892.41
减：交易费用	1,606.66
买卖债券差价收入	389,078.70

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,318.00
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	2,318.00

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-326,588.36
——股票投资	43,681.98
——债券投资	-370,270.34
——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	-326,588.36

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	51.03
转换费收入	0.06
合计	51.09

**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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	1,912.40
信息披露费	7,650.30
证券出借违约金	-
其他费用	165.00
账户维护费	3,577.00
合计	13,304.70

**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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。



**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	72,936.14	360,517.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,129.68	5,729.82
应支付基金管理人的净管理费	68,806.46	354,787.75

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,838.93	103,005.02

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C	合计
新疆前海联合基金管理有限 公司	-	0.37	0.37
中国工商银行股份有限公司	-	42.14	42.14
合计	-	42.51	42.51
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C	合计
新疆前海联合基金管理有限 公司	-	0.97	0.97
中国工商银行股份有限公司	-	67.66	67.66
合计	-	68.63	68.63

注：1. 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。

2、根据本基金管理人于 2022 年 9 月 10 日发布的《关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下部分产品开展销售服务费率优惠活动的公告》，自 2022 年 9 月 13 日起，本基金的销售服务费率由 0.40% 调整为 0.01%。截至资产负债表日，该优惠活动未发生变化。后续优惠活动变化及结束具体时间，以管理人公告为准。

#### 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

##### 前海联合添利债券 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）持有的基金份额	10,004,000	10,004,000

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	1,327,903.21	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,327,903.21	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	39.20%	-

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	46,876.39	1,997.53	145,507.86	885.46

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2024 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

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券型基金，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、国债期货、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,845,267.40	29,766,053.65
合计	2,845,267.40	29,766,053.65

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	546,325.34	14,898,878.79
AAA 以下	245,765.85	4,890,383.57
未评级	-	32,696,965.09
合计	792,091.19	52,486,227.45

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 2024 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年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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%。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 2024 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 2024 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 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	46,876.39	-	-	-	46,876.39
结算备付金	18,177.93	-	-	-	18,177.93
存出保证金	7,906.66	-	-	-	7,906.66
交易性金融资产	3,507,902.01	129,456.58	-	255,137.00	3,892,495.59
资产总计	3,580,862.99	129,456.58	-	255,137.00	3,965,456.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,451.28	3,451.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,240.53	2,240.53
应付托管费	-	-	-	640.15	640.15
应付销售服务费	-	-	-	9.60	9.60
应交税费	-	-	-	14.53	14.53
其他负债	-	-	-	62,441.46	62,441.46
负债总计	-	-	-	68,797.55	68,797.55
利率敏感度缺	3,580,862.99	129,456.58	-	186,339.45	3,896,659.02

口					
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	172,148.85	-	-	-	172,148.85
结算备付金	922,199.75	-	-	-	922,199.75
存出保证金	7,491.55	-	-	-	7,491.55
交易性金融资产	82,137,974.20	114,306.90	-	4,243,940.00	86,496,221.10
买入返售金融资产	11,498,620.94	-	-	-	11,498,620.94
应收清算款	-	-	-	936,299.40	936,299.40
资产总计	94,738,435.29	114,306.90	-	5,180,239.40	100,032,981.59
负债					
应付清算款	-	-	-	877,559.32	877,559.32
应付赎回款	-	-	-	2,773.28	2,773.28
应付管理人报酬	-	-	-	58,683.76	58,683.76
应付托管费	-	-	-	16,766.80	16,766.80
应付销售服务费	-	-	-	11.57	11.57
应交税费	-	-	-	267.18	267.18
其他负债	-	-	-	189,138.35	189,138.35
负债总计	-	-	-	1,145,200.26	1,145,200.26
利率敏感度缺口	94,738,435.29	114,306.90	-	4,035,039.14	98,887,781.33

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	5,925.49	183,923.04
	2. 市场利率上升 25 个基点	-5,924.54	-183,792.99

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金



的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	255,137.00	6.55	4,243,940.00	4.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	255,137.00	6.55	4,243,940.00	4.29

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 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 6.55% (2023 年 12 月 31 日：4.29%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	917,771.61	23,402,656.37
第二层次	2,974,723.98	63,093,564.73
第三层次	-	-
合计	3,892,495.59	86,496,221.10

##### 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	255,137.00	6.43
	其中：股票	255,137.00	6.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,637,358.59	91.73
	其中：债券	3,637,358.59	91.73
	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	65,054.32	1.64
8	其他各项资产	7,906.66	0.20
9	合计	3,965,456.57	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	182,617.00	4.69
C	制造业	54,850.00	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,670.00	0.45
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	255,137.00	6.55

### 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	600938	中国海油	2,000	66,000.00	1.69
2	601899	紫金矿业	3,000	52,710.00	1.35
3	601857	中国石油	4,600	47,472.00	1.22
4	601138	工业富联	800	21,920.00	0.56
5	600029	南方航空	3,000	17,670.00	0.45
6	002281	光迅科技	300	11,211.00	0.29
7	002601	龙佰集团	600	11,142.00	0.29
8	603993	洛阳钼业	1,300	11,050.00	0.28
9	002916	深南电路	100	10,577.00	0.27
10	601168	西部矿业	300	5,385.00	0.14

## 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	000408	藏格矿业	1,084,273.00	1.10
2	601899	紫金矿业	818,880.00	0.83
3	300630	普利制药	756,125.00	0.76
4	603518	锦泓集团	740,690.00	0.75
5	002675	东诚药业	704,560.00	0.71
6	000895	双汇发展	545,954.00	0.55
7	000630	铜陵有色	520,800.00	0.53
8	300709	精研科技	501,556.00	0.51
9	601857	中国石油	494,000.00	0.50
10	600938	中国海油	464,695.00	0.47
11	601168	西部矿业	317,560.00	0.32
12	002154	报喜鸟	193,200.00	0.20
13	002867	周大生	167,003.00	0.17
14	000983	山西焦煤	154,500.00	0.16
15	600435	北方导航	133,210.00	0.13
16	002465	海格通信	127,000.00	0.13
17	601390	中国中铁	44,592.00	0.05
18	002738	中矿资源	36,747.00	0.04
19	600029	南方航空	35,600.00	0.04
20	601921	浙版传媒	33,368.00	0.03

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	601899	紫金矿业	1,416,482.00	1.43
2	000408	藏格矿业	1,190,985.00	1.20
3	002675	东诚药业	745,869.00	0.75
4	300630	普利制药	712,890.00	0.72
5	603518	锦泓集团	613,735.00	0.62
6	000983	山西焦煤	611,924.00	0.62
7	000895	双汇发展	596,624.00	0.60
8	601728	中国电信	510,108.00	0.52
9	688981	中芯国际	507,100.00	0.51
10	600938	中国海油	477,587.00	0.48
11	601857	中国石油	473,500.00	0.48
12	300709	精研科技	465,600.00	0.47
13	000630	铜陵有色	460,800.00	0.47
14	603259	药明康德	345,300.00	0.35
15	601168	西部矿业	332,507.00	0.34
16	300347	泰格医药	304,800.00	0.31
17	601318	中国平安	269,271.00	0.27
18	000938	紫光股份	255,360.00	0.26
19	002154	报喜鸟	182,759.00	0.18
20	600276	恒瑞医药	166,634.00	0.17

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	8,249,532.00
卖出股票收入（成交）总额	11,813,924.16

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	2,845,267.40	73.02
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	792,091.19	20.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,637,358.59	93.35

## 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	019709	23 国债 16	22,000	2,234,353.15	57.34
2	019727	23 国债 24	6,000	610,914.25	15.68
3	132026	G 三峡 EB2	1,000	129,456.58	3.32
4	113042	上银转债	700	79,571.45	2.04
5	110059	浦发转债	670	73,884.50	1.90

## 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. 上银转债发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2023 年 11 月 15 日，根据沪金罚决字[2023]51-[2023]52 号，由于违规经营，上海银行被国家金融监管总局上海监管局两次均罚款 690 万元，合计罚款 1380 万元。

(2) 2023 年 11 月 27 日，根据上海汇管罚字[2023]3111220301 号，由于未尽审核办理股权转让购付汇业务，上海银行被国家外汇管理局上海市分局罚款 70 万元，没收违法所得 257.23 万元，罚没款合计 327.23 万元。

(3) 2023 年 12 月 28 日，根据沪金罚决字[2023]81 号，由于未依法履行职责，上海银行被国家金融监管总局上海监管局罚款 145 万元。

(4) 2024 年 5 月 30 日，根据沪金罚决字[2024]43 号，由于境外机构重大投资事项未经行政许可，上海银行被国家金融监管总局上海监管局罚款 80 万元。

本基金对上海银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

#### 2. 浦发转债发债主体受到监管部门处罚情况：

浦发银行多家分行，因违规经营，未依法履行责任等，受到当地国家金融监管局等监管机构的罚款。

本基金对浦发银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

#### 3. 兴业转债发债主体受到监管部门处罚情况：

兴业银行多家分行，因违规经营，未依法履行责任等，受到当地国家金融监管局和央行分行等监管机构的罚款。

本基金对兴业银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

#### 4. 重银转债发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2023 年 10 月 31 日，根据渝金管罚决字[2023]24 号，由于违规经营，重庆银行被国家金融监管总局重庆监管局罚款 150 万元。

(2) 2024 年 6 月 19 日，根据渝金管罚决字[2024]12 号，由于截至 2021 年底贷款风险分类不准确；资金投向不合规且未按约定用途使用；对政府平台项目风险管控不到位；贷前调查不尽职；小微企业抵押评估费用由借款企业承担，重庆银行被国家金融监管总局重庆监管局罚款 200 万元。

本基金对重庆银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	7,906.66
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	7,906.66

## 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	132026	G 三峡 EB2	129,456.58	3.32
2	113042	上银转债	79,571.45	2.04
3	110059	浦发转债	73,884.50	1.90
4	113052	兴业转债	73,588.02	1.89
5	113056	重银转债	68,329.28	1.75
6	110073	国投转债	68,190.99	1.75
7	127016	鲁泰转债	50,173.05	1.29
8	113516	苏农转债	48,391.08	1.24
9	113037	紫银转债	48,313.41	1.24
10	113044	大秦转债	38,484.83	0.99
11	127043	川恒转债	23,457.01	0.60
12	113627	太平转债	21,601.86	0.55
13	123131	奥飞转债	21,539.40	0.55
14	113065	齐鲁转债	14,819.69	0.38
15	113659	莱克转债	8,973.19	0.23
16	118044	赛特转债	8,861.48	0.23
17	113633	科沃转债	8,539.75	0.22

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合添利债券 A	243	9,862.8	1,327,903.21	55.41%	1,068,758.38	44.59%
前海联合添利债券 C	526	1,883.86	-	-	990,912.91	100%
合计	734	4,615.22	1,327,903.21	39.20%	2,059,671.29	60.80%

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合添利债券 A	108.56	0.0045%
	前海联合添利债券 C	209.85	0.0212%
	合计	318.41	0.0094%

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、基金投资和研发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。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	1,327,903.21	39.20%	-	-	-

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	1,327,903.21	39.20%	-	-	-

注：本基金管理人已赎回持有期限已满三年的本基金全部发起份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	75,506,812.05	293,767,779.52
本报告期期初基金份额总额	86,437,309.79	1,160,903.26
本报告期基金总申购份额	1,348,956.62	46,638.90
减：本报告期基金总赎回份额	85,389,604.82	216,629.25
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	2,396,661.59	990,912.91

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 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，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	
国投证券股份有限公司	1	8,800,771.00	43.86%	8,324.63	45.82%	-
华创证券有限责任公司	2	5,606,828.00	27.95%	5,303.33	29.19%	-
国盛证券有限责任公司	1	3,473,723.00	17.31%	2,591.06	14.26%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,037,278.00	5.17%	981.20	5.40%	-
中信建投证券股份有限公司	1	583,205.00	2.91%	435.27	2.40%	-
广发证券股份有限公司	1	561,651.16	2.80%	531.38	2.92%	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

华金证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：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
国投证券 股份有限公司	1,351,599.45	2.26%	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	16,487,004.50	27.56%	73,600,000.00	46.03%	-	-	-	-

国盛证券 有限责任 公司	31,989,573.59	53.48%	77,900,000.00	48.72%	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3,634,490.30	6.08%	3,400,000.00	2.13%	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	280,131.10	0.47%	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	6,076,309.30	10.16%	5,000,000.00	3.13%	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-01-22
2	新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-03-30
3	新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金 2024 年第一季度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-04-22
4	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024-05-09
5	新疆前海联合基金管理有限公司	上海证券报、中国证监会基金电	2024-06-04

	司关于旗下部分公开募集证券投资基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险揭示的公告	子披露网站及基金管理人网站	
--	--	---------------	--

## § 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	20240229-20240630	-	1,327,903.21	-	1,327,903.21	39.2%
	2	20240101-20240229	85,233,902.13	-	85,233,902.13	-	-

#### 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利债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金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处外，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

二〇二四年八月三十日