

新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 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:2021 年 10 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	94,877,613.92份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。	
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	
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	93,631,764.00 份	1,245,849.92 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（2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 30 日）	
	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
1. 本期已实现收益	3,602,581.19	44,928.53
2. 本期利润	3,163,259.62	39,060.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0338	0.0330
4. 期末基金资产净值	112,203,914.84	1,529,508.12

5. 期末基金份额净值	1.1984	1.2277
-------------	--------	--------

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合添利债券 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	2.90%	0.33%	0.08%	0.13%	2.82 %	0.20 %
过去六个月	4.71%	0.29%	0.85%	0.12%	3.86 %	0.17 %
过去一年	8.38%	0.33%	2.69%	0.13%	5.69 %	0.20 %
过去三年	19.26%	0.34%	8.67%	0.13%	10.5 9%	0.21 %
自基金合同 生效起至今	19.84%	0.30%	6.09%	0.13%	13.7 5%	0.17 %

前海联合添利债券 C 净值表现

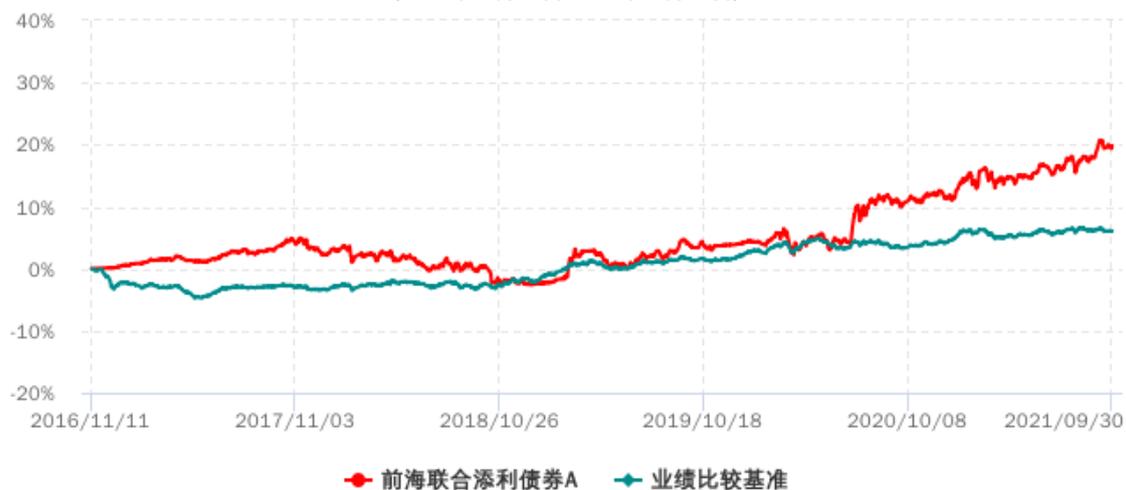
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	2.80%	0.33%	0.08%	0.13%	2.72 %	0.20 %

过去六个月	4.49%	0.29%	0.85%	0.12%	3.64%	0.17%
过去一年	7.95%	0.33%	2.69%	0.13%	5.26%	0.20%
过去三年	23.13%	0.36%	8.67%	0.13%	14.46%	0.23%
自基金合同生效起至今	22.77%	0.31%	6.09%	0.13%	16.68%	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-2021年09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-2021年09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		
黄浩东	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2019-12-17	-	10年	黄浩东先生，硕士研究生，10年证券投资研究经验。2011年7月至2019年8月任职于东莞证券股份有限公司

				<p>深圳分公司，历任研究员、投资经理、副总经理兼投资经理。2019 年 8 月加入前海联合基金，现任固定收益部总经理、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2019 年 12 月 17 日起任职）、新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）、新疆前海联合添泽债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 6 月 4 日起任职）、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 6 月 8 日起任职）、新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 8 月 13 日起任职）、新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理（自 2021 年 5 月 7 日起任职）和新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 20 日</p>
--	--	--	--	---

					起任职)。
--	--	--	--	--	-------

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 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业务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

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2021 年三季度，经济数据连续两月持续下滑。究其原因，短期有疫情因素，但主要源于地产下行。三季度地产销售情况较弱，恒大出现违约风险后，各民营地产企业投资拿

地意愿骤减。制造业投资增速也开始回落，而基建投资 8 月增速开始回升，政府希望通过基建对冲地产的下行风险。受制于疫情，经济和物价等因素，消费增速也大幅下滑。7 月出乎意料的降准引领收益率出现一波下行。但后期市场受到利率债供给影响和美国 taper 加速等影响，收益率出现了一定的回调。

权益市场：三季度白马股有所恢复，赛道股波动增大。

转债市场：三季度中证转债指数出现持续走强，但在 9 月份中受到估值和股票市场调整的影响，出现比较大的回调。

本基金三季度维持中等杠杆操作，转债仓位随着行情变化调整，股票仓位则维持在合同约定范围内的中高水平。

4.5 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 1.1984 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.90%，同期业绩比较基准收益率为 0.08%；截至报告期末前海联合添利债券 C 基金份额净值为 1.2277 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.80%，同期业绩比较基准收益率为 0.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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	15,892,400.24	13.65
	其中：股票	15,892,400.24	13.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,571,983.21	82.11
	其中：债券	95,571,983.21	82.11

	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	800,000.00	0.69
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,074,132.83	1.78
8	其他资产	2,054,141.62	1.76
9	合计	116,392,657.90	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	-	-
C	制造业	10,281,108.00	9.04
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	83,600.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	220,284.88	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,053,505.00	0.93
J	金融业	752,355.00	0.66
K	房地产业	700,700.00	0.62
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	603,748.00	0.53
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	1,222,146.40	1.07
R	文化、体育和娱乐业	974,952.96	0.86
S	综合	-	-
	合计	15,892,400.24	13.97

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	300083	创世纪	66,000	1,024,320.00	0.90
2	600519	贵州茅台	400	732,000.00	0.64
3	002597	金禾实业	18,000	708,660.00	0.62
4	600570	恒生电子	12,000	687,360.00	0.60
5	000333	美的集团	8,600	598,560.00	0.53
6	002044	美年健康	79,900	592,858.00	0.52
7	600690	海尔智家	22,500	588,375.00	0.52
8	300144	宋城演艺	41,000	577,280.00	0.51
9	002415	海康威视	9,800	539,000.00	0.47
10	600031	三一重工	21,000	534,240.00	0.47

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	6,999,600.00	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,002,500.00	4.40
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	38,884,945.10	34.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,684,938.11	39.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,571,983.21	84.03

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	112729	18 申宏 02	100,000	10,306,000.00	9.06
2	163927	20 东债 01	100,000	10,087,000.00	8.87
3	163290	20 海通 02	100,000	10,009,000.00	8.80
4	132011	17 浙报 EB	97,900	9,936,850.00	8.74
5	132008	17 山高 EB	49,990	5,259,947.80	4.62

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

20 海通 02 发债主体受监管处罚情况:

(1) 2021 年 3 月 30 日, 根据沪证监决〔2021〕40 号, 因在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中, 未按照审慎经营原则, 有效控制和防范风险, 未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响; 未将相关业务行为纳入全面合规风控体系, 合规风控机制存在缺失; 投资银行业务内部控制存在漏洞, 债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离, 利益冲突审查机制存在缺失等违法违规事由, 上海证监局责令海通证券自处罚决定作出之日起 1 年内每 3 个月开展一次内部合规检查, 自处罚决定作出之日起 12 个月内, 暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

(2) 2021 年 9 月 7 日, 根据《中国证券监督管理委员会立案告知书》(证监立案字 0152021022 号) 及《中国证券监督管理委员会调查通知书》(证监调查字 0152021061 号), 因海通证券在开展西南药业股份有限公司(现奥瑞德光电股份有限公司)财务顾问业务的持续督导工作期间未勤勉尽责, 涉嫌违法违规, 根据《中华人民共和国证券法》等法律法规, 中国证监会决定对海通证券进行立案并调查。

(3) 2021 年 9 月 28 日, 根据重庆证监局《行政处罚事先告知书》(处罚字〔2021〕5 号), 由于上述(2)事项, 海通证券被重庆证监局责令改正, 没收财务顾问业务收入 100 万元, 并处以 300 万元罚款。

基金管理人经审慎分析, 认为海通证券资产规模大, 经营情况良好, 且海通证券主体评级为市场最高的 AAA 评级, 实力很强, 上述事项对海通证券自身信用基本面影响很小, 对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于海通证券的决策程序说明: 基于海通证券基本面研究以及二级市场的判断, 本基金投资于海通证券, 其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析, 认为该事项对海通证券经营和价值应不会构成重大影响, 对基金运作无影响。

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	7,358.88
2	应收证券清算款	1,342,346.13
3	应收股利	-
4	应收利息	702,416.61
5	应收申购款	2,020.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,054,141.62

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	132011	17 浙报 EB	9,936,850.00	8.74
2	132008	17 山高 EB	5,259,947.80	4.62
3	132018	G 三峡 EB1	1,352,885.60	1.19
4	110038	济川转债	1,036,736.70	0.91
5	113011	光大转债	1,024,830.00	0.90
6	127013	创维转债	1,003,295.00	0.88
7	128105	长集转债	917,280.00	0.81
8	110068	龙净转债	874,240.00	0.77
9	128071	合兴转债	766,500.00	0.67
10	110051	中天转债	710,280.00	0.62
11	113569	科达转债	709,590.00	0.62
12	113021	中信转债	694,460.00	0.61
13	128117	道恩转债	634,920.00	0.56
14	113044	大秦转债	633,120.00	0.56
15	110064	建工转债	633,060.00	0.56
16	128129	青农转债	629,948.52	0.55
17	110059	浦发转债	623,460.00	0.55

18	113033	利群转债	622,620.00	0.55
19	110043	无锡转债	591,000.00	0.52
20	110053	苏银转债	583,800.00	0.51
21	110073	国投转债	575,250.00	0.51
22	128107	交科转债	566,500.00	0.50
23	128114	正邦转债	560,064.92	0.49
24	113563	柳药转债	523,700.50	0.46
25	123056	雪榕转债	523,300.00	0.46
26	128083	新北转债	523,050.00	0.46
27	113601	塞力转债	522,050.00	0.46
28	127016	鲁泰转债	517,160.11	0.45
29	128081	海亮转债	498,470.80	0.44
30	110034	九州转债	498,420.00	0.44
31	110041	蒙电转债	462,600.00	0.41
32	123096	思创转债	434,400.00	0.38
33	127028	英特转债	430,280.00	0.38
34	113532	海环转债	419,360.00	0.37
35	110052	贵广转债	417,120.00	0.37
36	113584	家悦转债	409,374.00	0.36
37	110045	海澜转债	353,760.00	0.31
38	127024	盈峰转债	342,990.00	0.30
39	123002	国祯转债	341,430.00	0.30
40	113610	灵康转债	339,540.00	0.30
41	113549	白电转债	330,000.00	0.29
42	113542	好客转债	323,940.00	0.28
43	127021	特发转 2	317,490.00	0.28
44	128135	洽洽转债	289,316.80	0.25
45	132007	16 凤凰 EB	273,658.50	0.24
46	110056	亨通转债	232,960.00	0.20

47	128037	岩土转债	232,211.40	0.20
48	113516	苏农转债	232,020.00	0.20
49	127015	希望转债	228,360.00	0.20
50	110062	烽火转债	216,100.00	0.19
51	110076	华海转债	215,080.00	0.19
52	128131	崇达转 2	213,720.00	0.19
53	113519	长久转债	211,120.00	0.19
54	128022	众信转债	208,240.00	0.18
55	113596	城地转债	187,740.00	0.17
56	110063	鹰 19 转债	179,070.00	0.16
57	113039	嘉泽转债	173,190.00	0.15
58	123063	大禹转债	120,110.00	0.11
59	113024	核建转债	115,540.00	0.10
60	110067	华安转债	112,260.00	0.10
61	113605	大参转债	111,480.00	0.10
62	127012	招路转债	111,250.00	0.10
63	123039	开润转债	110,230.00	0.10
64	123077	汉得转债	107,480.00	0.09
65	128074	游族转债	107,280.00	0.09
66	123028	清水转债	82,120.00	0.07
67	110057	现代转债	58,245.00	0.05
68	110060	天路转债	58,065.00	0.05
69	128090	汽模转 2	56,970.00	0.05
70	128040	华通转债	56,570.00	0.05
71	123059	银信转债	55,625.00	0.05
72	113619	世运转债	53,795.00	0.05
73	132022	20 广版 EB	3,051.90	0.00

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

	前海联合添利债券 A	前海联合添利债券 C
报告期期初基金份额总额	93,713,371.31	1,180,427.96
报告期期间基金总申购份额	21,711.47	116,581.93
减：报告期期间基金总赎回份额	103,318.78	51,159.97
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	93,631,764.00	1,245,849.92

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购或者赎回本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金管理人已赎回认购的持有期限已满三年的本基金份额。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20210701-20210930	92,661,657.00	-	-	92,661,657.00	97.66%
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资份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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

二〇二一年十月二十七日