

# 新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 10 月 25 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月19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7月1日起至2023年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	2,729,030.13 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	<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</p>

	种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。	
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。	
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	
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	1,235,065.90 份	1,493,964.23 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 07 月 01 日-2023 年 09 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
1. 本期已实现收益	-7,221.76	-9,848.88
2. 本期利润	-10,222.40	-13,835.98
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0081	-0.0093
4. 期末基金资产净值	1,437,712.41	1,659,632.13
5. 期末基金份额净值	1.1641	1.1109

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

###### 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	-0.72%	0.15%	0.01%	0.05%	-0.73%	0.10%
过去六个月	-1.50%	0.24%	0.95%	0.04%	-2.45%	0.20%
过去一年	-0.02%	0.28%	0.62%	0.05%	-0.64%	0.23%
过去三年	0.35%	0.29%	4.54%	0.05%	-4.19%	0.24%
自基金转型	5.87%	0.29%	2.13%	0.06%	3.74%	0.23%

日起至今						
------	--	--	--	--	--	--

## 前海联合添鑫 3 个月定开债券 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	-0.83%	0.14%	0.01%	0.05%	-0.84%	0.09%
过去六个月	-1.70%	0.24%	0.95%	0.04%	-2.65%	0.20%
过去一年	-0.42%	0.28%	0.62%	0.05%	-1.04%	0.23%
过去三年	-0.87%	0.29%	4.54%	0.05%	-5.41%	0.24%
自基金转型 日起至今	4.37%	0.29%	2.13%	0.06%	2.24%	0.23%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

2、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，转型后的基金合同于 2020 年 3 月 26 日生效。

## 3.2.2 自基金转型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-2023年09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-2023年09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		
张文	本基金的基金经理	2021-08-20	-	10年	张文先生，硕士，10年证券投资基金投资研究交易经验。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

				<p>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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，经济基本面底部修复。国内方面，景气指标触底回升至荣枯线以上。需求方面，出口、消费底部位置边际有所改善，投资表现整体较弱。生产端表现较好，通胀数据陆续见底反弹。社融数据亦底部位置改善，但持续性有待观察。总体来看，经济恢复仍是波浪式前进，曲折式发展的过程，三季度地产、化债等政策发力，基本面向好动能逐渐累积。国际环境复杂严峻，外需预期不稳，美联储货币政策节奏仍有变数。

资金面方面，8 月份逆回购、1 年期 LPR 调降 10bp，MLF 调降 15bp，5 年期 LPR 未调降，9 月份降准 0.25%，央行在季末也加大公开市场投放力度，流动性供给较充裕，隔夜资金中枢环比上季度上行，R001 走高 10bp 左右。债市方面，三季度前半段，受基本面走弱，降息等刺激，收益率震荡下行，后半段受政策密集出台、地方债加速发行、地产化债等政策影响，收益率震荡上行。整季来看，10 年期国债收益率上行 4bp 至 2.67%附近，1/3/5/10 年期国开债收益率分别上行 16/8/4/-3bp 左右，1 年期 AAA 存单/3 年期 AAA 商金债/3 年期 AAA 城投债/3 年期 AAA 二级债分别上行 14/8/6/7bp

左右，中证转债指数单季下跌 0.73%，可转债估值整体处于偏高位置。股市方面，本季市场以调整为主，具体行业来看，非银、煤炭、石油石化等领涨，电力设备、传媒、计算机等领跌，上证、深证、沪深 300 单季度收益分别为-3.26%、-8.32%、-4.11%。

报告期内，本基金在合同约定范围内降低了股票和可转债的配置比例，增加了纯债的配置比例和久期。股票部分以分散投资思路配置，可转债根据估值水平适度调降仓位，优选性价比较高的个券，纯债部分根据基本面走势做好久期管理。未来一个季度会根据基本面、资金面、市场情绪的变化，优化大类资产结构，努力挖掘表现稳定的股票资产，合理分配纯债、可转债、可交债资产配置比例，在控制好回撤的基础上努力为投资者提供更好的持有体验。

#### 4.5 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 1.1641 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.01%；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 1.1109 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.01%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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申请持续营销本基金。

### § 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	255,525.80	8.19
	其中：股票	255,525.80	8.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,644,112.49	84.71
	其中：债券	2,644,112.49	84.71
	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	217,285.10	6.96
8	其他资产	4,306.11	0.14
9	合计	3,121,229.50	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	25,112.00	0.81
C	制造业	142,377.00	4.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,800.00	1.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,048.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,496.80	0.21
J	金融业	25,007.00	0.81
K	房地产业	9,685.00	0.31
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	255,525.80	8.25

### 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	600900	长江电力	600	13,344.00	0.43
2	300124	汇川技术	200	13,298.00	0.43
3	601058	赛轮轮胎	1,000	12,610.00	0.41
4	601688	华泰证券	700	11,067.00	0.36
5	600007	中国国贸	500	9,685.00	0.31
6	601318	中国平安	200	9,660.00	0.31
7	600426	华鲁恒升	300	9,630.00	0.31
8	600548	深高速	800	7,992.00	0.26
9	600585	海螺水泥	300	7,809.00	0.25

10	600674	川投能源	500	7,400.00	0.24
----	--------	------	-----	----------	------

#### 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	1,144,584.34	36.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,912.19	3.26
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	306,675.39	9.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,091,940.57	35.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,644,112.49	85.37

#### 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	019688	22 国债 23	5,000	507,700.96	16.39
2	019668	22 国债 03	2,000	201,078.08	6.49
3	110059	浦发转债	1,830	199,132.78	6.43
4	019319	13 国债 19	1,000	131,245.62	4.24
5	163030	19 鲁高 02	1,000	103,843.31	3.35

#### 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

##### 1.21 东北 03 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2022 年 11 月 23 日，根据吉汇检罚〔2022〕4 号，由于违反外汇账户管理规定，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条第（四）项，东北证券被国家外汇管理局吉林省分局给予警告，责令改正，并处罚款 10 万元。

(2) 2023 年 4 月 28 日，根据长银罚决字〔2023〕1 号，由于未按规定履行客户身份识别义务，东北证券被中国人民银行长春中心支行处以罚款 51.86 万元。

(3) 2023 年 2 月 6 日，根据证监立案字 0392023014 号，东北证券在执行豫金刚石 2016 年非公开发行股票项目中，涉嫌保荐、持续督导等业务未勤勉尽责，所出具的文件存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，证监会决定对东北证券立案调查；5 月 12 日，东北证券收到证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2023]23 号），6 月 17 日，东北证券收到证监会《行政处罚决定书》（〔2023〕45 号），证监会决定对东北证券责令改正，给予警告，没收保荐业务收入 188.68 万元，并处以 566.04 万元罚款。

基金管理人经审慎分析，认为东北证券经营情况尚好，且其主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例较低，上述事项对东北证券自身信用基本面影响较小，对其短期流动性影响小。

本基金投资于东北证券的决策程序说明：基于东北证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于东北证券，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，认为上述事项对东北证券经营和价值应不会构成重大影响，对基金运

作无影响。

#### 2. 华鲁恒升股票发行主体受监管处罚情况：

因污染物超标仍享受环保电价款，华鲁恒升于 2022 年 11 月 21 日被山东省市场监督管理局依据相关法规给予没收违法所得处罚决定。

基金管理人分析认为，事件对该公司正常经营影响较小，且该公司第一时间开展相关事宜的整改处理。

本基金投资于华鲁恒升的决策程序说明：基于华鲁恒升基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于华鲁恒升，其决策流程符合相关法律法规和公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对公司的经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 3. 浦发转债发债主体受监管处罚情况：

浦发银行多家分行，因违规经营，未依法履行责任，涉嫌违反法律法规，受到当地银保监分局罚款。

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。

### 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	1,833.88
2	应收证券清算款	2,472.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,306.11

### 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	110059	浦发转债	199,132.78	6.43
2	113042	上银转债	61,078.43	1.97
3	113056	重银转债	51,904.16	1.68
4	113065	齐鲁转债	49,369.99	1.59
5	113044	大秦转债	47,095.12	1.52
6	127047	帝欧转债	43,446.58	1.40
7	123056	雪榕转债	43,331.14	1.40
8	127024	盈峰转债	38,736.14	1.25
9	128108	蓝帆转债	30,556.27	0.99
10	113516	苏农转债	26,671.92	0.86
11	128129	青农转债	26,529.70	0.86
12	110047	山鹰转债	26,173.18	0.85
13	127056	中特转债	25,231.26	0.81
14	113021	中信转债	22,133.08	0.71
15	110063	鹰 19 转债	21,508.00	0.69
16	127012	招路转债	19,143.68	0.62
17	127016	鲁泰转债	18,090.45	0.58
18	127041	弘亚转债	17,671.13	0.57
19	110062	烽火转债	17,295.06	0.56
20	113532	海环转债	17,210.70	0.56
21	113549	白电转债	15,985.07	0.52
22	123010	博世转债	15,739.61	0.51
23	113657	再 22 转债	15,702.71	0.51
24	127025	冀东转债	13,859.12	0.45
25	128131	崇达转 2	13,549.07	0.44
26	127054	双箭转债	12,729.42	0.41
27	128071	合兴转债	11,661.15	0.38
28	110079	杭银转债	11,639.61	0.38
29	110064	建工转债	11,429.93	0.37
30	113050	南银转债	11,371.57	0.37
31	113542	好客转债	11,311.07	0.37
32	128105	长集转债	10,833.53	0.35
33	113033	利群转债	10,730.16	0.35
34	113052	兴业转债	10,319.37	0.33
35	127017	万青转债	10,167.71	0.33
36	128125	华阳转债	10,052.74	0.32
37	127031	洋丰转债	7,783.05	0.25
38	123121	帝尔转债	7,668.90	0.25
39	127005	长证转债	7,634.19	0.25
40	118024	冠宇转债	5,989.74	0.19
41	113046	金田转债	5,421.92	0.18
42	113563	柳药转债	5,009.13	0.16
43	123063	大禹转债	4,967.86	0.16

44	127035	濮耐转债	4,779.23	0.15
45	128133	奇正转债	3,919.49	0.13
46	128037	岩土转债	3,273.20	0.11
47	113606	荣泰转债	2,284.53	0.07

#### 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

	前海联合添鑫 3 个月 定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月 定开债券 C
报告期期初基金份额总额	1,331,570.90	1,503,625.41
报告期期间基金总申购份额	105.66	89.51
减：报告期期间基金总赎回份额	96,610.66	9,750.69
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	1,235,065.90	1,493,964.23

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

	前海联合添鑫 3 个月 定开债券 A	前海联合添鑫 3 个月 定开债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	398,899.68	1,248,855.22
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	398,899.68	1,248,855.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	14.6169	45.7619

#### 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 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	20230701-20230930	1,647,754.9	-	-	1,647,754.9	60.38%
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

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《关于持续营销新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金的议案》。有关详细信息请参见本基金管理人于 2023 年 9 月 22 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》。

## § 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

二〇二三年十月二十五日