

新疆前海联合添泽债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2026 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年07月15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2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合添泽债券	
基金主代码	009349	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 06 月 04 日	
报告期末基金份额总额	88,682,963.18 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	本基金充分发挥管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产配置进行动态管理。综合信用分析、久期控制、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，同时关注一级市场投资机会，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、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	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
下属分级基金的交易代码	009349	009350
报告期末下属分级基金的份额	69,965,987.78 份	18,716,975.40 份

总额		
----	--	--

注：基金管理人对本基金的风险等级评价结果以公司官网最新披露的旗下基金产品风险等级评价说明为准。

§ 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（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
1. 本期已实现收益	27,328.35	51,431.26
2. 本期利润	3,884.06	47,361.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0060
4. 期末基金资产净值	86,098,206.82	22,722,013.84
5. 期末基金份额净值	1.2306	1.2140

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

前海联合添泽债券 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	0.57%	0.08%	0.61%	0.04%	-0.04%	0.04%
过去六个月	1.31%	0.17%	0.90%	0.04%	0.41%	0.13%
过去一年	2.93%	0.20%	-0.45%	0.05%	3.38%	0.15%
过去三年	17.56%	0.22%	5.10%	0.07%	12.46%	0.15%
过去五年	26.35%	0.18%	8.45%	0.06%	17.90%	0.12%
自基金合同 生效起至今	29.05%	0.16%	7.97%	0.06%	21.08%	0.10%

前海联合添泽债券 C 净值表现

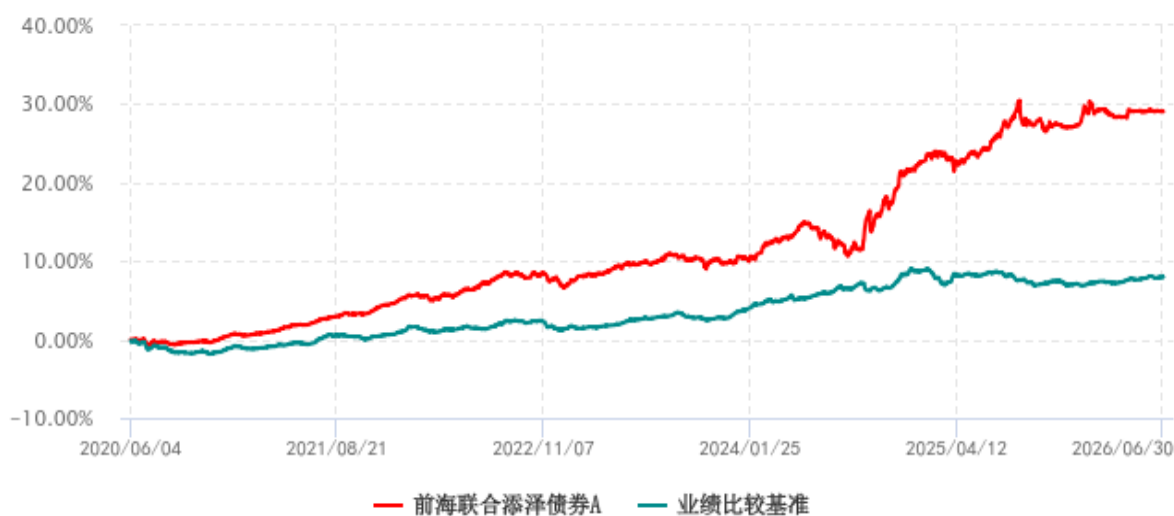
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	0.08%	0.61%	0.04%	-0.04%	0.04%
过去六个月	1.30%	0.17%	0.90%	0.04%	0.40%	0.13%

过去一年	2.92%	0.20%	-0.45%	0.05%	3.37%	0.15%
过去三年	17.54%	0.22%	5.10%	0.07%	12.44%	0.15%
过去五年	25.26%	0.18%	8.45%	0.06%	16.81%	0.12%
自基金合同生效起至今	27.39%	0.16%	7.97%	0.06%	19.42%	0.10%

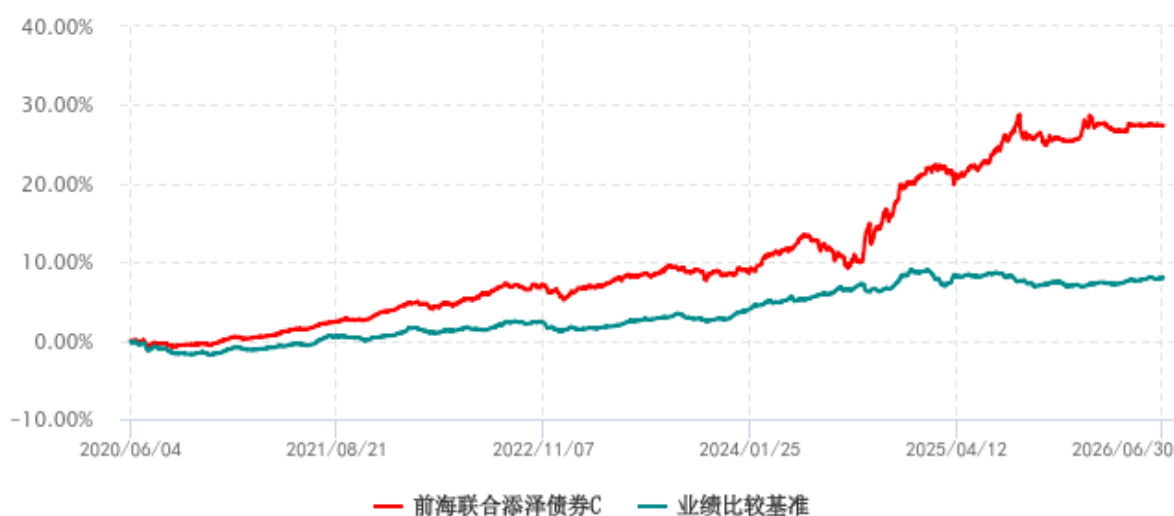
注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%。

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

前海联合添泽债券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06月04日-2026年06月30日)



前海联合添泽债券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06月04日-2026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		
孟令上	本基金基金经理，信用研究部负责人	2025-07-23	—	14 年	孟令上先生，硕士，8 年证券投资基金投资研究从业经验。曾任大公国际资信评估有限公司金融机构部信用分析师、前海人寿保险股份有限公司风险管理部信用分析师、平安证券股份有限公司投资银行部高级经理、民生证券股份有限公司投资银行事业部企业融资一部业务董事和新疆前海联合基金管理有限公司风险管理部负责人。现任新疆前海联合基金管理有限公司信用研究部负责人、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2022 年 8 月 12 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 2025 年 7 月 23 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 2025 年 7 月 23 日起任职)、新疆前海联合弘利债券型证券投资基金基金经理(2025 年 11 月 24 日起任职)、新疆前海联合现金添利货币市场基金基金经理(2025 年 12 月 19 日起任职)和新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金经理(2026 年 3 月 31 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

2026 年二季度，经济内外分化格局延续，外需、出口表现偏强，但内需修复乏力，国内经济数据整体偏弱。债券市场方面，政府债供给节奏维持偏慢，非银机构资金充裕，流动性宽松持续程度超出市场预期。5 月末，在央行逆回购、MLF 持续呵护流动性，叠加权益市场回调等多重因素推动下，10 年期国债收益率打破区间震荡，下行至 1.71% 附近。6 月央行持续收紧流动性投放，市场滋生货币政策转向的担忧，叠加赎回压力冲击，债市出现阶段性调整。后续随着陆家嘴论坛落地隔夜逆回购操作工具，以及央行季末流动性维稳操作，收益率边际修复。全月收益率呈现先上行、后回落走势，10 年期国债收益率整体在 1.73% 附近窄幅震荡。整体而言，二季度债券长端收益率区间窄幅运行，在流动性持续宽松、基本面走弱预期支撑下，债市震荡偏强。（数据来源：Wind）

可转债方面，前期可转债估值经历一轮冲高回落，市场长期运行在高估值、高波动区间，受“固收+”产品及可转债 ETF 资金持续流出影响，估值中枢逐步回归合理水平。二季度可转债行情延续弱势，偏债型、平衡型、偏股型可转债先后调整，年初配置资金与短线投机资金共振推升的行情难以重现。当前可转债整体估值仍处偏高水平，可重点挖掘偏股型可转债的结构性机会。

报告期内，本基金纯债部分维持中性偏积极的仓位与久期，灵活开展波段交易，同步严控组合回撤。可转债市场估值整体偏高、缺乏持续性趋势行情，因此对可转债采取偏防御持仓思路，择机挖掘偏股型可转债的结构性投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添泽债券 A 基金份额净值为 1.2306 元，本报告期内，该类基金份额净值

增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.61%；截至报告期末前海联合添泽债券 C 基金份额净值为 1.2140 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在基金资产净值连续 60 个工作日以上（2026/4/1-2026/6/24）低于 5000 万元的情形。截至本报告期末，本基金基金资产净值恢复至 5000 万元以上。

报告期内，本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等固定费用由本基金管理人支付承担。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	109,778,225.42	94.33
	其中：债券	109,778,225.42	94.33
	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	6,584,283.30	5.66
8	其他资产	9,667.06	0.01
9	合计	116,372,175.78	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	10,213,780.42	9.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	23,487,112.71	21.58
	其中：政策性金融债	10,128,657.53	9.31
4	企业债券	1,645,397.61	1.51
5	企业短期融资券	61,952,658.09	56.93
6	中期票据	10,278,317.81	9.45
7	可转债（可交换债）	202,056.86	0.19
8	同业存单	1,998,901.92	1.84
9	其他	—	—
10	合计	109,778,225.42	100.88

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	102381617	23 杭州国资 MTN001	100,000	10,278,317.81	9.45
2	250211	25 国开 11	100,000	10,128,657.53	9.31
3	012582441	25 浦发集团 SCP005	100,000	10,113,259.73	9.29
4	012681325	26 中粮 SCP002	100,000	10,011,613.15	9.20
5	2320026	23 徽商银行	80,000	8,211,771.62	7.55

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

1.25 国开 11 发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2025 年 7 月 25 日，根据京汇罚[2025]30 号，因违规经营，国家开发银行被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款、没收违法所得，罚没金额合计 1394.42 万元。

(2) 2025 年 9 月 22 日，根据银罚决字[2025]66 号，因违规经营，国家开发银行被央行处以罚款 123 万元。

(3) 国家开发银行河南省分行、青海省分行、云南省分行、安徽省分行、甘肃省分行等 7 家分支机构，因违规经营，被当地国家金融监管局、央行分行等监管机构处以罚款。

本基金对国家开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。

2.23 徽商银行发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2025 年 9 月 19 日，根据皖银罚决字[2025]19 号，因违反金融统计相关规定，徽商银行被央行安徽省分行罚款 20 万元。

(2) 2025 年 10 月 24 日，因贷款产品管理不审慎、贷款三查不到位，徽商银行被国家金融监管总局安徽监管局罚款 240 万元。

(3) 2025 年 12 月 5 日，因违规发放贷款、贷后管理不到位、信用卡业务管理不到位、理财业务不审慎，徽商银行被国家金融监管总局安徽监管局罚款 150 万元。

(4) 2025 年 12 月 5 日, 因财务顾问业务管理不到位、异地业务不合规, 徽商银行被国家金融监管总局安徽监管局罚款 665 万元。

(5) 徽商银行芜湖弋江支行、蚌埠五河支行、滁州分行、芜湖中山南路支行、淮北相西支行等多家分支机构, 因违规经营, 被当地国家金融监管局处以罚款。

本基金对徽商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。

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	4,611.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,055.14
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,667.06

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	127110	广核转债	15,803.58	0.01
2	113042	上银转债	12,707.91	0.01
3	113052	兴业转债	11,508.76	0.01
4	113691	和邦转债	11,347.97	0.01
5	128136	立讯转债	9,870.14	0.01
6	113048	晶科转债	8,848.87	0.01
7	127064	杭氧转债	7,614.48	0.01
8	113661	福 22 转债	6,994.33	0.01
9	127084	柳工转 2	6,875.28	0.01
10	127037	银轮转债	6,368.55	0.01
11	113677	华懋转债	3,880.36	0.00
12	110077	洪城转债	3,811.75	0.00
13	113062	常银转债	3,804.10	0.00
14	113056	重银转债	3,737.04	0.00
15	127061	美锦转债	3,671.38	0.00
16	118034	晶能转债	3,435.80	0.00

17	123107	温氏转债	3,330.66	0.00
18	128121	宏川转债	3,236.10	0.00
19	123158	宙邦转债	2,979.94	0.00
20	110099	福能转债	2,808.49	0.00
21	113046	金田转债	2,667.65	0.00
22	123149	通裕转债	2,656.07	0.00
23	110097	天润转债	2,631.88	0.00
24	118031	天 23 转债	2,426.67	0.00
25	110087	天业转债	2,384.43	0.00
26	127045	牧原转债	2,347.18	0.00
27	118044	赛特转债	1,710.44	0.00
28	123178	花园转债	1,657.45	0.00
29	118013	道通转债	1,653.67	0.00
30	123124	晶瑞转 2	1,627.89	0.00
31	123235	亿田转债	1,469.11	0.00
32	127103	东南转债	1,440.62	0.00
33	113066	平煤转债	1,413.41	0.00
34	113658	密卫转债	1,407.37	0.00
35	113688	国检转债	1,341.55	0.00
36	123122	富瀚转债	1,326.62	0.00
37	110098	南药转债	1,321.65	0.00
38	123224	宇邦转债	1,314.85	0.00
39	113043	财通转债	1,301.82	0.00
40	118024	冠宇转债	1,299.12	0.00
41	123172	漱玉转债	1,286.91	0.00
42	113652	伟 22 转债	1,285.91	0.00
43	113058	友发转债	1,277.47	0.00
44	123223	九典转 02	1,276.33	0.00
45	127050	麒麟转债	1,264.35	0.00
46	113674	华设转债	1,262.96	0.00
47	113070	渝水转债	1,238.02	0.00
48	127040	国泰转债	1,222.06	0.00
49	127089	晶澳转债	1,220.18	0.00
50	111018	华康转债	1,203.40	0.00
51	123119	康泰转 2	1,194.75	0.00
52	113059	福莱转债	1,191.36	0.00
53	113053	隆 22 转债	1,190.91	0.00
54	110086	精工转债	1,179.96	0.00
55	113648	巨星转债	1,176.10	0.00
56	113647	禾丰转债	1,155.86	0.00
57	127083	山路转债	1,149.95	0.00
58	113627	太平转债	1,138.25	0.00
59	110076	华海转债	1,136.56	0.00

60	123113	仙乐转债	1,129.60	0.00
61	113616	韦尔转债	1,122.91	0.00
62	113605	大参转债	1,122.75	0.00
63	123117	健帆转债	1,119.85	0.00
64	123090	三诺转债	1,119.62	0.00
65	110085	通 22 转债	1,119.51	0.00
66	110075	南航转债	1,096.85	0.00
67	113049	长汽转债	1,071.22	0.00
68	110073	国投转债	1,068.29	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

	前海联合添泽债券 A	前海联合添泽债券 C
报告期期初基金份额总额	3,115,296.69	7,877,171.61
报告期期间基金总申购份额	68,271,434.23	13,637,203.59
减：报告期期间基金总赎回份额	1,420,743.14	2,797,399.80
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	69,965,987.78	18,716,975.40

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 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	20260625 – 20260630	–	24,373,578.16	–	24,373,578.16	27.48%
个人	1	20260624 – 20260624	–	11,373,903.15	–	11,373,903.15	12.83%
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、转换入份额，赎回份额包含转换出份额。

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泽债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添泽债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合添泽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

二〇二六年七月二十一日