

新疆前海联合科技先锋混合型
证券投资基金
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--|--------------|
| 基金简称 | 前海联合科技先锋混合 | |
| 交易代码 | 006801 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 8 月 14 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 45,926,986.69 份 | |
| 投资目标 | 通过精选投资于科技先锋主题相关证券，深入研究并积极投资与科技先锋主题相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力求获取超额收益与长期资本增值。 | |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下的资产配置和自下而上的个股选择进行有机结合的投资策略，注重风险与收益的平衡。本基金将主要投资于精选具有较高投资价值的科技新兴主题相关的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，长期平均风险与预期收益率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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 前海联合科技先锋混合 A | 前海联合科技先锋混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006801 | 006802 |

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 25,000,447.08 份 | 20,926,539.61 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（2020年7月1日—2020年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|---------------|
| | 前海联合科技先锋混合 A | 前海联合科技先锋混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 1,921,123.79 | 1,478,611.32 |
| 2. 本期利润 | -1,095,765.67 | -869,821.60 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0453 | -0.0450 |
| 4. 期末基金资产净值 | 36,264,790.89 | 30,196,628.81 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4506 | 1.4430 |

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

前海联合科技先锋混合 A

| 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 | -1.83% | 1.84% | 5.89% | 1.29% | -7.72% | 0.55% |
| 过去六个月 | 27.77% | 1.68% | 20.27% | 1.12% | 7.50% | 0.56% |
| 过去一年 | 46.81% | 1.71% | 27.90% | 1.18% | 18.91% | 0.53% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.06% | 1.60% | 35.07% | 1.15% | 9.99% | 0.45% |

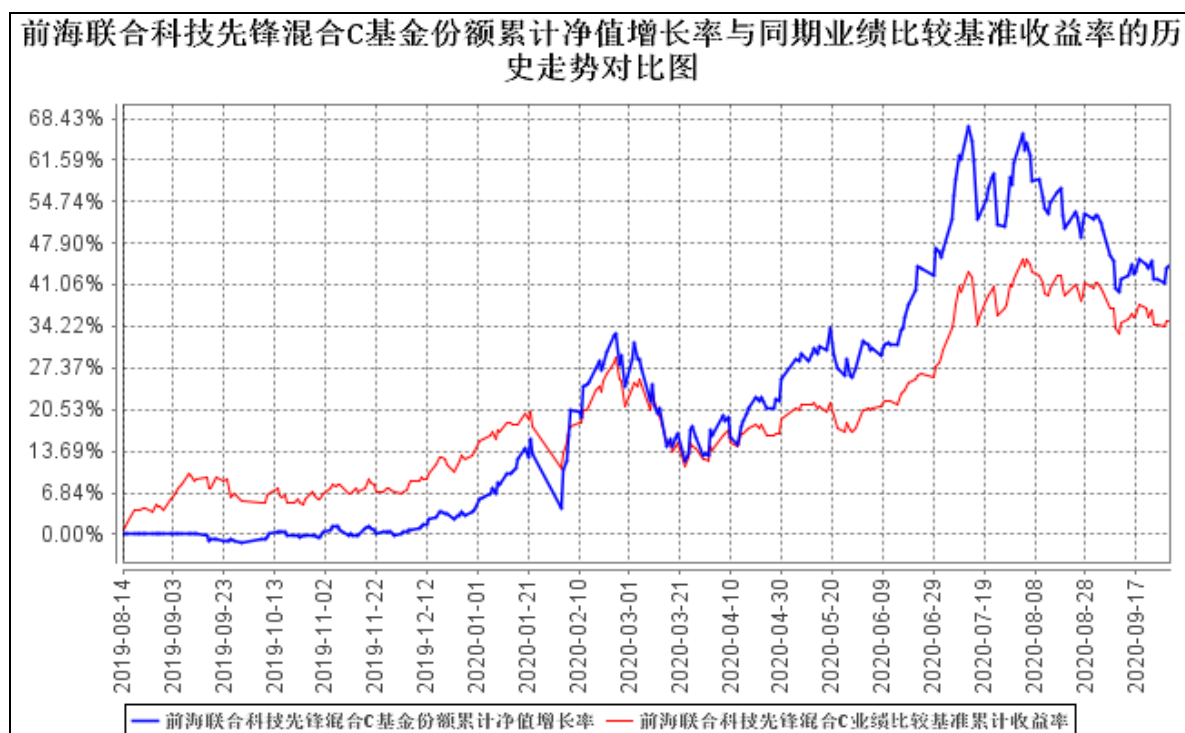
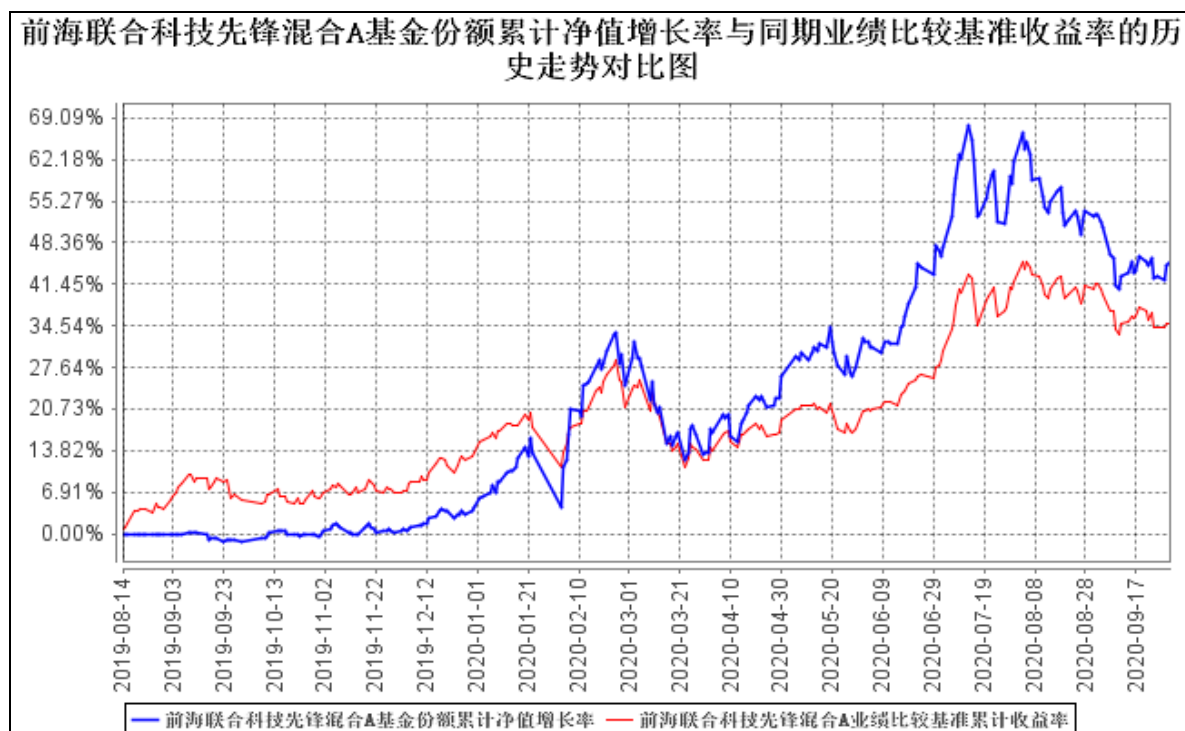
前海联合科技先锋混合 C

| 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 | -1.92% | 1.84% | 5.89% | 1.29% | -7.81% | 0.55% |
| 过去六个月 | 27.52% | 1.68% | 20.27% | 1.12% | 7.25% | 0.56% |
| 过去一年 | 46.14% | 1.71% | 27.90% | 1.18% | 18.24% | 0.53% |
| 自基金合 | 44.30% | 1.60% | 35.07% | 1.15% | 9.23% | 0.45% |

| | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|--|
| 同生效起 至今 | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|--|

注：本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

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



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至报告期末，本基金建仓期结束未满 1 年。

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 | | |
| 王静 | 本基金的基金经理 | 2019年8月14日 | - | 11年 | 王静女士，金融学硕士，CFA，11年证券投资研究经验。2009年7月至2016年4月任职于民生加银基金，先后从事钢铁、化工、交运、纺织服装、农业等行业研究。2016年5月加入前海联合基金，现任新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金兼新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月至2020年2月曾任新疆前海联合泳涛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年1月至2020年2月曾任新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年7月至2020年2月曾任新疆前海联合研究优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年9月至2020年2月曾任新疆前海联合润丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年12月至2020年2月曾任新疆前海联合先进制造灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2020年4月曾任新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金的基 |

| | | | | | |
|----|----------|-----------------|---|------|---|
| | | | | | 金经理。2017 年 8 月至 2020 年 4 月曾任新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 林材 | 本基金的基金经理 | 2020 年 2 月 18 日 | - | 13 年 | 林材先生，理学硕士，13 年证券投资基金投资研究经验。2011 年 10 月至 2015 年 7 月任金元顺安基金经理，2008 年 11 月至 2011 年 10 月任民生加银基金医药行业研究员、基金经理助理。2000 年 7 月至 2003 年 9 月曾任职于广州医药集团。2015 年 9 月加入前海联合基金。现任新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金兼新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金、新疆前海联合国民健康产业灵活配置混合型证券投资基金和新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合研究优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 7 月曾任新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 7 月曾任新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的基金经理。 |
| 张磊 | 本基金的基金经理 | 2020 年 6 月 8 日 | - | 7 年 | 张磊先生，清华大学工商管理硕士，7 年证券投资基金投资研究经验，先后从事 TMT、医药等行业研究。2013 年 7 月至 2017 年 2 月任华润元大基金管理有限公司投资管理部研究员，2017 年 2 月加入前海联合基金。现任新 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金兼新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金和新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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”为根据公司对外的公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司对外的公告的聘任日期和解聘日期。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年前三季度，上证综指上涨 5.50%，深证成指上涨 23.74%。上半年经济下滑明显，从中长期来看，经济在缓慢复苏，后市的走势将取决于基本面、政策和资金面的变化。上半年受到新冠疫情影响，资金主要流向了医疗和消费两大板块，但三季度高估值板块出现回调，波动较大。海外市场目前两大不确定因素：一是美国第二轮财政刺激法案的落地时间和力度，主要是影响利率与估值水平；二是美国最终大选结果，在 11 月大选落地之前，这些不确定性都较难预判，市场的风险偏好大概率仍会受到压制。

在投资策略方面，我们保持适当的谨慎，坚持自下而上精选优质个股，关注科技创新周期带来的优质龙头公司估值提升同时也关注业绩超预期的行业，把握估值低、有政策预期或有积极催化剂的板块。坚持从公司的基本面、估值出发，重点选取基本面坚实、具备核心竞争力、资产负债表健康、业绩具有稳定性的行业龙头公司，买入持有，以获取长期的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合科技先锋混合 A 基金份额净值为 1.4506 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.83%；截至本报告期末前海联合科技先锋混合 C 基金份额净值为 1.4430 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.92%；同期业绩比较基准收益率为 5.89%。

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 | 52,882,223.25 | 78.98 |
| | 其中：股票 | 52,882,223.25 | 78.98 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 13,953,073.62 | 20.84 |
| 8 | 其他资产 | 122,310.18 | 0.18 |
| 9 | 合计 | 66,957,607.05 | 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 | 34,508,924.09 | 51.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| | 应业 | | |
| E | 建筑业 | 5,217.68 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,603.40 | 0.02 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,876,128.08 | 17.87 |
| J | 金融业 | 1,343,440.00 | 2.02 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,121,730.00 | 1.69 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 434,420.00 | 0.65 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 280,000.00 | 0.42 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,297,760.00 | 4.96 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 52,882,223.25 | 79.57 |

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 | 002460 | 赣锋锂业 | 65,000 | 3,522,350.00 | 5.30 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,000 | 3,132,000.00 | 4.71 |
| 3 | 600570 | 恒生电子 | 30,300 | 2,987,277.00 | 4.49 |
| 4 | 300015 | 爱尔眼科 | 52,000 | 2,673,840.00 | 4.02 |
| 5 | 688111 | 金山办公 | 7,500 | 2,475,000.00 | 3.72 |
| 6 | 300253 | 卫宁健康 | 114,100 | 2,218,104.00 | 3.34 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 10,000 | 2,092,000.00 | 3.15 |
| 8 | 600588 | 用友网络 | 52,200 | 1,994,562.00 | 3.00 |
| 9 | 600486 | 扬农化工 | 20,000 | 1,754,000.00 | 2.64 |
| 10 | 600745 | 闻泰科技 | 15,000 | 1,752,900.00 | 2.64 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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调查以及处罚的情况的说明

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 | 31,079.74 |
| 2 | 应收证券清算款 | 36,787.28 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,515.09 |
| 5 | 应收申购款 | 51,928.07 |

| | | |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 122,310.18 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

| 项目 | 前海联合科技先锋混合 A | 前海联合科技先锋混合 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 20,847,561.46 | 16,530,440.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 15,995,898.72 | 16,760,962.64 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 11,843,013.10 | 12,364,863.21 |
| 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 | 25,000,447.08 | 20,926,539.61 |

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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 8 月 15 日发布公告，刘菲先生自 2020 年 8 月 15 日起不再担任公司总经理助理兼首席信息官。

§ 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科技先锋混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合科技先锋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

2020 年 10 月 28 日