

新疆前海联合沪深 300 指数型
证券投资基金
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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 1 月 22 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 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 前海联合沪深 300 |
| 交易代码 | 003475 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 11,544,296.08 份 |
| 投资目标 | 本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪 |

| | | |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
| | 标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。 | |
| 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 | 前海联合沪深 300A | 前海联合沪深 300C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003475 | 007039 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,360,812.26 份 | 6,183,483.82 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10月1日—2020年12月31日） | |
|-----------------|-----------------------------|---------------|
| | 前海联合沪深 300A | 前海联合沪深 300C |
| 1. 本期已实现收益 | 53,558.93 | 53,291.08 |
| 2. 本期利润 | 1,061,824.41 | 1,223,695.75 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2006 | 0.1980 |
| 4. 期末基金资产净值 | 9,177,532.16 | 10,512,579.96 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.7120 | 1.7001 |

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、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应基金代码。

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

前海联合沪深 300A

| 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 | 13.23% | 0.92% | 12.90% | 0.94% | 0.33% | -0.02% |
| 过去六个月 | 23.65% | 1.25% | 23.83% | 1.28% | -0.18% | -0.03% |
| 过去一年 | 35.51% | 1.43% | 25.86% | 1.36% | 9.65% | 0.07% |
| 过去三年 | 44.57% | 1.29% | 28.11% | 1.28% | 16.46% | 0.01% |
| 自基金合同生效起 | 71.20% | 1.13% | 44.07% | 1.14% | 27.13% | -0.01% |

| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

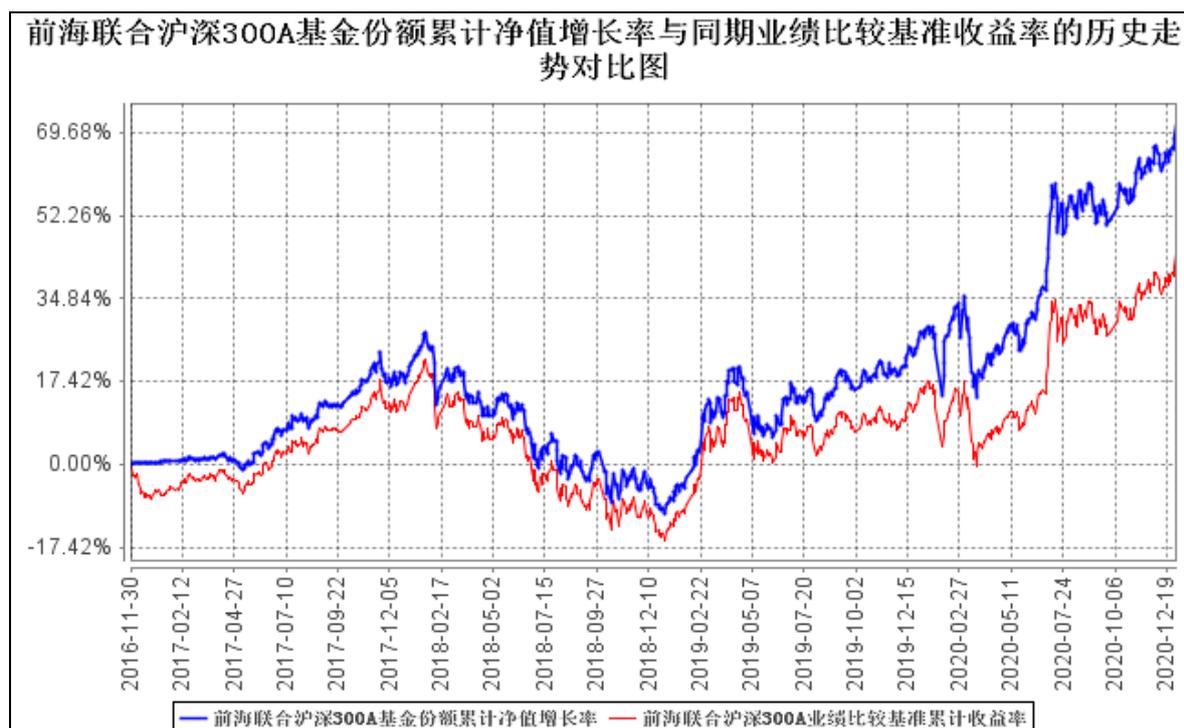
前海联合沪深 300C

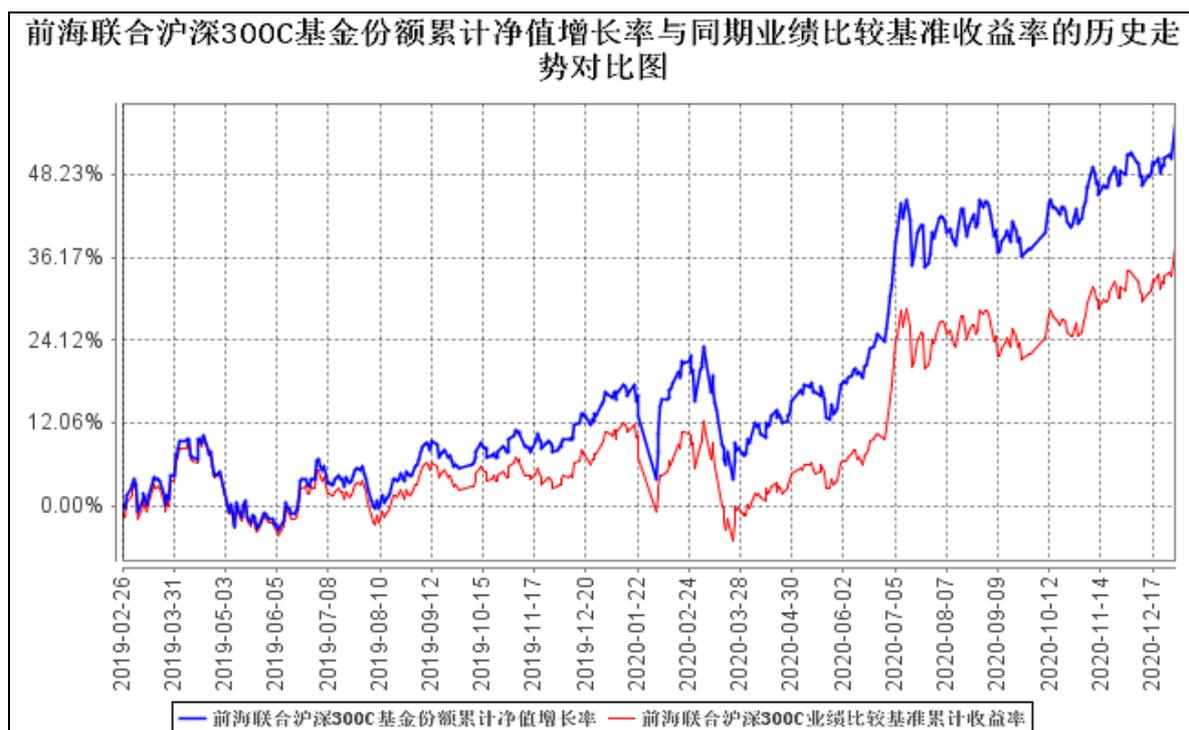
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 13.11% | 0.92% | 12.90% | 0.94% | 0.21% | -0.02% |
| 过去六个月 | 23.40% | 1.25% | 23.83% | 1.28% | -0.43% | -0.03% |
| 过去一年 | 34.94% | 1.43% | 25.86% | 1.36% | 9.08% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 55.35% | 1.29% | 37.72% | 1.26% | 17.63% | 0.03% |

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

2、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应基金代码。

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：本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码；前海联合沪深 300C 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起始日为 2019 年 2 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 | | |
| 张磊 | 本基金的基金经理 | 2020 年 7 月 7 日 | - | 7 年 | 张磊先生，清华大学工商管理硕士，7 年证券基金投资研究经验，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。现任新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金兼新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金和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。 |

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”为根据公司对对外公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司对对外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 年四季度，各大指数震荡向上。上证综指涨幅 7.92%，深证成指涨幅 12.11%，沪深 300 涨幅 13.6%。各行业龙头呈现出强者恒强的走势，大中市值公司优于小市值公司。分行业来看，有色、新能源、食品饮料、家电、汽车等行业涨幅靠前，TMT 整体表现较差。

四季度随着海外需求逐渐回升，出口业务进一步加速，基础原材料和工业产成品价格都有所上涨，顺周期板块走势强劲，这和我们在三季报中分析的基本一致。国内市场也从必须消费的稳定转为可选消费回升。中国的疫情控制的最好，四季度经济也恢复的最好，往后看到 2021 年二季度之前，国内经济同比保持增速难度不大。海外由于新冠感染基数大，虽然疫苗已经开始投入使用，但距离真正控制疫情仍需时日，所以预计海外的货币政策仍将宽松。报告期内，本基金也以此做了板块和个股权重的微调。

本基金紧密跟踪指数，并在一定程度优化，报告期内严格控制净值在合理偏离区间之内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合沪深 300A 基金份额净值为 1.7120 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.23%；截至本报告期末前海联合沪深 300C 基金份额净值为 1.7001 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.11%；同期业绩比较基准收益率为 12.90%。

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，本基金从 2020 年 1 月 22 日起至 2020 年 12 月 31 日止，连续 229 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。本基金管理人已经于 2020 年 4 月 24 日向证监会申请持续营销。

§ 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 | 18,427,044.02 | 92.50 |
| | 其中：股票 | 18,427,044.02 | 92.50 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 699,090.00 | 3.51 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：债券 | 699,090.00 | 3.51 |
| | 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 | 731,132.96 | 3.67 |
| 8 | 其他资产 | 63,521.66 | 0.32 |
| 9 | 合计 | 19,920,788.64 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | 190,028.40 | 0.97 |
| B | 采矿业 | 528,758.92 | 2.69 |
| C | 制造业 | 9,700,632.59 | 49.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 169,546.00 | 0.86 |
| E | 建筑业 | 204,287.40 | 1.04 |
| F | 批发和零售业 | 56,165.00 | 0.29 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 411,294.00 | 2.09 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 484,525.49 | 2.46 |
| J | 金融业 | 5,340,790.16 | 27.12 |
| K | 房地产业 | 440,885.02 | 2.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | 410,855.76 | 2.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 111,009.28 | 0.56 |
| 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 | 10,539.00 | 0.05 |
| Q | 卫生和社会工作 | 279,603.00 | 1.42 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 88,124.00 | 0.45 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 18,427,044.02 | 93.59 |

5.2.2 报告期末积极投资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积极投资股票。

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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 | 600519 | 贵州茅台 | 600 | 1,198,800.00 | 6.09 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 12,000 | 1,043,760.00 | 5.30 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 2,100 | 612,885.00 | 3.11 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 11,500 | 505,425.00 | 2.57 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 5,000 | 492,200.00 | 2.50 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,200 | 468,132.00 | 2.38 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 17,800 | 371,486.00 | 1.89 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 5,600 | 346,864.00 | 1.76 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 1,100 | 310,695.00 | 1.58 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 6,400 | 310,464.00 | 1.58 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 | 699,090.00 | 3.55 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 699,090.00 | 3.55 |

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 | 019640 | 20 国债 10 | 7,000 | 699,090.00 | 3.55 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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 | 1,725.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,057.35 |
| 5 | 应收申购款 | 54,738.74 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 63,521.66 |

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 | 前海联合沪深 300A | 前海联合沪深 300C |
|---------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,260,029.21 | 6,299,297.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,031,848.92 | 553,254.10 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 931,065.87 | 669,068.14 |
| 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 | 5,360,812.26 | 6,183,483.82 |

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

| | |
|------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 5,286,210.54 |
| 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 | 5,286,210.54 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 45.79 |

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 | 20201001-20201231 | 5,286,210.54 | - | - | 5,286,210.54 | 45.79% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，单一投资者持有基金份额比例过于集中可能引起产品的流动性风险，本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。</p> | | | | | | | |

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

经公司股东会 2020 年 11 月 11 日召开的 2020 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，夏正林先生接替冯梅女士担任公司独立董事。

§ 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沪深 300 指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合沪深 300 指数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

2021 年 1 月 22 日