

# 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 2020 年年度报告

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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	52
8.8 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贵金属投资明细 .....	53
8.9 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 .....	53
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
8.11 投资组合报告附注 .....	53
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	56
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8 其他重大事件 .....	60
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
12.1 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 .....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	前海联合泓元定开债券
基金主代码	005378
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017年12月6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
报告期末基金份额总额	5,822,903,071.07份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	<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、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金采取久期策略、期限结构策略、信用债投资策略等积极投资策略，在严格控股风险的前提下，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种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
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，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邱张斌	朱巍
	联系电话	0755-82780666	0571-87659806

	电子邮箱	service@qhlhfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-640-0099	95527
传真		0755-82780000	0571-88268688
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		深圳市宝安区兴业路 1100 号金利通大厦(前海人寿金融中心) T2 栋 33 层	杭州市延安路 368 号
邮政编码		518031	310006
法定代表人		王晓耕	沈仁康

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市宝安区兴业路 1100 号金利通大厦(前海人寿金融中心) T2 栋 33 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	372,690,691.87	342,773,497.77	365,045,594.51
本期利润	299,688,033.77	345,923,367.25	450,121,173.84
加权平均基金份额本期利润	0.0369	0.0479	0.0549
本期加权平均净值利润率	3.58%	4.67%	5.42%
本期基金份额净值增长率	3.81%	4.73%	6.45%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	10,037,935.24	35,261,420.26	24,141,170.17
期末可供分配基金份额利润	0.0017	0.0040	0.0041
期末基金资产净值	5,911,906,409.00	9,042,729,387.13	6,057,045,261.19
期末基金份额净值	1.0153	1.0249	1.0248
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	16.11%	11.84%	6.80%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

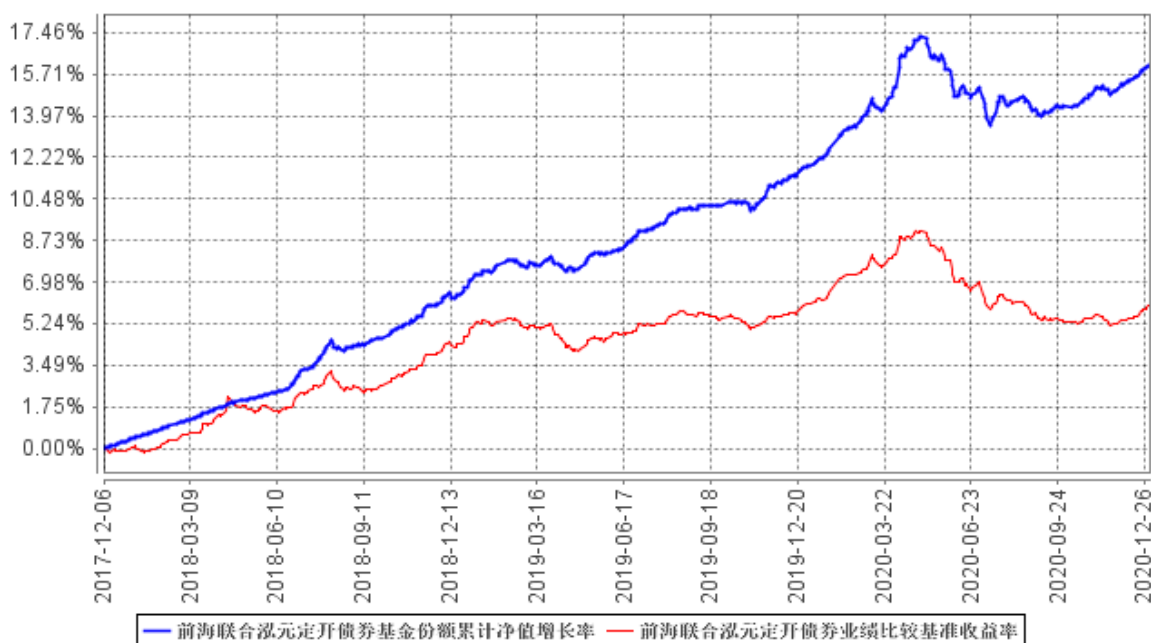
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.53%	0.04%	0.64%	0.04%	0.89%	0.00%
过去六个月	0.92%	0.08%	-0.85%	0.07%	1.77%	0.01%
过去一年	3.81%	0.11%	-0.06%	0.09%	3.87%	0.02%
过去三年	15.74%	0.07%	6.09%	0.07%	9.65%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.11%	0.07%	6.02%	0.07%	10.09%	0.00%

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。

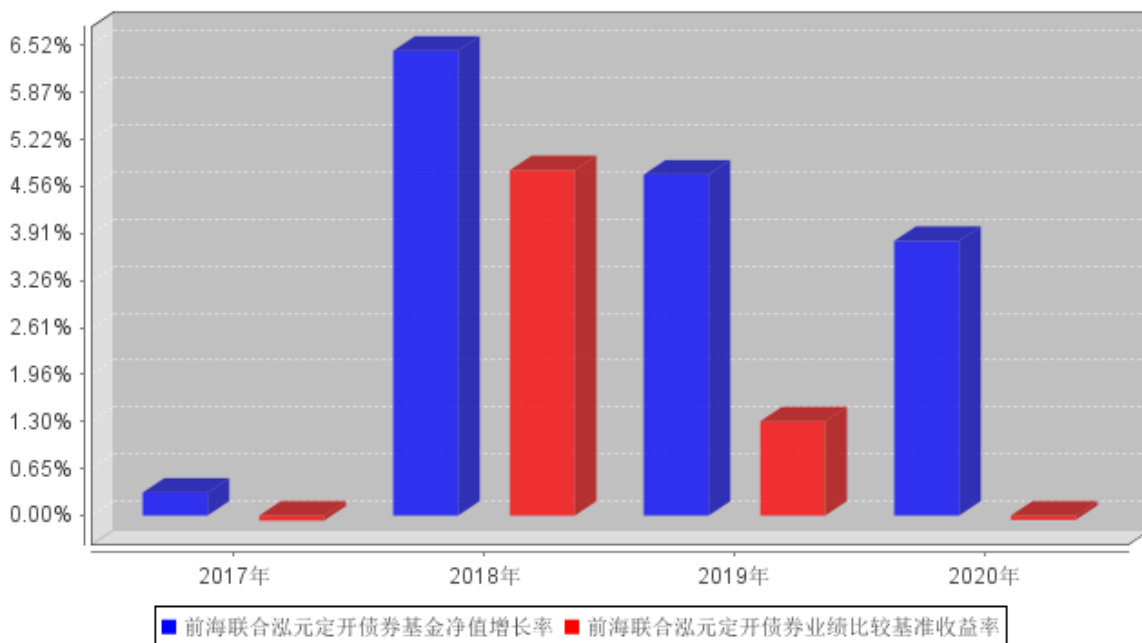
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

前海联合泓元定开债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合泓元定开债券自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2017 年 12 月 6 日生效，2017 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准



收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	0.4816	385,411,011.90	-	385,411,011.90	
2019	0.4720	360,237,241.31	-	360,237,241.31	
2018	0.4200	402,811,093.93	-	402,811,093.93	
合计	1.3736	1,148,459,347.14	-	1,148,459,347.14	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842号文批准，于2015年8月7日成立。公司注册资本2亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理33只开放式基金，包括2只货币市场基金、18只债券型基金、11只混合型基金、1只指数型基金和1只基金中基金（FOF），另管理15只专户理财产品，管理资产总规模超过533亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
敬夏玺	本基金的基金经理	2017年12月6日	-	10年	敬夏玺先生，中央财经大学金融学硕士，10年基金投资研究、交易经验。2011年7月至2016年5月任职于融通基金，历任债券交易员、固定收益部投资经理，管理公司债券专户产品。2010年7月至2011年7月任工银瑞信基金中央交易室交易员。2016年5月加入前海联合基金。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兼新疆前海联合添鑫3个月定期开放债券型证券投资基金、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、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、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金、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的基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 1 月曾任新疆前海联合海盈货币市场基金的基金经理，2018 年 9 月至 2019 年 12 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，2016 年 11 月至 2020 年 3 月曾任新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的基金经理，2017 年 5 月至 2020 年 3 月曾任新疆前海联合汇盈货币市场基金的基金经理。
张文	本基金的基金经理	2020 年 10 月 28 日	-	8 年	张文，硕士研究生，8 年证券投资研究交易经验。2019 年 9 月加入前海联合基金，任职于固定收益部。2016 年 11 月至 2019 年 9 月任深圳慈曜资产管理有限公司交易管理部交易主管，2014 年 5 月至 2016 年 9 月任第一创业证券股份有限公司资产管理部高级交易经理，2012 年 11 月至 2014 年 5 月任中

					山证券有限责任公司固定收益部交易员。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兼新疆前海联合汇盈货币市场基金、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。

#### 4.2 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》等有关法律法规和本基金合同的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公

平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 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。本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年是极不平凡的一年，如果回到年初，相信绝大多数人都想象不到新冠疫情会成为笼罩世界一整年的阴霾，它给我们的正常生活带来了极大的挑战，社交活动减少、出行受限、跨境人流锐减、经济陷入停滞等等。我国在严格的疫情防控下，经济生活有序的恢复，GDP 全年增长 2.3%，第四季度增长 6.5%，单季度增长回到疫情前水平，可能是全年唯一正增长的主要经济体，成为了全球经济当之无愧的稳定器。但即使是中国，我们仍未完全走出疫情的阴霾，经济生活的恢复结构非正常化，生产供给的恢复快于消费需求，物流强于人流，疫情防控及外需相关的产业快速反弹，餐饮娱乐及出行旅游等消费及内需相关的行业仍未恢复至常态。以美联储为首的全球央行为对冲经济衰退而采取的大规模宽松政策，推升了股票、地产、大宗商品等资产价格，贫富差距分化加大，持有相关资产的个人及企业的资产负债表明显改善，其他个人及企业则依旧受损。

回到债券市场，受到经济基本面前低后高以及央行适时调整流动性投放策略的影响，债券收益率维持宽幅波动，中低等级信用债面临的潜在风险高于利率债及优质的高评级信用债。本基金成立后以利率债的配置为主，辅以适度的杠杆操作增强收益，成立以来实现了净值正增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0153 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.81%，业绩比较基准收益率为-0.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，疫情还是我们生活及投资的重要主线。我相信未来是美好的，人类一定会战胜疫情，这是我们所有投资行为的前提，但在战胜疫情的这个过程中、在各个重要的时间节点上，我们仍然面临着非常多的不确定性，全球的经济恢复可能会迟到但一定会来到，货币流动性的拐点也是一样。对于债券市场，短期受制于经济增长的同比修复，但修复动能和时间跨度充满不确定性，全球经济的长期增长仍不容乐观，因此中期来看债券收益率若有足够的调整幅度，将会有一个不错的配置时间点。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人对公司各项内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至报告期末，本基金可供分配利润为 10,037,935.24 元。报告期内，本基金的基金管理人于 2020 年 1 月 15 日公告 2020 年度第一次分红，向截至 2020 年 1 月 16 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.045 元；于 2020 年 3 月 11 日公告 2020 年度第二次分红，向截至 2020 年 3 月 12 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.0616 元；于 2020 年 5 月 13 日公告 2020 年度第三次分红，向截至 2020 年 5 月 14 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发

红利 0.08 元；于 2020 年 6 月 17 日公告 2020 年度第四次分红，向截至 2020 年 6 月 18 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.07 元；于 2020 年 10 月 21 日公告 2020 年度第五次分红，向截至 2020 年 10 月 22 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.14 元；于 2020 年 12 月 16 日公告 2020 年度第六次分红，向截至 2020 年 12 月 17 日止在本基金注册登记机构新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.085 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在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的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，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对基金份额持有人进行了 6 次利润分配，分配金额为 385,411,011.90 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的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 2020 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 24824 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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(以下简称“前海联合泓元定开债券基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了前海联合泓元定开债券基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于前海联合泓元定开债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>前海联合泓元定开债券基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估前海联合泓元定开债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算前海联合泓</p>

	<p>元定开债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督前海联合泓元定开债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对前海联合泓元定开债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海联合泓元定开债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	李隐煜
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,265,577.43	892,872.21
结算备付金		-	385,880.27
存出保证金		100,004.58	45,791.51
交易性金融资产	7.4.7.2	6,824,989,200.00	9,447,790,200.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,964,889,200.00	8,415,988,700.00
资产支持证券投资		860,100,000.00	1,031,801,500.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	112,445,125.78	188,752,888.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,938,799,907.79	9,637,867,632.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,024,717,942.92	592,399,449.50
应付证券清算款		-	24,903.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,001,652.19	1,534,267.52
应付托管费		350,578.29	536,993.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	89,025.02	120,582.20
应交税费		216,163.97	262,908.41
应付利息		283,136.40	25,140.18

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	235,000.00	234,000.00
负债合计		1,026,893,498.79	595,138,244.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	5,822,903,071.07	8,822,903,071.07
未分配利润	7.4.7.10	89,003,337.93	219,826,316.06
所有者权益合计		5,911,906,409.00	9,042,729,387.13
负债和所有者权益总计		6,938,799,907.79	9,637,867,632.06

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0153 元，基金份额总额 5,822,903,071.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		358,502,211.25	418,977,039.02
1. 利息收入		360,638,164.41	350,021,252.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	149,880.63	289,509.99
债券利息收入		321,365,666.07	317,888,676.96
资产支持证券利息收入		39,077,740.70	31,302,722.09
买入返售金融资产收入		44,877.01	540,343.71
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		70,866,704.94	65,805,916.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	72,777,585.42	66,750,299.64
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-1,910,880.48	-944,382.85
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-73,002,658.10	3,149,869.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		58,814,177.48	73,053,671.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,804,878.01	16,743,704.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,881,707.34	5,764,451.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	80,356.03	102,865.73
5. 利息支出		35,431,873.35	49,857,765.00
其中：卖出回购金融资产支出		35,431,873.35	49,857,765.00
6. 税金及附加		342,962.75	274,856.76
7. 其他费用	7.4.7.20	272,400.00	310,028.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		299,688,033.77	345,923,367.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		299,688,033.77	345,923,367.25

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,822,903,071.07	219,826,316.06	9,042,729,387.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	299,688,033.77	299,688,033.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,000,000,000.00	-45,100,000.00	-3,045,100,000.00
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-3,000,000,000.00	-45,100,000.00	-3,045,100,000.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-385,411,011.90	-385,411,011.90
五、期末所有者权益（基金净值）	5,822,903,071.07	89,003,337.93	5,911,906,409.00
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	5,910,737,773.32	146,307,487.87	6,057,045,261.19

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	345,923,367.25	345,923,367.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,912,165,297.75	87,832,702.25	2,999,998,000.00
其中:1.基金申购款	2,912,165,297.75	87,832,702.25	2,999,998,000.00
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-360,237,241.31	-360,237,241.31
五、期末所有者权益(基金净值)	8,822,903,071.07	219,826,316.06	9,042,729,387.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

    
 王晓耕                                    王晓耕                                    陈艳  
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2071号《关于准予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注册的批复》进行募集,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,010,000,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1013 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,010,000,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《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合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即以封闭期内封闭运作和封闭期与封闭期之间定期开放的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日



次日起(包括该日)至 3 个月对应日的前一日止。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)至 3 个月对应日的前一日止。首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)至 3 个月对应日的前一日止,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上最长不超过 20 个工作日,最短不少于 5 个工作日。基金管理人应在每个封闭期结束前公布开放期和下一封闭期的具体时间安排。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,001,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,具体为债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、中小企业私募债券、同业存单等)、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票或权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:在封闭期,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日内,本基金投资不受上述比例限制。在开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但在每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简

称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益;

对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经公告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	1,265,577.43	892,872.21
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计:	1,265,577.43	892,872.21

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	501,785,356.72	500,506,000.00
	银行间市场	5,449,481,277.49	5,464,383,200.00
	合计	5,951,266,634.21	5,964,889,200.00
资产支持证券	858,649,275.08	860,100,000.00	1,450,724.92
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,809,915,909.29	6,824,989,200.00	15,073,290.71
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	597,254,658.09	604,327,700.00
	银行间市场	7,735,546,006.05	7,811,661,000.00
	合计	8,332,800,664.14	8,415,988,700.00
资产支持证券	1,026,913,587.05	1,031,801,500.00	4,887,912.95
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,359,714,251.19	9,447,790,200.00	88,075,948.81

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,995.83	611.91
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	173.60
应收债券利息	106,115,678.14	183,637,547.23
应收资产支持证券利息	6,327,406.81	5,114,534.73
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	45.00	20.60
合计	112,445,125.78	188,752,888.07

## 7.4.7.6 其他资产

无余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	89,025.02	120,582.20
合计	89,025.02	120,582.20

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	235,000.00	234,000.00
合计	235,000.00	234,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日



	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,822,903,071.07	8,822,903,071.07
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000,000.00	-3,000,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,822,903,071.07	5,822,903,071.07

注：1、申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

2、根据《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合同》、《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招募说明书》、《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开放日常申购、赎回业务的公告》及《关于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提前结束开放期并进入下一封闭期的公告》的相关规定，本期本基金开放期分别为2020年4月1日(含)至2020年4月8日(含)、2020年7月9日(含)至2020年7月22日(含)和、2020年10月23日(含)至2020年11月19日(含)。开放期内本基金接受申购及赎回申请，其余时间为本基金封闭期，不接受申购及赎回申请。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,261,420.26	184,564,895.80	219,826,316.06
本期利润	372,690,691.87	-73,002,658.10	299,688,033.77
本期基金份额交易产生的变动数	-12,503,164.99	-32,596,835.01	-45,100,000.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-12,503,164.99	-32,596,835.01	-45,100,000.00
本期已分配利润	-385,411,011.90	-	-385,411,011.90
本期末	10,037,935.24	78,965,402.69	89,003,337.93

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	99,344.63	111,561.22
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	49,372.01	26,394.59
其他	1,163.99	151,554.18
合计	149,880.63	289,509.99

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	72,777,585.42	66,750,299.64
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	72,777,585.42	66,750,299.64

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,964,251,985.89	13,600,797,659.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,687,256,279.11	13,257,372,511.43
减：应收利息总额	204,218,121.36	276,674,848.21
买卖债券差价收入	72,777,585.42	66,750,299.64

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	514,306,342.05	463,748,243.38
减：卖出资产支持证券成本总额	493,337,361.26	444,241,882.83
减：应收利息总额	22,879,861.27	20,450,743.40
资产支持证券投资收益	-1,910,880.48	-944,382.85

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.16 股利收益**

无。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-73,002,658.10	3,149,869.48
——股票投资	-	-
——债券投资	-69,565,470.07	368,295.00
——资产支持证券投资	-3,437,188.03	2,781,574.48
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-73,002,658.10	3,149,869.48

**7.4.7.18 其他收入**

无。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	3,179.78	2,410.73
银行间市场交易费用	77,176.25	100,455.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	80,356.03	102,865.73

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
审计费用	115,000.00	102,828.64

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	900.00	1,200.00
汇划费	200.00	-
账户维护费	36,300.00	36,000.00
律师费用	-	40,000.00
持有人大会费用	-	10,000.00
合计	272,400.00	310,028.64

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 20 日公告 2021 年度第一次分红，向截至 2021 年 1 月 21 日止在本基金注册登记人新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.023 元。

本基金的基金管理人于 2021 年 2 月 24 日公告 2021 年度第二次分红，向截至 2021 年 2 月 25 日止在本基金注册登记人新疆前海联合基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.035 元。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新疆前海联合基金管理有限公司（“新疆前海联合”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人
凯信恒有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.4 权证交易**

无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,804,878.01	16,743,704.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 17 日及上年度可比期间，支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

2、根据基金份额持有人大会表决通过的《关于申请降低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管理费率有关事项的议案》，自 2019 年 4 月 18 日起，支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,881,707.34	5,764,451.14

注：1、自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 17 日及上年度可比期间，支付基金托管人浙商银行的

托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

2、根据基金份额持有人大会表决通过的《关于申请降低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托管费率有关事项的议案》，自 2019 年 4 月 18 日起，支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.07% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.07% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浙商银行	-	-	-	-	4,591,654,000.00	306,415.60
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浙商银行	-	291,238,599.18	-	-	16,508,676,000.00	1,626,706.17

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00
报告期初持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1718%	0.1134%

注：本基金管理人投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	浙商银行	1,265,577.43	99,344.63	892,872.21

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020年1月16日	-	2020年1月16日	0.0450	39,703,063.82	-	39,703,063.82	
2	2020年3月12日	-	2020年3月12日	0.0616	54,349,082.92	-	54,349,082.92	
3	2020年5月14日	-	2020年5月14日	0.0800	70,583,224.57	-	70,583,224.57	



4	2020年 6月18 日	-	2020 年6月 18日	0.0700	61,760,321.50	-	61,760,321.50
5	2020年 10月22 日	-	2020 年10 月22 日	0.1400	109,520,642.99	-	109,520,642.99
6	2020年 12月17 日	-	2020 年12 月17 日	0.0850	49,494,676.10	-	49,494,676.10
合计	-	-		0.4816	385,411,011.90	-	385,411,011.90

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,024,717,942.92元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200406	20农发06	2021年1月 4日	99.76	1,100,000.00	109,736,000.00
190204	19国开04	2021年1月 4日	101.92	500,000.00	50,960,000.00
190408	19农发08	2021年1月 4日	101.26	500,000.00	50,630,000.00
160310	16进出10	2021年1月 4日	98.90	1,000,000.00	98,900,000.00
160418	16农发18	2021年1月 4日	101.33	1,000,000.00	101,330,000.00
140211	14国开11	2021年1月 6日	107.85	73,000.00	7,873,050.00
160408	16农发08	2021年1月	100.26	1,600,000.00	160,416,000.00

		4 日			
200309	20 进出 09	2021 年 1 月 4 日	99.98	1,000,000.00	99,980,000.00
160213	16 国开 13	2021 年 1 月 4 日	98.32	4,100,000.00	403,112,000.00
170215	17 国开 15	2021 年 1 月 4 日	104.46	43,000.00	4,491,780.00
合计				10,916,000	1,087,428,830.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，具体为债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、中小企业私募债券、同业存单等)、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人浙商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	209,716,000.00	-
合计	209,716,000.00	-

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,022,820,000.00	768,815,000.00
合计	1,022,820,000.00	768,815,000.00

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	2,564,706,000.00	2,563,306,500.00
AAA 以下	560,425,000.00	499,463,200.00
未评级	1,607,222,200.00	4,584,404,000.00
合计	4,732,353,200.00	7,647,173,700.00

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	820,128,000.00	951,573,500.00
AAA 以下	-	80,228,000.00
未评级	39,972,000.00	-
合计	860,100,000.00	1,031,801,500.00

注：长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回

情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因定期开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,024,717,942.92 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金处于封闭期。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,265,577.43	-	-	-	1,265,577.43
存出保证金	100,004.58	-	-	-	100,004.58
交易性金融资产	1,908,811,000.00	3,411,528,000.00	1,504,650,200.00	-	6,824,989,200.00
应收利息	-	-	-	112,445,125.78	112,445,125.78
资产总计	1,910,176,582.01	3,411,528,000.00	1,504,650,200.00	112,445,125.78	6,938,799,907.79
负债					
卖出	1,024,717,942.92	-	-	-	1,024,717,942.92

回购金融资产款					
应付管理人报酬	-	-	-	1,001,652.19	1,001,652.19
应付托管费	-	-	-	350,578.29	350,578.29
应付交易费用	-	-	-	89,025.02	89,025.02
应付利息	-	-	-	283,136.40	283,136.40
应交税费	-	-	-	216,163.97	216,163.97
其他负债	-	-	-	235,000.00	235,000.00
负债总计	1,024,717,942.92	-	-	2,175,555.87	1,026,893,498.79
利率敏感度缺口	885,458,639.09	3,411,528,000.00	1,504,650,200.00	110,269,569.91	5,911,906,409.00
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	892,872.21	-	-	-	892,872.21
结算备付金	385,880.27	-	-	-	385,880.27
存出保证金	45,791.51	-	-	-	45,791.51
交易	1,779,246,000.00	4,548,241,200.00	3,120,303,000.00	-	9,447,790,200.00

性金融资产					
应收利息	-	-	-	188,752,888.07	188,752,888.07
资产总计	1,780,570,543.99	4,548,241,200.00	3,120,303,000.00	188,752,888.07	9,637,867,632.06
负债					
卖出回购金融资产款	592,399,449.50	-	-	-	592,399,449.50
应付证券清算款	-	-	-	24,903.52	24,903.52
应付管理人报酬	-	-	-	1,534,267.52	1,534,267.52
应付托管费	-	-	-	536,993.60	536,993.60
应付交易费用	-	-	-	120,582.20	120,582.20
应付利息	-	-	-	25,140.18	25,140.18
应交税费	-	-	-	262,908.41	262,908.41
其他负债	-	-	-	234,000.00	234,000.00
负债总计	592,399,449.50	-	-	2,738,795.43	595,138,244.93
利率敏感度缺口	1,188,171,094.49	4,548,241,200.00	3,120,303,000.00	186,014,092.64	9,042,729,387.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。



**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	42,159,499.32	80,764,779.74
市场利率上升 25 个基点	-41,628,325.34	-79,551,635.03	

**7.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 6,824,989,200.00 元，无属于第一或第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 9,447,790,200.00 元，无第一或第三层次）。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	6,824,989,200.00	98.36
	其中：债券	5,964,889,200.00	85.96
	资产支持证券	860,100,000.00	12.40
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	1,265,577.43	0.02
8	其他各项资产	112,545,130.36	1.62
9	合计	6,938,799,907.79	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,614,218,200.00	61.13
	其中：政策性金融债	1,816,938,200.00	30.73
4	企业债券	430,289,000.00	7.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	897,562,000.00	15.18
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,022,820,000.00	17.30
9	其他	-	-
10	合计	5,964,889,200.00	100.90

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180406	18 农发 06	4,150,000	444,174,500.00	7.51
2	160213	16 国开 13	4,100,000	403,112,000.00	6.82
3	1928034	19 交通银行 01	4,000,000	400,600,000.00	6.78
4	2020008	20 北京银行 小微债 02	3,000,000	295,890,000.00	5.00
5	112093840	20 广东南海农商行 CD004	3,000,000	292,110,000.00	4.94

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1889391	18 建元 21A2_bc	3,500,000	214,095,000.00	3.62
2	1989018	19 中盈万家 1A2	3,000,000	172,800,000.00	2.92
3	159340	19 花 02A1	1,400,000	140,112,000.00	2.37
4	138818	兴恒 2A	890,000	88,875,400.00	1.50
5	168613	智禾 01A	890,000	88,715,200.00	1.50
6	168436	惠盈 01A	890,000	88,652,900.00	1.50
7	139944	蚁信 09A	400,000	39,972,000.00	0.68
8	1989060	19 德宝天元 1B_bc	500,000	10,445,000.00	0.18
9	1689171	16 居融 1A	500,000	8,745,000.00	0.15
10	1989107	19 建元 2A1_bc	250,000	7,687,500.00	0.13

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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

#### 1. 19 交通银行 01 发债主体被监管处罚事件：

2020 年 4 月 20 日，根据银保监罚决字（2020）6 号，因理财产品数量漏报；资金交易信息漏报严重；贸易融资业务漏报等案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，交通银行被银保监会处以 260 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为交通银行股东背景良好，净资产规模大，经营情况良好，且交通银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，对交通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。

本基金投资于交通银行的决策程序说明：基于交通银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于交通银行，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，认为上述事项对交通银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

#### 2. 20 北京银行小微债 01、20 北京银行小微债 02 发债主体被监管处罚事件：

（1）2020 年 5 月 14 日，根据京汇罚（2020）6 号，因未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料等案由，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条，国家外汇管理局北京外汇管理部责令北京银行整改，并给予警告以及 14 万元的罚款。

（2）2020 年 7 月 11 日，根据京银保监罚决字（2020）23 号，因同业投资对资产转让业务承担回购义务，同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露，收费管理政策执行不严、违规

收取相关费用，个人贷款自主支付管理薄弱、贷款资金违规流入股市、房市，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十八条，北京银保监局责令北京银行整改，并给予 150 万元的罚款。

(3) 2020 年 12 月 23 日，根据京银保监罚决字（2020）41 号，因北京银行下辖西单支行违规出具与事实不符的询证函回函等违法违规案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，北京银保监局责令北京银行整改，并给予 350 万元的罚款。

(4) 2020 年 12 月 30 日，根据京银保监罚决字（2020）45 号，因对外销售虚假金融产品；出具与事实不符的单位定期存款开户证实书等违法违规案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，北京银保监局责令北京银行整改，并给予 3940 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为北京银行净资产规模大，经营情况良好，且北京银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，对北京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。

本基金投资于北京银行的决策程序说明：基于北京银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于北京银行，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，认为上述事项对北京银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

### 3. 19 杭州银行二级发债主体被监管处罚事件：

(1) 2020 年 1 月 3 日，根据浙银保监罚决字（2020）5 号，因贷后管理不到位，流动资金贷款挪用入房地产企业等案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，杭州银行被浙江银保监局处以 50 万元的罚款。

(2) 2020 年 1 月 16 日，根据浙银保监罚决字（2020）12 号，因虚增存贷款；个人经营性贷款管理不审慎，贷款资金被挪用于购房等案由，依据《中华人民共和国商业银行法》第七十四条；《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，杭州银行被浙江银保监局处以 225 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为杭州银行净资产规模大，经营情况良好，且杭州银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，对杭州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。

本基金投资于杭州银行的决策程序说明：基于杭州银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于杭州银行，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，认为上述事项对杭州银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金

运作无影响。

#### 4.16 国开 13 发债主体被监管处罚事件：

2020 年 12 月 25 日，根据银保监罚决字（2020）67 号，因为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况等案由，国家开发银行被银保监会处以 4880 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为国家开发银行资产规模大，经营情况良好，实力很强，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对国家开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。

本基金投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于国家开发银行，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，认为该事项对国家开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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	100,004.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	112,445,125.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,545,130.36

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2	2,911,451,535.54	5,822,903,071.07	100.00%	-	-

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

无。

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.00	0.17	10,001,000.00	0.17	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000.00	0.17	10,001,000.00	0.17	3年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年12月6日）基金份额总额	10,010,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	8,822,903,071.07
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	3,000,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,822,903,071.07

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 经公司股东会 2020 年 4 月 21 日召开的 2020 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，邓清泉先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由乔宗利先生担任公司第二届董事会董事。经公司第二届董事会 2020 年 4 月 30 日召开的 2020 年第 8 次临时会议与会董事一致审议通过，乔宗利先生担任公司第二届董事会副董事长。

2. 本基金管理人于 2020 年 6 月 30 日发布公告，张永任先生自 2020 年 6 月 29 日起担任公司总经理助理。

3. 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。

4. 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。

5. 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对基金 2020 年年报进行审计，该事务所自 2017 年 12 月 6 日基金成立以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 115,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

（2）券商选择程序：

- 1) 券商研究质量与研究服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	911,562,149.28	100.00%	6,615,214,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第一次分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 1 月 15 日
2	前海联合泓元定开债券基金 2019 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 1 月 20 日
3	关于提醒直销网上交易系统投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 1 月 23 日
4	前海联合基金关于在疫情防控期间可选择官网 APP 等进行线上基金业务办理的提示	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 1 月 31 日
5	前海联合泓元定开债券基金 2020	上海证券报、中国证	2020 年 3 月 11 日

	年第二次分红公告	监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
6	前海联合基金关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
7	前海联合泓元定开债券基金开放日常申购、赎回的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 28 日
8	关于前海联合基金暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 31 日
9	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
10	前海联合泓元定开债券基金 2019 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 4 月 29 日
11	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第三次分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 5 月 13 日
12	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第四次分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 6 月 17 日
13	关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传有效身份证影印件并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 6 月 24 日
14	关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传有效身份证影印	上海证券报、中国证监会基金电子披露网	2020 年 6 月 29 日

	件并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	站及基金管理人网站	
15	前海联合泓元定开债券基金开放日常申购、赎回的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 7 月 4 日
16	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 7 月 21 日
17	前海联合泓元定开债券基金 2020 年中期报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 8 月 29 日
18	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第五次分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 10 月 21 日
19	前海联合泓元定开债券基金开放日常申购、赎回的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 10 月 22 日
20	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 10 月 28 日
21	前海联合泓元定开债券基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 10 月 29 日
22	前海联合泓元定开债券基金 2020 年第六次分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 16 日
23	前海联合基金关于调整部分基金在直销柜台首次申购及追加申购单笔最低金额的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 30 日

24	前海联合基金公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	-----------------------------	------------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20200101-20201231	8,812,902,071.07	-	3,000,000,000.00	5,812,902,071.07	99.83%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准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募集的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

### 13.2 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。

### 13.3 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 3 月 30 日