

# 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 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年4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2021年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海联合泓旭定开债券
交易代码	008386
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020年7月23日
报告期末基金份额总额	209,999,999.99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	<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，长期平均风险和预期收益率低

	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	上海银行股份有限公司

### § 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（2021年1月1日—2021年3月31日）
1. 本期已实现收益	1,412,292.58
2. 本期利润	1,449,292.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0069
4. 期末基金资产净值	214,040,252.26
5. 期末基金份额净值	1.0192

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。

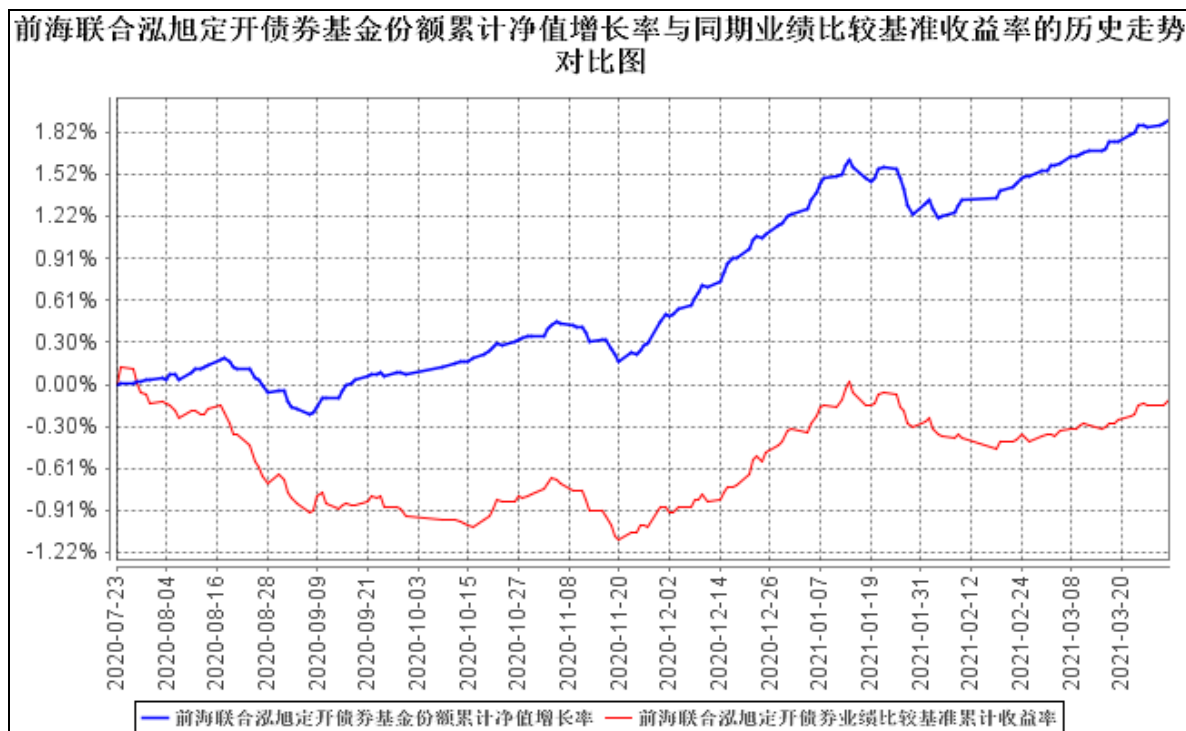
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	0.68%	0.04%	0.20%	0.04%	0.48%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.04%	0.84%	0.04%	1.01%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.92%	0.04%	-0.12%	0.05%	2.04%	-0.01%

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：1、本基金的基金合同于2020年7月23日生效，截至报告期末，本基金成立未满1年。

2、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		
敬夏玺	本基金的基金经理	2020年7月23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

				<p>司债券专户产品。</p> <p>2010年7月至2011年7月任工银瑞信基金中央交易室交易员。</p> <p>2016年5月加入前海联合基金。现任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、新疆前海联合泓元纯债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。</p>
--	--	--	--	--

					2019 年 12 月至 2021 年 1 月新疆前海联合润盈短债债券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

2021 年一季度，国内经济基本面继续改善，在疫苗全球逐步推进的条件下，外需表现依旧强劲。随着美国疫苗普及率快速提升，经济快速反弹的预期强烈，导致美债收益率快速上行，导致全球资本市场面临重新定价压力，但由于国内货币政策及债券收益率的调整先于海外，因此国内债券市场表现相对稳定。本组合维持了中短久期高等级债券的配置，在资金面较稳定的时候维持了一定的杠杆操作。

展望未来一个季度，在经济基本面继续改善的预期下，债券市场可能仍未到趋势性看多的窗

口，未来需要关注海外经济复苏进程，以及国内经济数据的边际变化，来调整组合的配置。

#### 4.5 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1.0192元；本报告期基金份额净值增长率为0.68%，业绩比较基准收益率为0.20%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	281,348,000.00	98.44
	其中：债券	281,348,000.00	98.44
	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	434,166.16	0.15
8	其他资产	4,010,299.08	1.40
9	合计	285,792,465.24	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	242,228,000.00	113.17
	其中：政策性金融债	81,046,000.00	37.86
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	39,120,000.00	18.28
9	其他	-	-
10	合计	281,348,000.00	131.45

### 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	112009483	20 浦发银行 CD483	400,000	39,120,000.00	18.28
2	180211	18 国开 11	300,000	30,417,000.00	14.21
3	190214	19 国开 14	300,000	30,009,000.00	14.02
4	180204	18 国开 04	200,000	20,620,000.00	9.63
5	1820049	18 贵阳银行 绿色金融 01	200,000	20,210,000.00	9.44

### 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国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

#### 5.9.3 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。



## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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

1.18 国开 11、19 国开 14、18 国开 04 发债主体被监管处罚事项：

(1) 2020 年 10 月 26 日，根据京汇罚〔2020〕32、33 号，因违反银行交易记录管理规定、违规开展外汇交易，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条、第四十九条，国家开发银行被国家外汇管理局北京外汇管理部处以合计 120 万元的罚款。

(2) 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。

(3) 2020 年 4 月 1 日-2021 年 3 月 31 日，国家开发银行海南省分行及浙江省分行由于擅自提供对外担保；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规行为，被当地外汇管理局、银保监局等监管机构处以罚款合计 4511.16 万元，并没收违法所得 1097.91 万元。

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。

2.18 贵阳银行绿色金融 01 发债主体被监管处罚事项：

2020 年 6 月 28-29 日，根据贵银保监罚决字(2020)4-12 号，贵阳银行因重要岗位轮岗执行不到位；向关系人发放信用贷款等案由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等，贵阳银行被贵州银保监局处以合计 275 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为贵阳银行资产规模大，经营情况良好，且贵阳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，该事项对贵阳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。

本基金投资于贵阳银行的决策程序说明：基于贵阳银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于贵阳银行，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，认为该事项对贵阳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 招商银行小微债01发债主体被监管处罚事项:

(1) 2020年9月29日,根据深外管检[2020]76号,因违反外汇市场交易管理行为,依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条第五项、第四十九项规定,国家外汇管理局深圳市分局责令招商银行改正,并处以罚款人民币120万元,对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分。

(2) 2020年11月27日,根据深外管检[2020]92号,因违反规定办理结汇、售汇的行为,依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条第三项规定,国家外汇管理局深圳市分局责令招商银行改正,并处以罚款人民币55万元,没收违法所得129万元人民币。

基金管理人经审慎分析,认为招商银行净资产规模大,经营情况良好,且招商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比例低,上述事项对招商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。

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

### 4.18 民生银行01发债主体被监管处罚事项:

(1) 2020年7月14日,根据银保监罚决字〔2020〕43号,民生银行因违反宏观调控政策,违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资等案由,被银保监会没收违法所得296.47万元,并处罚款10486.47万元。

(2) 2020年11月26日,根据京汇罚〔2020〕44号,因违反规定办理售汇业务等,根据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条、第四十八条,民生银行被北京外汇管理局没收违法所得191万元人民币,处80万元人民币罚款,并给予警告。

(3) 2020年4月1日-2021年3月31日,民生银行四川、山东、宁波、河南、青海分行等5家分支机构因贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位等违法违规行为受到当地银保监局行政处罚,共计罚款金额130万元。

基金管理人经审慎分析,认为民生银行净资产规模大,经营情况良好,且民生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比例低,上述事项对民生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。

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

#### 5.19 长沙银行小微债 01 发债主体被监管处罚事项：

(1) 2020年7月30日，根据湘银保监罚决字（2020）62、64号，因未将主要股东的关联方纳入长沙银行的关联方，导致长沙银行重大关联交易未按规定程序审批；贷后检查不到位，贷款资金被挪用，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，长沙银行被湖南银保监局处以合计60万元的罚款。

(2) 2020年10月9日，根据湘银保监罚决字（2020）70号，因个人消费贷款贷款三查不实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，长沙银行被湖南银保监局处以40万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为长沙银行资产规模大，经营情况良好，且长沙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，该事项对长沙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。

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

#### 6.19 宁波银行小微债 01 发债主体被监管处罚事件：

(1) 2020年10月16日，根据甬银保监罚决字（2020）48号，因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，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，宁波银保监局对宁波银行处以30万元的罚款，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。

(2) 2020年11月7日，根据京银保监罚决字（2020）34号，因办理融资性保函违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，北京银保监局责令宁波银行北京分行改正，并给予30万元罚款的行政处罚。

(3) 2020年12月10日，根据苏州银保监罚决字（2020）35号，因贷款管理严重违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，宁波银行苏州分行被苏州银保监局处以90万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为宁波银行资产规模大，经营情况良好，且宁波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，该事项对宁波银行自身信用基

本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

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

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,010,299.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,010,299.08

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	209,999,999.99
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	209,999,999.99

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	10,001,000.00
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	10,001,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例 (%)	4.76

### 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 报告期末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	4.76	10,001,000.00	4.76	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	4.76	10,001,000.00	4.76	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。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20210101-20210331	199,998,999.99	-	-	199,998,999.99	95.24%
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资份额。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及各基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本基金管理人就旗下 25 只证券投资基金增加侧袋机制相关内容并相应对相关法律文件进行修订，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的相关公告。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准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募集的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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。

### 10.2 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。

### 10.3 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 4 月 22 日