

新疆前海联合泰瑞纯债债券型
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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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 | 前海联合泰瑞纯债 | |
| 交易代码 | 008636 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 8 月 13 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,199,770.99 份 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准收益。 | |
| 投资策略 | 本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金采用期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等积极的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用潜在投资机会，实现组合资产的增值。 | |
| 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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 前海联合泰瑞纯债 A | 前海联合泰瑞纯债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008636 | 008703 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 693,133.39 份 | 506,637.60 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（2021年1月1日—2021年3月31日） | |
|-----------------|---------------------------|------------|
| | 前海联合泰瑞纯债 A | 前海联合泰瑞纯债 C |
| 1. 本期已实现收益 | 95,417.52 | 2,873.61 |
| 2. 本期利润 | 62,545.00 | 3,601.22 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0111 | 0.0094 |
| 4. 期末基金资产净值 | 702,673.28 | 512,091.68 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0138 | 1.0108 |

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

前海联合泰瑞纯债 A

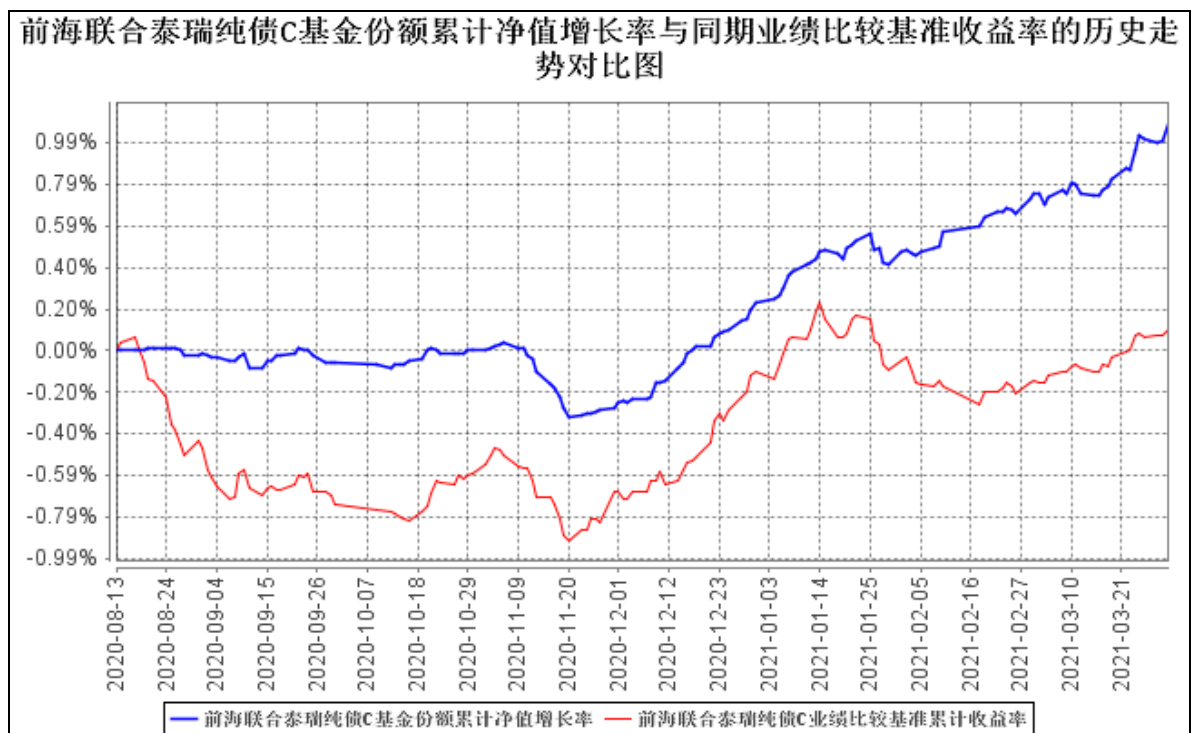
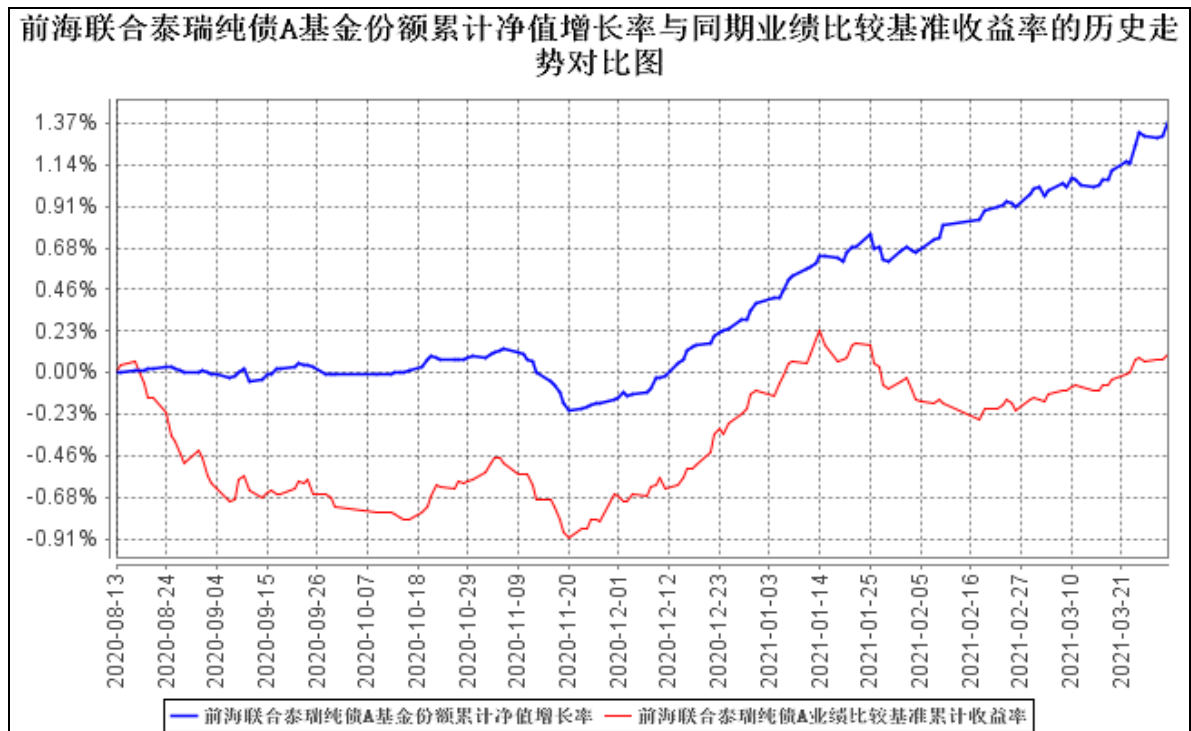
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.00% | 0.04% | 0.20% | 0.04% | 0.80% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.39% | 0.03% | 0.84% | 0.04% | 0.55% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.38% | 0.03% | 0.10% | 0.05% | 1.28% | -0.02% |

前海联合泰瑞纯债 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 | 0.85% | 0.03% | 0.20% | 0.04% | 0.65% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.14% | 0.03% | 0.84% | 0.04% | 0.30% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.08% | 0.03% | 0.10% | 0.05% | 0.98% | -0.02% |

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 8 月 13 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 | | |
| 张雅洁 | 本基金的基金经理 | 2020 年 8 月 13 日 | - | 11 年 | 张雅洁女士，悉尼大学及中央昆士兰大学金融与会计双硕士，11 年证券投资基金投资研究经验。2013 年 6 月至 2015 年 9 月在博时基金从事固定收益研究和投资工作，曾担任博时上证企债 30ETF 等基金的基金经理助理，2010 年 2 月至 2013 年 5 月在融通基金从事信用债研究工作。2015 年 9 月加入前海联合基金，现任新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金兼新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金和新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合添鑫一年定期开放债券型证券投资基金（后转型为新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金）的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 9 月曾任新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月至 2021 年 2 月新疆前海联合海盈货币市场基金的基金经理。2016 年 12 月至 2021 年 3 月新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金的基 |

| | | | | | |
|-----|-------------------|-----------------|---|-----|---|
| | | | | | 金经理。2019 年 5 月至 2021 年 3 月新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月至 2021 年 3 月新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月至 2021 年 3 月新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2021 年 2 月新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 黄浩东 | 本基金的基金经理,固定收益部总经理 | 2020 年 8 月 13 日 | - | 9 年 | 黄浩东先生,清华大学管理学学士及管理学硕士,9 年证券投资研究经验。2011 年 7 月至 2019 年 8 月任职于东莞证券股份有限公司深圳分公司,历任研究员、投资经理、副总经理兼投资经理。2019 年 8 月加入前海联合基金。现任新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金兼新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、新疆前海联合添泽债券型证券投资基金、新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金和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。 |

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。

4.1.1 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 2021 年一季度，境内外疫苗全面开始接种，全球经济延续复苏趋势，大宗商品走势强劲。国内供给端和出口趋势良好，而需求则还没有明显提升。核心 CPI 触底回升和 PPI 持续向好，一度引发了市场的担忧，但 CPI 同比基数不高，目前不是主要矛盾。猪周期下行背景下，通胀预期会比较温和上升，央行预计会根据通胀数据相机而动。

回顾一季度货币政策，央行除了 1 月底防止股市和房市过热收紧了流动性外，其他时间都维持流动性的合理宽裕。货币政策中性继续为主要方向，货币政策预计将保持流动性合理宽裕，努力服务实体经济。

本基金在一季度维持中短久期的策略，通过持有短久期信用债获取底仓票息收益，再辅以中长久期利率债的波段交易操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末前海联合泰瑞纯债 A 基金份额净值为 1.0138 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.00%；截至本报告期末前海联合泰瑞纯债 C 基金份额净值为 1.0108 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.85%；同期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

本报告期内，本基金从 2020 年 12 月 2 日起至 2021 年 3 月 31 日止，连续 80 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。本基金管理人已经于 2021 年 3 月 9 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,206,182.00 | 92.09 |
| | 其中：债券 | 1,206,182.00 | 92.09 |
| | 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 | 76,245.74 | 5.82 |
| 8 | 其他资产 | 27,394.83 | 2.09 |
| 9 | 合计 | 1,309,822.57 | 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 | 902,432.00 | 74.29 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 303,750.00 | 25.00 |
| | 其中：政策性金融债 | 303,750.00 | 25.00 |
| 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 | 1,206,182.00 | 99.29 |
|----|----|--------------|-------|

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 | 6,700 | 669,732.00 | 55.13 |
| 2 | 018006 | 国开 1702 | 3,000 | 303,750.00 | 25.00 |
| 3 | 019547 | 16 国债 19 | 2,500 | 232,700.00 | 19.16 |

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

国开 1702 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。

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

本基金本报告期内未投资股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 4,726.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 22,668.61 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 27,394.83 |

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

| 项目 | 前海联合泰瑞纯债 A | 前海联合泰瑞纯债 C |
|--------------|---------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 21,003,482.69 | 204,437.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 690,804.79 | 303,306.24 |

| | | |
|---------------------------|---------------|------------|
| 减: 报告期期间基金总赎回份额 | 21,001,154.09 | 1,106.06 |
| 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 | 693,133.39 | 506,637.60 |

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 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 988,448.95 |
| 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 | 988,448.95 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例(%) | 82.39 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|----|------|-----------|------------|--------------|-------|
| 1 | 申购 | 2021年2月4日 | 689,822.63 | 700,000.00 | 0.80% |
| 2 | 申购 | 2021年2月4日 | 298,626.32 | 300,000.00 | - |
| 合计 | | | 988,448.95 | 1,000,000.00 | |

§ 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 | 20210204-20210331 | 0.00 | 988,448.95 | 0.00 | 988,448.95 | 82.39% |
| | 2 | 20210101-20210207 | 20,999,945.00 | 0.00 | 20,999,945.00 | 0.00 | 0.00% |

| | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|
| 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。

8.2 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。

§ 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泰瑞纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合泰瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合泰瑞纯债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

2021 年 4 月 22 日