

**新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金**

**2021 年第 2 季度报告**

2021 年 06 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 07 月 21 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19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4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海联合润盈短债
基金主代码	008010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年12月24日
报告期末基金份额总额	472,521,153.54份
投资目标	本基金重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
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	中债综合财富(1 年以下)指数收益率*80%+银行一年期定存款利率(税后)*20%	
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	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合润盈短债 A	前海联合润盈短债 C
下属分级基金的交易代码	008010	008011
报告期末下属分级基金的份额总额	470,614,924.41 份	1,906,229.13 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 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）	
	前海联合润盈短债 A	前海联合润盈短债 C
1. 本期已实现收益	422,221.38	12,179.76
2. 本期利润	517,782.19	12,897.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0054	0.0052
4. 期末基金资产净值	493,988,498.45	1,979,850.53
5. 期末基金份额净值	1.0497	1.0386

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

前海联合润盈短债 A 净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-	②-
----	-------	-------	-------	-------	----	----

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④	③	④
过去三个月	0.61%	0.01%	0.70%	0.01%	-0.09%	0.00%
过去六个月	1.80%	0.04%	1.38%	0.01%	0.42%	0.03%
过去一年	3.27%	0.03%	2.53%	0.01%	0.74%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.97%	0.03%	3.83%	0.01%	1.14%	0.02%

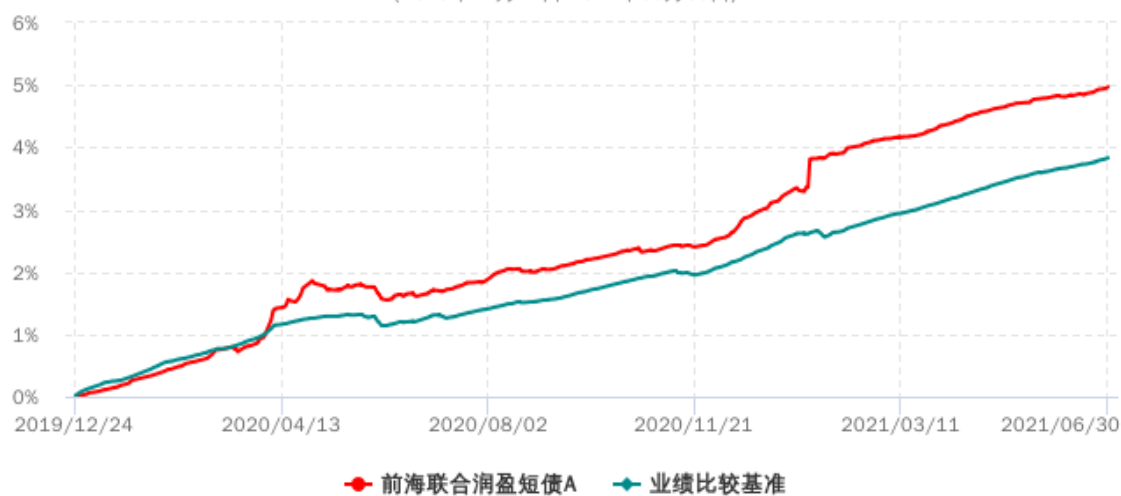
## 前海联合润盈短债 C 净值表现

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	0.50%	0.01%	0.70%	0.01%	-0.20%	0.00%
过去六个月	1.15%	0.02%	1.38%	0.01%	-0.23%	0.01%
过去一年	2.41%	0.02%	2.53%	0.01%	-0.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.86%	0.03%	3.83%	0.01%	0.03%	0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1 年以下)指数收益率\*80%+银行一年期定期存款利率(税后)\*20%。

### 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

前海联合润盈短债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月24日-2021年06月30日)



前海联合润盈短债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月24日-2021年06月30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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	业 年 限	
曾婷婷	本基金的基金经理	2019- 12-24	-	9 年	曾婷婷女士，硕士研究生，CPA,9 年证券基金从业经历。2013 年 4 月至 2015 年 8 月任华润元大基金固定收益部研究员。2011 年 11 月至 2013 年 3 月，任职于第一创业证券研究所。2008 年 10 月至 2011 年 10 月任安永会计师事务所高级审计，2015 年 10 月加入前海联合基金，现任新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理（自 2016 年 9 月 5 日起任职）、新疆前海联合泳盛纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 1 月 24 日起任职）、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 12 月 24 日起任职）、新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）和新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 26 日起任职）。曾任新疆前海联合汇盈货币

					市场基金基金经理（自 2017 年 7 月 3 日至 2021 年 5 月 17 日）和新疆前海联合泳辉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 7 月 5 日至 2021 年 5 月 17 日）。
--	--	--	--	--	---

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

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遵规守信情况的说明**

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 报告期内基金的投资策略和运作分析**

2021 年 2 季度，经济继续恢复，但动能有所放缓。出口和地产依然较强，但出口有所减弱，地产投资增速也有所减弱，基建受高耗能抑制以及城投融资约束，表现较弱，制造业

有所回升，消费逐步恢复，但 5 月广东疫情，对消费有一定影响。PPI 上升幅度超预期，CPI 较为温和，通胀对货币政策暂不构成影响，货币政策稳字当头。2 季度债市主线在资金面，除了季末特殊时点资金价格波动较大，其余时点均较为宽松。受资金面影响，2 季度债市震荡走强。

本基金定位为货币增强产品，在报告期内，本基金主要用利率债的波段交易来增强组合收益，并做好回撤控制。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合润盈短债 A 基金份额净值为 1.0497 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%；截至报告期末前海联合润盈短债 C 基金份额净值为 1.0386 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

#### 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 2021 年 1 月 11 日起至 2021 年 5 月 12 日止，连续 79 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。自 2021 年 5 月 13 日起，本基金基金资产净值恢复至 5000 万元以上。本基金管理人已经于 2021 年 4 月 21 日向证监会申请持续运作。

### § 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	469,746,000.00	94.69
	其中：债券	469,746,000.00	94.69
	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	4,862,758.80	0.98
8	其他资产	21,479,066.19	4.33
9	合计	496,087,824.99	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	411,439,000.00	82.96
	其中：政策性金融债	381,058,000.00	76.83
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	58,307,000.00	11.76
9	其他	-	-
10	合计	469,746,000.00	94.71

#### 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	190407	19 农发 07	1,100,000	110,605,000.00	22.30
2	210206	21 国开 06	800,000	80,008,000.00	16.13
3	190202	19 国开 02	700,000	70,259,000.00	14.17
4	160421	16 农发 21	500,000	50,035,000.00	10.09
5	112108118	21 中信银行 CD118	500,000	48,590,000.00	9.80

#### 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监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

1.21 国开 06、19 国开 02、20 国开 15 发债主体受监管处罚情况：

(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 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日，国家开发银行海南省分行、浙江省分行、陕西省分行以及广西壮族自治区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、人行等监管机构处以罚款合计 4505.91 万元，并没收违法所得 1102.66 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。

### 2.19 农发 07、16 农发 21、20 农发 06 发债主体受监管处罚情况：

2020 年 7 月 1 日-2021 年 6 月 30 日，中国农业发展银行浙江省分行、托克托县支行等 21 家分支机构由于项目调查审查不尽职；未能通过有效的内控措施发现并纠正员工违规保管客户物品的行为等违法违规行为，被当地银保监局、外汇管理局等监管机构处以警告、罚款等行政处罚，罚款金额合计 645 万元。

基金管理人经审慎分析，认为中国农业发展银行资产规模大，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，该事项对中国农业发展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。

本基金投资于中国农业发展银行的决策程序说明：基于中国农业发展银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于中国农业发展银行，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，认为该事项对中国农业发展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 发债主体受监管处罚情况：

(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。

(3) 2021 年 5 月 17 日，根据银保监罚决字（2021）16 号，因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品等违法违规事由，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，招商银行被银保监会罚款 7170 万元。

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。

#### 4.20 进出 09 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2021 年 2 月 7 日，根据闽银保监罚决字（2021）13 号，中国进出口银行福建省分行由于发放无指定用途固定资产贷款，被福建银保监局处以罚款 50 万元。

(2) 2021 年 4 月 22 日，根据琼银保监罚决字[2021]11 号，中国进出口银行海南省分行由于贷款“三查”不到位，被海南银保监局处以 50 万元的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为中国进出口银行资产规模大，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，上述事项对中国进出口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。

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

### 5.11.2 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	5,934.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,471,892.16
5	应收申购款	13,001,239.56
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,479,066.19

### 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

	前海联合润盈短债 A	前海联合润盈短债 C
报告期期初基金份额总额	505,454.74	2,460,685.74
报告期期间基金总申购份额	472,584,279.01	2,636,926.32
减：报告期期间基金总赎回 份额	2,474,809.34	3,191,382.93
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	470,614,924.41	1,906,229.13

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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金
------	----------------	----------

别						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	20210629-202 10630	-	142,95 2,827. 56	-	142,952 ,827.56	30.25%
机构	2	20210629-202 10630	-	142,95 2,827. 56	-	142,952 ,827.56	30.25%
个人	1	20210513-202 10628	-	85,946 ,075.1 8	-	85,946, 075.18	18.19%
个人	2	20210513-202 10628	-	85,946 ,075.1 8	-	85,946, 075.18	18.19%
个人	3	20210401-202 10401;202104 20-20210421	617,66 5.53	-	-	617,665 .53	0.13%
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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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润盈短债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合润盈短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

二〇二一年七月二十一日