

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

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 23 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:2023 年 01 月 28 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2023年1月18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。

截至第一个开放期最后一日（即2022年12月23日）日终，本基金的基金资产净值加上基金开放期最后一日交易申请确认的申购确认金额及转换转入确认金额，扣除赎回确认金额及转换转出确认金额后的余额低于5000万元。根据《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基金合同》的约定，经向中国证监会备案，基金管理人决定于本基金第一个开放期到期后暂停运作，即暂停进入下一封闭期。

本报告期自2022年10月1日起至2022年12月23日（第一个开放期最后一日）止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合淳安 3 年定开债券
基金主代码	008160
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 26 日
报告期末基金份额总额	35,314.25 份
投资目标	本基金严格采用持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金在封闭期内，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，并采用买入并持有到期策略，投资到期日（或回收期限）不超过基金剩余封闭期的债券。本基金在开放期内，将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
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	浙商银行股份有限公司

§ 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（2022 年 10 月 01 日-2022 年 12 月 23 日）
1. 本期已实现收益	25,367,619.45
2. 本期利润	25,367,619.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0049
4. 期末基金资产净值	35,880.79
5. 期末基金份额净值	1.0160

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、根据《关于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第一个开放期到期后暂停运作、不进入下一封闭期的公告》，本基金第一个开放期为 2022 年 11 月 28 日至 2022 年 12 月 23 日，在第一个开放期到期后暂停运作，即暂停进入下一封闭期。

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	1.84%	0.18%	-0.72%	0.08%	2.56%	0.10%
过去六个月	2.69%	0.12%	0.01%	0.07%	2.68%	0.05%
过去一年	4.34%	0.09%	0.39%	0.06%	3.95%	0.03%

过去三年	11.13%	0.05%	2.44%	0.07%	8.69%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.44%	0.05%	3.00%	0.07%	8.44%	-0.02%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

2、因本基金于 2022 年 12 月 24 日起暂停运作，本次报告基金净值表现计算阶段截止日期均为 2022 年 12 月 23 日。

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

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11月26日-2022年12月23日)



注：根据《关于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第一个开放期到期 后暂停运作、不进入下一封闭期的公告》，本基金自 2022 年 12 月 24 日起暂停运作。

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		

张文	本基金的基金经理	2020-10-28	—	10 年	<p>张文先生，硕士，10 年证券投资基金投资研究经验。曾任中山证券有限责任公司固定收益部交易员、第一创业证券股份有限公司资产管理部高级交易经理、深圳慈曜资产管理有限公司交易管理部交易主管、新疆前海联合基金管理有限公司基金经理助理、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 20 日至 2021 年 9 月 14 日）、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经理（自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 1 月 5 日）和新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 7 月 27 日）。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基金经理（自 2020 年 10 月 28 日起任职）、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基金经理（自 2020 年 10 月 28 日起任职）、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2020 年 10 月 29 日起任职）、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理（自 2020 年 12 月 1 日起任职）、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理（自 2021 年 5 月 18 日起任职）、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 20 日起任职）、新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 20 日起任职）、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基金经理（自 2021 年 8 月 20 日起任职）、新疆前</p>
----	----------	------------	---	------	--

					海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理（自 2022 年 3 月 5 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 2022 年 3 月 5 日起任职）。
--	--	--	--	--	---

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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年四季度，宏观经济受疫情冲击较大。国内方面，PMI 指标逐月下滑，生产端和需求端均表现疲软，制造业和建筑业仍有回升，服务业回落。需求方面，出口同比增速进入负值区间，制造业和基建投资仍有一定正增长，地产投资和销售整体仍较弱，社零消费进一步下滑。通胀数据基本符合预期，社融增速震荡向下，宽信用内生需求不足。国际方面，美联储加息节奏持续，俄乌冲突未见缓解，欧美经济体通胀压力仍较大，海外经济增长及货币政策仍面临不确定性。

资金面方面，流动性整体较宽松，资金价格维持低位，央行月年末时点也加大公开市场投放

力度，此外，12 月降准 0.25%落地。债市方面，受季中以来疫情政策及地产政策及机构行为影响，现券收益率先有所下行后快速回调，整季来看，季初季末国开债关键期限收益率上行 5-25bp 不等，短端表现更弱，十年国债收于 2.83%左右，信用利差大幅走阔。

报告期内，本基金以利率债为主要持仓，继续维持一定的杠杆操作，久期匹配产品的封闭期，收益保持稳定增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合淳安 3 年定开债券基金份额净值为 1.0160 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 1.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.72%。

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	-	-
	其中：债券	-	-
	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	733,052.79	100.00
8	其他资产	-	-
9	合计	733,052.79	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

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按摊余成本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

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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

无。

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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

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

报告期期初基金份额总额	6,100,042,352.29
报告期期间基金总申购份额	12,026.47
减：报告期期间基金总赎回份额	6,100,019,064.51
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	35,314.25

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	20221001-20221207	1,799,999,000	-	1,799,999,000	-	-
	2	20221001-20221212	2,499,999,000	-	2,499,999,000	-	-
	3	20221213-20221214	599,999,000	-	599,999,000	-	-
	4	20221208-20221213	999,999,000	-	999,999,000	-	-
个人	1	20221215-20221226	10,159.12	-	10,159.12	-	-
	2	20221215-20221226	-	9,905.77	9,905.77	-	-
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

根据《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基金合同》的约定，经向中国证监会备案，基金管理人于 2022 年 12 月 24 日发布《关于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第一个开放期到期后暂停运作、不进入下一封闭期的公告》，决定于本基金第一个开放期到期后暂停运作、即暂停进入下一封闭期。本次开放期到期日的下一工作日（即 2022 年 12 月 26 日），投资人未确认的申购申请对应的已缴纳申购款项本金全部退回；对于该开放期最后一日日终留存的基金份额，全部自动赎回，且不收取赎回费。具体内容详见基金管理人于 2022 年 12 月 24 日在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

§ 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淳安纯债 3 年定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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

二〇二三年一月二十八日