

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

2021 年中期报告

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 08 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。本中期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8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 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	17
§ 5 托管人报告	17
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	18

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	22
6.4 报表附注	23
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 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	49
7.8 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	50
7.9 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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 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情况	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
10.2 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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§ 12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 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 06 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	60,010,671.03 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	1、封闭期投资策略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。2、开放期投资策略开放期内，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。
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		深圳市南山区桂湾四路197号前海华润金融中心T1栋第28和29层	杭州市延安路368号
邮政编码		518031	310006
法定代表人		吴昱村	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》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www.qhlfund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限 公司	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华 润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	122,468,444.12
本期利润	108,404,601.07
加权平均基金份额本期利润	0.0235
本期加权平均净值利润率	2.30%
本期基金份额净值增长率	3.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	1,136,629.96
期末可供分配基金份额利润	0.0189
期末基金资产净值	61,147,300.99
期末基金份额净值	1.0189
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）

基金份额累计净值增长率	19.75%
-------------	--------

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

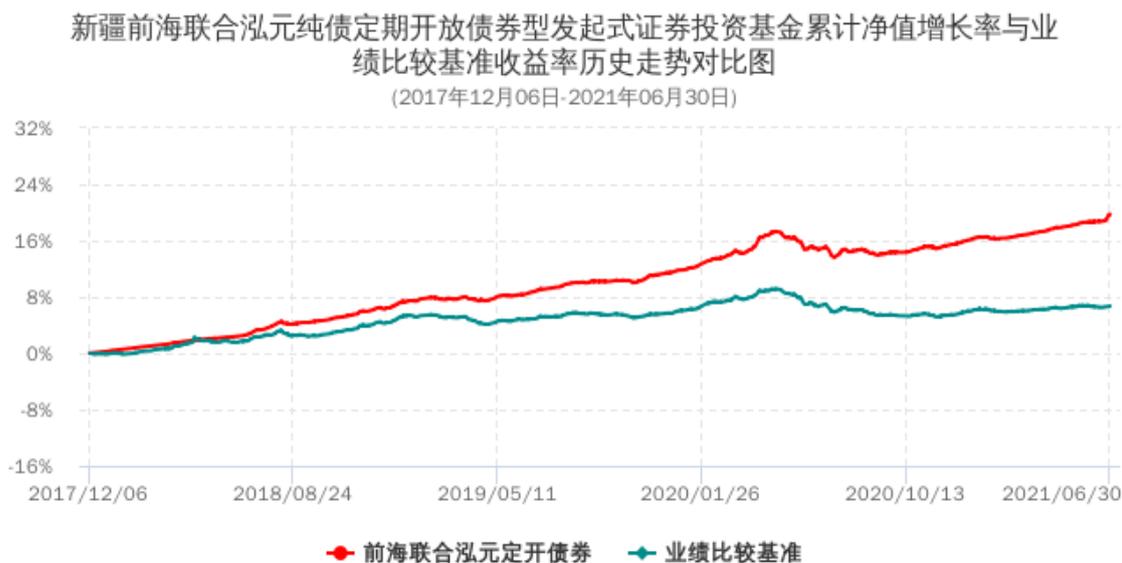
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.95%	0.14%	-0.04%	0.03%	0.99%	0.11%
过去三个月	2.16%	0.08%	0.45%	0.03%	1.71%	0.05%
过去六个月	3.14%	0.06%	0.65%	0.04%	2.49%	0.02%
过去一年	4.08%	0.07%	-0.20%	0.06%	4.28%	0.01%
过去三年	16.40%	0.08%	4.53%	0.07%	11.87%	0.01%
自基金合同生效起至今	19.75%	0.07%	6.71%	0.07%	13.04%	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



3.3 其他指标

无。

§ 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、深圳分公司。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34只开放式基金，包括2只货币市场基金、18只债券型基金、12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12只专户理财产品，管理资产总规模超过364亿元人民币。

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	-	8 年	<p>张文先生，硕士研究生，8 年证券投资研究交易经验。</p> <p>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。2019 年 9 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</p>

					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（自 2021 年 5 月 18 日起任职）基金经理、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）、新疆前海联合泳益纯债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）、新疆前海联合泳嘉纯债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 日起任职）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基金经理（自 2021 年 8 月 20 日起任职）。
敬夏玺	本基金的基金经理	2017-	-	10	敬夏玺先生，硕士研究生，

		12-06		年	<p>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，现任新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 2 日起任职）、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 2017 年 12 月 6 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 2018 年 3 月 7 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 2019 年 11 月 26 日起任职）、新疆前海联合泳益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）、新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2020 年 5 月 21 日起</p>
--	--	-------	--	---	---

				<p>任职)、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 2020 年 7 月 23 日起任职) 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基金经理 (自 2020 年 8 月 26 日起任职)。</p> <p>曾任新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2016 年 8 月 18 日至 2019 年 1 月 23 日)、新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2016 年 11 月 17 日至 2020 年 3 月 25 日)、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理 (自 2017 年 5 月 25 日至 2020 年 3 月 25 日)、新疆前海联合润丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (自 2018 年 9 月 20 日至 2019 年 12 月 30 日) 和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 日至 2021 年 1 月 28 日)。</p>
--	--	--	--	---

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。

4.1.3 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 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 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

2021 年上半年，生产端领先需求端，复苏较快，净出口边际放缓但仍处于高位，地产投资韧性较强，制造业投资继续回升，基建投资和消费有所回暖，但修复进程偏慢；由于去年基数较高，金融数据从高点缓慢回落；上半年，大宗商品涨价，PPI 飙涨，年中逐渐达到高点，CPI 转正，核心 CPI 上行；整体来看，基本面渐进修复，节奏回归常态。资金面方面，整体较宽松，1 月底、5 月底、6 月中下旬超储率较低，资金价格有所上行。收益率方面，

上半年收益率先上后下，2月中旬达到收益率高点，较年初，收益率整体下行 5-10bp 左右，期限利差变化不大，信用利差收窄。

本基金上半年适度调仓，继续持有利率债和高等级信用债，资产的安全性和流动性仍较高，下半年根据基本面和资金面的变化，动态调整仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合泓元定开债券基金份额净值为 1.0189 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增速向潜在增速靠近，主线需关注通胀对中下游产业链的影响幅度，此外，由于财政后置，地方债发行远不及预期，要密切关注政府债券供给节奏，指标方面，重点关注 taper、核心 CPI、出口、地产投资、地方债、MLF 供给等变化。整体来看，下半年变数增加，市场预期有一定分歧，收益率宽幅震荡概率较大。

4.6 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。

4.7 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 1,136,629.96 元。报告期内,本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 20 日公告 2020 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 0.023 元;于 2021 年 2 月 24 日公告 2020 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 0.035 元;于 2021 年 6 月 23 日公告 2020 年度第三次分红,向截至 2021 年 6 月 24 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 0.221 元。

4.8 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

本报告期内,本基金从 2020 年 12 月 6 日起至 2021 年 3 月 7 日止,连续 59 个工作日持有人户数低于 200 户,自 2021 年 3 月 8 日起本基金持有人户数超过 200 户。

§ 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、基金费用开支及利润分配等问题上,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。

5.3 托管人对本中期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 2021 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2021 年 06 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	2,345,387.14	1,265,577.43
结算备付金		7,178,355.17	-
存出保证金		67,630.61	100,004.58

交易性金融资产	6.4.7.2	51,126,000.00	6,824,989,200.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		45,731,000.00	5,964,889,200.00
资产支持证券投资		5,395,000.00	860,100,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,502,035.31	112,445,125.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		62,219,408.23	6,938,799,907.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,024,717,942.92
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		602,856.45	1,001,652.19
应付托管费		210,999.76	350,578.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	70,432.68	89,025.02
应交税费		74,312.97	216,163.97

应付利息		821.62	283,136.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	112,683.76	235,000.00
负债合计		1,072,107.24	1,026,893,498.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,010,671.03	5,822,903,071.07
未分配利润	6.4.7.10	1,136,629.96	89,003,337.93
所有者权益合计		61,147,300.99	5,911,906,409.00
负债和所有者权益总计		62,219,408.23	6,938,799,907.79

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0189 元，基金份额总额 60,010,671.03 份。

6.2 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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		122,017,595.93	283,473,519.89
1. 利息收入		91,864,235.53	191,508,637.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,268,144.40	79,455.24
债券利息收入		74,509,436.31	172,528,025.66
资产支持证券利息收入		13,121,652.37	18,889,190.41
买入返售金融资产收入		965,002.45	11,965.84

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,217,203.45	49,387,203.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	42,724,915.00	49,901,427.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	1,492,288.45	-514,224.66
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,063,843.05	42,577,679.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17.1	-	-
减：二、费用		13,612,994.86	24,966,297.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,725,833.94	9,128,425.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,654,041.85	3,194,948.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	50,328.54	37,246.30
5. 利息支出		6,972,450.23	12,295,868.61
其中：卖出回购金融资产支出		6,972,450.23	12,295,868.61
6. 税金及附加		108,026.54	174,349.42
7. 其他费用	6.4.7.19	102,313.76	135,458.56
三、利润总额（亏损总额以		108,404,601.07	258,507,222.39

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		108,404,601.07	258,507,222.39

6.3 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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 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)	5,822,903,071.07	89,003,337.93	5,911,906,409.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	108,404,601.07	108,404,601.07
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)	-5,762,892,400.04	-78,233,145.70	-5,841,125,545.74
其中：1. 基金申购款	496,630.82	7,114.51	503,745.33
2. 基金赎回款	-5,763,389,030.86	-78,240,260.21	-5,841,629,291.07
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)	-	-118,038,163.34	-118,038,163.34
五、期末所有者权益(基金净值)	60,010,671.03	1,136,629.96	61,147,300.99

项 目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 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)	-	258,507,222.39	258,507,222.39
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
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)	-	-226,395,692.81	-226,395,692.81
五、期末所有者权益(基金净值)	8,822,903,071.07	251,937,845.64	9,074,840,916.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吴昱村

吴昱村

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

6.4 报表附注

6.4.1 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 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 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》、《基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	2,345,387.14
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	2,345,387.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 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	-	-
	银行间市场	45,713,720.00	45,731,000.00
	合计	45,713,720.00	45,731,000.00
资产支持证券	4,402,832.3	5,395,000.00	992,167.66

	4		
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	50,116,552. 34	51,126,000.00	1,009,447.66

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	104,030.89
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	2,907.27
应收债券利息	1,393,052.06
应收资产支持证券利息	2,017.64
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	27.45
合计	1,502,035.31

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	70,432.68
合计	70,432.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 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-审计费	43,876.39
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	112,683.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,822,903,071.07	5,822,903,071.07

本期申购	496,630.82	496,630.82
本期赎回（以“-”号填列）	-5,763,389,030.86	-5,763,389,030.86
本期末	60,010,671.03	60,010,671.03

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 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	10,037,935.24	78,965,402.69	89,003,337.93
本期利润	122,468,444.12	-14,063,843.05	108,404,601.07
本期基金份额交易产生的变动数	-12,952,744.18	-65,280,401.52	-78,233,145.70
其中：基金申购款	848.24	6,266.27	7,114.51
基金赎回款	-12,953,592.42	-65,286,667.79	-78,240,260.21
本期已分配利润	-118,038,163.34	-	-118,038,163.34
本期末	1,515,471.84	-378,841.88	1,136,629.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	137,170.63
定期存款利息收入	3,095,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,722.62
其他	751.15
合计	3,268,144.40

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 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	42,724,915.00
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	42,724,915.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,966,977,795.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,754,502,093.78
减：应收利息总额	169,750,787.13
买卖债券差价收入	42,724,915.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	899,366,981.60
减：卖出资产支持证券成本总额	881,392,807.90
减：应收利息总额	16,481,885.30
资产支持证券投资收益	1,492,288.45

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,063,843.05
——股票投资	-
——债券投资	-13,605,285.79
——资产支持证券投资	-458,557.26
——基金投资	-
——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	-14,063,843.05

6.4.7.17.1 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	4,292.29
银行间市场交易费用	46,036.25
交易基金产生的费用	-
合计	50,328.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	600.00
账户维护费	27,330.00
合计	102,313.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙商银行股份有限公司	基金托管人
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管 理费	4,725,833.94	9,128,425.63
其中：支付销售机构的客户 维护费	61.05	0.00

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	1,654,041.85	3,194,948.98

注：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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 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
浙商银行股份有限 公司	-	-	-	-	1,860,8 78,000. 00	147,073 .74
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

各关联方名称	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
浙商银行股份有限 公司	-	-	-	-	2,751,4 98,000. 00	209,665 .28

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 12 月 06 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	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份 额	10,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,000.00	10,001,000.00

报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	0.00%	0.11%
-------------------------	-------	-------

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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
浙商银行股份有限公司	2,345,387.1 4	137,170.63	1,352,587.1 3	52,687.36

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

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	合 计
----	---------------	-----	-----------------------	--------------	-------------------	--------------	--------

1	2021 0225	- (场内)	2021022 5 (场外)	0.035	20,380,1 60.84	-	20,380,1 60.84	-
2	2021 0121	- (场内)	2021012 1 (场外)	0.023	13,392,6 77.06	-	13,392,6 77.06	-
3	2021 0624	- (场内)	2021062 4 (场外)	0.221	84,265,3 25.36	0.08	84,265,3 25.44	-
合 计				0.279	118,038, 163.26	0.08	118,038, 163.34	-

6.4.12 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	1,022,820,000.00
合计	-	1,022,820,000.00

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.4 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	2,564,706,000.00
AAA 以下	-	560,425,000.00
未评级	45,731,000.00	1,607,222,200.00
合计	45,731,000.00	4,732,353,200.00

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。

6.4.13.2.5 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	5,395,000.00	820,128,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	39,972,000.00
合计	5,395,000.00	860,100,000.00

注：长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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 2021 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。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 2021 年 6 月 30 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 2021 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,345,387.14	-	-	-	2,345,387.14
结算备付金	7,178,355.17	-	-	-	7,178,355.17
存出保证金	67,630.61	-	-	-	67,630.61
交易性金融	10,094,000.	35,637,000.	5,395,000.0	-	51,126,000.

资产	00	00	0		00
应收利息	-	-	-	1,502,035.31	1,502,035.31
资产总计	19,685,372.92	35,637,000.00	5,395,000.00	1,502,035.31	62,219,408.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	602,856.45	602,856.45
应付托管费	-	-	-	210,999.76	210,999.76
应付交易费用	-	-	-	70,432.68	70,432.68
应交税费	-	-	-	74,312.97	74,312.97
应付利息	-	-	-	821.62	821.62
其他负债	-	-	-	112,683.76	112,683.76
负债总计	-	-	-	1,072,107.24	1,072,107.24
利率敏感度缺口	19,685,372.92	35,637,000.00	5,395,000.00	429,928.07	61,147,300.99
上年度末 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	1,908,811.00	3,411,528.00	1,504,650.20	-	6,824,989.20
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					
卖出回购金	1,024,717,942.92	-	-	-	1,024,717,942.92
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

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。

6.4.13.4.1.2 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 2021 年 06 月 30 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	185,956.25	42,159,499.32
	市场利率上升 25 个基点	-185,399.50	-41,628,325.34

	基点		
--	----	--	--

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	51,126,000.00	82.17
	其中：债券	45,731,000.00	73.50
	资产支持证券	5,395,000.00	8.67
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	9,523,742.31	15.31
8	其他各项资产	1,569,665.92	2.52
9	合计	62,219,408.23	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.5 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	45,731,000.00	74.79
	其中：政策性金融债	45,731,000.00	74.79
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	45,731,000.00	74.79

7.6 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	170412	17 农发 12	350,000	35,637,000.00	58.28
2	150404	15 农发 04	100,000	10,094,000.00	16.51

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 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	1689171	16 居融 1A	500,000	5,395,000.0 0	8.82

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

1.17 农发 12、15 农发 04 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	67,630.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,502,035.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,569,665.92

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
231	259,786.45	60,010,67 1.03	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 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情况

无。

8.4 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	1,000.00	0.00%	1,000.00	0.00%	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	1,000.00	0.00%	1,000.00	0.00%	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。

3. 本基金于 2017 年 12 月 6 日成立，截至 2020 年 12 月 6 日，本基金成立满 3 年。本基金管理人于 2021 年 3 月 2 日申请赎回本基金发起式基金份额 10,000,000.00 份。基金管理人的赎回行为符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第十二条第二款有关发起式基金份额锁定期的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 12 月 06 日）基金份额总额	10,010,000,000.00
---------------------------------	-------------------

本报告期期初基金份额总额	5,822,903,071.07
本报告期基金总申购份额	496,630.82
减：本报告期基金总赎回份额	5,763,389,030.86
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	60,010,671.03

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、本报告期内，王晓耕女士自 2021 年 4 月 15 日起不再担任公司总经理职务，张永任先生自 2021 年 4 月 15 日起代为履行公司总经理职责；吴昱村先生自 2021 年 5 月 26 日起担任公司总经理，张永任先生不再代为履行总经理职责；邹文庆先生自 2021 年 6 月 21 日起担任公司总经理助理。

2、经 2021 年 4 月 12 日召开的公司股东会 2021 年第 1 次临时会议与会股东一致审议通过，段军山先生接替孙学致先生担任公司独立董事。

3、经 2021 年 4 月 17 日召开的公司股东会 2021 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，王晓耕女士辞去公司第二届董事会董事职务。

4、经 2021 年 5 月 28 日召开的公司股东会 2021 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，聘任吴昱村先生担任公司第二届董事会董事。

5、经 2021 年 6 月 28 日召开的公司股东会 2021 年定期会议与会股东一致审议通过，乔宗利先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由孙莉女士担任公司第二届董事会董事。

经 2021 年 7 月 16 日召开的公司第二届董事会 2021 年第 10 次临时会议与会董事一致审议通过，孙莉女士担任公司第二届董事会副董事长。

6、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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

因业务开展需要，经本公司董事会 2021 年第 3 次临时会议审议通过并经全体独立董事同意，本基金自 2021 年 5 月 28 日起，改聘中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已通知基金托管人或经基金托管人同意。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本报告期内，新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	599,921,91	100.00%	5,091,855,	100.00%	-	-	-	-

有限 责任 公司	0.46		000.0 0					
国信 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江	-	-	-	-	-	-	-	-

证券 股份 有限 公司								
----------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

10.8 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 2021 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	2021-01-20
2	前海联合泓元定开债券基金 2020 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	2021-01-22
3	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	2021-02-19
4	前海联合泓元定开债券基金 暂停大额申购业务的公告	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	2021-02-23
5	前海联合泓元定开债券基金 2021 年第二次分红公告	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	2021-02-24
6	关于提醒投资者及时更新已 过期身份证件及其他身份基 本信息的公告	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	2021-03-20
7	前海联合基金管理有限公司 关于旗下部分基金根据侧袋 机制指引修订相关法律文件	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	2021-03-29

	的公告		
8	前海联合泓元定开债券基金 2020 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	2021-03-30
9	前海联合泓元定开债券基金 2021 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	2021-04-22
10	前海联合基金管理有限公司 基金改聘会计师事务所公告 (二)	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	2021-06-01
11	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	2021-06-18
12	前海联合泓元定开债券基金 暂停大额申购业务的公告	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	2021-06-22
13	前海联合泓元定开债券基金 2021 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	2021-06-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区 间					
机构	1	20210101 -2021063 0	5,812,90 2,071.07	-	5,752,90 0,000.00	60,002,0 71.07	99.99%
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。

11.2 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（包括本基金）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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二一年八月三十日