

新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10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2023年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 前海联合智选 3 个月持有期混合（FOF） |
| 基金主代码 | 009159 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 10 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,357,720.26 份 |
| 投资目标 | 本基金是混合型基金中基金，通过大类资产配置，主要投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将在基金合同约定的投资范围内，根据对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策的分析，判断宏观经济的运行趋势，评估股票、债券、商品、现金类资产、另类资产等各资产类别的风险收益特征，并加以分析比较，形成对不同资产类别中长期走势的预期，并据此对各大类资产的配置比例进行动态调整。力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例；并通过定量和定性分析相结合的方法精选子基金来实现上述资产配置方案，实现基金资产的稳定回报。 |
| 业绩比较基准 | 上证国债指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，理论上其预期风险与 |

| | | |
|-----------------|----------------------------------------------------------|--------------------------|
| | 预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金。 | |
| 基金管理人 | 新疆前海联合基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) A | 前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009159 | 009160 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,967,152.90 份 | 1,390,567.36 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(2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日) | |
|-----------------|----------------------------------------|--------------------------|
| | 前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) A | 前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) C |
| 1. 本期已实现收益 | -2,191.18 | -3,052.26 |
| 2. 本期利润 | -18,559.41 | -13,405.81 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0099 | -0.0099 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,114,066.40 | 1,481,688.76 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0747 | 1.0655 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本基金 T 日的基金份额净值在 T+3 日内公告。

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

前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) A 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 | -0.78% | 0.19% | -0.11% | 0.17% | -0.67% | 0.02% |
| 过去六个月 | -0.78% | 0.18% | -0.01% | 0.17% | -0.77% | 0.01% |
| 过去一年 | -0.20% | 0.17% | 2.23% | 0.19% | -2.43% | -0.02% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 7.47% | 0.21% | 4.18% | 0.23% | 3.29% | -0.02% |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|

前海联合智选3个月持有期混合(FOF)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 | -0.89% | 0.19% | -0.11% | 0.17% | -0.78% | 0.02% |
| 过去六个月 | -0.99% | 0.18% | -0.01% | 0.17% | -0.98% | 0.01% |
| 过去一年 | -0.60% | 0.17% | 2.23% | 0.19% | -2.83% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.55% | 0.21% | 4.18% | 0.23% | 2.37% | -0.02% |

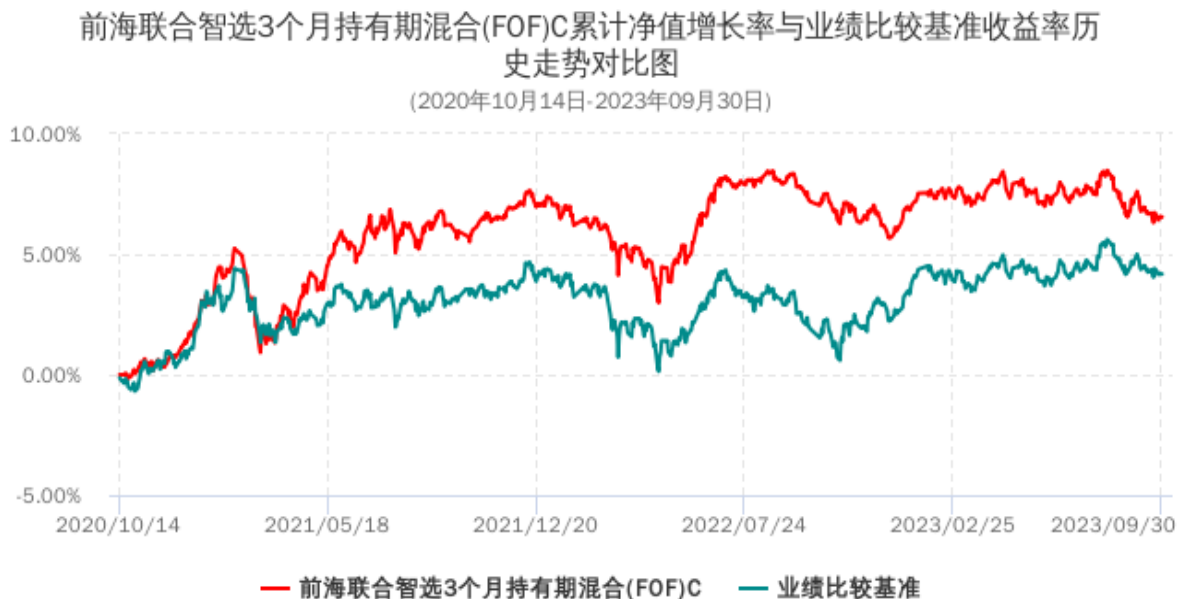
注：本基金业绩比较基准为：上证国债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%。

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

前海联合智选3个月持有期混合(FOF)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

(2020年10月14日-2023年09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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 须智宸 | 本基金基金经理 | 2022-02-15 | - | 4年 | 须智宸先生，波士顿大学硕士。曾任上银国际有限公司（香港）资产管理部固定收益分析师，现任新疆前海联合智选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自2022年2月15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。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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

2023 年三季度，我国经济延续上半年以来的弱修复格局，内生复苏动能不足，同时叠加海外资金收紧，权益市场各宽基指数普遍表现不佳。八月下旬以来多项利好政策密集落地，体现出政府托底经济的决心，政策底大概率可以确认，权益市场继续大幅下跌风险减小。相较于股市的缺乏信心，债市对政策发力表现得更为敏感，八月末以来债市利率扭头上行。

本基金三季度大类资产配置整体维持稳定，在偏债混合类投资策略中股债比例中性偏积极。后续我们仍将根据宏观经济和政策变化，适时在基金合同约定范围内对资产比例进行相应调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) A 基金份额净值为 1.0747 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%；截至报告期末前海联合智选 3 个月持有期混合 (FOF) C 基金份额净值为 1.0655 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为

-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

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，截至 2023 年 9 月 11 日，本基金基金资产净值连续 60 个工作日以上低于 5000 万元。本基金管理人已向证监会申请持续运作本基金。2023 年 9 月 12 日，本基金基金份额持有人大会审议通过了《关于持续运作新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的议案》。

§ 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 | 3,405,661.05 | 93.26 |
| 3 | 固定收益投资 | 101,540.19 | 2.78 |
| | 其中：债券 | 101,540.19 | 2.78 |
| | 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 | 112,462.53 | 3.08 |
| 8 | 其他资产 | 32,198.02 | 0.88 |
| 9 | 合计 | 3,651,861.79 | 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

| 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 | 101,540.19 | 2.82 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 101,540.19 | 2.82 |

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 | 019688 | 22 国债 23 | 1,000 | 101,540.19 | 2.82 |

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

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 | 25.21 |
| 2 | 应收证券清算款 | 30,229.74 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,943.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 32,198.02 |

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产 净值比 例(%) | 是否属于基金管 理人及管理人关 联方所管理的基 金 |
|----|--------|--------------|------------|----------------|----------------|----------------------|------------------------------------|
| 1 | 001338 | 安信稳健 增值C | 契约型开 放式 | 149,365. 26 | 235,280. 16 | 6.54 | 否 |
| 2 | 002651 | 东方红汇 利A | 契约型开 放式 | 217,552. 67 | 233,825. 61 | 6.50 | 否 |
| 3 | 001203 | 东方红稳 健精选A | 契约型开 放式 | 143,656. 25 | 228,571. 46 | 6.36 | 否 |
| 4 | 003031 | 安信新目 标C | 契约型开 放式 | 166,276. 72 | 226,152. 97 | 6.29 | 否 |
| 5 | 110018 | 易方达增 强回报B | 契约型开 放式 | 169,395. 46 | 225,465. 36 | 6.27 | 否 |
| 6 | 012220 | 南方安泰 C | 契约型开 放式 | 201,183. 81 | 225,446. 58 | 6.27 | 否 |
| 7 | 002010 | 中欧瑾通 C | 契约型开 放式 | 148,840. 98 | 206,129. 87 | 5.73 | 否 |
| 8 | 001136 | 易方达裕 如 | 契约型开 放式 | 152,922. 07 | 192,681. 81 | 5.36 | 否 |
| 9 | 002016 | 南方荣光 C | 契约型开 放式 | 125,930. 50 | 191,036. 57 | 5.31 | 否 |
| 10 | 004517 | 南方安康 | 契约型开 放式 | 175,820. 15 | 190,254. 98 | 5.29 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023年07月01日至 2023年09月30日 | 其中：交易及持有基金管理人以 及管理关联方所管理基金产生 的费用 |
|--------------------------|----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费 (元) | 350.56 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费 (元) | 7.56 | - |
| 当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元) | 1,631.57 | - |
| 当期持有基金产生的应支付 管理费(元) | 5,789.33 | - |
| 当期持有基金产生的应支付 | 1,318.27 | - |

| | | |
|---------------------|------|---|
| 托管费(元) | | |
| 当期交易基金产生的交易费 (元) | 4.46 | - |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| | 前海联合智选 3 个月 持有期混合 (FOF) A | 前海联合智选 3 个月 持有期混合 (FOF) C |
|---------------------------|------------------------------|------------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,459,157.35 | 1,272,946.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 601,249.92 | 304,248.72 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 93,254.37 | 186,628.35 |
| 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 | 1,967,152.90 | 1,390,567.36 |

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。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 前海联合智选 3 个月 持有期混合 (FOF) A | 前海联合智选 3 个月 持有期混合 (FOF) C |
|--|---------------------------------|---------------------------------|
| | | |

| | | |
|--------------------------|------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 956,328.31 | 958,221.54 |
| 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 | 956,328.31 | 958,221.54 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 28.4815 | 28.5379 |

8.2 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。

§ 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 | 20230701-20230930 | 1,914,549.85 | - | - | 1,914,549.85 | 57.02% |
| 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的议案》。该议案于 2023 年 9 月 12 日表决通过。有关详细信息请参见本基金管理人于 2023 年 8 月 4 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于以通讯方式召开新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会的公告》以及 2023 年 9 月 13 日发布的《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§ 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智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；

- 2、《新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《新疆前海联合智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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
二〇二三年十月二十五日