

# 新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2022 年 01 月 24 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2022年1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10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	前海联合泓瑞定开债券
基金主代码	005722
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018年03月07日
报告期末基金份额总额	49,547,173.31份
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，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（2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	162, 114. 16
2. 本期利润	205, 104. 16
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0041
4. 期末基金资产净值	50, 685, 264. 10
5. 期末基金份额净值	1. 0230

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

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. 41%	0. 01%	0. 60%	0. 05%	-0. 1 9%	-0. 0 4%
过去六个月	3. 12%	0. 09%	1. 44%	0. 05%	1. 68 %	0. 04 %
过去一年	5. 04%	0. 07%	2. 10%	0. 05%	2. 94 %	0. 02 %
过去三年	12. 75%	0. 07%	3. 37%	0. 07%	9. 38 %	0. 00 %
自基金合同 生效起至今	17. 98%	0. 06%	7. 62%	0. 07%	10. 3 6%	-0. 0 1%

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

新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式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

(2018年03月07日-2021年12月31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		
张文	本基金的基金经理	2021-08-20	-	9 年	张文先生，硕士，9 年证券基金投资研究经验。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和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）和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

				<p>20 日至 2022 年 1 月 5 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(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)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)。</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。

#### 4.1.1 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

2021 年四季度,经济数据显示供需整体仍较弱,下行压力持续,复苏进展放缓。生产端出现底部企稳,需求端弱势复苏,具体来看,工业生产从限电影响逐渐恢复,服务业表现偏弱,基建投资降幅扩大,制造业基本持平,地产延续回落略有企稳,进出口数据表现尚可,消费数据底部回升,CPI 略有回升,PPI 高位运行,类滞胀特征持续,稳增长压力显现;金融数据方面,政府债券和居民贷款支撑下,社融存量同比向上拐点出现。

资金面方面,央行 12 月降准符合市场预期,在关键时点也加大公开市场投放力度,流动性较宽松,资金价格整体平稳,但月末时点略有抬升。债市方面,季初现券偏弱,之后强势反弹,十年国债收益率下行 10bp,收于 2.8%以下,期限利差和信用利差收窄。

报告期内,本基金以利率债持仓为主,资产的安全性和流动性较高,未来一个季度会根据基本面和资金面的变化,动态调整仓位。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合泓瑞定开债券基金份额净值为 1.0230 元,本报告期内,基金份额净值增长率为 0.41%,同期业绩比较基准收益率为 0.60%。

### 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	43,967,000.00	86.39
	其中:债券	43,967,000.00	86.39
	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	6,300,000.00	12.38

	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	273,655.40	0.54
8	其他资产	350,282.17	0.69
9	合计	50,890,937.57	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	3,994,000.00	7.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,973,000.00	78.87
	其中：政策性金融债	39,973,000.00	78.87
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	43,967,000.00	86.75

## 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	210211	21 国开 11	300,000	29,973,000.00	59.14
2	108903	农发 2101	100,000	10,000,000.00	19.73
3	019658	21 国债 10	40,000	3,994,000.00	7.88

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

##### 1. 21 国开 11 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日，国家开发银行大连市分行、海南省分行、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 4530.91 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. 农发 2101 发债主体受监管处罚情况：

2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日，中国农业发展银行浙江省分行、托克托县支行等 16 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、人行等监管机构处以警告、罚款等行政处罚，罚款金额合计 625 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。

### 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	919.80
2	应收证券清算款	2,209.32
3	应收股利	-
4	应收利息	347,153.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	350,282.17

### 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

报告期期初基金份额总额	49,547,071.40
报告期期间基金总申购份额	101.91
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	49,547,173.31

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

持有的本基金份额_本期期初	1,000.00
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
持有的本基金份额	1,000.00
持有的本基金份额占总份额比例（%）	0.0020

## 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 报告期末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。

## § 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	20211001-20211231	24,770,561.07	-	-	24,770,561.07	49.99%
机构	2	20211001-20211231	24,770,174.90	-	-	24,770,174.90	49.99%

产品特有风险
--------

<p>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。</p>
--

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浙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《关于新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，该议案于 2021 年 12 月 7 日表决通过。本次基金份额持有人大会决议的事项，将于基金管理人发布基金份额持有人大会决议生效公告之日起实施，修订后的《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合同》自同日起正式生效。有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 11 月 2 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泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，以及于 2021 年 12 月 8 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泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金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泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合泓瑞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，其他备查文件等文本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  
二〇二二年一月二十四日