新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金
清算报告

基金管理人：新疆前海联合基金管理股份有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告出具日：2021 年 12 月 28 日

报告送出日：2022 年 2 月 25 日

一、重要提示

新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金(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[2016]2671号《关于准予新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金注册的批复》进行募集，于2017年8月14日正式生效。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《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》应当终止。本基金管理人于2021年11月16日发布《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永兴纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，审议议案于2021年12月21日通过，大会决议自通过之日起生效，本基金管理人于2021年12月22日发布《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合永兴纯债债券型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》。本基金的最后运作日定为2021年12月22日，并于2021年12月23日进入财产清算期，2021年12月28日为本基金清算的最后一日。

由本基金基金管理人、基金托管人、中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市盈科（广州）律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，北京市盈科（广州）律师事务所对清算报告出具法律意见书。

二、基金情况

（一）基本信息

1、基本信息

基金名称	新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金
基金简称	新疆前海联合永兴纯债
基金主代码	003928
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月14日
最后运作日（2021年12月22日）基金份额总额	462,800.05份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

投资策略	本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。首先，本基金在宏观周期研究的基础上，决定整体组合的久期、杠杆率策略。其次，本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。然后，本基金通过息差策略、个券挖掘策略的补充获得超额收益。最后，通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。通过甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，力争增加组合的绝对超额收益。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率。	
基金管理人	新疆前海联合基金管理股份有限公司	
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：	前海联合永兴纯债A	前海联合永兴纯债C
下属分级基金的交易代码：	003928	007036
最后运作日（2021年12月22日）下属分级基金的份额总额	1,936.95份	460,863.10份

2、基金运作情况

本基金由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中国人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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201,156,751.74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797号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年8月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为201,156,802.14份基金份额，其中认购资金利息折合50.40份基金份额。根据《关于新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金增加C类基金份额并相应修订基金合同的公告》和《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》，自2019年2月21日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费并根据持有期限收取赎回费，但不收取销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费，但收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费，称为C类基金份额。本基金增加C类基金份额后，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额在增加收取销售服务费的C类基金份额后，全部自动转换为本基金A类基

金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、地方政府债 、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具和货币市场工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票、以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起10个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，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。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

（二）清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》应当终止。本基金管理人于2021年11月16日发布《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永兴纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，审议议案于2021年12月21日通过，大会决议自通过之日起生效，本基金管理人于2021年12月22日发布《新疆前海联合基金管理有限公司关于新疆前海联合永兴纯债债券型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》。本基金的最后运作日定为2021年12月22日，并于2021年12月23日进入财产清算期，2021年12月28日为本基金清算的最后一日。

由本基金基金管理人、基金托管人、中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市盈科（广州）律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，北京市盈

科（广州）律师事务所对清算报告出具法律意见书。

（三）最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为2021年12月22日，清算期为2021年12月23日至2021年12月28日。

三、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

四、财务报告

资产负债表

会计主体：新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月22日

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月22日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	4,985.38
结算备付金	-
存出保证金	144.03
交易性金融资产	718,039.90
其中：股票投资	-
债券投资	718,039.90
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	15,175.66
应收申购款	-
资产总计	738,344.97

负债和所有者权益	-
负债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	116.68
应付托管费	38.96
应付销售服务费	38.74
应付交易费用	
应交税费	-
其他负债	92,507.04
负债合计	92,701.42
所有者权益：	
实收基金	462,800.05
未分配利润	182,843.50
所有者权益合计	645,643.55
负债和所有者权益总计	738,344.97

注：1、报告截止日2021年12月22日(基金最后运作日)，基金份额总额462,800.05份，其中前海联合永兴纯债A基金份额净值1.0884元，份额总额1,936.95份；前海联合永兴纯债C基金份额净值1.3964元，份额总额460,863.10份。

2、本财务报告已经中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自2021年12月23日至2021年12月28日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规及《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

（一）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。本基金清算费用为16,000.00元律师费。该款项已于2021年12月28日支付。

（二）最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款为4,985.38元，是存放于基金托管银行

的活期存款。

2、本基金最后运作日存出保证金为144.03元，应收活期存款利息为0.10元，应收存出保证金利息为0.01元。该款项将按照结算规则,逐步划回基金托管银行账户。

3、本基金最后运作日交易性金融资产为718,039.90元，全部为债券资产。应收债券利息为15,175.55元。本基金于2021年12月24日将最后运作日持有的全部债券资产变现，变现金额为 733,490.15元。

（三）最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理费为116.68元，应付托管费为38.96元，应付销售服务费38.74元，该款项已于2021年12月27日支付。

2、本基金最后运作日应付审计费为35,301.06元，该款项已于2021年12月27日支付。

3、本基金最后运作日应付信息披露费为57,205.98元，经与报社协商一致予以减免，该款项已于2021年12月28日回冲至基金资产。

（四）停止运作后的清算损益情况说明

项目	清算报告期间：2021年12月23日至2021年12月28日
一、收入	
1.利息收入	114.05
其中：存款利息收入	14.56
债券利息收入	99.43
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
证券出借利息收入	-
其他利息收入	0.06
2.投资收益（损失以“-”填列）	853.47
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	853.47
衍生工具收益	-

股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-677.47
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	57,205.98
二、费用	
1、管理人报酬	-
2、托管费	-
3、受托费	-
4、销售服务费	-
5、投资顾问费	-
6、交易费用	0.73
7、利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
8、税金及附加	-
9、其他费用	16,000.00
三、利润总额（亏损总额以"-"填列）	41,495.30
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"填列）	41,495.30

（五）截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

项目	金额
一、最后运作日 2021年12月22日基金净资产	645,643.55
加：清算报告期间净收益	41,495.30
减：清算报告期间赎回确认	-
二、2021年 12月28日基金净资产	687,138.85

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2021年12月28日，本基金剩余财产为687,138.85元。自本次清算期结束日次日2021年12月29日至清算款项支付日前一日的相关应收利息归基金份额持有人所有。根据相关规则，保证

金和应收利息将于未来划入基金托管银行账户，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付上述款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金基金合同》等规定及时进行分配。

六、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金清算报告》之审计报告；

2、《新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金清算报告》之法律意见书。

（二）存放地点

基金管理人的办公场所。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2021 年 12 月 28 日