

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  
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：上海银行股份有限公司

报告出具日：2022 年 1月 17日

报告送出日：2022 年 2月 28日

## 一、重要提示

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(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[2019]2190号《关于准予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注册的批复》进行募集,于2020年7月23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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式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,《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式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30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泓旭纯债1年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》,审议《关于终止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合同相关事项的议案》,审议议案于2022年1月4日通过,大会决议自通过之日起生效,本基金管理人于2022年1月5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泓旭纯债1年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》。本基金的最后运作日定为2022年1月5日,并于2022年1月6日进入财产清算期,2022年1月17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、致同会计师事务所(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,并由致同会计师事务所(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	新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	前海联合泓旭定开债券
基金主代码	008386
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月23日
最后运作日(2022年01月05日)基金份额总额	10,001,000.00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	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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。</p>
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	上海银行股份有限公司

## 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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合同》负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式基金，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209,999,999.99元，业经致同会计师事务所(特殊普通合伙)验字(2020)第441ZC00239号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2020年7月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为209,999,999.99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，基金托管人为上海银行股份有限公司。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《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合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即本基金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）至第1年年度对应日的前一日止。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）至第1年年度对应日的前一日止。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）至第1年年度对应日的前一日止，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、次级债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、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，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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产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，在每次开放期前1个月、开放期及开放期结束后1个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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》、《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式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30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泓旭纯债1年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》，审议《关于终止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合同相关事项的议案》，审议议案于2022年1月4日通过，大会决议自通过之日起生效，本基金管理人于2022年1月5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泓旭纯债1年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》。本基金的最后运作日定为2022年1月5日，并于2022年1月6日进入财产清算期，2022年1月17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、致同会计师事务所（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，并由致同会计师事务所（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2022年1月5日，清算期为2022年1月6日至2022年1月17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：新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年1月5日

单位：人民币元

项目	本期末 2022年1月5日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	205,553.47
结算备付金	8.70
存出保证金	1,232.01
交易性金融资产	10,007,428.14
其中：交易性股票投资	-
交易性债券投资	10,007,428.14
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收申购款	-
资产总计	10,214,222.32
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	416.08
应付托管费	138.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	85,945.87
负债合计	86,500.64
所有者权益：	
实收基金	10,001,000.00
未分配利润	126,721.68

所有者权益合计	10,127,721.68
负债和所有者权益总计	10,214,222.32

注：1、报告截止日2022年1月5日(基金最后运作日)，前海联合泓旭定开债券净值1.0127元，份额总额10,001,000.00份。

2、银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性债券投资所列金额包含对应应计利息。

3、本财务报告已经致同会计师事务所（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2022年1月6日至2022年1月17日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规及《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式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2022年1月17日支付。

### （二）最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日存放于本基金托管银行的活期存款为205,485.96元。

2、本基金最后运作日存出保证金为1,231.06元，应收存出保证金利息为0.95元，应收结算备付金利息为8.70元，应收活期存款利息为67.51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人民币10,007,428.14元，全部为债券资产。截至2022年1月10日已全部变现，变现金额为10,008,803.50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416.08元，应付托管费为138.69元，该款项已于2022年1月17日支付。

2、本基金最后运作日应付审计费为10,000.00元，该款项已于2022年1月17日支付。

3、本基金最后运作日应付信息披露费为75,945.87元，经与报社协商一致予以减免，该款项已于2022年1月6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：2022年1月6日至2022年1月17日
一、收入	
1. 利息收入	3,996.95
其中：存款利息收入	1,981.66
债券利息收入	2,015.29
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	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-57,886.00
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-57,886.00
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）	57,266.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
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	19.93
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	-59,745.87
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	63,102.89
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	63,102.89

#### （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 2022年1月5日基金净资产	10,127,721.68
加：清算报告期间净收益	63,102.89
减：清算报告期间赎回确认	-
二、2022年1月17日基金净资产	10,190,824.57

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2022年1月17日，本基金剩余财产为10,190,824.57元，其中银行存款为10,187,734.69元，存出保证金为1,231.06元，应收活期存款利息为2,048.57元，应收存出保证金利息为1.55元，应收结算保证金利息为8.70元，预提银行汇划费200.00元（该费用以银行实际结算金额为准）。

自本次清算期结束日次日2022年1月18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、《新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》等规定及时分配。

## 六、备查文件目录

### （一）备查文件目录

1、《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清算报告》之审计报告；

2、《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。

新疆前海联合泓旭纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2022年1月17日