

新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日：2023 年 04 月 12 日

报告送出日：2023 年 04 月 26 日

## 一、基金情况

## (一)、基本信息

## 1、基本信息

基金名称	新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金	
基金简称	前海联合沪深300	
基金主代码	003475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月30日	
最后运作日基金份额总额	11,601,499.59	
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。	
投资策略	本基金主要采用复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
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：	前海联合沪深300A	前海联合沪深300C
下属分级基金的交易代码：	003475	007039
报告期末下属分级基金的份额总额	4,136,940.84 份	7,464,558.75份

## 2、基金运作情况

新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金(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]1861号《关于准予新疆前海联合沪深300指数型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《新疆前海联合沪深300指数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200,202,657.90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(2016)第1557号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金合同》于2016年11月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,202,690.71份基金份额,其中认购资金利息折合32.81份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于新疆前海联合沪深300指数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《新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金合同》,自2019年2月26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《新疆前海联合沪深300指数型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,以沪深300指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票、存托凭证)、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具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相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于90%,投资于沪深300指数成份股和备选

成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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：沪深300指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

根据《新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金合同》以及新疆前海联合基金管理有限公司于2023年04月06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沪深300指数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》，本基金自2023年04月07日起进入基金财产清算程序。

## （二）、清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合沪深300指数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，《新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金合同》应当终止。本基金管理人于2023年03月03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沪深300指数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沪深300指数型证券投资基金基金合同相关事项的议案》（以下简称“《议案》”），议案于2023年04月04日经本基金基金份额持有人大会表决通过，大会决议自表决通过之日起生效，本基金管理人于2023年04月06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沪深300指数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》。

基金管理人、基金托管人、致同会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所成立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，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## （三）、最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为2023年04月06日，清算期为2023年04月07日至2023年04月12日。

## 二、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。

### 三、财务报告

#### 资产负债表

会计主体：新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金

报告截止日：2023 年 04 月 06 日

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 04 月 06 日
资产：	
银行存款	1,157,198.99
结算备付金	7,490.41
存出保证金	333.80
交易性金融资产	14,770,679.19
其中：股票投资	14,770,679.19
债券投资	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	147,241.00
应收利息	
应收申购款	
资产总计	16,082,943.39
负债和所有者权益	
负债：	

应付证券清算款	
应付赎回款	80,121.25
应付赎回费	3.28
应付管理人报酬	1,985.80
应付托管费	458.25
应付销售服务费	778.68
应付交易费用	1,394.38
应交税费	
其他负债	83,611.90
负债合计	168,353.54
所有者权益：	
实收基金	11,601,499.59
未分配利润	4,313,090.26
所有者权益合计	15,914,589.85
负债和所有者权益总计	16,082,943.39

注：1、报告截止日 2023 年 04 月 06 日(基金最后运作日)，前海联合沪深300A净值 1.3859 元，份额总额 4,136,940.84 份；前海联合沪深300C净值 1.3639 元，份额总额 7,464,558.75 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。

#### 四、清算情况

自 2023 年 04 月 07 日至 2023 年 04 月 12 日止为本基金清算报告期，基

金财产清算小组按照法律法规及《新疆前海联合沪深300指数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。根据本基金的基金合同，本基金的清算费用由基金财产承担。其中包括：律师费20,000.00元，审计费10,000.00元。

### （二）、最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日结算备付金 7,484.97 元，结算保证金为 333.62 元，该款项将按照结算规则，逐步划回托管户。

2、本基金最后运作日应收活期存款利息为 186.54元，应收结算备付金利息为 5.44元，应收结算保证金利息为 0.18 元；上述款项预计于 2023 年 06 月 21 日季度结息日划至基金托管户。

3、本基金最后运作日证券清算款为 147,241.00 元，该款项于 2023 年 04 月 07 日划入托管户。

4、本基金最后运作日本基金持有的交易性金融资产-股票投资为 14,770,679.19 元该资产已于 2023年 04 月 10 日前全部卖出清算金额为 14,849,752.01 元，已于 2023年 04 月 11 日全部划入基金托管户。

### （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 1,985.80 元，应付托管费为 458.25元，应付销售服务费为 778.68 元，应付交易费用 1,394.38 元，应付指数使用费 53,296.70 元，应付审计费 5,000.00 元，该款项已于 2023 年 04 月 11 日支付。

### （四）、停止运作后的清算损益情况说明

项 目	2023 年 04 月 07 日至 2023年04月12日
一、营业总收入	66,521.81
1. 利息收入	215.48
其中：存款利息收入	215.48
债券利息收入	-

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）	-643,056.93
其中：股票投资收益	-642,275.78
基金投资收益	-
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-781.15
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	
其他投资收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	709,288.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	75.18
减：二、营业总支出	4,725.80
1. 管理人报酬	
2. 托管费	
3. 销售服务费	
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	4,725.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	61,796.01

减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	61,796.01
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	61,796.01

### （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 2023 年 04 月 06 日 基金净资产	15,914,589.85
加：清算报告期间净收益	61,796.01
减：赎回金额（含费用及赎回费收入）	284,368.44
二、2023 年 04 月 12 日基金净资产	15,692,017.42

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2023 年 04 月 12 日，本基金剩余财产为 15,692,017.42 元。自本次清算期结束日次日 2023 年 04 月 13 日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，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该笔款项（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、《新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金合同》等规定及时进行分配。

## 五、备查文件目录

### （一）、备查文件目录

1、新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 06 日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

2、关于新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金清算事宜的法律意见。

### （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。

新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年04月12日