

新疆前海联合泳祺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有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告出具日：2023年9月15日

报告送出日：2023年11月2日

## 一、基金情况

### (一) 基本信息

#### 1、基本信息

基金名称	新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金
基金简称	前海联合泳祺纯债
基金主代码	006203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年09月06日
最后运作日基金份额总额	492,820.21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	<p>本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。</p> <p>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</p>

	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有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合泳祺纯债A	前海联合泳祺纯债C
下属分级基金的交易代码	006203	006204
报告期末下属分级基金的份额总额	491,360.12份	1,460.09份

## 2、基金运作情况

新疆前海联合泳祺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[2018]1036号《关于准予新疆前海联合泳祺纯债债券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》、《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2018年8月30日至2018年9月4日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币201,504,664.53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(2018)第0608号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,504,664.63份基金份额,其中认购资金利息折合为0.10份基金份额。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金根据认(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。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费,不收取销售服务费的,称为A类基金份额;收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,不收取认购费和申购费的,称为C类基金份额。相关费率及费率水平在招募说明书中列示。本基金的A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工

具，包括国内依法发行和上市交易的国债、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、中小企业私募券、资产支持证券、公开发行的次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具和货币市场工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票、权证，也不参与新股申购和增发。本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终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%。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。

根据《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》的约定：“基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，则本基金按照基金合同的约定进行清算并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管规则另有规定时，从其规定。”

截至2023年09月13日日终，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金已触发《基金合同》约定的基金合同终止条款，本基金应按照基金合同的约定进行清算并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金基金合同于2023年09月13日终止，自2023年09月14日进入清算程序。

## (二) 清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，截至2023年09月13日日终，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金已触发《基金合同》约定的基金合同终止条款，本基金应按照基金合同的约定进行清算并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金基金合同于2023年09月13日终止，自2023年09月14日进入清算程序。

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）和上海市通力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，上海市通力律师事务所对

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09月13日，清算期为2023年09月14日至2023年09月15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：新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023年09月13日

单位：人民币元

项目	本期末2023年09月13日
资产：	
银行存款	91,864.71
结算备付金	939.69
存出保证金	394.49
交易性金融资产	
其中：交易性股票投资	
交易性债券投资	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	506,091.16
应收利息	

应收申购款	
资产总计	599,290.05
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	66.45
应付托管费	22.19
应付销售服务费	0.24
应付交易费用	
应交税费	
其他负债	74,521.20
负债合计	74,610.08
所有者权益：	
实收基金	492,820.21
未分配利润	31,859.76
所有者权益合计	524,679.97
负债和所有者权益总计	599,290.05

注：1、报告截止日2023年09月13日(基金最后运作日)，前海联合泳祺纯债A净值1.0643元，份额总额491,360.12份；前海联合泳祺纯债C净值1.1823元，份额总额1,460.09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。

#### 四、清算情况

自2023年09月14日至2023年09月15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《新疆前海联合泳祺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。根据本基金的基金合同，本基金的清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。其中包括：律师费20,000.00元，审计费18,630.30元。

律师费20,000.00元，该款项已于2023年09月15日支付。

## （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本金余额为901.23元，结算保证金本金余额为392.81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128.60元，应收结算备付金利息为38.46元，应收结算保证金利息为1.68元；上述款项预计于2023年09月21日季度结息日划至基金托管户。

## （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66.45元，应付托管费为22.19元，应付销售服务费为0.24元，该款项已于2023年09月15日支付。

2、本基金最后运作日预提信息披露费为55,890.90元，经与报社协商一致予以减免，该款项已于2023年09月14日回冲至基金资产。

3、本基金最后运作日预提审计费为18,630.30元，根据合同约定，实际支付审计费18,630.30元，该款项已于2023年09月15日支付。

## （四）停止运作后的清算损益情况说明

项目	清算报告期间：2023年09月14日至2023年09月15日
一、收入	
1. 利息收入	6.82
其中：存款利息收入	6.82
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）	
其中：股票投资收益	
基金投资收益	
债券投资收益	
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）	
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	
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	-35,835.90
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	35,842.72
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”填列）	35,842.72

#### （五）停止运作后的清算损益情况说明

项目	金额
一、最后运作日2023年09月13日基金净资产	524,679.97

加：清算报告期间净收益	35,842.72
减：赎回金额（含费用及赎回费收入）	
二、2023年09月15日基金净资产	560,522.69

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09月15日，本基金剩余财产为560,522.69元。自本次清算期结束日次日2023年09月16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。

#### （六）基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

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、《新疆前海联合泳祺纯债债券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、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金2023年1月1日至2023年09月13日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；
- 2、关于《新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金清算报告》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。

新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2023年09月15日