

新疆前海联合添惠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：浙商银行股份有限公司

报告出具日：2022年7月7日

报告送出日：2022年7月28日

一、基金情况

(一) 基本信息

1、基本信息

基金名称	新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金	
基金简称	前海联合添惠纯债	
基金主代码	003174	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月10日	
最后运作日基金份额总额	4,322,444.48份	
投资目标	本基金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>本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,自上而下决定资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>本基金综合运用久期调整、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>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、期限结构、类属资产结构、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,决定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略;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。</p>	
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%。	
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	
下属分级基金的基金简称:	前海联合添惠纯债A	前海联合添惠纯债C
下属分级基金的交易代码:	003174	007038
报告期末下属分级基金的份额总额	665,067.58份	3,657,376.90份

2、基金运作情况

新疆前海联合添惠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]1287号《关于准予新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金注册的批复》、机构部函[2017]708号《关于新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金延期募集备案的回函》和机构部函[2018]13号《关于同意新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金延期募集备案的函》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《新疆前海联合添惠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210,509,646.44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0084号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年4月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,562,297.08份基金份额,其中认购资金利息折合52,650.64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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《关于新疆前海联合添惠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《新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》,自2019年2月22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》、《新疆前海联合添惠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,包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等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，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资于股票或权证等权益类资产，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。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：一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%。

根据《新疆前海联合添惠纯债债券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2022年6月22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添惠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》，本基金自2022年6月23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》、《新疆前海联合添惠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，《新疆前海联合添惠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2022年5月19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添惠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添惠纯债债券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2022年6月21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2022年6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添惠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》。

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2022年6月22日，清算期为2022年6月23日至2022年7月7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：新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年6月22日

单位：人民币元

项目	本期末2022年6月22日
资产：	
银行存款	69,727.76
结算备付金	13,181.01
存出保证金	2,474.22
交易性金融资产	5,089,567.28
其中：交易性股票投资	-
交易性债券投资	5,089,567.28
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	5,174,950.27
负债和所有者权益	
负债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	4,628.56
应付管理人报酬	936.71

应付托管费	312.24
应付销售服务费	263.50
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	65,003.34
负债合计	71,144.35
所有者权益：	
实收基金	4,322,444.48
未分配利润	781,361.44
所有者权益合计	5,103,805.92
负债和所有者权益总计	5,174,950.27

注：1、报告截止日2022年6月22日(基金最后运作日)，前海联合添惠纯债A净值1.1949元，份额总额665,067.58份；前海联合添惠纯债C净值1.1782元，份额总额3,657,376.90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2022年6月23日至2022年7月7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《新疆前海联合添惠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13,181.01元，结算保证金为2,474.22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0.68元,应收结算备付金利息为0.59元,应收结算保证金利息为0.12元;上述款项预计于2022年9月21日季度结息日划至基金托管户。

3、本基金最后运作日持有的交易性金融资产-债券投资为5,089,567.28元,该资产已于2022年6月28日前全部卖出,清算金额为5,086,515.39元,已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936.71元,应付托管费为312.24元,应付销售服务费为263.50元,该款项已于2022年7月4日支付。

2、本基金最后运作日应付信息披露费为56,000.84元,经与报社协商一致予以减免,该款项已于2022年7月6日回冲至基金资产。

3、本基金最后运作日预提审计费为8,999.48元,根据合同约定,实际支付审计费10,000.00元,该款项已于2022年7月6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：2022年6月23日至 2022年7月7日
一、收入	
1. 利息收入	418.85
其中：存款利息收入	418.85
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）	-8,301.05
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-

债券投资收益	-8,301.05
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）	5,254.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	19.99
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	5.09
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	-35,000.32
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	32,387.27
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	32,387.27

（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2022年6月22日基金净资产	5,103,805.92
加：清算报告期间净收益	32,387.27
减：赎回金额（含费用及赎回费收入）	186,545.29

二、2022年7月7日基金净资产	4,949,647.90
------------------	--------------

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7月7日，本基金剩余财产为4,949,647.90元。自本次清算期结束日次日2022年7月8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、《新疆前海联合添惠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、新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金2022年1月1日至2022年6月22日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；
- 2、关于新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金清算的法律意见。

（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。

新疆前海联合添惠纯债债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2022年7月7日