

中欧天禧纯债债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2022年3月18日

报告公告日期：2022年3月24日

一、重要提示

中欧天禧纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会《关于准予中欧天禧纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2315号文）准予募集，于2015年12月14日成立并正式运作，基金合同生效日的基金份额总额为395,008,061.32份，包含认购资金利息结转的份额239,526.10份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

依据《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》、《中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2022年2月28日表决通过了《关于终止中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，决定终止本基金基金合同。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2022年3月1日发布的《中欧基金管理有限公司关于中欧天禧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公告》。

本基金从2022年3月2日起进入清算期，由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师和上海市通力律师事务所律师组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称：中欧天禧纯债债券型证券投资基金。基金简称：中欧天禧债券。基金代码：001963。

2、基金运作方式：契约型、开放式。

3、基金合同生效日：2015年12月14日

4、基金运作终止日：2022年3月1日。基金份额总额 283,487,931.52 份。

5、投资目标：在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

6、业绩比较基准：中债综合指数收益率

7、风险收益特征：本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

8、基金管理人：中欧基金管理有限公司

9、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

1、资产负债表

会计主体：中欧天禧纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年3月1日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2022年3月1日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	312,478,367.51
结算备付金	412,137.72
存出保证金	27,792.10
交易性金融资产	295,003,306.30
其中：债券投资	295,003,306.30
资产支持证券投资	0.00
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收申购款	-
资产总计	607,921,603.63

负债：	
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	309,927,939.62
应付管理人报酬	152,098.99
应付托管费	30,419.80
应付销售服务费	-
应付交易费用	9,863.99
应交税费	2,862.35
应付利息	-
其他负债	81,506.80
负债合计	310,204,691.55
所有者权益：	
实收基金	283,487,931.52
未分配利润	14,228,980.56
所有者权益合计	297,716,912.08
负债和所有者权益总计	607,921,603.63

四、清盘事项说明

1、清算原因

依据《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》、《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于 2022 年 2 月 28 日表决通过了《关于终止中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，决定终止本基金基金合同，并依法履行基金财产清算程序。

2、清算起始日

本基金于 2022 年 3 月 2 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2022 年 3 月 2 日。

3、清算报表编制基础

本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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

五、清算情况

自2022年3月2日至2022年3月18日清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、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《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币412,137.72元，将于2022年4月4日划入托管户。存出保证金为人民币27,792.10元，已于2022年3月2日划入托管户1,135.20元，剩余将于2022年4月4日划入托管户。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币295,003,306.30元，本基金持有的债券均已卖出，共收回294,981,153.43元。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币309,927,939.62元，该款项已于2022年3月2日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币152,098.99元，该款项已于2022年3月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币30,419.80元，该款项已于2022年3月2日支付。

(4) 本基金最后运作日应付银行间交易费用为人民币9,863.99元，该款项将于2022年3月23日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币2,862.35元，该款项已于2022年3月3日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币81,506.80元，均为应付审计费用，已于2022年3月4日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 3 月 2 日 至 2022 年 3 月 18 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入	49,495.28
处置交易性金融资产产生的收益	1,206,794.64
公允价值变动损益	-1,228,947.51
清算收入小计	27,342.41
二、清算费用	2,595.00
清算费用小计	2,595.00
三、清算净收益	24,747.41

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 3 月 1 日基金净资产	297,716,912.08
加：自 2022 年 3 月 2 日至 2022 年 3 月 18 日 止清算期间净收益	24,747.41
减：清算期间确认的净赎回、转出款	528,493.87
二、2022 年 3 月 18 日基金净资产	297,213,165.62

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 3 月 18 日本基金剩余财产为人民币 297,213,165.62 元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2022 年 3 月 2 日至清算款划出日前一日的存款利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 《中欧天禧纯债债券型证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 1 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2) 上海市通力律师事务所关于《中欧天禧纯债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层。

3、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。

中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年三月十八日