

诺安基金管理有限公司关于诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金清算报告的公告

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2017年6月9日

清算报告公告日：2017年8月1日

一、重要提示

诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下基金诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金（以下简称：“本基金”，基金代码：001020）经中国证监会2015年1月5日证监许可【2015】44号文核准公开募集，于2015年3月23日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第五部分基金备案”中，“基金合同生效后，在开放期的最后一日日终，如基金资产净值低于2亿元，则无须召开持有人大会，基金合同将于该日次日终止并根据第二十部分的约定进行财产清算。”的条款以及《诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第二十部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的有关规定。

基金登记机构于2017年4月24日完成对本基金在本次开放期最后一日（即2017年4月21日）申购、赎回业务申请的确认，业务确认后本基金基金资产净值为37,370,309.87元，已触发了《基金合同》中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，无须召开持有人大会，本基金将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算。

自2017年4月24日起，本基金进入清算程序。本基金清算期自2017年4月24日至2017年6月9日止。由基金管理人诺安基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、北京颐合中鸿律师事务所于2017年4月24日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，北京颐合中鸿律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称 诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金

基金简称 诺安裕鑫收益定期开放债券

交易代码 001020

基金运作方式

契约型开放式。 本基金以定期开放方式运作，其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）两年的期间。 本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起 日起两年。 首个封闭期结束之后第一个工作日为管理费计提日，第二个

工作日起进入首个开放期， 下一个封闭期为首个开放期结束之日次日

起的两年，以此类推。 本基金每个开放期最长不超过1个月，最短不少于

5个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

基金合同生效日 2015年3月23日

投资目标 本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下，力求资产持续稳妥地保值增值，为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

投资策略

1、封闭期投资策略

在封闭期内，为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次

开放期的流动性需求， 原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合 久期与封闭期进行适当的匹配。

同时，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，减小基金净值的波动。

2、开放期投资安排

在开放期，本基金原则上将使基金资产保持现金状态，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足

开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况，进行相应压力测试，制定开放期操作规范流程和应急预案，做好应付极端情况下巨额赎回的准备。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的两年期定期存款基准利率（税后）+1.25%。

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 诺安基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017年4月24日（最后运作日）

单位：人民币元

资产：

银行存款 12,802,312.15

结算备付金 828,260.87

存出保证金 9,589.41

交易性金融资产 22,448,837.00

买入返售金融资产 13,000,000.00

应收利息 213,378.67

资产总计 49,302,378.10

负债：

应付赎回款 1,782,273.65

应付托管费 6,147.63

应付销售服务费 15,369.10

应付证券清算款 9,999,757.28

其他负债 124,300.00

负债合计 11,927,847.66

所有者权益：

实收基金 35,871,091.38

未分配利润 1,503,439.06

所有者权益合计 37,374,530.44

负债和所有者权益总计 49,302,378.10

四、清盘事项说明

1、基本情况

诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]44号《关于准予诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人诺安基金管理有限公司自2015年2月26日到2015年3月19日

止期间向社会公开募集，基金合同于 2015 年 3 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 209,723,746.96 份基金份额。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、短期融资券、高收益债券、可转换债券、中期票据、资产支持证券、债券回购及银行存款等。本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，所投资的债券的信用评级均在 AA-以上。在开放期，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在非开放期，本基金不受上述 5% 的限制。应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前三个月、开放期以及开放期结束后的三个月，本基金的债券资产比例可不受上述限制。本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的两年期定期存款基准利率（税后）+1.25%。

根据《基金合同》，基金合同生效后，在开放期的最后一日日终，如基金资产净值低于 2 亿元，则无须召开持有人大会，基金合同将于该日次日终止并根据基金合同的约定进行财产清算。

2、清算原因

本基金于开放日 2017 年 4 月 21 日基金资产净值加上当日有效申购申请金额扣除有效赎回申请金额后的余额低于人民币 2 亿元，满足基金合同终止的条件，按照基金合同的约定应进行基金财产清算。

3、清算起始日

根据基金合同的约定，本基金于 2017 年 4 月 24 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2017 年 4 月 24 日。

4、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，资产负债按清算价格计价。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。

五、清算情况

自 2017 年 4 月 24 日至 2017 年 6 月 9 日止清算期间，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、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币 10,741.59 元、应收结算备付金利息人民币 924.94 元、应收存出保证金利息人民币 13.02 元，共计人民币 11,679.55 元。该款项由基金管理人诺安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 6 月 9 日划入托管账户。剩余应收利息为应收债券利息，参见资产处置情况（5）。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 828,260.87 元，该款项由基金管理人诺安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 6 月 9 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金人民币 9,589.41 元，该款项由基金管理人诺安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 6 月 9 日划入托管账户。

(4) 本基金终止日持有的交易性金融资产人民币 22,448,837.00 元，应收债券利息人民币 201,699.12 元，明细如下：

单位：人民币元

交易平

台 债券名称 债券代码 终止日估

值单价 数量 终止日成本总额 终止日估值总额 终止日应收利息

交易所 15 付息国债 23 019523 96.58 98,750.00 9,939,658.07 9,537,275.00 8,089.38

交易所 14 汕投资 124575 98.76 19,840.00 1,859,793.70 1,959,398.40 16,260.41

交易所 14 象山债 124711 103.96 8,960.00 930,302.07 931,481.60 56,985.60

交易所 14 浏阳债 124921 105.80 290.00 29,134.50 30,682.00 1,091.40

银行间 16 扬州交产

SCP002

01169866

5 99.90 100,000.00 9,968,379.45 9,990,000.00 119,272.33

以上全部交易性金融资产于 2017 年 5 月 9 日已全部变现，变现产生的证券清算款人民币 22,739,577.36 元于 2017 年 5 月 9 日划入托管账户，且清算期间买入的 17 渤海证券 CP002 已于 2017 年 5 月 19 日变现，清算期间的交易所回购也已于 2017 年 6 月 2 日到期变现。清算期间共发生处置损失人民币 129,498.74 元，交易费用人民币 577.87 元。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,782,273.65 元，该款项已于 2017 年 4 月 26 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 6,147.63 元，该款项已于 2017 年 5 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 15,369.10 元，该款项已于 2017 年 5 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 9,999,757.28 元，该款项已于 2017 年 4 月 25 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 124,300.00 元，其中 9,300.00 元为预提银行间账户维护费，该款项将于 2017 年 6 月 9 日后支付；其中 115,000.00 为预提信息披露费，该款项已于 2017 年 6 月 9 日支付。

3、清算期间的清算损益情况

自 2017 年 4 月 24 日

至 2017 年 6 月 9 日

止清算期间

项目 单位：人民币元

一、清算收益

1、利息收入-债券利息收入 130,550.02

2、利息收入-买入返售证券利息收入 83,421.93

3、利息收入-银行存款利息收入（注 1） 7,895.96

4、交易性金融资产处置收益/（损失） -129,498.74

清算收入小计 92,369.17

二、清算费用

1、交易费用 577.87

2、清算律师费 40,000.00

3、清算审计费 30,000.00

4、银行汇划费 423.00

5、利息支出一卖出回购金融资产支出 154.73

清算费用小计 71,155.60

三、清算净收益 21,213.57

注 1：由于最后运作日和清算起始日均为 2017 年 4 月 24 日，此处的利息收入系计提的自 2017 年 4 月 25 日至 2017 年 6 月 9 日的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

4、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 2017 年 4 月 24 日基金净资产 37,374,530.44

加：清算期间净收益 21,213.57

二、2017年6月9日基金净资产 37,395,744.01

资产处置及负债清偿后，于2017年6月9日本基金剩余财产为人民币37,395,744.01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2017年4月24日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，清算起始日2017年4月24日至清算款划出日当天因支付清算相关费用及划出清算款产生的汇划费亦由份额持有人承担。基金管理人诺安基金管理有限公司于2017年6月9日以自有资金垫付并已于2017年6月9日划入托管账户人民币900,000.00元，用以垫付应收利息及结算备付金等，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。

5、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，报中国证监会备案后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)《诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》；

(2)颐合中鸿律师事务所关于《诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站

(www.lionfund.com.cn) 查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人办公场所，供公众查阅。

七、投资者可以通过拨打本公司客户服务电话400-888-8998进行咨询或登录本公司网站www.lionfund.com.cn了解相关情况。

八、本公告的有关内容在法律法规允许范围内由本公司负责解释。

风险提示：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。基金管理人管理的其他基金的业绩不代表本基金业绩表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。

投资者申请使用网上交易业务前，应认真阅读有关网上交易协议、相关规则，了解网上交易的固有风险，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好网上交易信息，特别是账号和密码。

特此公告。

诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一七年八月一日