

诺安基金管理有限公司关于中小板等权重交易型开放式指数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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2017年11月10日

清算报告公告日：2017年12月30日

一、重要提示

诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下基金中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金（以下简称：“本基金”，基金代码：159921）经中国证券监督管理委员会2012年8月7日证监许可【2012】1065号文核准公开募集，于2012年12月10日成立并正式运作，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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》、《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等相关法律法规的有关规定，本基金于2017年9月18日起至2017年10月30日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议并于2017年10月31日通过了《关于中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。根据基金份额持有人大会决议生效的《议案》，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11月1日起，本基金进入清算程序。本基金清算期自2017年11月1日至2017年11月10日止。由基金管理人诺安基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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11月1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

基金名称中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金

基金简称诺安中小板等权重ETF

场内简称中小等权

基金主代码159921

基金运作方式交易型开放式

基金合同生效日2012年12月10日

基金管理人诺安基金管理有限公司

基金托管人交通银行股份有限公司

注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司

基金合同存续期不定期

基金份额上市的证券交易所深圳证券交易所

上市日期2013-1-31

投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

投资策略

本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的

比例不低于基金资产净值的 90%。

业绩比较基准本基金的业绩比较基准为中小板等权重指数收益率。

风险收益特征

本基金是股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 10 月 31 日

单位：人民币元

最后运作日

2017 年 10 月 31 日

资产：

银行存款 1,040,826.48

存出保证金 135.40

交易性金融资产 10,963,833.37

应收利息 1,891.09

资产总计 12,006,686.34

负债：

应付管理人报酬 5,013.98

应付托管费 1,002.78

应付交易费用 1,075.14

其他负债 180,272.36

负债合计 187,364.26

所有者权益：

实收基金 7,305,171.00

未分配利润 4,514,151.08

所有者权益合计 11,819,322.08

负债和所有者权益总计 12,006,686.34

四、清盘事项说明

1、基本情况

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[2012]1065 号《关于准予中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人诺安基金管理有限公司自 2012 年 11 月 5 日到 2012 年 11 月 30 日期间向社会公开募集，基金合同于 2012 年 12 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额为 253,305,171.00 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证、股指期货以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)。其中，本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。

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。

2、清算原因

本基金于 2017 年 9 月 18 日起至 2017 年 10 月 30 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议并于 2017 年 10 月 31 日通过了《诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》之附件《关于中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。本基金的基金合同自 2017 年 10 月 31 日终止。

3、清算起始日

根据基金合同的约定，本基金于 2017 年 11 月 1 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2017 年 11 月 1 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 11 月 1 日至 2017 年 11 月 10 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利息余额人民币 1,891.09 元，清算期间计提应收活期存款利息人民币 4,194.52 元，应收存出保证金利息人民币 0.10 元，共计人民币 6,085.71 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 11 月 10 日划入托管账户。

(2)W 本基金最后运作日存出保证金人民币 135.40 元，清算期间存出保证金净增加人民币 4.93 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 140.33 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 11 月 10 日划入托管账户。

(3)本基金最后运作日持有的交易性金融资产人民币 10,963,833.37 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。其中，非停牌股票资产为人民币 10,289,535.21 元（单只非停牌股票最后运作日估值金额=该只股票最后运作日收盘价*股票数量），停牌股票资产为人民币 674,298.16 元（单只停牌股票最后运作日估值金额=该只停牌股票的停牌价格*股票数量）。具体情况如下：

①非停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2017 年 10 月 31 日）持有的全部非停牌股票已于 2017 年 11 月 1 日卖出，卖出所得金额共计人民币 10,312,554.63 元。

②停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2017 年 10 月 31 日）持有的全部停牌股票明细如下：

序号	股票名称	股票代码	数量（股）	停牌价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
----	------	------	-------	------------	-----------------

1	沙钢股份	002075	7,700	16.12	124,124.00
---	------	--------	-------	-------	------------

2	中环股份	002129	11,837	8.24	97,536.88
---	------	--------	--------	------	-----------

3	石基信息	002153	3,944	23.90	94,261.60
---	------	--------	-------	-------	-----------

4	深圳惠程	002168	7,532	16.99	127,968.68
---	------	--------	-------	-------	------------

5	金正大	002470	12,100	9.15	110,715.00
---	-----	--------	--------	------	------------

6	万达电影	002739	2,300	52.04	119,692.00
---	------	--------	-------	-------	------------

合计					674,298.16
----	--	--	--	--	------------

本次清算期间（2017年11月1日至2017年11月10日）停牌股票复牌及处置情况：

序号 股票名称 股票代码 数量（股） 复牌日期 变现日期

最后运作日估值金额

（人民币元）

变现金额（人民币

元）

1 石基信息 002153 3,944

2017年11月

2日

2017年11月2

日

94,261.60 100,659.48

截至清算结束日（2017年11月10日），本基金所持停牌股票明细如下：

序号 股票名称 股票代码 数量（股） 停牌价格（人民币元）

最后运作日估值金额（人民币

元）

1 沙钢股份 002075 7,700 16.12 124,124.00

2 中环股份 002129 11,837 8.24 97,536.88

3 深圳惠程 002168 7,532 16.99 127,968.68

4 金正大 002470 12,100 9.15 110,715.00

5 万达电影 002739 2,300 52.04 119,692.00

合计 580,036.56

基金管理人以自有资金垫付截至本次清算结束日仍持有的停牌股票资产人民币 580,

036.56 元， 该款项已于 2017 年 11 月 10 日划入托管账户。待全部停牌股票复牌并卖出变现

后，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按照基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。

2、 负债清偿情况

(1)2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 5,013.98 元， 该款项已于 2017 年 11 月 2 日支付。

(2)2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,002.78 元， 该款项已于 2017 年 11 月 2 日支付。

(3)2 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,075.14 元， 该款项已于 2017 年 11 月 3 日支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币 180,272.36 元， 其中 49,971.52 元为预提上市年费， 该款项已于 2017 年 11 月 7 日支付； 其中 50,300.84 元为指数使用费， 该款项已于 2017 年 11 月 8 日支付； 其中 80,000.00 元为预提信息披露费， 该款项已于 2017 年 11 月 9 日支付。

3、 清算期间的清算损益情况

项目

自 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 10 日止清算

期间

一、 清算收益

1、 利息收入-银行存款利息收入（注 1） 4,194.62

2、 股票变现收益（注 2） 40,644.84

清算收入小计 44,839.46

二、清算费用

1、交易费用 21,057.83

2、律师费 80,000.00

3、审计费 30,000.00

4、银行汇划手续费 50.00

5、上市年费（注3） 5,028.48

清算费用小计 136,136.31

三、清算净损失-91,296.85

注1：利息收入系计提的自2017年11月1日至2017年11月10日的银行存款利息及存出保证金利息。

注2：股票变现损益为本次清算期间卖出股票金额与其最后运作日估值金额及因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额的差额。

注3：上市年费为实际支付金额与最后运作日账面计提金额的差额。

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10月31日基金净资产 11,819,322.08

加：清算期间净损失-91,296.85

二、2017年11月10日基金净资产 11,728,025.23

资产处置及负债清偿后，于2017年11月10日本基金剩余财产为人民币11,728,025.23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11月1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11月1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11月10日以自有资金垫付并已于2017年11月10日划入托管账户人民币600,000.00元，用以垫付应收利息、存出保证金及停牌股票资产等，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。

52、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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时地进行分配。若分配后出现停牌股票整体变现金额高于基金管理人为其垫付金额的情况，基金管理人将根据约定再次进行分配，敬请投资者留意本公司届时发布的有关公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 北京颐合中鸿律师事务所关于《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见。
- (3) 《关于中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金清算备案的回函》（机构部函【2017】2958号）

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：

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、托管协议、招募说明书等文件及相关公告，如实填写或更新个人信息并核对自身的风险承受能力，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金产品。

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。

中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组

二〇一七年十二月三十日