
诺德天禧债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告出具日期：二〇一八年六月五日

报告公告日期：二〇一八年七月五日

目录

目录	1
1、重要提示	2
2、基金产品概况	3
3、基金运作情况概述	4
4、财务报告	4
4.1 资产负债表（已审计）	4
4.2 利润表（已审计）	5
5、基金财产分配	6
5.1 资产处置情况	6
5.2 负债清偿情况	7
5.3 清算期间的清算损益情况	7
5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况	7
5.5 基金财产清算报告的告知安排	8
6、备查文件目录	8
6.1 备查文件目录	8
6.2 存放地点	8
6.3 查阅方式	8

1、重要提示

诺德天禧债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]1620号《关于准予诺德天禧债券型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德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《诺德天禧债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集,于2016年8月15日成立并正式运作。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据市场环境变化,为维护基金份额持有人的利益,基金管理人根据《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《诺德天禧债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关约定,提议终止《基金合同》。

本基金于2018年4月11日至2018年5月11日期间以通讯方式组织召开了基金份额持有人大会,会议审议并表决通过了《关于终止诺德天禧债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,会议决议自2018年5月14日起生效。基金管理人于2018年5月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了《诺德基金管理有限公司关于诺德天禧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》。

根据生效的持有人大会决议,本基金自2018年5月16日进入清算程序。基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2018年5月16日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。

2、基金产品概况

基金名称	诺德天禧债券型证券投资基金
基金简称	诺德天禧
基金代码	003101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月15日
最后运作日（2018年5月15日） 基金份额总额	2,094,797.40份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系，形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期，并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析，综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素，主动构建和调整投资组合，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资收益的目的。
业绩比较基准	中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

3、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2016]1620号《关于准予诺德天禧债券型证券投资基金注册的批复》核准，由诺德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《诺德天禧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200,521,937.16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(2016)第1059号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德天禧债券型证券投资基金基金合同》于2016年8月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,529,988.25份基金份额，其中认购资金利息折合8,051.09份基金份额。自2016年8月15日至2018年5月15日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

本基金于2018年4月11日至2018年5月11日期间以通讯方式组织召开了基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止诺德天禧债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，会议决议自2018年5月14日起生效。根据生效的持有人大会决议，本基金自2018年5月16日进入清算程序。

4、财务报告

4.1 资产负债表（已审计）

会计主体：诺德天禧债券型证券投资基金

报告截止日：2018年5月15日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年5月15日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	306,937.57	243,003.71
结算备付金	8,607.28	457,808.54
存出保证金	27,196.56	30,095.13
交易性金融资产	-	51,718,002.60
其中：股票投资	-	8,321,708.50
债券投资	-	43,396,294.10
应收证券清算款	1,748,138.74	134,073.92

应收利息	280.38	1,087,058.49
应收申购款	919.26	199.84
资产总计	2,092,079.79	53,670,242.23
负债和所有者权益		
负 债:		
应付赎回款	184.34	2,522.49
应付管理人报酬	527.62	63,390.37
应付托管费	87.91	10,565.07
应付交易费用	-	32,919.28
其他负债	72,191.30	290,000.00
负债合计	72,991.17	399,397.21
所有者权益:		
实收基金	2,094,797.40	52,626,963.27
未分配利润	-75,708.78	643,881.75
所有者权益合计	2,019,088.62	53,270,845.02
负债和所有者权益总计	2,092,079.79	53,670,242.23

注:

1. 报告截止日 2018 年 5 月 15 日(基金最后运作日), 基金份额净值 0.9639 元, 基金份额总额 2,094,797.40 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 15 日(基金最后运作日)止期间。

4.2 利润表 (已审计)

会计主体: 诺德天禧债券型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 15 日

单位: 人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 15 日 (基金最后运作日)	2017 年度
一、收入	710,666.98	14,331,699.76
利息收入	180,005.18	18,374,382.55
其中: 存款利息收入	3,826.49	83,418.27
债券利息收入	174,129.53	17,834,085.86
买入返售金融资产收入	2,049.16	456,878.42
投资收益(损失以“-”填列)	427,387.31	-16,389,224.31
其中: 股票投资收益	598,367.08	3,748,673.60
债券投资收益	-169,761.62	-20,490,799.55
股利收益	-1,218.15	352,901.64
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	102,752.19	12,346,467.74

其他收入（损失以“-”号填列）	522.30	73.78
减：二、费用	105,608.54	4,373,811.65
管理人报酬	28,831.67	2,282,899.01
托管费	4,805.25	380,483.14
交易费用	24,771.34	264,883.31
利息支出	2,416.49	1,113,426.19
其中：卖出回购金融资产支出	2,416.49	1,113,426.19
税金及附加	342.49	-
其他费用	44,441.30	332,120.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	605,058.44	9,957,888.11
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	605,058.44	9,957,888.11

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师许康玮、都晓燕出具了普华永道中天特审字(2018)第 2216 号标准无保留意见的审计报告。

5、基金财产分配

自 2018 年 5 月 16 日至 2018 年 6 月 4 日止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，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：

5.1 资产处置情况

1、本基金最后运作日清算备付金为 8,607.28 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金。该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 29 日划入托管户。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。

2、本基金最后运作日存出保证金为 27,196.56 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 29 日划入托管户。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。

3、 本基金最后运作日应收利息为 280.38 元，其中应收活期存款利息为 188.56 元，应收备付金利息为 16.49 元，应收保证金利息为 75.33 元。该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 29 日划入托管户。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。

4、本基金最后运作日应收申购款为 919.26 元。该款项已于 2018 年 5 月 16 日划

入托管户。

5、本基金最后运作日应收证券清算款为 1,748,138.74 元。该款项已于 2018 年 5 月 16 日划入托管户。

5.2 负债清偿情况

1、 本基金最后运作日应付赎回款为 184.34 元,该款项已于 2018 年 5 月 17 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为 527.62 元,该款项已于 2018 年 5 月 24 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为 87.91 元,该款项已于 2018 年 5 月 24 日支付。

4、本基金最后运作日预提费用为 72,191.30 元。其中信息披露费为 50,000.00 元,该款项已于 2018 年 5 月 24 日支付;预提审计费为 22,191.30 元,该款项已于 2018 年 5 月 31 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

1、本基金清算期间应收利息为 547.17 元,其中应收活期存款利息收入为 526.24 元,应收备付金利息为 5.07 元,应收保证金利息为 15.86 元。该款项由基金管理人以自有资金垫付,并已于 2018 年 5 月 29 日划入托管户。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。

2、本基金清算期间公证费为 10,000.00 元,系基金份额持有人会议计票公证费,该款项已于 2018 年 5 月 24 日支付。

3、本基金清算期间律师费为 30,000.00 元,该款项已于 2018 年 5 月 24 日支付。

4、本基金清算期间补提审计费为 7,808.70 元,该款项已于 2018 年 5 月 31 日支付。

5、本基金清算期间产生的银行汇划费为 95.00 元,其中 50.00 元为预计金额。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日 2018 年 5 月 15 日基金净资产	2,019,088.62

减：2018年5月16日申赎调整	-3,307.46
加：清算期间净收益	-47,356.53
二、2018年6月4日基金净资产	1,975,039.55

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。

截至2018年6月4日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币2,009,948.28元，其中人民币36,631.39元为基金管理人代垫的最低备付金、存出保证金、以当前适用的利率预估的银行存款、最低备付金、存出保证金利息等。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人有权于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

5.5 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、诺德天禧债券型证券投资基金2018年5月15日资产负债表及审计报告
- 2、法律意见书

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 www.nuodefund.com。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

诺德天禧债券型证券投资基金
基金财产清算小组
清算报告出具日：2018年6月5日