

# 诺安基金管理有限公司关于诺安永鑫收益 一年定期开放债券型证券投资基金清算报 告

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年10月11日

清算报告公告日：2019年12月17日

## 一、重要提示

诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1613号文核准募集，于2014年6月24日成立并正式运作，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》、《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等相关法律法规的有关规定，诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2019年9月24日在《上海证券报》和指定网站披露了《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）触发基金合同终止情形，本公司按照《基金合同》有关规定对本基金的基金财产进行清算。本基金于2019年9月24日进入基金财产清算程序。

本基金清算期自2019年9月24日至2019年10月11日止。由基金管理人诺安基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2019年9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，上海源泰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 诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

基金简称 诺安永鑫一年定期开放债券

基金主代码 000510

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2014年6月24日

基金管理人 诺安基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

基金合同存续期 不定期

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，为投资者提供较好的养老资产管理工具。

### 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，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 同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）。

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。

### 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年9月23日

单位：人民币元

最后运作日

2019年9月23日

资产：

银行存款 18,140,694.23

结算备付金 2,390,909.09

存出保证金 836.05

应收利息 10,326.39

资产总计 20,542,765.76

负债：

应付赎回款 802,531.58

应付托管费 3,162.16

应付销售服务费 7,905.35

应付交易费用 6,341.64

其他负债 67,865.99

负债合计 887,806.72

所有者权益：

实收基金 15,402,866.11

未分配利润 4,252,092.93

所有者权益合计 19,654,959.04

负债和所有者权益总计 20,542,765.76

### 四、清盘事项说明

#### 1、基本情况

诺安永鑫收益一年定期开放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”)《关于核准诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1613号)批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2014年6月24日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为305,012,682.35份基金份额,其中认购资金利息折合164,224.75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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》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,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产以及股票等权益类品种和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金各类资产的投资比例范围为: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。其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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两个月、开放期以及开放期结束后的两个月内，本基金的债券资产比例可不受上述限制。

## 2、清算原因

根据《基金合同》“第五部分基金备案”的约定，基金合同生效后，在开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开持有人大会，基金将于该日次日终止运作并根据第二十部分的约定进行财产清算：1、基金资产净值低于5000万元。2、基金份额持有人人数少于200人。3、本基金前十名份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的90%。

基金登记机构于2019年9月23日完成对本基金在本次开放期最后一日（即2019年9月20日）申购、赎回业务申请的确认，业务确认后本基金的基金资产净值为19,879,045.50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。

## 3、清算起始日

根据基金合同的约定，本基金于2019年9月24日起进入清算期，故本基金清算起始日为2019年9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2019年9月24日至2019年10月11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为人民币10,326.39元，清算期间结算备付金结息人民币9,385.05元，其中结息收入为人民币1.26元；存出保证金结息人民币0.97元，其中结息损失为人民币0.07元；计提应收银行存款利息人民币6,359.84元，应收结算备付金利息人民币1,721.44元，应收存出保证金利息人民币0.72元，于清算结束日应收利息余额为人民币9,023.56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2019年10月11日划入托管账户。

(2)本基金最后运作日结算备付金余额为人民币2,390,909.09元，清算期间结算备付金净减少人民币2,390,909.09元，清算结束日结算备付金余额为人民币0.00元。

(3)本基金最后运作日存出保证金余额为人民币836.05元，清算期间存出保证金净减少人民币6.44元，清算结束日存出保证金余额为人民币829.61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2019年10月11日划入托管账户。

### 2、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币802,531.58元，该款项于2019年9月24日支付人民币563,284.35元，2019年9月25日支付人民币239,247.23元。

(2)本基金最后运作日应付托管费余额为人民币3,162.16元，该款项已于2019年10月9日支付。

(2)本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币7,905.35元，该款项已于2019年10月9日支付。

(4)本基金最后运作日应付交易费用余额为人民币6,341.64元，清算期间支付交易费用人民币5,650.00元，清算结束日应付交易费用余额为人民币691.64元。

(5)本基金最后运作日其他负债余额为人民币67,865.99元，其中9,300.00元为预提账户维护费，该款项于2019年10月8日支付人民币4,800.00元，于2019年10月9日支付人民币4,500.00元；其中58,565.99元为上海证券报信息披露费，因上海证券报减免诺安永鑫一年定期开放债券信息披露费，该款项已于2019年10月11日冲销。

### 3、清算期间的清算损益情况

项目 自 2019 年 9 月 24 日至 2019 年 10 月 11 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） 8,083.19

清算收入小计 8,083.19

#### 二、清算费用

1、律师费 10,000.00

2、审计费 30,000.00

3、银行汇划手续费 1,090.70

4、上海证券报信息披露费 -58,565.99

清算费用小计 -17,475.29

#### 三、清算净损益 25,558.48

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 9 月 24 日至 2019 年 10 月 11 日的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息，以及存出保证金和结算备付金结息损益。

#### 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 2019 年 9 月 23 日基金净资产 19,654,959.04

加：清算期间净损益 25,558.48

二、2019 年 10 月 11 日基金净资产 19,680,517.52

资产处置及负债清偿后，于 2019 年 10 月 11 日本基金剩余财产为人民币 19,680,517.52 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 2019 年 9 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 2019 年 9 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以自有资金垫付并已于 2019 年 10 月 11 日划入托管账户人民币 40,000.00 元，用以垫付应收利息、存出保证金等，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。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进行分配。

#### 六、备查文件目录

##### 1、备查文件目录

（1）《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》；

（2）上海源泰律师事务所关于诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金清算事宜的法律意见。

##### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

##### 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。

诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2019 年 12 月 17 日