

# 诺安优化配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 19 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 诺安优化配置混合  |
| 交易代码       | 006025  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 9 月 20 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 10,952,255.63 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采用 GARP (Growth at a Reasonable Price) 的投资策略，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、估值相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。本基金采用“自下而上”的选股方法，充分发挥管理人的研究优势，对企业的内在价值进</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>行深入细致的分析，本基金主要从公司的成长性与股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>4、权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎的原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。</p> <p>在预判市场风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在面临市场下跌时择机卖出股指期货合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%   |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。  |
| 基金管理人  | 诺安基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 中国银行股份有限公司  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2019年1月1日—2019年3月31日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,338,536.87              |
| 2. 本期利润         | 3,082,493.70              |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1299                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 12,549,959.58             |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1459                    |

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

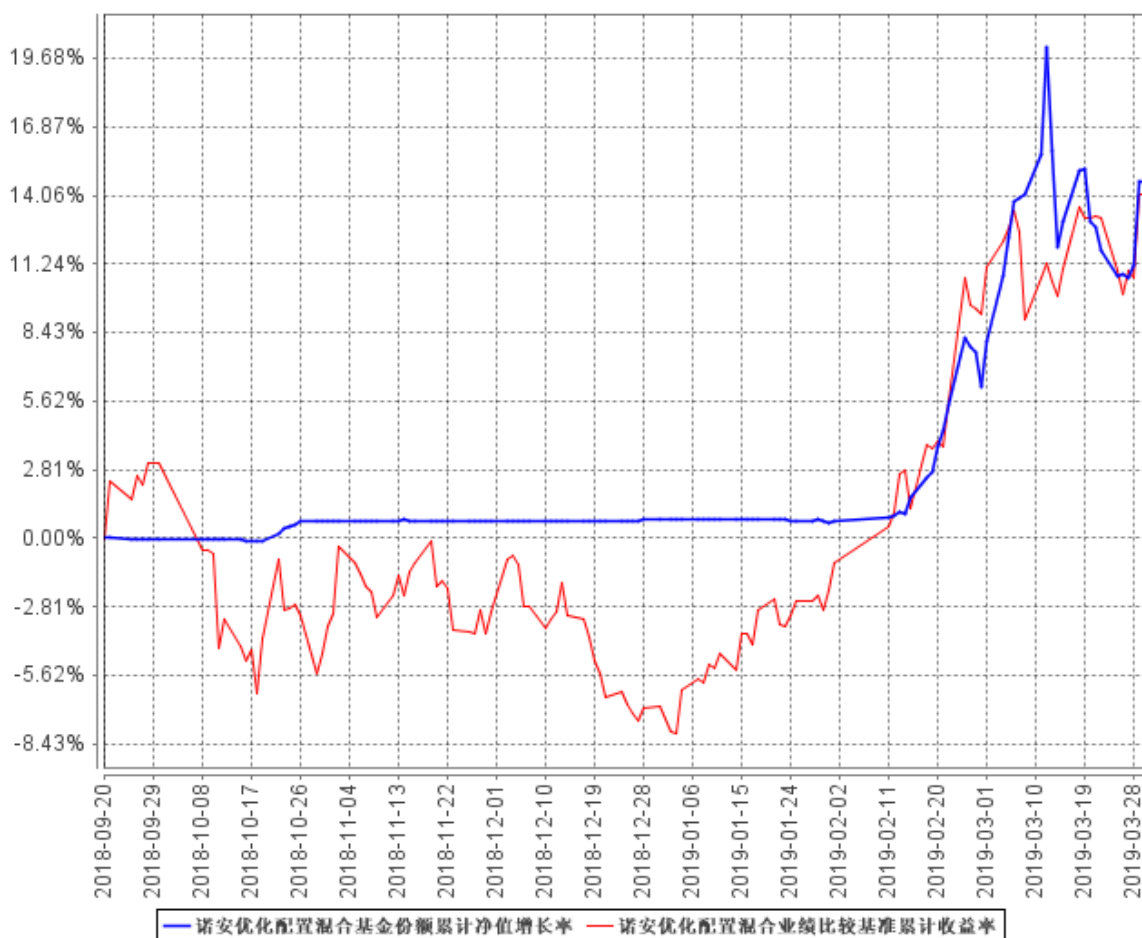
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 13.71%     | 1.19%         | 22.55%         | 1.24%                 | -8.84% | -0.05% |

注：本基金的业绩比较基准为“80%×沪深300指数+15%×中债综合全价指数+5%×金融机构人民币活期存款利率（税后）”。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 杨琨 | 本基金基金经理 | 2019 年 1 月 22 日 | -    | 11     | 硕士，曾先后任职于益民基金管理有限公司、天弘基金管理有限公司、诺安基金管理有限公司、安邦人寿保险股份有限公司，从事行业研究、投资工作。2014 年 6 月 7 日至 2015 年 7 月 |

|     |   |                    |                    |   |   |
|-----|---|--------------------|--------------------|---|---|
|     |   |                    |                    |   | <p>8 日任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 5 月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理。</p> <p>2017 年 8 月任诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任诺安优化配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 2 月起任诺安新经济股票型证券投资基金基金经理。</p>   |
| 盛震山 | 无 | 2018 年<br>9 月 20 日 | 2019 年<br>1 月 22 日 | 9 | <p>硕士/MBA，曾任职于中国电信集团北京市电信有限公司、中国移动通信有限公司研究院，后任职于光大证券股份有限公司，从事行业研究工作。</p> <p>2012 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，任研究员。2015 年 9 月至 2019 年 1 月任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 1 月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 3 月至 2019 年 1 月任诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 6 月至 2019 年 1 月任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理，2018 年 7 月至 2019 年 1 月任诺安积极配置混合型证券投资基金基金经理，</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 2018 年 9 月至<br>2019 年 1 月任诺安优<br>化配置混合型证券投资<br>基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：①此处盛震山先生的任职日期为基金合同生效之日，盛震山先生的离任日期及杨琨先生的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安优化配置混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安优化配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市

场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 1 次，主要原因在于投资组合采用不同的投资策略。经检查未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年市场存在三个重要的政策变量分别是持续宽松的货币政策、大规模减税和科创板的推出。货币是中短期的影响因素，减税和科创板是中长期的影响因素，针对于短期的投资策略来说我们更关注宽松的货币是否能顺利的进入实体经济，中长期的策略我们更关注受益于减税的优秀公司和科技创新能力强的公司。

持续的货币宽松政策会使得股票市场的估值水平和风险偏好好转。目前我们所处的阶段距离产生通胀还有一段时间，现阶段股票市场是可为的。与上一轮周期对比，政府此次开启的是减税而不是房地产，对企业和居民是长期的红利，有利于培育国内市场，减少对外贸的依存度。综合判断，宽松的货币政策是近期市场的主要矛盾，有利于股票市场回暖。大规模的减税会使得具有议价能力优秀公司的盈利能力再上一个台阶。科创板的推出会给市场带来新的科技类投资标的，估值体系也和传统公司有所区别。我国经过了人口红利和加杠杆的发展过程，现阶段及未来迫切需要高科技领域的突破以缩小和发达国家的差距和提升国内潜在增长率。本基金会权衡影响短期市场的主要矛盾，以及中国中长期发展的方向，来进行行业 and 公司的优化配置，为投资者带来满意的投资回报。

一季度信用扩张初现好转迹象，市场估值和风险偏好明显回升。一季度本基金重点配置了行业供需格局发生明显变化的行业、存在低估和减税受益的公司。上半年通胀风险不大，重点跟踪下半年的潜在风险因素。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.1459 元。本报告期基金份额净值增长率为 13.71%，同期业绩比较基准收益率为 22.55%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 3 月 29 日期间存在连续二十个工作日基



金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 10,461,455.50 | 74.64        |
|    | 其中：股票             | 10,461,455.50 | 74.64        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 100,000.00    | 0.71         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,442,252.16  | 24.56        |
| 8  | 其他资产              | 12,243.50     | 0.09         |
| 9  | 合计                | 14,015,951.16 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 1,223,521.60 | 9.75         |
| B  | 采矿业              | 118,233.00   | 0.94         |
| C  | 制造业              | 4,401,329.07 | 35.07        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -            |
| J  | 金融业              | 4,024,579.83 | 32.07        |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 693,792.00   | 5.53         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 10,461,455.50 | 83.36 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300498 | 温氏股份 | 30,136  | 1,223,521.60 | 9.75         |
| 2  | 002567 | 唐人神  | 92,363  | 1,214,573.45 | 9.68         |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 107,406 | 1,211,539.68 | 9.65         |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 319,227 | 1,190,716.71 | 9.49         |
| 5  | 601818 | 光大银行 | 285,700 | 1,171,370.00 | 9.33         |
| 6  | 002157 | 正邦科技 | 63,578  | 1,035,685.62 | 8.25         |
| 7  | 601888 | 中国国旅 | 9,900   | 693,792.00   | 5.53         |
| 8  | 600872 | 中炬高新 | 15,100  | 552,358.00   | 4.40         |
| 9  | 000935 | 四川双马 | 20,400  | 383,112.00   | 3.05         |
| 10 | 600438 | 通威股份 | 31,500  | 383,040.00   | 3.05         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除正邦科技、光大银行、浦发银行外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

2018 年 7 月 20 日，江西正邦科技股份有限公司（以下简称：“正邦科技”）披露下属子公司肇东正邦养殖有限公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》，公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》，处罚原因包括污水处理设施未运行，环保设施破损及其他环保措施不达标等。正邦科技得知上述情况后，专派项工作组驻点肇东进行整改，对相关责任人进行严肃处理，本次受处罚金额累计为 205 万元，占公司 2017 年度营业收入的 0.01%，上述对正邦科技环保负面影响因素已经消除，目前生产经营情况恢复正常。

截至本报告期末，正邦科技（002157）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有正邦科技。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

光大银行于 2018 年 11 月 9 日受到了中国银行保险监督管理委员会行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕10 号）主要违法违规事实为（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。行政处罚决定为没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。

截至本报告期末，光大银行（601818）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为处罚对公司净利润影响较小，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续

持有光大银行。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日发布的银反洗罚决字【2018】3 号文对浦发银行进行处罚。

主要违法行为类型和行政处罚内容如下：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 30 万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；存在与身份不明的客户进行交易的行为，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（四）项规定，处以 40 万元罚款；对浦发银行合计处以 170 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 18 万元罚款。

截至本报告期末，浦发银行（600000）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为处罚对公司净利润影响很小，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有浦发银行。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

#### 5.11.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 10,985.59 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 862.49    |
| 5  | 应收申购款   | 395.42    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 12,243.50 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 32,166,981.57 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,880,774.22  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 24,095,500.16 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 10,952,255.63 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|---|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |
| 机构  | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -    |
| 个人  | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -    |
| 产品特有风险  |                |                         |      |      |      |            |      |
| 本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意。 |                |                         |      |      |      |            |      |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安优化配置混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安优化配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安优化配置混合型证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安优化配置混合型证券投资基金 2019 年第一季度报告正文。
- ⑥报告期内诺安优化配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019 年 4 月 19 日