

诺安多策略混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 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贵金属投资明细.....	44
7.9 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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安多策略混合型证券投资基金
基金简称	诺安多策略混合
基金主代码	320016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 9 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,612,035.36 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安多策略股票型证券投资基金”变更为“诺安多策略混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过数量化手段优化投资策略，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略以及股指期货投资策略五部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略 本基金主要投资的大类资产是股票、债券和现金，我们将从宏观面、政策面、资金面和基本面等全面研究、综合分析，发掘择时因子，根据择时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。</p> <p>2. 股票投资策略 本基金以“定量投资”为主，辅以“定性投资”，力争实现稳定超额回报。</p> <p>3. 债券投资策略 本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。</p> <p>4. 权证投资策略 本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，进行稳健投资。</p> <p>5. 股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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

	险、中高收益的基金品种。
--	--------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	田青
	联系电话	0755-83026688	010-67595096
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	010-67595096
传真		0755-83026677	010-66275853
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		秦维舟	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,041,729.70
本期利润	7,536,996.07
加权平均基金份额本期利润	0.2908
本期加权平均净值利润率	19.08%
本期基金份额净值增长率	22.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	15,018,656.95
期末可供分配基金份额利润	0.5864
期末基金资产净值	40,630,692.31
期末基金份额净值	1.586
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	58.60%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或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 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

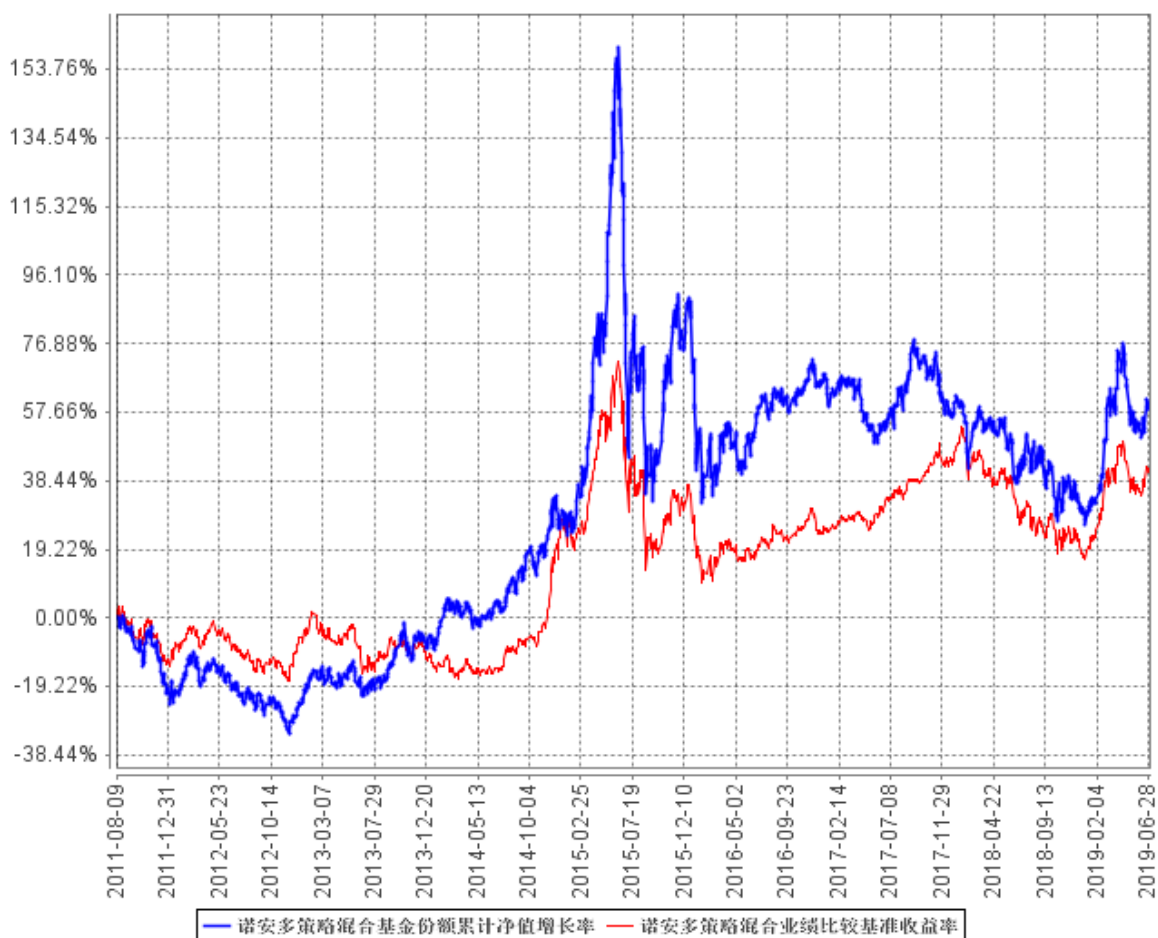
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.99%	1.22%	4.16%	0.87%	-1.17%	0.35%
过去三个月	-3.59%	1.51%	-0.59%	1.15%	-3.00%	0.36%
过去六个月	22.47%	1.50%	20.61%	1.16%	1.86%	0.34%
过去一年	11.30%	1.55%	8.48%	1.15%	2.82%	0.40%
过去三年	1.08%	1.17%	19.36%	0.83%	-18.28%	0.34%
自基金合同生效起至今	58.60%	1.57%	41.86%	1.11%	16.74%	0.46%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2019 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 62 只开放式基金: 诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金 (LOF)、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李玉良	本基金基金经理	2015 年 7 月 14 日	-	15	博士，曾任职于中国工商银行股份有限公司，从事内部风险管理及稽核工作。2010 年 6 月加入诺安基金管理有限公司，历任产品经理、基金经理助理。2015 年 3 月至 2019 年 5 月任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。2015 年 7 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理，2016 年 3 月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 7 月起任诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

报告期间，诺安多策略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《诺安多策略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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，市场行情开始好转，流动性改善、风险偏好提升推动估值修复。一季度各风格指数长势喜人，估值修复到合理区间。5 月初中方在中美第 11 轮经贸洽谈中强势亮出自己的底线，美方再次对中方输美产品加征关税，中美贸易冲突达到高峰。由于基本面疲弱以及中美贸易冲突加剧，市场展开了一轮调整。前期涨幅较大的中小创调整较多，以外资为主的增量资金加码

消费龙头，白马股形成抱团之势。上半年，中证 100 涨幅 28.81%，中小板上涨 20.75%，创业板涨幅 20.87%。

本基金采用量化风格择时及多因子选股策略，对市场主要风格指数进行风格择时。同时，利用量化手段把握行业、概念板块结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.586 元。本报告期基金份额净值增长率为 22.47%，同期业绩比较基准收益率为 20.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然我们认同中美竞争会是长期趋势，但我们也相信，最坏的时刻已经过去。中美贸易争端正在向好的方向发展。即使有反复，对市场的影响边际减弱。货币政策方面，美国经济下行压力加大，美国或许会进入降息周期，再加上目前欧洲主要国家国债有史以来第一次出现负利率，那么我们的货币政策有进一步宽松空间。

市场方面，经过二季度的震荡调整，目前主要风格指数估值位于合理区间。盈利方面，经济大概率于 2019 年 4 季度触底。板块方面以消费为代表的白马估值修复明显，恐怕难以取得超额收益。我们更看好以科技为代表的成长板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,205,729.24	12,512,473.76
结算备付金		561,891.34	609,911.02
存出保证金		96,859.23	114,224.68
交易性金融资产	6.4.7.2	36,185,531.48	23,338,246.20
其中：股票投资		36,185,531.48	23,338,246.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,370.57	2,456.78
应收股利		-	-
应收申购款		1,776.74	2,734.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		41,053,158.60	36,580,047.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,145,205.57
应付赎回款		52,793.67	7,320.06
应付管理人报酬		49,203.79	9,829.55
应付托管费		8,200.63	7,401.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	268,878.21	324,357.14
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	43,389.99	35,003.39
负债合计		422,466.29	2,529,116.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,612,035.36	26,287,294.72
未分配利润	6.4.7.10	15,018,656.95	7,763,635.57
所有者权益合计		40,630,692.31	34,050,930.29
负债和所有者权益总计		41,053,158.60	36,580,047.07

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.586 元，基金份额总额 25,612,035.36 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		8,678,179.81	-2,520,964.58
1.利息收入		50,198.48	94,149.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,152.46	36,858.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,046.02	57,291.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,129,591.91	-2,307,231.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,834,414.11	-2,541,924.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	295,177.80	234,693.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	495,266.37	-309,757.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,123.05	1,875.06
减：二、费用		1,141,183.74	1,378,251.67
1. 管理人报酬		292,994.67	315,342.07
2. 托管费		48,832.41	52,557.04
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	752,467.48	938,798.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	46,889.18	71,554.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,536,996.07	-3,899,216.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,536,996.07	-3,899,216.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,287,294.72	7,763,635.57	34,050,930.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,536,996.07	7,536,996.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-675,259.36	-281,974.69	-957,234.05
其中：1.基金申购款	2,073,540.28	1,316,934.32	3,390,474.60
2.基金赎回款	-2,748,799.64	-1,598,909.01	-4,347,708.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,612,035.36	15,018,656.95	40,630,692.31
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	30,597,608.35	17,528,128.54	48,125,736.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,899,216.25	-3,899,216.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-4,376,295.86	-2,485,058.06	-6,861,353.92
其中：1.基金申购款	1,217,830.01	641,902.00	1,859,732.01
2.基金赎回款	-5,594,125.87	-3,126,960.06	-8,721,085.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	26,221,312.49	11,143,854.23	37,365,166.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 奥成文 </u>	<u> 薛有为 </u>	<u> 薛有为 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）原名为诺安多策略股票型证券投资基金。根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第104号）规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自2015年8月6日起，诺安多策略股票型证券投资基金名称变更为诺安多策略混合型证券投资基金。原诺安多策略股票型证券投资基金经中国证监会《关于核准诺安多策略股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]739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《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2011年8月9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1,249,071,475.18份基金份额，其中认购资金利息折合236,845.34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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》和《诺安多策略混合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，包括国内依法发行、上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具、股指期货和资产支持证券以及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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个

人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,205,729.24
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,205,729.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,200,229.47	36,185,531.48	-14,697.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	36,200,229.47	36,185,531.48	-14,697.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,103.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	227.61
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	39.24
合计	1,370.57

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	268,878.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	268,878.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付赎回费	83.23
预提费用	43,306.76
合计	43,389.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,287,294.72	26,287,294.72
本期申购	2,073,540.28	2,073,540.28
本期赎回(以“-”号填列)	-2,748,799.64	-2,748,799.64
本期末	25,612,035.36	25,612,035.36

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,148,839.84	-6,385,204.27	7,763,635.57
本期利润	7,041,729.70	495,266.37	7,536,996.07
本期基金份额交易产生的变动数	-451,475.43	169,500.74	-281,974.69
其中：基金申购款	1,557,911.88	-240,977.56	1,316,934.32
基金赎回款	-2,009,387.31	410,478.30	-1,598,909.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,739,094.11	-5,720,437.16	15,018,656.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	29,158.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,105.87
其他	888.26
合计	34,152.46

注：本报告期内“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	246,156,543.42
减：卖出股票成本总额	238,322,129.31
买卖股票差价收入	7,834,414.11

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	295,177.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	295,177.80

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	495,266.37
——股票投资	495,266.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-

增值税	
合计	495,266.37

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	3,067.64
基金转换费收入	55.41
合计	3,123.05

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	752,467.48
银行间市场交易费用	-
合计	752,467.48

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	25,950.67
汇划费	3,582.42
合计	46,889.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	托管人、代销机构
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	292,994.67	315,342.07
其中：支付销售机构的客户维护费	107,278.33	115,117.57

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日

日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	48,832.41		52,557.04	

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,205,729.24	29,158.33	12,575,377.61	30,543.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计

息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制办公会，实施董事会合规审查与风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金管理人建立了以合规审查与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险控制部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同

中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,205,729.24	-	-	-	-	4,205,729.24
结算备付金	561,891.34	-	-	-	-	561,891.34
存出保证金	96,859.23	-	-	-	-	96,859.23
交易性金融资产	-	-	-	-	36,185,531.48	36,185,531.48
应收利息	-	-	-	-	1,370.57	1,370.57
应收申购款	-	-	-	-	1,776.74	1,776.74
资产总计	4,864,479.81	-	-	-	36,188,678.79	41,053,158.60
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	52,793.67	52,793.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	49,203.79	49,203.79
应付托管费	-	-	-	-	8,200.63	8,200.63
应付交易费用	-	-	-	-	268,878.21	268,878.21
其他负债	-	-	-	-	43,389.99	43,389.99
负债总计	-	-	-	-	422,466.29	422,466.29
利率敏感度缺口	4,864,479.81	-	-	-	-35,766,212.50	40,630,692.31
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	12,512,473.76	-	-	-	-	12,512,473.76
结算备付金	609,911.02	-	-	-	-	609,911.02
存出保证金	114,224.68	-	-	-	-	114,224.68
交易性金融资产	-	-	-	-	23,338,246.20	23,338,246.20
应收利息	-	-	-	-	2,456.78	2,456.78
应收申购款	-	-	-	-	2,734.63	2,734.63
资产总计	13,236,609.46	-	-	-	23,343,437.61	36,580,047.07
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,145,205.57	2,145,205.57
应付赎回款	-	-	-	-	7,320.06	7,320.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	9,829.55	9,829.55
应付托管费	-	-	-	-	7,401.07	7,401.07
应付交易费用	-	-	-	-	324,357.14	324,357.14
其他负债	-	-	-	-	35,003.39	35,003.39
负债总计	-	-	-	-	2,529,116.78	2,529,116.78
利率敏感度缺口	13,236,609.46	-	-	-	-20,814,320.83	34,050,930.29

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	36,185,531.48	89.06	23,338,246.20	68.54
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	36,185,531.48	89.06	23,338,246.20	68.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化 其他市场变量保持不变		
	分析	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
			相关风险变量的变动
		本期末(2019年6月 30日) <table border="1" style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr> <td>上年度末(2018年12月 31日)</td> </tr> </table>	上年度末(2018年12月 31日)
上年度末(2018年12月 31日)			

	业绩比较基准上升 5%	2,817,535.36	1,658,791.07
	业绩比较基准下降 5%	-2,817,535.36	-1,658,791.07

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布,在 95%的置信度下,使用过去一年的历史数据,按照 VaR 正态算法,计算未来一个交易日里,基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信区间 : 95%		
	2. 观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位:人民币元)	本期末(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	1,044,812.06	774,779.91
	合计	1,044,812.06	774,779.91

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 36,151,661.54 元,无属于第二层次的余额,属于第三层次的余额为 33,869.94 元,其中列入属于第三层次的金融工具为未上市交易的股票(2018 年 12 月 31 日:属于第一层次的余额为 23,338,246.20 元,无属于第二、三层次的余额)。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2018 年 12 月 31 日:无)。

(2)其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,185,531.48	88.14
	其中：股票	36,185,531.48	88.14
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	-	-
	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	4,767,620.58	11.61
8	其他各项资产	100,006.54	0.24
9	合计	41,053,158.60	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采矿业	20,966.30	0.05
C	制造业	20,348,691.80	50.08
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	2,073,900.00	5.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,240,973.72	3.05
H	住宿和餐饮业	3,265,990.00	8.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	487,322.72	1.20
J	金融业	8,747,686.94	21.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	36,185,531.48	89.06

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	61,600	3,389,848.00	8.34
2	600030	中信证券	138,200	3,290,542.00	8.10
3	600967	内蒙一机	258,800	2,898,560.00	7.13
4	600258	首旅酒店	139,300	2,504,614.00	6.16
5	600038	中直股份	52,655	2,159,908.10	5.32
6	600297	广汇汽车	465,000	2,073,900.00	5.10
7	300206	理邦仪器	307,400	2,068,802.00	5.09
8	002371	北方华创	29,403	2,036,157.75	5.01
9	600837	海通证券	143,300	2,033,427.00	5.00
10	300604	长川科技	104,200	1,964,170.00	4.83
11	300473	德尔股份	60,129	1,736,525.52	4.27
12	002008	大族激光	38,000	1,306,440.00	3.22
13	300122	智飞生物	29,400	1,267,140.00	3.12
14	300450	先导智能	37,500	1,260,000.00	3.10
15	601872	招商轮船	284,627	1,240,973.72	3.05
16	300296	利亚德	155,461	1,217,259.63	3.00
17	002049	紫光国微	27,200	1,199,792.00	2.95
18	600478	科力远	206,500	1,154,335.00	2.84
19	600754	锦江股份	30,900	761,376.00	1.87
20	300036	超图软件	31,900	471,482.00	1.16
21	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.08
22	300782	卓胜微	247	26,903.24	0.07
23	600968	海油发展	5,906	20,966.30	0.05
24	300780	德恩精工	637	18,855.20	0.05
25	603867	新化股份	696	17,963.76	0.04
26	300594	朗进科技	360	15,879.60	0.04
27	601698	中国卫通	4,041	15,840.72	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601111	中国国航	13,081,018.08	38.42
2	601336	新华保险	11,820,625.80	34.71
3	600029	南方航空	9,690,159.00	28.46
4	601601	中国太保	8,481,748.00	24.91
5	600309	万华化学	7,657,829.00	22.49
6	300206	理邦仪器	7,612,324.20	22.36
7	300296	利亚德	6,775,454.87	19.90
8	601318	中国平安	6,495,553.13	19.08
9	300473	德尔股份	6,119,598.75	17.97
10	002008	大族激光	5,257,018.20	15.44
11	600478	科力远	5,102,329.50	14.98
12	601398	工商银行	5,083,923.00	14.93
13	601872	招商轮船	4,776,026.49	14.03
14	601688	华泰证券	4,602,035.77	13.52
15	000002	万科A	4,350,373.00	12.78
16	300679	电连技术	4,276,648.20	12.56
17	002373	千方科技	4,145,643.00	12.17
18	601128	常熟银行	3,852,567.42	11.31
19	601211	国泰君安	3,770,698.00	11.07
20	600875	东方电气	3,601,907.00	10.58
21	600754	锦江股份	3,530,213.32	10.37
22	002230	科大讯飞	3,396,343.00	9.97
23	600536	中国软件	3,367,528.00	9.89
24	600030	中信证券	3,349,666.00	9.84
25	600426	华鲁恒升	3,173,220.00	9.32
26	002368	太极股份	2,922,357.00	8.58
27	600967	内蒙一机	2,906,104.00	8.53
28	603799	华友钴业	2,710,666.60	7.96
29	000938	紫光股份	2,684,103.78	7.88
30	600977	中国电影	2,435,180.00	7.15

31	002714	牧原股份	2,380,702.00	6.99
32	002157	正邦科技	2,376,896.00	6.98
33	601699	潞安环能	2,355,584.00	6.92
34	002236	大华股份	2,347,188.00	6.89
35	603019	中科曙光	2,289,355.00	6.72
36	600867	通化东宝	2,278,037.92	6.69
37	600258	首旅酒店	2,242,366.00	6.59
38	300349	金卡智能	2,228,584.00	6.54
39	600038	中直股份	2,144,005.50	6.30
40	601003	柳钢股份	2,133,288.00	6.26
41	300339	润和软件	2,110,348.00	6.20
42	600837	海通证券	2,068,667.00	6.08
43	001979	招商蛇口	2,053,662.00	6.03
44	300604	长川科技	2,045,332.80	6.01
45	002371	北方华创	2,041,790.05	6.00
46	600297	广汇汽车	2,033,111.00	5.97
47	600066	宇通客车	2,019,939.00	5.93
48	002567	唐人神	1,990,282.00	5.85
49	300284	苏交科	1,972,466.00	5.79
50	002475	立讯精密	1,960,875.30	5.76
51	002020	京新药业	1,950,091.17	5.73
52	300070	碧水源	1,788,004.38	5.25
53	002138	顺络电子	1,771,945.16	5.20
54	601628	中国人寿	1,761,680.00	5.17
55	300469	信息发展	1,694,637.00	4.98
56	002422	科伦药业	1,661,561.00	4.88
57	002405	四维图新	1,637,276.00	4.81
58	002653	海思科	1,590,677.50	4.67
59	300003	乐普医疗	1,588,316.00	4.66
60	300498	温氏股份	1,565,518.00	4.60
61	000977	浪潮信息	1,539,386.00	4.52
62	603986	兆易创新	1,531,757.17	4.50
63	000670	*ST 盈方	1,476,431.00	4.34
64	300365	恒华科技	1,467,744.00	4.31
65	002310	东方园林	1,441,496.00	4.23
66	300422	博世科	1,378,665.00	4.05

67	002449	国星光电	1,369,860.20	4.02
68	603026	石大胜华	1,359,424.00	3.99
69	603816	顾家家居	1,343,745.46	3.95
70	600887	伊利股份	1,321,063.31	3.88
71	000826	启迪环境	1,249,594.60	3.67
72	300450	先导智能	1,232,090.00	3.62
73	300122	智飞生物	1,228,715.00	3.61
74	002049	紫光国微	1,227,264.00	3.60
75	600756	浪潮软件	1,213,994.00	3.57
76	002110	三钢闽光	1,190,870.00	3.50
77	600343	航天动力	1,154,262.31	3.39
78	600104	上汽集团	1,146,272.00	3.37
79	600507	方大特钢	1,106,758.00	3.25
80	600588	用友网络	1,105,841.00	3.25
81	300316	晶盛机电	1,035,551.00	3.04
82	600216	浙江医药	935,636.00	2.75
83	600048	保利地产	890,811.00	2.62
84	002128	露天煤业	819,878.00	2.41
85	300446	乐凯新材	796,743.00	2.34
86	000915	山大华特	783,414.00	2.30

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601111	中国国航	12,946,570.41	38.02
2	601318	中国平安	10,396,520.00	30.53
3	601601	中国太保	10,139,456.00	29.78
4	601336	新华保险	10,006,516.05	29.39
5	600029	南方航空	9,948,001.00	29.22
6	600309	万华化学	8,753,901.28	25.71
7	300296	利亚德	7,910,646.18	23.23
8	300206	理邦仪器	5,731,188.75	16.83
9	600478	科力远	5,445,202.50	15.99
10	601398	工商银行	5,129,367.00	15.06
11	601688	华泰证券	4,690,731.91	13.78

12	002373	千方科技	4,476,849.00	13.15
13	000002	万科A	4,284,832.37	12.58
14	600536	中国软件	4,057,026.00	11.91
15	601872	招商轮船	3,803,584.62	11.17
16	601128	常熟银行	3,800,275.00	11.16
17	300679	电连技术	3,736,752.00	10.97
18	002008	大族激光	3,736,695.00	10.97
19	601211	国泰君安	3,660,419.00	10.75
20	300473	德尔股份	3,540,304.00	10.40
21	603019	中科曙光	3,424,774.00	10.06
22	600426	华鲁恒升	3,273,508.00	9.61
23	002236	大华股份	3,241,541.08	9.52
24	002368	太极股份	3,095,448.00	9.09
25	002230	科大讯飞	3,019,402.00	8.87
26	600756	浪潮软件	2,938,399.00	8.63
27	600754	锦江股份	2,787,702.00	8.19
28	600104	上汽集团	2,778,665.00	8.16
29	600875	东方电气	2,711,662.00	7.96
30	000938	紫光股份	2,666,099.96	7.83
31	300451	创业慧康	2,644,786.00	7.77
32	601699	潞安环能	2,569,345.90	7.55
33	603799	华友钴业	2,456,570.00	7.21
34	002714	牧原股份	2,427,811.00	7.13
35	600977	中国电影	2,408,213.00	7.07
36	002157	正邦科技	2,377,459.00	6.98
37	300349	金卡智能	2,262,424.00	6.64
38	601003	柳钢股份	2,245,664.40	6.60
39	000977	浪潮信息	2,222,505.40	6.53
40	600867	通化东宝	2,221,636.24	6.52
41	001979	招商蛇口	2,073,937.00	6.09
42	300339	润和软件	2,068,306.00	6.07
43	300070	碧水源	2,067,760.00	6.07
44	002475	立讯精密	1,997,521.60	5.87
45	300284	苏交科	1,968,820.00	5.78
46	002020	京新药业	1,948,281.22	5.72
47	002567	唐人神	1,944,188.00	5.71
48	603986	兆易创新	1,925,648.00	5.66
49	600066	宇通客车	1,876,082.56	5.51

50	002422	科伦药业	1,856,271.00	5.45
51	601628	中国人寿	1,808,209.00	5.31
52	002310	东方园林	1,796,724.00	5.28
53	300003	乐普医疗	1,791,656.00	5.26
54	000670	*ST 盈方	1,688,112.00	4.96
55	002653	海思科	1,622,132.50	4.76
56	300498	温氏股份	1,538,949.00	4.52
57	300469	信息发展	1,505,772.00	4.42
58	000826	启迪环境	1,480,531.20	4.35
59	002138	顺络电子	1,480,455.00	4.35
60	300365	恒华科技	1,473,886.00	4.33
61	600055	万东医疗	1,440,436.24	4.23
62	300422	博世科	1,438,338.00	4.22
63	002405	四维图新	1,426,751.00	4.19
64	603026	石大胜华	1,377,060.00	4.04
65	600343	航天动力	1,376,626.03	4.04
66	002110	三钢闽光	1,376,595.00	4.04
67	002449	国星光电	1,369,996.00	4.02
68	300316	晶盛机电	1,368,772.00	4.02
69	600887	伊利股份	1,357,165.50	3.99
70	600036	招商银行	1,323,220.00	3.89
71	603816	顾家家居	1,304,973.00	3.83
72	600507	方大特钢	1,221,304.00	3.59
73	600498	烽火通信	1,194,381.00	3.51
74	600588	用友网络	1,190,162.00	3.50
75	000800	一汽轿车	1,108,981.70	3.26
76	300271	华宇软件	1,054,495.00	3.10
77	600332	白云山	1,047,339.26	3.08
78	300550	和仁科技	1,032,320.00	3.03
79	600216	浙江医药	1,005,378.00	2.95
80	300168	万达信息	993,347.00	2.92
81	000915	山大华特	962,674.00	2.83
82	600048	保利地产	883,895.00	2.60
83	002128	露天煤业	881,340.00	2.59
84	300446	乐凯新材	777,275.00	2.28

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	250,674,148.22
卖出股票收入（成交）总额	246,156,543.42

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除新华保险外，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 10 月 18 日，新华人寿保险股份有限公司收到中国银行保险监督管理委员会出具的《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》（银保监处罚决字（2018）1 号）。主要是因为公司未依法履行其他职责，信息披露虚假或严重误导性陈述。

截至本报告期末，新华保险（601336）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司估值较低，有增长潜力，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新华保险。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,859.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,370.57
5	应收申购款	1,776.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,006.54

7.12.4 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。

7.12.5 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情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,654	15,484.91	0.00	0.00%	25,612,035.36	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	665,413.18	2.5980%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年8月9日）基金份额总额	1,249,071,475.18
本报告期期初基金份额总额	26,287,294.72
本报告期基金总申购份额	2,073,540.28
减：本报告期基金总赎回份额	2,748,799.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	25,612,035.36

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	1	288,403,181.45	58.10%	268,590.12	58.10%	-
中泰证券	1	187,563,003.48	37.79%	174,678.13	37.79%	-
光大证券	1	20,407,406.47	4.11%	19,005.76	4.11%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需, 并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6)、研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
浙商证券	-	-	85,200,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019年1月2日
2	诺安基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用诺安基金名义进行诈骗活动的提示性公告	《中国证券报》	2019年1月17日
3	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过东海证券定投申购起点金额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019年1月21日
4	诺安多策略混合型证券投资基金	《证券时报》	2019年1月21日

	2018 年第 4 季度报告		
5	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在桂林银行停止办理申(认)购、定投申购、转换的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 3 月 1 日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券(山东)为代销机构的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 3 月 6 日
7	诺安基金管理有限公司关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 3 月 15 日
8	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)2019 年第 1 期-摘要	《证券时报》	2019 年 3 月 26 日
9	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)2019 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2019 年 3 月 26 日
10	诺安多策略混合型证券投资基金 2018 年年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 27 日
11	诺安多策略混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《证券时报》	2019 年 3 月 27 日
12	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过华夏财富办理申购、定投业务起点金额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 3 月 28 日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中投证券基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 3 月 29 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 3 月 30 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票华友钴业估值调整的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 4 月 13 日
16	诺安多策略混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《证券时报》	2019 年 4 月 19 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京植信基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 4 月 19 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在嘉实财富开通定投业	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券	2019 年 4 月 23 日

	务并开展费率优惠活动的公告	报》、《证券日报》	
19	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过肯特瑞办理申购、定投业务起点金额、最低赎回（保有）份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 4 月 26 日
20	诺安基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 4 月 30 日
21	诺安基金管理有限公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 5 月 20 日
22	诺安基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 5 月 21 日
23	诺安基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 5 月 29 日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 6 月 21 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金定投业务费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 6 月 27 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。							

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安多策略股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安多策略混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安多策略股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥诺安多策略混合型证券投资基金 2019 年半年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安多策略混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日