

诺安汇利灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	诺安汇利混合	
基金主代码	005901	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 11 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	
报告期末基金份额总额	5,803,713.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C
下属分级基金的交易代码:	005901	005902
报告期末下属分级基金的份额总额	5,130,367.02 份	673,346.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极的大类资产配置和个股个券精选，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外经济形势、宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平及信用风险等因素的研判，预测各大类资产在不同市场周期内的风险收益特征，并以此来调整基金资产在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、类属资产配置策略</p> <p>受信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等不同因素的影响，国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券等不同类属的券种收益率变化特征存在明显的差异，并表现出不同的利差变化趋势。基金管理人将分析各类属券种的利差变化趋势，合理配置并灵活调整不同类属券种在组合中的构成比例，通过对类属的合理配置力争获取超越基准的收益率水平。</p> <p>3、普通债券投资策略</p> <p>本基金将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。</p> <p>4、可转换债券投资策略</p> <p>本基金将积极参与公司发行条款较好、基本面优秀、申购收益高的可转债的一级市场申购，待其上市后依据对其正股的判断以及可转债合理定价水平决定继续持有或卖出；同时，本基金将综合运用多种投资策略在可转债二级市场上进行投资操作，力争在风险可控的前提下获取较高的投资收益。</p> <p>5、可交换债券投资策略</p> <p>可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基</p>

	<p>金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析，综合开展投资决策。</p> <p>6、股票投资策略</p> <p>本基金可适当参与股票二级市场投资，增强基金资产收益。</p> <p>股票投资主要采用自上而下与自下而上相结合，定性分析与定量分析相结合。充分借鉴内部和外部研究观点，动态跟踪行业景气度和估值水平，优先选择具备完善的法人治理结构和有效的激励机制、明显受益于行业景气提升、根据市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等指标衡量的估值水平相对偏低的上市公司</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>9、权证投资策略</p> <p>在严格控制风险的前提下，本基金可适度进行权证投资。投资权证的目的为控制下跌风险和实现基金资产增值。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95599
传真	0755-83026677	010-68121816
注册地址	深圳市深南大道 4013 号 兴业银行大厦 19-20 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号 兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	秦维舟	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

基金级别	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,252,529.08	196,620.46
本期利润	1,498,870.58	195,711.89
加权平均基金份额本期利润	0.1794	0.1678
本期加权平均净值利润率	16.53%	15.19%
本期基金份额净值增长率	8.27%	8.29%
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	493,993.65	76,396.31
期末可供分配基金份额利润	0.0963	0.1135
期末基金资产净值	5,624,360.67	749,743.15
期末基金份额净值	1.0963	1.1135
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	9.63%	11.35%

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

诺安汇利混合 A

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	0.55%	0.94%	1.99%	0.34%	-1.44%	0.60%
过去三个月	-4.59%	1.08%	0.23%	0.44%	-4.82%	0.64%
过去六个月	8.27%	0.98%	9.29%	0.45%	-1.02%	0.53%
自基金合同生效起至今	9.63%	0.71%	7.65%	0.45%	1.98%	0.26%

诺安汇利混合 C

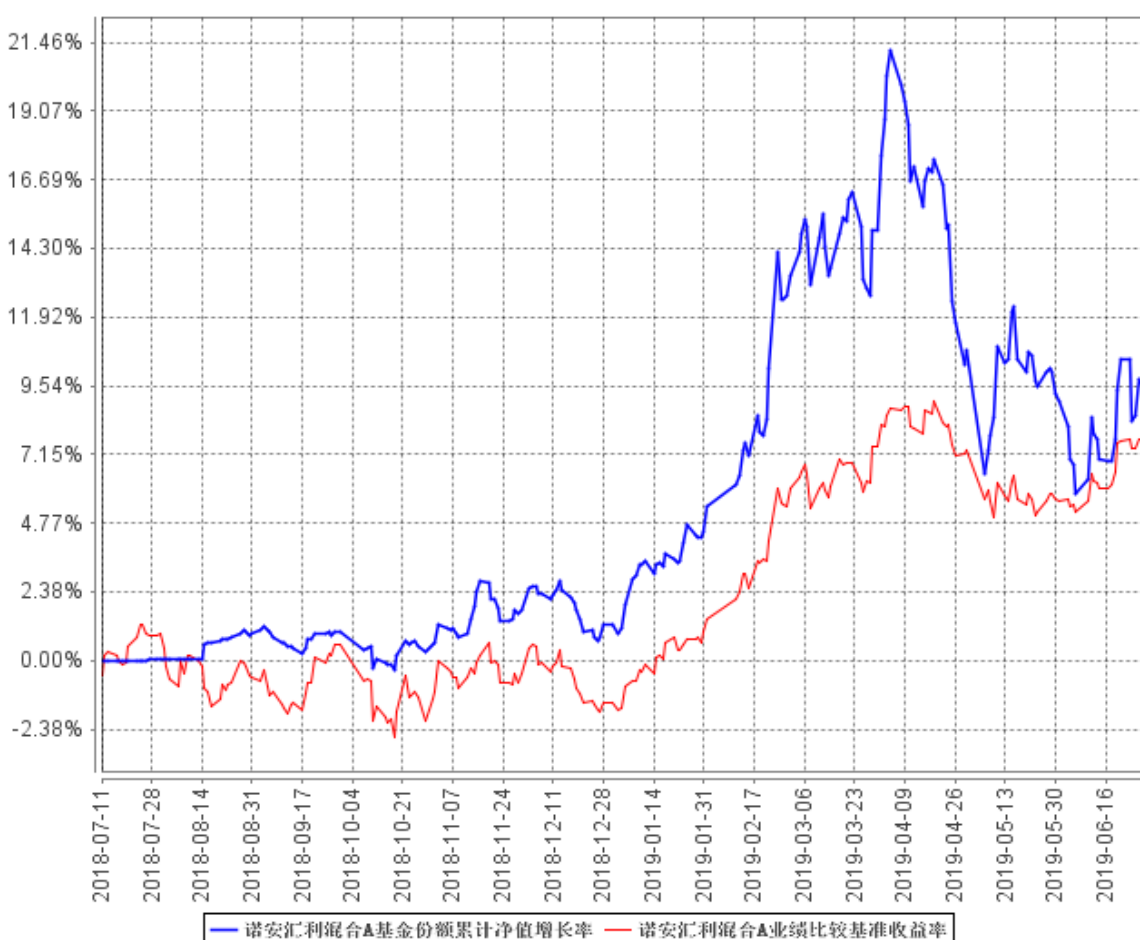
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②	③			
过去一个月	0.50%	0.94%	1.99%	0.34%	-1.49%	0.60%
过去三个月	-4.71%	1.08%	0.23%	0.44%	-4.94%	0.64%
过去六个月	8.29%	0.98%	9.29%	0.45%	-1.00%	0.53%
自基金合同生效起至今	11.35%	0.72%	7.65%	0.45%	3.70%	0.27%

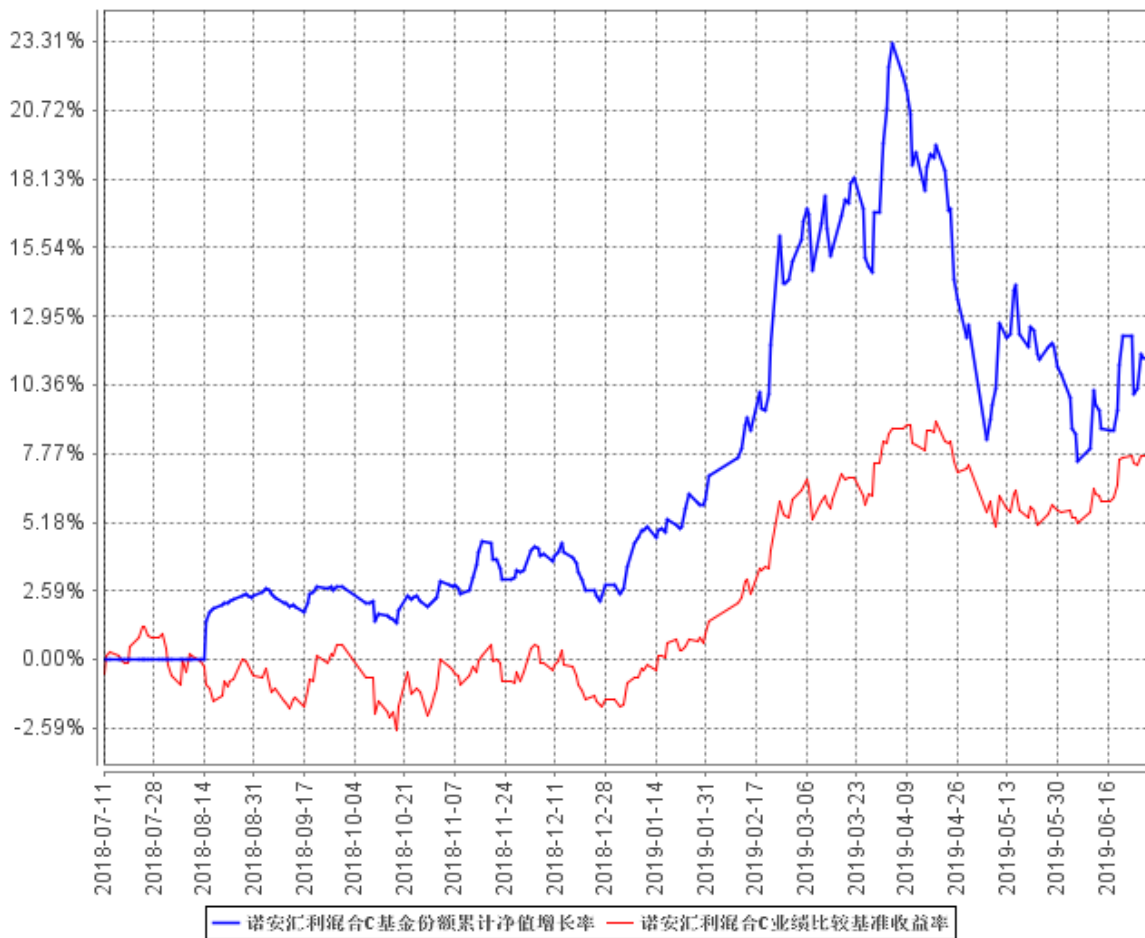
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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

诺安汇利混合 A



诺安汇利混合 C



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		
谢志华	本基金基金经理	2018 年 7 月 11 日	-	13	理学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司，从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于 2010 年 8 月至 2012 年 8 月任招商安心收益债券基金经理，2011 年 3 月至 2012 年 8 月任招商安瑞进取债券基金经理。2012 年 8 月加入诺安基金管理有限公司，任投资经理，现任固定收益事业部副总经理、总裁助理。2013 年 11 月至 2016 年 2 月任诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理，2015 年 3 月至 2016 年 2 月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券基金经理，2013 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安信用债券一年定期开放债券基金经理，2014 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安永鑫收益一年定期开放债券基金经理，2013 年 8 月至 2016 年 3 月任诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理，2014 年 11 月至 2017 年 6 月任诺安保本混合基金经理，2015 年 12 月至 2017 年 12 月任诺安利鑫保本混合及诺安景鑫保本混合基金经理，2016 年 1 月至 2018 年 1 月任诺安益鑫保本混合基金经理，2016 年 2 月至 2018 年 3 月任诺安安鑫保本混合基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 1

					<p>月任诺安利鑫混合基金经理，2016年4月至2018年5月任诺安和鑫保本混合基金经理，2014年11月至2018年6月任诺安汇鑫保本混合基金经理，2017年12月至2018年7月任诺安景鑫混合基金经理，2017年6月至2019年1月任诺安行业轮动混合基金经理，2013年5月至2019年6月任诺安鸿鑫保本混合基金经理。2013年5月起任诺安纯债定期开放债券基金经理，2013年12月起任诺安优化收益债券基金经理，2014年11月起任诺安聚利债券基金经理，2016年2月起任诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理，2018年5月起任诺安天天宝货币基金经理，2018年7月起任诺安汇利灵活配置混合基金经理，2019年3月任诺安鼎利混合基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

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合规守信情况的说明

报告期间，诺安汇利灵活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《诺安汇利灵活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 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

受财政提早发力等因素的影响，宏观经济数据一季度有所企稳，二季度温和回落。通胀温和上行，总体可控。资金方面相对宽松。债券市场上半年基本呈现震荡走势，4 月份，受公布的一季度数据超预期等因素影响，收益率有所上行，进入 5 月以后，受中美贸易摩擦等因素影响，收益率震荡回落。转债市场一季度涨幅较大，二季度有所回调。

投资运作上，诺安汇利混合以可转债投资为主，进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，诺安汇利混合 A 基金份额净值为 1.0963 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.27%。截至本报告期末，诺安汇利混合 C 基金份额净值为 1.1135 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.29%。同期业绩比较基准收益率为 9.29%。

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，经济有一定下行压力，需关注房地产投资及出口数据走势。全球降息背景下，国内货币政策预计仍将保持相对宽松，债券市场仍有一定机会。信用债方面，当前经济背景下，信用风险仍需警惕。可转债当前位置仍有较高投资价值。

下一阶段，诺安汇利混合将继续积极把握转债市场机会。

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

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期末有利润分配事项。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—诺安基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，诺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：诺安汇利灵活配置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	876,985.72	2,000,787.54
结算备付金		5,053.16	19,291.10
存出保证金		1,281.05	863.73
交易性金融资产	6.4.7.2	5,562,221.73	19,488,063.73
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,562,221.73	19,488,063.73
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	9,810.63	244,716.43
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,455,352.29	21,753,722.53
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		-	1,999,757.00
应付证券清算款		13.45	-
应付赎回款		56,712.84	37,074.18
应付管理人报酬		5,238.98	17,178.60
应付托管费		1,047.80	3,435.69
应付销售服务费		366.98	1,184.33
应付交易费用	6.4.7.7	254.02	2,434.45
应交税费		47.86	135.50

应付利息		-	2,137.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	17,566.54	55,093.14
负债合计		81,248.47	2,118,430.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,803,713.86	19,357,368.38
未分配利润	6.4.7.10	570,389.96	277,923.87
所有者权益合计		6,374,103.82	19,635,292.25
负债和所有者权益总计		6,455,352.29	21,753,722.53

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，诺安汇利混合 A 基金份额净值 1.0963 元，基金份额总额 5,130,367.02 份；诺安汇利混合 C 基金份额净值 1.1135 元，基金份额总额 673,346.84 份。诺安汇利混合份额总额合计为 5,803,713.86 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安汇利灵活配置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
一、收入		1,806,601.67
1.利息收入		48,500.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,544.41
债券利息收入		44,956.33
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,485,353.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,208.70
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,463,844.01
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	301.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	245,432.93
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	27,314.24
减：二、费用		112,019.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,258.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,451.65

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,882.31
4. 交易费用	6.4.7.19	1,282.09
5. 利息支出		7,752.51
其中：卖出回购金融资产支出		7,752.51
6. 税金及附加		52.65
7. 其他费用	6.4.7.20	36,339.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,694,582.47
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,694,582.47

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安汇利灵活配置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）	19,357,368.38	277,923.87	19,635,292.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,694,582.47	1,694,582.47
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）	-13,553,654.52	-1,402,116.38	-14,955,770.90
其中：1.基金申购款	3,313,725.64	392,876.41	3,706,602.05
2.基金赎回款	-16,867,380.16	-1,794,992.79	-18,662,372.95
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）	5,803,713.86	570,389.96	6,374,103.82

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：

_____ 奥成文	_____ 薛有为	_____ 薛有为
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

诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金（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”)《关于准予诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]665号)批准,由诺安基金管理有限公司(以下简称“诺安基金公司”)依照《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》等法律法规以及《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年7月11日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为224,114,781.61份基金份额,其中认购利息折合37,653.74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(以下简称“中国农业银行”)。

根据《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据销售机构和相关费用的不同,分别设置A类和C类两类基金份额,每类基金份额单独设置基金代码,按照不同的费率计提申购费用、赎回费用、管理费、托管费和销售服务费用。A类基金份额的基金代码为005901,C类基金份额代码为005902。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、次级债等)、债券回购、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、国债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的相关规定)。本基金可持有可转债、可交换债券转股所得的股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,也可直接从二级市场上买入股票和权证。如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例为:投资于股票的比例为基金资产的0%-95%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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,同时亦按照中国证券监督管理委员会(以下简称“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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

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	876,985.72

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：	876,985.72

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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,422,182.40	140,039.33
	银行间市场	-	-
	合计	5,422,182.40	140,039.33
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,422,182.40	5,562,221.73	140,039.33

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	105.30
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	2.07

应收债券利息	9,702.72
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	0.54
合计	9,810.63

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	254.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	254.02

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	210.45
预提费用	17,356.09
合计	17,566.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

诺安汇利混合 A		
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	17,171,879.50	17,171,879.50
本期申购	2,536,886.89	2,536,886.89
本期赎回(以“-”号填列)	-14,578,399.37	-14,578,399.37
本期末	5,130,367.02	5,130,367.02

金额单位：人民币元

诺安汇利混合 C

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	2,185,488.88	2,185,488.88
本期申购	776,838.75	776,838.75
本期赎回(以“-”号填列)	-2,288,980.79	-2,288,980.79
本期末	673,346.84	673,346.84

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

诺安汇利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	352,990.41	-136,852.83	216,137.58
本期利润	1,252,529.08	246,341.50	1,498,870.58
本期基金份额交易产生的变动数	-664,249.60	-556,764.91	-1,221,014.51
其中：基金申购款	260,649.13	49,484.74	310,133.87
基金赎回款	-924,898.73	-606,249.65	-1,531,148.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	941,269.89	-447,276.24	493,993.65

单位：人民币元

诺安汇利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,457.84	-17,671.55	61,786.29
本期利润	196,620.46	-908.57	195,711.89
本期基金份额交易产生的变动数	-139,966.18	-41,135.69	-181,101.87
其中：基金申购款	52,747.14	29,995.40	82,742.54
基金赎回款	-192,713.32	-71,131.09	-263,844.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,112.12	-59,715.81	76,396.31

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	3,376.08
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	147.75
其他	20.58
合计	3,544.41

注:本报告期内“其他”为申购款利息及保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	272,752.70
减:卖出股票成本总额	251,544.00
买卖股票差价收入	21,208.70

6.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	20,101,108.98
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	18,472,908.91
减:应收利息总额	164,356.06
买卖债券差价收入	1,463,844.01

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	301.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	301.05

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	245,432.93
——股票投资	-
——债券投资	245,432.93

——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	245,432.93

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	27,286.48
基金转换费收入	27.76
合计	27,314.24

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	819.59
银行间市场交易费用	462.50
合计	1,282.09

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	-
汇划费	1,983.81
其他	300.00
账户维护费	16,700.00
合计	36,339.90

注：本报告期内“其他”为上交所查询服务费。

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无发生变化。

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
中国农业银行股份有限公司	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
当期发生的基金应支付的管理费	52,258.09
其中：支付销售机构的客户维护费	25,186.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,451.65

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	0.00	5.84	5.84
中国农业银行股份有限公司(托管人)	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	5.84	5.84

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.6%。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一

次性支付给登记机构。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，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

本基金本报告期内无基金管理人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	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	876,985.72	3,376.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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

截至本报告期末，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

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，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农业银行股份有限公司，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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	818,708.40	2,003,747.00
AAA 以下	4,743,513.33	12,036,316.73
未评级	-	5,448,000.00
合计	5,562,221.73	19,488,063.73

注：未评级债券为政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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 6.4.12 中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，并进行适当报告和披露；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同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	876,985.72	-	-	-	-	876,985.72
结算备付金	5,053.16	-	-	-	-	5,053.16
存出保证金	1,281.05	-	-	-	-	1,281.05
交易性金融资产	2,701,019.08	2,861,202.65	-	-	-	5,562,221.73
应收利息	-	-	-	-	9,810.63	9,810.63
资产总计	3,584,339.01	2,861,202.65	-	-	9,810.63	6,455,352.29
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	13.45	13.45
应付赎回款	-	-	-	-	56,712.84	56,712.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,238.98	5,238.98
应付托管费	-	-	-	-	1,047.80	1,047.80
应付销售服务费	-	-	-	-	366.98	366.98
应付交易费用	-	-	-	-	254.02	254.02
应交税费	-	-	-	-	47.86	47.86
其他负债	-	-	-	-	17,566.54	17,566.54
负债总计	-	-	-	-	81,248.47	81,248.47
利率敏感度缺口	3,584,339.01	2,861,202.65	-	-	-71,437.84	6,374,103.82
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	2,000,787.54	-	-	-	-	2,000,787.54
结算备付金	19,291.10	-	-	-	-	19,291.10
存出保证金	863.73	-	-	-	-	863.73
交易性金融资产	2,258,440.35	10,340,404.38	1,441,219.00	5,448,000.00	-	19,488,063.73
应收利息	-	-	-	-	-244,716.43	244,716.43
资产总计	4,279,382.72	10,340,404.38	1,441,219.00	5,448,000.00	244,716.43	21,753,722.53
负债						
卖出回购金融资产款	1,999,757.00	-	-	-	-	1,999,757.00
应付赎回款	-	-	-	-	-37,074.18	37,074.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-17,178.60	17,178.60
应付托管费	-	-	-	-	-3,435.69	3,435.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-1,184.33	1,184.33
应付交易费用	-	-	-	-	-2,434.45	2,434.45
应付利息	-	-	-	-	-2,137.39	2,137.39
应交税费	-	-	-	-	-135.50	135.50
其他负债	-	-	-	-	-55,093.14	55,093.14
负债总计	1,999,757.00	-	-	-	-118,673.28	2,118,430.28
利率敏感度缺口	2,279,625.72	10,340,404.38	1,441,219.00	5,448,000.00	126,043.15	19,635,292.25

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变化		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(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)
	市场利率下降27个基点	-	108,267.39
	市场利率上升27个基点	-	-108,267.39

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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,562,221.73	87.26	19,488,063.73	99.25
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	5,562,221.73	87.26	19,488,063.73	99.25

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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（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）
	业绩比较基准上升 5%	452,019.57	780,601.04
	业绩比较基准下降 5%	-452,019.57	-780,601.04

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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	78,416.49	80,394.14
	合计	78,416.49	80,394.14

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 5,562,221.73 元，无属于第二层次和第三层次的余额（2018 年 12 月 31 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 12,519,844.73 元，属于第二层次的余额为 6,889,219.00 元，属于第三层次余额为 79,000.00 元）。

(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。

(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、买入返售金融资产和其他金融负债，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,562,221.73	86.16
	其中：债券	5,562,221.73	86.16
	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	882,038.88	13.66
8	其他各项资产	11,091.68	0.17
9	合计	6,455,352.29	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	300059	东方财富	251,544.00	1.28

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	300059	东方财富	272,752.70	1.39

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	251,544.00
卖出股票收入（成交）总额	272,752.70

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,562,221.73	87.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,562,221.73	87.26

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113517	曙光转债	4,170	451,819.50	7.09
2	113011	光大转债	3,200	346,880.00	5.44
3	110052	贵广转债	2,510	299,819.50	4.70
4	128057	博彦转债	2,560	267,801.60	4.20
5	113522	旭升转债	2,100	217,980.00	3.42

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，除光大转债外，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。

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，光大转债（113011）为本基金前十大重仓。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转债。本基金对该债券的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

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	1,281.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	9,810.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,091.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113517	曙光转债	451,819.50	7.09
2	113011	光大转债	346,880.00	5.44
3	113522	旭升转债	217,980.00	3.42
4	128027	崇达转债	216,384.48	3.39
5	128034	江银转债	212,454.55	3.33
6	110047	山鹰转债	207,445.10	3.25
7	110046	圆通转债	205,999.40	3.23
8	123010	博世转债	203,713.50	3.20
9	110048	福能转债	184,890.80	2.90
10	113519	长久转债	183,277.00	2.88
11	128048	张行转债	146,888.00	2.30
12	113515	高能转债	138,168.00	2.17
13	128015	久其转债	126,999.00	1.99
14	127005	长证转债	115,980.00	1.82
15	113518	顾家转债	110,770.00	1.74
16	113013	国君转债	101,916.00	1.60
17	123016	洲明转债	89,833.80	1.41
18	127007	湖广转债	76,853.00	1.21
19	113516	苏农转债	75,208.00	1.18
20	123017	寒锐转债	52,596.00	0.83
21	123007	道氏转债	50,220.00	0.79
22	113020	桐昆转债	47,528.00	0.75
23	110033	国贸转债	33,435.00	0.52
24	123002	国祯转债	23,950.00	0.38
25	123011	德尔转债	19,596.00	0.31
26	128032	双环转债	9,315.00	0.15
27	128044	岭南转债	8,955.00	0.14
28	113014	林洋转债	4,785.50	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	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
诺安汇利混合 A	163	31,474.64	-	-	5,130,367.02	100.00%
诺安汇利混合 C	40	16,833.67	-	-	673,346.84	100.00%
合计	203	28,589.72	-	-	5,803,713.86	100.00%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	诺安汇利混合 A	17,585.47	0.3428%
	诺安汇利混合 C	-	-
	合计	17,585.47	0.3428%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	诺安汇利混合 A	0
	诺安汇利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安汇利混合 A	0
	诺安汇利混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C
基金合同生效日（2018 年 7 月 11 日）基金份额总额	100,385,731.68	123,729,049.93
本报告期期初基金份额总额	17,171,879.50	2,185,488.88
本报告期基金总申购份额	2,536,886.89	776,838.75
减：本报告期基金总赎回份额	14,578,399.37	2,288,980.79
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	5,130,367.02	673,346.84

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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。此外，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	
渤海证券	2	272,752.70	100.00%	254.02	100.00%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变更情况：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要,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
渤海证券	16,464,873.60	100.00%	13,900,000.00	100.00%	-	-

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	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《中国证券报》	2019年1月21日
5	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)2019年第1期-摘要	《中国证券报》	2019年2月25日
6	诺安汇利灵活配置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2月25日
7	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
8	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
9	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年	基金管理人网站	2019年3月27日

	年度报告		
10	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《中国证券报》	2019 年 3 月 27 日
11	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
12	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《中国证券报》	2019 年 4 月 19 日
13	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务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 4 月 23 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	诺安基金管理有限公司关于增加大通证券为旗下部分基金代销机构的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 5 月 29 日
19	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
20	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
21	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持债券曙光转债估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、	2019 年 6 月 26 日

		《证券日报》	
22	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	1	2019.02.27-2019.02.28	1,990,649.75	-	1,990,649.75	-	0.00%
	2	2019.02.15-2019.02.25	2,988,824.63	-	2,988,824.63	-	0.00%
	3	2019.03.12-2019.06.28	-	1,764,978.31	-	1,764,978.31	30.41%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金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，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。</p>							

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汇利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安汇利灵活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诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安汇利灵活配置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