

# 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 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.....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13        |
| 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.....       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 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..... | 13        |
| 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.....      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 14        |
| 6.2 利润表.....                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 34        |
| 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.....       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 34        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 34        |
| 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.....      | 34        |
| 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.....   | 35        |
| 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.....   | 35        |
| 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.....      | 35        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 35        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 35        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>36</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 36        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                  | 36        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 37        |
| 8.4 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..... | 37        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>               | <b>37</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                 | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 38        |
| 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.....  | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 38        |
| 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.....     | 38        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 38        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 39        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>         | <b>41</b> |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                 | <b>41</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                       | 41        |
| 12.2 存放地点.....                         | 41        |
| 12.3 查阅方式.....                         | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                    |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称            | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金   |                    |
| 基金简称            | 诺安纯债定期开放债券          |                    |
| 场内简称            | 诺安纯债                |                    |
| 基金主代码           | 163210              |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                    |
| 基金合同生效日         | 2013 年 3 月 27 日     |                    |
| 基金管理人           | 诺安基金管理有限公司          |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 414, 183, 851. 00 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                    |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深圳证券交易所             |                    |
| 上市日期            | 2013-06-24          |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 诺安纯债                | 诺安债 C              |
| 下属分级基金场内简称:     | 诺安纯债                | -                  |
| 下属分级基金的交易代码:    | 163210              | 163211             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 349, 814, 763. 73 份 | 64, 369, 087. 27 份 |

注：本基金的 A 类份额通过场内和场外两种方式交易，上市的证券所为“深圳证券交易所”，场内简称“诺安纯债”，场内代码 163210。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在有效控制风险的前提下，通过对影响债券市场各类要素的分析以及投资组合的积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益。  |
| 投资策略   | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>在封闭期内，为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> <p>2、开放期投资安排</p> <p>在开放期，本基金原则上将使基金资产保持现金状态，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况，进行相应压力测试，制定开放期操作规范流程和应急预案，做好应付极端情况下赎回的准备。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为三年期定期存款税后收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |

## 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                   | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈勇                           | 洪渊                  |
|         | 联系电话 | 0755-83026688                | (010)66105799       |
|         | 电子邮箱 | info@lionfund.com.cn         | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-8998                 | 95588               |
| 传真      |      | 0755-83026677                | (010)66105798       |
| 注册地址    |      | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号   |
| 邮政编码    |      | 518048                       | 100140              |
| 法定代表人   |      | 秦维舟                          | 易会满                 |

## 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》、《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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 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          | 诺安纯债                                  | 诺安债 C                                 |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 68,512,506.76                         | 17,692,412.85                         |
| 本期利润          | 23,068,034.82                         | 5,525,348.40                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0461                                | 0.0436                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.70%                                 | 3.49%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.39%                                 | 3.15%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 85,279,386.17                         | 15,023,433.89                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2438                                | 0.2334                                |
| 期末基金资产净值      | 355,952,102.92                        | 65,449,051.70                         |

|              |                  |        |
|--------------|------------------|--------|
| 期末基金份额净值     | 1.018            | 1.017  |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 34.30%           | 32.54% |

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

诺安纯债

| 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      | 1.09%    | 0.08%       | 0.35%      | 0.01%         | 0.74%  | 0.07% |
| 过去三个月      | 1.28%    | 0.12%       | 1.07%      | 0.01%         | 0.21%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 3.39%    | 0.10%       | 2.15%      | 0.01%         | 1.24%  | 0.09% |
| 过去一年       | 10.72%   | 0.09%       | 4.32%      | 0.01%         | 6.40%  | 0.08% |
| 过去三年       | 33.24%   | 0.12%       | 12.94%     | 0.01%         | 20.30% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.30%   | 0.11%       | 14.07%     | 0.01%         | 20.23% | 0.10% |

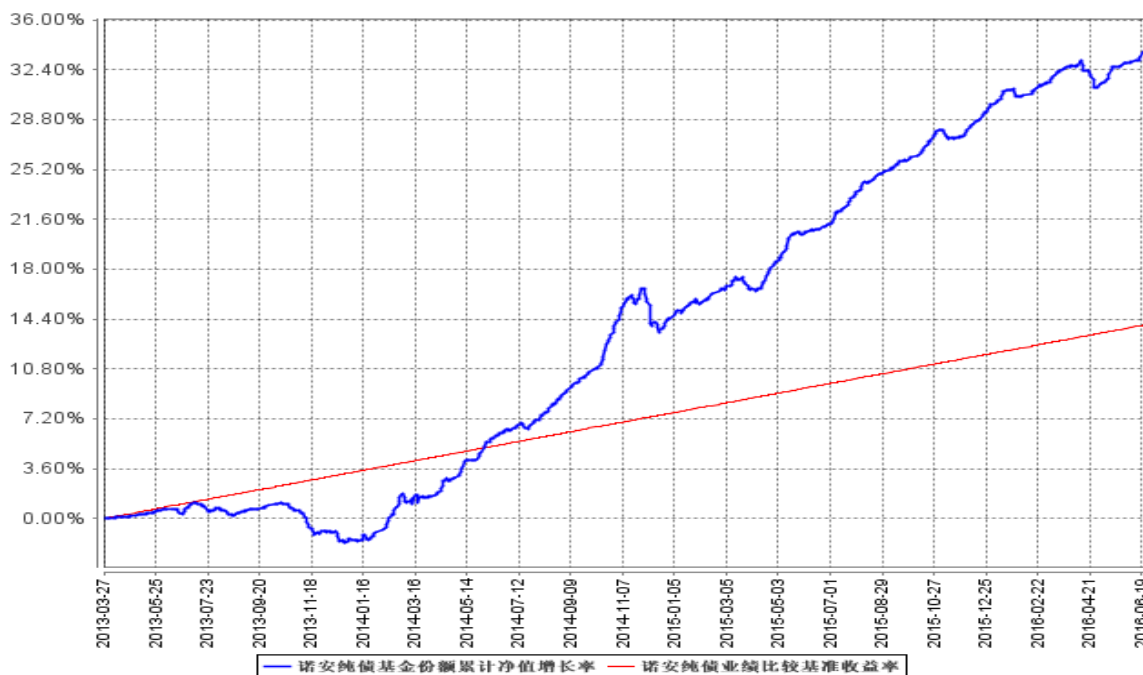
诺安债 C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.99%    | 0.08%       | 0.35%      | 0.01%         | 0.64%  | 0.07% |
| 过去三个月      | 1.18%    | 0.12%       | 1.07%      | 0.01%         | 0.11%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 3.15%    | 0.10%       | 2.15%      | 0.01%         | 1.00%  | 0.09% |
| 过去一年       | 10.27%   | 0.09%       | 4.32%      | 0.01%         | 5.95%  | 0.08% |
| 过去三年       | 31.62%   | 0.12%       | 12.94%     | 0.01%         | 18.68% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.54%   | 0.12%       | 14.07%     | 0.01%         | 18.47% | 0.11% |

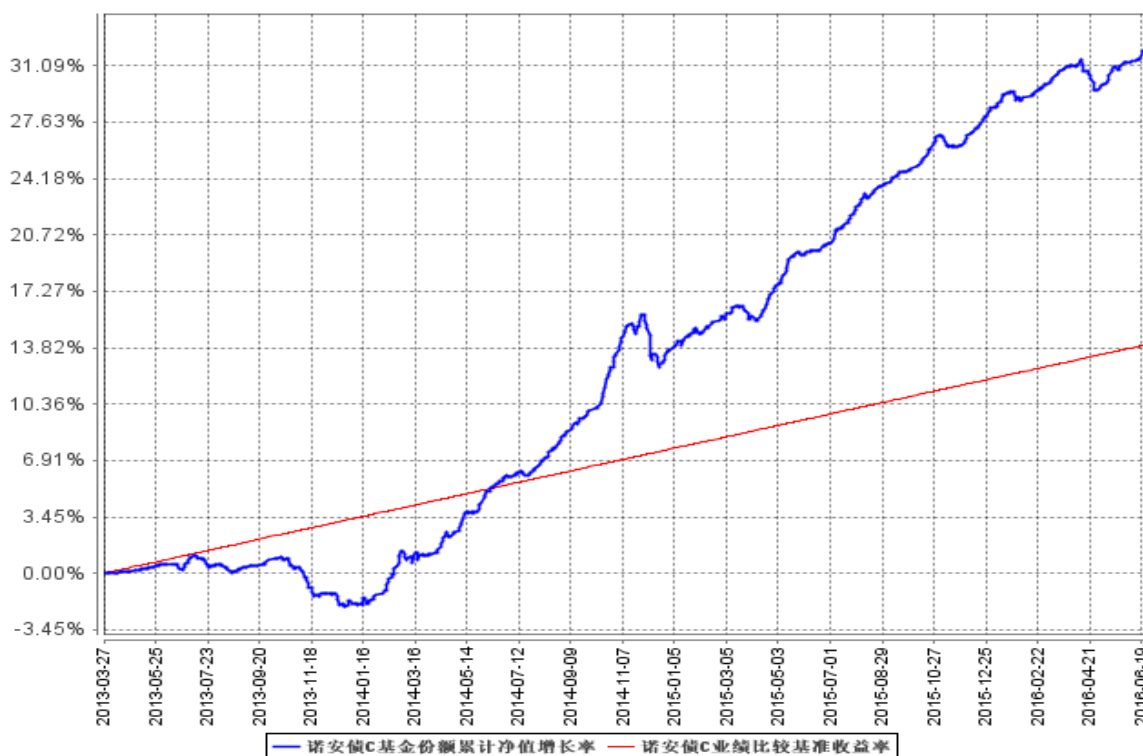
注：本基金的业绩比较基准为三年期定期存款税后收益率。

### 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

诺安纯债 A



诺安债 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基金合同约定。



## § 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 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、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本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、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、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、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本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、诺安和鑫保本混合型证券投资基金。

#### 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 | 固定收益部总监、 | 2013 年 5        | -    | 10     | 理学硕士，具有基金从业资格。曾 |

|  |  |        |  |   |
|--|--|--------|--|---|
|  | 总裁助理, 诺安纯债定期开放债券基金经理、诺安鸿鑫保本混合基金经理、诺安优化收益债券基金经理、诺安保本混合基金经理、诺安汇鑫保本混合基金经理、诺安聚利债券基金经理、诺安利鑫保本混合基金经理、诺安景鑫保本混合基金经理、诺安益鑫保本混合基金经理、诺安安鑫保本混合基金经理、诺安理财宝货币基金经理、诺安聚鑫宝货币基金经理、诺安货币基金经理、诺安和鑫保本混合基金经理。 | 月 25 日 |  | 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, 现任固定收益部总监、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。2013 年 5 月起任诺安鸿鑫保本混合及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 月起任诺安保本混合、诺安汇鑫保本混合及诺安聚利债券基金经理, 2015 年 12 月起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 月起任诺安益鑫保本混合基金经理, 2016 年 2 月起任诺安安鑫保本混合、诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理, 2016 年 4 月起担任诺安和鑫保本混合基金经理。 |
|--|--|--------|--|---|

注：①此处基金经理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《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, 诺安纯债定期开放债券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《诺安纯债定期开放债券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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 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

2016 年上半年，国内经济内生增长动力继续疲软，边际刺激效果减弱，“新常态”下经济增速平稳下行。货币政策稳中偏松，资金面相对平稳。国内利率债市场先抑后扬，六月份长端收益率下行幅度较大。信用债方面，信用违约事件频出，低资质债券的流动性风险、信用风险攀升，两极分化依然严重，多数高等级品种信用利差走低。

投资运作上，诺安纯债保持了较高的杠杆比例，进行了债券的波段操作。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安纯债的基金份额净值为 1.018 元。本报告期基金份额净值增长率为 3.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.15%。

截至报告期末，诺安债 C 的基金份额净值为 1.017 元。本报告期基金份额净值增长率为 3.15%，同期业绩比较基准收益率为 2.15%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年基本面对债市的支撑仍将继续，通胀将维持低位，货币政策将保持相对稳健、下半年监管政策趋严导致的供需变化、人民币汇率走势以及资金面波动是影响国内债券市场重要因素，

下一阶段，诺安纯债将适当提高利率债配置比例，积极进行波段操作。信用债方面，根据严格的内部评级要求，更加审慎的自下而上挑选个券，并加强跟踪评级力度。

## 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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关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、合规与风险控制部、固定收益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历，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,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%,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,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## **§ 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**

本报告期内,本基金托管人在对诺安纯债定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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**

本报告期内,诺安纯债定期开放债券型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安纯债定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安纯债定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

### **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**

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 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：诺安纯债定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,227,713.53                   | 2,914,350.06                     |
| 结算备付金           |            | 15,674,182.17                  | 5,947,870.42                     |
| 存出保证金           |            | 8,666.89                       | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 737,033,469.30                 | 1,687,513,457.20                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 737,033,469.30                 | 1,687,513,457.20                 |
| 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    | 18,144,662.58                  | 41,124,149.10                    |
| 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            |            | 772,088,694.47                 | 1,737,499,826.78                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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       |            | 349,999,865.00                 | 591,999,190.50                   |
| 应付证券清算款         |            | 56,700.11                      | 55,957.29                        |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 240,129.54                     | 673,952.88                       |
| 应付托管费           |            | 68,608.43                      | 192,557.99                       |
| 应付销售服务费         |            | 21,399.39                      | 83,232.99                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 3,565.04                       | 10,374.80                        |
| 应交税费            |            | 127,493.40                     | 127,493.40                       |
| 应付利息            |            | 12,213.39                      | 154,430.26                       |

|               |          |                |                  |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 应付利润          |          | -              | -                |
| 递延所得税负债       |          | -              | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 157,565.55     | 200,000.00       |
| 负债合计          |          | 350,687,539.85 | 593,497,190.11   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 314,545,381.05 | 882,740,592.33   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 106,855,773.57 | 261,262,044.34   |
| 所有者权益合计       |          | 421,401,154.62 | 1,144,002,636.67 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 772,088,694.47 | 1,737,499,826.78 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 414,183,851.00 份，其中，A 类基金份额净值人民币 1.018 元，基金份额 349,814,763.73 份；C 类基金份额净值人民币 1.017 元，基金份额 64,369,087.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安纯债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 38,219,676.12                            | 77,406,367.58                                 |
| 1.利息收入                |            | 38,566,518.97                            | 53,461,291.64                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 117,141.16                               | 97,013.81                                     |
| 债券利息收入                |            | 38,331,213.31                            | 53,243,633.78                                 |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 118,164.50                               | 120,644.05                                    |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 57,264,693.54                            | 6,150,914.25                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 57,264,693.54                            | 6,150,914.25                                  |
| 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   | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -57,611,536.39                           | 17,794,161.69                                 |
| 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   | -  | -   |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 9,626,292.90                             | 18,397,113.34                                 |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 2,751,428.39                             | 3,599,766.51                                  |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 786,122.32    | 1,028,504.81  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 319,288.73    | 445,623.47    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 6,084.51      | 2,117.40      |
| 5. 利息支出                    |            | 5,583,061.24  | 13,177,653.07 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 5,583,061.24  | 13,177,653.07 |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 180,307.71    | 143,448.08    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 28,593,383.22 | 59,009,254.24 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 28,593,383.22 | 59,009,254.24 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安纯债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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）                        | 882,740,592.33                             | 261,262,044.34  | 1,144,002,636.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 28,593,383.22   | 28,593,383.22    |
| 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）      | -568,195,211.28                            | -182,999,653.99 | -751,194,865.27  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 118,952,687.26                             | 38,382,247.17   | 157,334,934.43   |
| 2. 基金赎回款                               | -687,147,898.54                            | -221,381,901.16 | -908,529,799.70  |
| 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）                        | 314,545,381.05                             | 106,855,773.57  | 421,401,154.62   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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<br>(基金净值)                                | 882,741,118.89 | 126,686,025.35 | 1,009,427,144.24 |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -              | 59,009,254.24  | 59,009,254.24    |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数<br>(净值减少以“-”号<br>填列)  | -526.56        | 410.73         | -115.83          |
| 其中：1.基金申购款   | 49,498.19      | 8,414.69       | 57,912.88        |
| 2.基金赎回款  | -50,024.75     | -8,003.96      | -58,028.71       |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -              | -              | -                |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 882,740,592.33 | 185,695,690.32 | 1,068,436,282.65 |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>奥成文 | _____<br>薛有为 | _____<br>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

诺安纯债定期开放债券型证券投资基金(简称“本基金”),经中国证监会(证监许可【2012】1463号)《关于核准诺安纯债定期开放债券型证券投资基金募集的批复》批准,于2013年2月28日到2013年3月20日向社会进行公开募集,经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)审验,截至2013年3月26日止,通过场内认购方式募集资金净额为人民币33,635,000.00元,有效认购金额产生的利息折合为2,273.00份基金份额;通过场外认购方式募集资金净额为人民币848,802,282.21元,有效认购金额产生的利息折合为332,153.49份基金份额;通过场内及场外认购方式募集基金份额882,771,708.70份,投资者户数共计6,512户。基金合同生效日为2013年3月27日,合同生效日基金份额为882,771,708.70份基金单位。

经深圳证券交易所(以下简称:深交所)深证上【2013】196号文核准同意,本基金A类基金份额于2013年6月24日在深交所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外,其中A类基金份

额可跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通，C 类基金份额不能进行跨系统转托管至场内。本基金自 2013 年 6 月 24 日开通 A 类基金份额的跨系统转托管业务。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为工商银行股份有限公司。《诺安纯债定期开放债券型证券投资基金合同》、《诺安纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 25 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**

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 重要会计政策和会计估计**

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 号文《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[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》、财税[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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 号文《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

(2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

(7) 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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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<br>2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1, 227, 713. 53        |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 1, 227, 713. 53        |

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016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             | 650,275,264.49 | 36,352,204.81 |
|               | 银行间市场             | 49,982,448.63  | 423,551.37    |
|               | 合计                | 700,257,713.12 | 36,775,756.18 |
| 资产支持证券        | -                 | -              | -             |
| 基金            | -                 | -              | -             |
| 其他            | -                 | -              | -             |
| 合计            | 700,257,713.12    | 737,033,469.30 | 36,775,756.18 |

**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<br>2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 259.28            |
| 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  | 6,347.97          |
| 应收债券利息     | 18,138,051.82     |
| 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         | 3.51              |
| 合计         | 18,144,662.58     |

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<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,565.04          |
| 合计          | 3,565.04          |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 157,565.55        |
| 合计          | 157,565.55        |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 诺安纯债                  |                            |                 |
|-----------------------|----------------------------|-----------------|
| 项目                    | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                 |
|                       | 基金份额(份)                    | 账面金额            |
| 上年度末                  | 690,326,920.31             | 690,326,920.31  |
| 本期申购                  | 96,581,945.59              | 96,581,945.59   |
| 本期赎回(以“-”号填列)         | -522,002,370.20            | -522,002,370.20 |
| 2016年4月22日 基金拆分/份额折算前 | 264,906,495.70             | 264,906,495.70  |
| 基金拆分/份额折算变动份额         | 84,580,292.86              | -               |
| 本期申购                  | 327,975.17                 | 248,641.84      |
| 本期赎回(以“-”号填列)         | -                          | -               |
| 本期末                   | 349,814,763.73             | 265,155,137.54  |

金额单位：人民币元

| 诺安债 C         |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                 |
|               | 基金份额(份)                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 192,413,672.02             | 192,413,672.02  |
| 本期申购          | 22,122,099.83              | 22,122,099.83   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -164,893,185.10            | -164,893,185.10 |

|                            |               |               |
|----------------------------|---------------|---------------|
| 2016 年 4 月 22 日 基金拆分/份额折算前 | 49,642,586.75 | 49,642,586.75 |
| 基金拆分/份额折算变动份额              | 15,055,357.32 | -             |
| 本期申购                       | -             | -             |
| 本期赎回(以“-”号填列)              | -328,856.80   | -252,343.24   |
| 本期末                        | 64,369,087.27 | 49,390,243.51 |

注：①本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

②根据《诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金的基金管理人于 2016 年 4 月 22 日对本基金进行基金份额拆分。根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式，A 类基金份额拆分比例为 1: 1.319283577，拆分后基金份额净值为人民币 1.000 元；C 类基金份额拆分比例为 1: 1.303275044，拆分后基金份额净值为人民币 1.000 元。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 诺安纯债           |                 |                |                 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 132,516,169.17  | 73,946,426.42  | 206,462,595.59  |
| 本期利润           | 68,512,506.76   | -45,444,471.94 | 23,068,034.82   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -115,749,289.76 | -22,984,375.27 | -138,733,665.03 |
| 其中：基金申购款       | 27,378,069.79   | 4,136,494.19   | 31,514,563.98   |
| 基金赎回款          | -143,127,359.55 | -27,120,869.46 | -170,248,229.01 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 85,279,386.17   | 5,517,579.21   | 90,796,965.38   |

单位：人民币元

| 诺安债 C          |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 34,358,316.73  | 20,441,132.02  | 54,799,448.75  |
| 本期利润           | 17,692,412.85  | -12,167,064.45 | 5,525,348.40   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -37,027,295.69 | -7,238,693.27  | -44,265,988.96 |
| 其中：基金申购款       | 5,828,888.62   | 1,038,794.57   | 6,867,683.19   |
| 基金赎回款          | -42,856,184.31 | -8,277,487.84  | -51,133,672.15 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 15,023,433.89  | 1,035,374.30   | 16,058,808.19  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 42,491.72                       |

|           |            |
|-----------|------------|
| 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 | 74,631.77  |
| 其他        | 17.67      |
| 合计        | 117,141.16 |

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                   |
|-------------------------|----------------------|
|                         | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 984,802,892.31       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 900,400,343.11       |
| 减：应收利息总额                | 27,137,855.66        |
| 买卖债券差价收入                | 57,264,693.54        |

#### 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

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -57,611,536.39       |
| ——股票投资     | -                    |
| ——债券投资     | -57,611,536.39       |
| ——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 | -              |
| 合计    | -57,611,536.39 |

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 322.01               |
| 银行间市场交易费用 | 5,762.50             |
| 合计        | 6,084.51             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期                   |
|--------|----------------------|
|        | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 审计费用   | 29,835.26            |
| 信息披露费  | 97,895.03            |
| 汇划费    | 4,142.16             |
| 上市费及年费 | 29,835.26            |
| 账户维护费  | 18,600.00            |
| 合计     | 180,307.71           |

注：“上市费”为深交所向本基金征收的上市年费，上市年费为60,000元/年。

### 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、直销机构 |



|              |          |
|--------------|----------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 托管人、代销机构 |
|--------------|----------|

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<br>2016年1月1日至2016年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30<br>日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,751,428.39                   | 3,599,766.51                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 847,549.95                     | 1,091,288.59                        |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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<br>2016年1月1日至2016年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30<br>日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 786,122.32                     | 1,028,504.81                        |

注：基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日      |            |            |
|-----------------------|--|------------|------------|
|                       | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                       | 诺安纯债                                       | 诺安债 C      | 合计         |
| 诺安基金管理有限公司<br>(管理人)   | -  | 39,298.16  | 39,298.16  |
| 中国工商银行股份有限公司<br>(托管人) | -  | 227,338.80 | 227,338.80 |
| 合计                    | -  | 266,636.96 | 266,636.96 |
| 获得销售服务费的各关联方名称        | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |            |            |
|                       | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                       | 诺安纯债                                       | 诺安债 C      | 合计         |
| 诺安基金管理有限公司<br>(管理人)   | -  | 57,968.07  | 57,968.07  |
| 中国工商银行股份有限公司<br>(托管人) | -  | 328,595.91 | 328,595.91 |
| 合计                    | -  | 386,563.98 | 386,563.98 |

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费额计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款

指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,227,713.53                          | 42,491.72 | 965,479.62                                 | 20,051.51 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 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 2016 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 2016 年 6 月 30 日止，本基金无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 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,999,865.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 130323 | 13 进出 23 | 2016 年 7 月 7 日 | 100.43 | 100,000 | 10,043,000.00 |
| 合计     |          |                |        | 100,000 | 10,043,000.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 340,000,000.00 元，分别于 2016 年 7 月 1 日至 2015 年 7 月 7 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险，并设定适当的投资限额，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成：第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导；第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、合规与风险控制部所监控；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

##### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。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，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未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 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<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 22,044,000.00          | 21,110,000.00            |
| AAA 以下 | 660,092,469.30         | 1,635,932,457.20         |
| 未评级    | 54,897,000.00          | 30,471,000.00            |
| 合计     | 737,033,469.30         | 1,687,513,457.20         |

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

②以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注‘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。本基金所持有卖出回购金融资产款的合同约定到期日均为一年以内且计息，账面余额接近其未折现的合约到期现金流量。其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数

变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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均计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上受市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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<br>2016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             |
|-------------------|-----------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| <b>资产</b>         |                 |               |                |               |               |                |
| 银行存款              | 1,227,713.53    | -             | -              | -             | -             | 1,227,713.53   |
| 结算备付金             | 15,674,182.17   | -             | -              | -             | -             | 15,674,182.17  |
| 存出保证金             | 8,666.89        | -             | -              | -             | -             | 8,666.89       |
| 交易性金融资产           | 30,129,000.00   | 38,142,608.10 | 592,146,861.20 | 76,615,000.00 | -             | 737,033,469.30 |
| 应收利息              | -               | -             | -              | -             | 18,144,662.58 | 18,144,662.58  |
| 其他资产              | -               | -             | -              | -             | -             | -              |
| 资产总计              | 47,039,562.59   | 38,142,608.10 | 592,146,861.20 | 76,615,000.00 | 18,144,662.58 | 772,088,694.47 |
| <b>负债</b>         |                 |               |                |               |               |                |
| 卖出回购金融资产款         | 349,999,865.00  | -             | -              | -             | -             | 349,999,865.00 |
| 应付证券清算款           | -               | -             | -              | -             | 56,700.11     | 56,700.11      |
| 应付管理人报酬           | -               | -             | -              | -             | 240,129.54    | 240,129.54     |
| 应付托管费             | -               | -             | -              | -             | 68,608.43     | 68,608.43      |
| 应付销售服务费           | -               | -             | -              | -             | 21,399.39     | 21,399.39      |
| 应付交易费用            | -               | -             | -              | -             | 3,565.04      | 3,565.04       |
| 应付利息              | -               | -             | -              | -             | 12,213.39     | 12,213.39      |
| 应交税费              | -               | -             | -              | -             | 127,493.40    | 127,493.40     |
| 其他负债              | -               | -             | -              | -             | 157,565.55    | 157,565.55     |
| 负债总计              | 349,999,865.00  | -             | -              | -             | 687,674.85    | 350,687,539.85 |
| 利率敏感度缺口           | -302,960,302.41 | 38,142,608.10 | 592,146,861.20 | 76,615,000.00 | 17,456,987.73 | 421,401,154.62 |
| 上年度末              | 6个月以内           | 6个月-1年        | 1-5年           | 5年以上          | 不计息           | 合计             |

|                  |                 |               |                  |                |               |                  |
|------------------|-----------------|---------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 2015 年 12 月 31 日 |                 |               |                  |                |               |                  |
| 资产               |                 |               |                  |                |               |                  |
| 银行存款             | 2,914,350.06    | -             | -                | -              | -             | 2,914,350.06     |
| 结算备付金            | 5,947,870.42    | -             | -                | -              | -             | 5,947,870.42     |
| 交易性金融资产          | 30,213,000.00   | 30,471,000.00 | 1,279,374,457.20 | 347,455,000.00 | -             | 1,687,513,457.20 |
| 应收利息             | -               | -             | -                | -              | 41,124,149.10 | 41,124,149.10    |
| 资产总计             | 39,075,220.48   | 30,471,000.00 | 1,279,374,457.20 | 347,455,000.00 | 41,124,149.10 | 1,737,499,826.78 |
| 负债               |                 |               |                  |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款        | 591,999,190.50  | -             | -                | -              | -             | 591,999,190.50   |
| 应付证券清算款          | -               | -             | -                | -              | 55,957.29     | 55,957.29        |
| 应付管理人报酬          | -               | -             | -                | -              | 673,952.88    | 673,952.88       |
| 应付托管费            | -               | -             | -                | -              | 192,557.99    | 192,557.99       |
| 应付销售服务费          | -               | -             | -                | -              | 83,232.99     | 83,232.99        |
| 应付交易费用           | -               | -             | -                | -              | 10,374.80     | 10,374.80        |
| 应付利息             | -               | -             | -                | -              | 154,430.26    | 154,430.26       |
| 应交税费             | -               | -             | -                | -              | 127,493.40    | 127,493.40       |
| 其他负债             | -               | -             | -                | -              | 200,000.00    | 200,000.00       |
| 负债总计             | 591,999,190.50  | -             | -                | -              | 1,497,999.61  | 593,497,190.11   |
| 利率敏感度缺口          | -552,923,970.02 | 30,471,000.00 | 1,279,374,457.20 | 347,455,000.00 | 39,626,149.49 | 1,144,002,636.67 |

#### 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（2016年6月30日）             | 上年度末（2015年12月31日） |
|    | 1. 市场利率下降 27个基点 | 4,174,999.79                | 10,457,132.77     |
|    | 2. 市场利率上升 27个基点 | -4,174,999.79               | -10,457,132.77    |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资，本基金有效降低了投资组合的其他价格风险，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。

本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%。在开放期，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在非开放期，本基金不受上述 5%的限制。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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<br>2016 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>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  | 737,033,469.30         | 174.90                   | 1,687,513,457.20         | 147.51                |
| 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            | 737,033,469.30         | 174.90                   | 1,687,513,457.20         | 147.51                |

#### 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. 置信度：95%        |                      |                        |
|   | 2. 观察期：一年         |                      |                        |
| 分析  | 风险价值<br>(单位：人民币元) | 本期末（2016 年 6 月 30 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
|   | 基金投资组合的风险价值       | 1,653,571.16         | 1,658,326.34           |
|   | 合计                | 1,653,571.16         | 1,658,326.34           |



#### 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. 公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

###### ② 各层级金融工具公允价值

于 2016 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二层级的余额为 737,033,469.30 元，无属于第一层级和第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日，第一层级：1,687,513,457.20 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

###### ③ 公允价值所属层级间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据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应属第二层级或第三层级。

##### 2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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  | 固定收益投资   | 737,033,469.30 | 95.46         |
|    | 其中：债券    | 737,033,469.30 | 95.46         |
|    | 资产支持证券   | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资    | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资  | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产 | -              | -             |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 16,901,895.70  | 2.19   |
| 7 | 其他各项资产            | 18,153,329.47  | 2.35   |
| 8 | 合计                | 772,088,694.47 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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      | 30,129,000.00  | 7.15          |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,129,000.00  | 7.15          |
| 4  | 企业债券      | 686,627,469.30 | 162.94        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | 20,277,000.00  | 4.81          |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -             |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 737,033,469.30 | 174.90        |

## 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  | 124388 | 13 任城债 | 500,000 | 52,970,000.00 | 12.57        |
| 2  | 124370 | 13 虞新区 | 500,000 | 52,595,000.00 | 12.48        |
| 3  | 124827 | 14 普国资 | 400,000 | 43,360,000.00 | 10.29        |
| 4  | 124090 | 12 遵国投 | 500,000 | 41,975,000.00 | 9.96         |
| 5  | 124613 | 14 长建投 | 300,000 | 33,255,000.00 | 7.89         |

### 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国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.10.2 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。

#### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,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。

7.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.11.3 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   | 8,666.89      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 18,144,662.58 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | -             |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 18,153,329.47 |

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 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。

## § 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  |
| 诺安纯债  | 2,652    | 131,906.02 | 124,078,587.45 | 35.47% | 225,736,176.28 | 64.53%  |
| 诺安债 C | 776      | 82,949.85  | 0.00           | -      | 64,369,087.27  | 100.00% |
| 合计    | 3,428    | 120,823.76 | 124,078,587.45 | 29.96% | 290,105,263.55 | 70.04%  |

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 期末上市基金前十名持有人

诺安纯债

| 序号 | 持有人名称                         | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------|---------------|----------|
| 1  | 中国出口信用保险公司                    | 39,886,639.30 | 11.40%   |
| 2  | 安盛天平财产保险股份有限公司—自有资金           | 26,387,914.32 | 7.54%    |
| 3  | 中国广核集团有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司 | 14,061,877.00 | 4.02%    |

|    |                               |              |       |
|----|-------------------------------|--------------|-------|
| 4  | 长江金色创富企业年金集合计划—浦发             | 5,280,878.00 | 1.51% |
| 5  | 嘉实基金—农业银行—中国农业银行股份有限公司企业年金理事会 | 5,254,925.49 | 1.50% |
| 6  | 王娉                            | 3,953,645.53 | 1.13% |
| 7  | 中国航天科技集团公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司 | 3,851,899.00 | 1.10% |
| 8  | 何林忠                           | 2,977,658.10 | 0.85% |
| 9  | 张智勇                           | 2,975,414.20 | 0.85% |
| 10 | 全国社保基金二零五组合                   | 2,876,678.00 | 0.82% |

注：以上信息中，持有人名称及持有份额由中国证券登记结算有限公司提供。

### 8.3 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 | 诺安纯债  | 0.00      | 0.0000%  |
|                  | 诺安债 C | 0.00      | 0.0000%  |
|                  | 合计    | 0.00      | 0.0000%  |

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）。

### 8.4 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 | 诺安纯债  | 0                 |
|                                | 诺安债 C | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 诺安纯债  | 0                 |
|                                | 诺安债 C | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 诺安纯债           | 诺安债 C          |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年3月27日）基金份额总额 | 687,298,573.33 | 195,473,135.37 |
| 本报告期初基金份额总额               | 690,326,920.31 | 192,413,672.02 |
| 本报告期基金总申购份额               | 96,909,920.76  | 22,122,099.83  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 522,002,370.20 | 165,222,041.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | 84,580,292.86  | 15,055,357.32  |

|             |                |               |
|-------------|----------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 349,814,763.73 | 64,369,087.27 |
|-------------|----------------|---------------|

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

2016年6月，针对深圳证监局向公司出具的《关于对诺安基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，以及对相关人员的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 |    |
| 招商证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

注：1、本基金本报告期末进行股票投资。

2、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

3、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 |
| 招商证券 | 13,224,726.49 | 14.55%       | 351,700,000.00    | 2.89%          | -    | -            |
| 中信建投 | 77,663,774.38 | 85.45%       | 11,801,000,000.00 | 97.11%         | -    | -            |

### 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 2015 年最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告 | 基金管理人网站                        | 2016 年 1 月 5 日  |
| 2  | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江金观诚网费率优惠活动的公告                | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 1 月 6 日  |
| 3  | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告                   | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 1 月 21 日 |

|    |   |                                |                 |
|----|---|--------------------------------|-----------------|
| 4  | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金首个开放期内打开申购、赎回业务的公告                         | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 3 月 25 日 |
| 5  | 诺安基金管理有限公司关于诺安纯债定期开放债券增加代销机构的公告                             | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 3 月 26 日 |
| 6  | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要                              | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 3 月 30 日 |
| 7  | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2015 年年度报告                                | 基金管理人网站                        | 2016 年 3 月 30 日 |
| 8  | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告               | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 4 月 1 日  |
| 9  | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行关于“财智组合”基金申购费率优惠活动的公告               | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 4 月 7 日  |
| 10 | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告                            | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 4 月 20 日 |
| 11 | 关于诺安纯债定期开放债券型证券投资基金份额折算公告                                   | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 4 月 20 日 |
| 12 | 关于诺安纯债定期开放债券型证券投资基金份额折算比例及停复牌的公告                            | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 4 月 25 日 |
| 13 | 关于诺安纯债定期开放债券型证券投资基金份额折算结果公告                                 | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 4 月 26 日 |
| 14 | 诺安基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 5 月 10 日 |
| 15 | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 1 期-摘要                    | 《证券时报》、<br>《中国证券报》             | 2016 年 5 月 11 日 |
| 16 | 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 1 期-正文                    | 基金管理人网站                        | 2016 年 5 月 11 日 |
| 17 | 诺安基金管理有限公司关于直销账户变更的公告                                       | 《中国证券报》                        | 2016 年 6 月 14 日 |



|    |   |                                |                 |
|----|---|--------------------------------|-----------------|
| 18 | 诺安基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 6 月 15 日 |
| 19 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 6 月 30 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

本基金为三年定期开放基金,2016 年 3 月 28 日至 2016 年 4 月 22 日为首个开放期时间。2016 年 4 月 22 日为折算日,由于登记系统原因,在折算日当天不办理基金的申购、赎回、转换、转托管业务等申请。即 2016 年 3 月 28 日至 2016 年 4 月 21 日期间,本基金接受申购、赎回业务申请。自 2016 年 4 月 23 日起至三年后对应日的前一日(2019 年 4 月 22 日)为本基金的第二个封闭期,封闭期内本基金不接受申购、赎回业务申请。

## § 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纯债定期开放债券型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安纯债定期开放债券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诺安纯债定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安纯债定期开放债券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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日