

诺安鸿鑫混合型证券投资基金  
(原诺安鸿鑫保本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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

诺安鸿鑫混合型证券投资基金（以下简称“诺安鸿鑫混合”）根据《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来。自 2019 年 6 月 18 日起，诺安鸿鑫混合转型正式生效，并自该日起《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》失效且《诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本报告中财务资料未经审计。

自 2019 年 6 月 18 日起，原诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安鸿鑫混合型证券投资基金。原诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 17 日止，诺安鸿鑫混合型证券投资基金本报告期自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	10
2.3 基金管理人和基金托管人.....	10
2.4 信息披露方式.....	10
2.5 其他相关资料.....	11
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>12</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	12
3.2 基金净值表现（转型后）.....	13
3.2 基金净值表现（转型前）.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>23</b>
6.1 资产负债表.....	23
6.2 利润表.....	24
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
6.4 报表附注.....	25
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>45</b>
6.1 资产负债表.....	45
6.2 利润表.....	46
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	47
6.4 报表附注.....	48
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>66</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	66
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	66
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.....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
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 .....	66
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
7.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>69</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	69
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	69
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 .....	69
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
7.12 投资组合报告附注 .....	71
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>	<b>72</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	72
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>73</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
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 .....	73
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后) .....</b>	<b>74</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前) .....</b>	<b>75</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>76</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
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 .....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
10.4 基金投资策略的改变 .....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
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 .....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	77
10.9 其他重大事件（转型后） .....	78
10.9 其他重大事件（转型前） .....	79
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
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 .....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82

<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>83</b>
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	诺安鸿鑫混合型证券投资基金
基金简称	诺安鸿鑫混合
基金主代码	000066
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月18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	61,425,865.70份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金
基金简称	诺安鸿鑫保本混合
基金主代码	000066
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月3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	87,230,207.15份
基金合同存续期	2013年5月3日至2019年6月17日止

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过对企业基本面全面、深入的研究，持续挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略四个方面。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济周期、国家经济政策、证券市场流动性和大类资产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，最优化投资组合的风险调整后收益。本基金在进行资产配置时，将重点考察宏观经济状况、资金流动性、资产估值水平和市场因素四个方面。</p> <p>（1）宏观经济状况</p> <p>重点关注反映国家经济增长情况及通胀水平的宏观经济指标、财政政策与货币政策、工业企业经营情况等；</p> <p>（2）资金流动性</p> <p>主要考察货币环境变化对利率、汇率等关键金融变量的影响，关注市场资金在各个资产市场间的流动，包</p>

	<p>括货币供应量、商业银行信贷、资金流动情况等。</p> <p>(3) 资产估值水平 通过对各类资产的相对估值和绝对估值指标的对比分析，寻找相对的估值洼地。</p> <p>(4) 市场因素 主要分析反映投资者情绪和市场动量特征等方面的指标来判断未来市场的变化趋势。</p> <p>2、股票投资策略 本基金管理人采取积极的股票选择策略，旨在依托本公司的研究平台，综合采用基本面分析和深入调查研究相结合的研究方法，以“自下而上”的方式精选出具备可持续的竞争优势、杰出的成长潜质、出色的经营管理能力，同时有合理估值的上市公司，构建投资组合。</p> <p>在股票选择方面，本基金将从上市公司的核心竞争力、盈利能力和盈利质量、公司治理水平和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司。</p> <p>具体而言，主要考虑的因素包括：</p> <p>(1) 核心竞争力 本基金对公司核心竞争力的考察主要分析公司的品牌优势、销售和其他网络的可复制性、资源优势、技术创新能力和竞争环境等因素。</p> <p>1) 品牌优势 分析公司是否在所属的行业已经拥有较高的市场份额，是否有良好的市场知名度和较好的品牌效应，是否处于行业龙头地位。</p> <p>2) 销售和营销网络的可复制性 分析公司在销售渠道及营销网络等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势。</p> <p>3) 资源优势 分析公司是否拥有独特优势的资源，是否在某些领域拥有独占性的优势。</p> <p>4) 技术创新能力 分析公司的产品自主创新情况、主要产品更新周期、专有技术和专利、对引进技术的吸收和改进能力。</p> <p>5) 竞争环境 分析公司所在行业的内部竞争格局、公司议价能力、公司规模经济、替代品的威胁和潜在竞争对手进入行业的壁垒等因素。</p> <p>(2) 盈利能力和盈利质量</p> <p>1) 盈利能力 结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景，从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力，专注于具有行业领</p>
--	---

	<p>先优势、资产质量良好、盈利能力较强的上市公司。</p> <p>2) 盈利质量</p> <p>本基金不仅关注公司的盈利能力，同时也关注公司盈利的质量，包括公司盈利的构成、盈利的主要来源、盈利的可持续性和可预测性、公司的盈利模式和扩张方式等方面。</p> <p>(3) 公司治理水平和管理层分析</p> <p>1) 公司治理水平分析</p> <p>清晰、合理的公司治理是公司不断良性发展的基础。本基金主要从股权结构的合理性、控股股东的背景和利益、董事会构成、信息披露的质量和及时性、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡等方面，对公司治理水平进行综合评估。</p> <p>2) 公司管理层分析</p> <p>公司管理层的素质和能力是决定公司能否良性发展、不断创造领先优势的关键因素。对公司管理团队进行评价，主要考察其过往业绩、诚信记录、经营战略规划和商业计划执行能力等。</p> <p>(4) 估值分析</p> <p>结合公司所处行业的特点及业务模式，运用相对估值指标和绝对估值模型相结合，并通过估值水平的历史纵向比较和与同行业、全市场横向比较，评估上市公司的投资价值和安全边际，选择股价尚未反映内在价值或具有估值提升空间的上市公司。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券组合管理的策略应该是多元化的，其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法，其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。主要包括：</p> <p>(1) 买入持有策略</p> <p>以简单、低成本为原则，挑选符合投资目标要求的债券买入持有，并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券，应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益率。</p> <p>(2) 债券类属配置策略</p> <p>根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。</p> <p>(3) 期限配置策略</p> <p>根据对流动性的要求、市场收益率的波动情况决定采用子弹型策略(Bullet Strategy)、哑铃型策略(Barbell Strategy)或梯形策略(Stair Strategy)，在各期限债券间进行配置。</p>
--	---



	<p>期限配置尽量选择在预期市场利率的高点或流动性需求较大的时点到期的债券，以减少因流动性不足导致的可能损失。</p> <p>通过分析不同期限债券的收益率绝对差额和相对差额，利用均值回归策略或收益率差额预期策略选择合适期限品种投资。</p> <p>(4) 久期偏离策略</p> <p>根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。管理人对债券市场收益率变动具有较高把握的预期的情况下，交易头寸投资过程中可以主动采用久期偏离策略，使组合久期较为明显的偏离基准。</p> <p>(5) 信用利差策略</p> <p>企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响，相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动，另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。基金管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差交易策略。</p> <p>(6) 收益率曲线策略</p> <p>在确定组合或类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从其相对价格变化中获利。</p> <p>(7) 回购放大策略</p> <p>该策略在资金相对充裕的情况下是风险很低的投资策略。在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作，同时选择 3 年以下的银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。</p> <p>(8) 骑乘策略</p> <p>骑乘策略是收益率曲线相对稳定的情况下，固定收益投资最为常用的策略，实证分析表明，剩余期限 0-3 年往往是收益率曲线最为陡峭的部分，通过集中持有（通常是放大持有）2-3 年的债券组合在 1 年后卖出可以获得较高的风险调整后收益。骑乘策略单独使用时应保证交易头寸的整体久期近似于基准（基准为据委托投资期结束的剩余期限）。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。股指期货的具体</p>
--	---

	投资策略包括：(1) 对冲投资组合的系统性风险；(2) 有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用恒定比例投资组合保险（CPPI, Constant Protection Portfolio Insurance）和基于期权的组合保险策略（OBPI, Option-Based Portfolio Insurance）。基金主要通过 CPPI 策略，在未来三年保本周期中，对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整，以达到保本和锁定部分收益的目的。同时，本基金通过积极稳健的股票投资策略，竭力为基金资产获取最高的增值回报。 本基金的投资策略由三部分组成：资产配置策略、稳健资产投资策略、风险资产投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为保本周期同期限的三年期定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	郭明
	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	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
本期已实现收益	-23,854.67
本期利润	-23,854.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0003
本期加权平均净值利润率	-0.03%
本期基金份额净值增长率	-0.02%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2019年6月30日
期末可供分配利润	23,785,386.58
期末可供分配基金份额利润	0.3872
期末基金资产净值	67,615,541.74
期末基金份额净值	1.1008
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019年6月30日
基金份额累计净值增长率	-0.02%

注：①本报告期不是完整报告期，期间为自2019年6月18日至2019年6月30日止。

②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。

③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。

④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。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2019年1月1日至2019年6月17日
本期已实现收益	23,363,217.52
本期利润	13,172,800.33
加权平均基金份额本期利润	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.47%
本期基金份额净值增长率	1.66%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2019年6月17日
期末可供分配利润	33,808,601.58
期末可供分配基金份额利润	0.3876
期末基金资产净值	96,049,625.40
期末基金份额净值	1.101
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019年6月17日
基金份额累计净值增长率	55.39%

注：①合同生效当期不是完整报告期，期间为自2019年1月1日至2019年6月17日止。

②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。

③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。

④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。

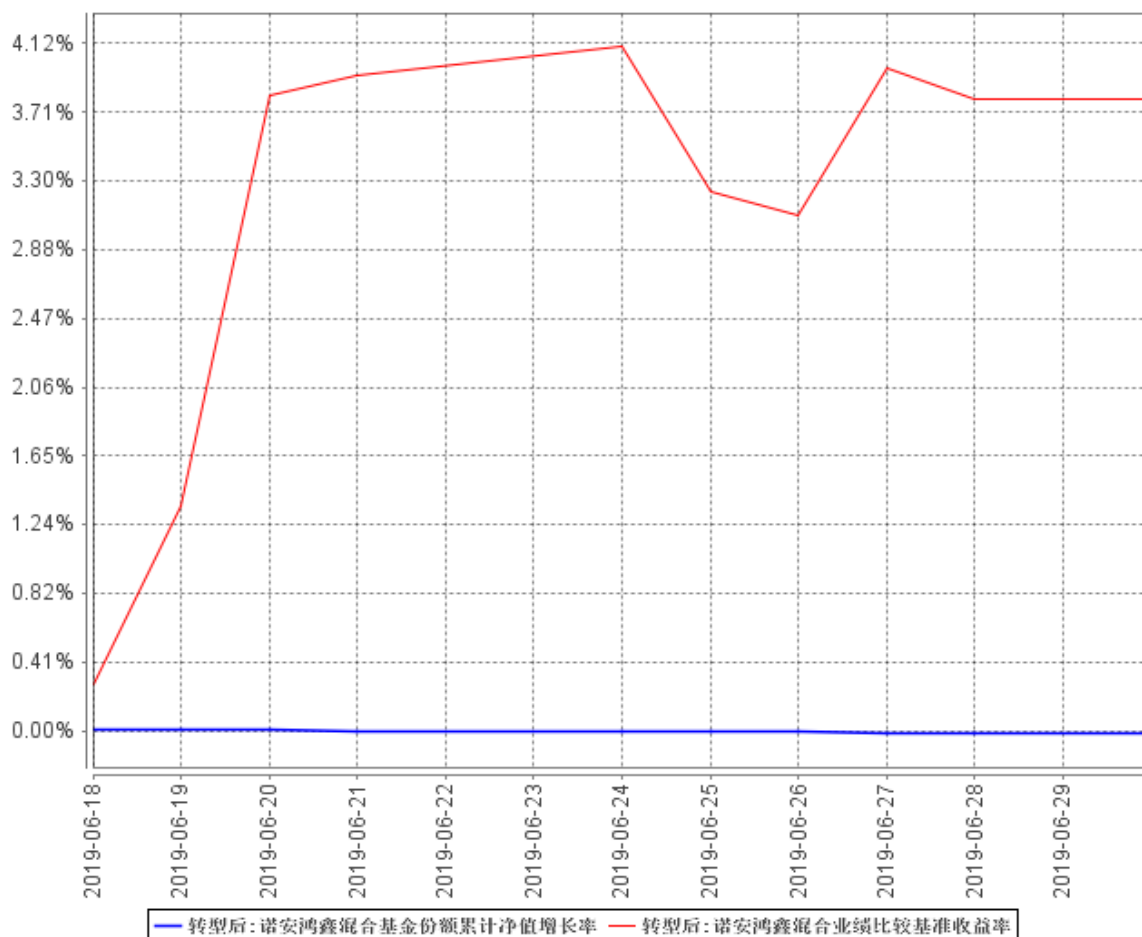
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-0.02%	0.01%	3.78%	0.90%	-3.80%	-0.89%

注：2019年6月18日（含当日）起，本基金转型为“诺安鸿鑫混合型证券投资基金”，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%。

#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：①2019 年 6 月 18 日（含当日）起，本基金转型为“诺安鸿鑫混合型证券投资基金”，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2019 年 6 月 30 日本基金建仓期尚未结束。

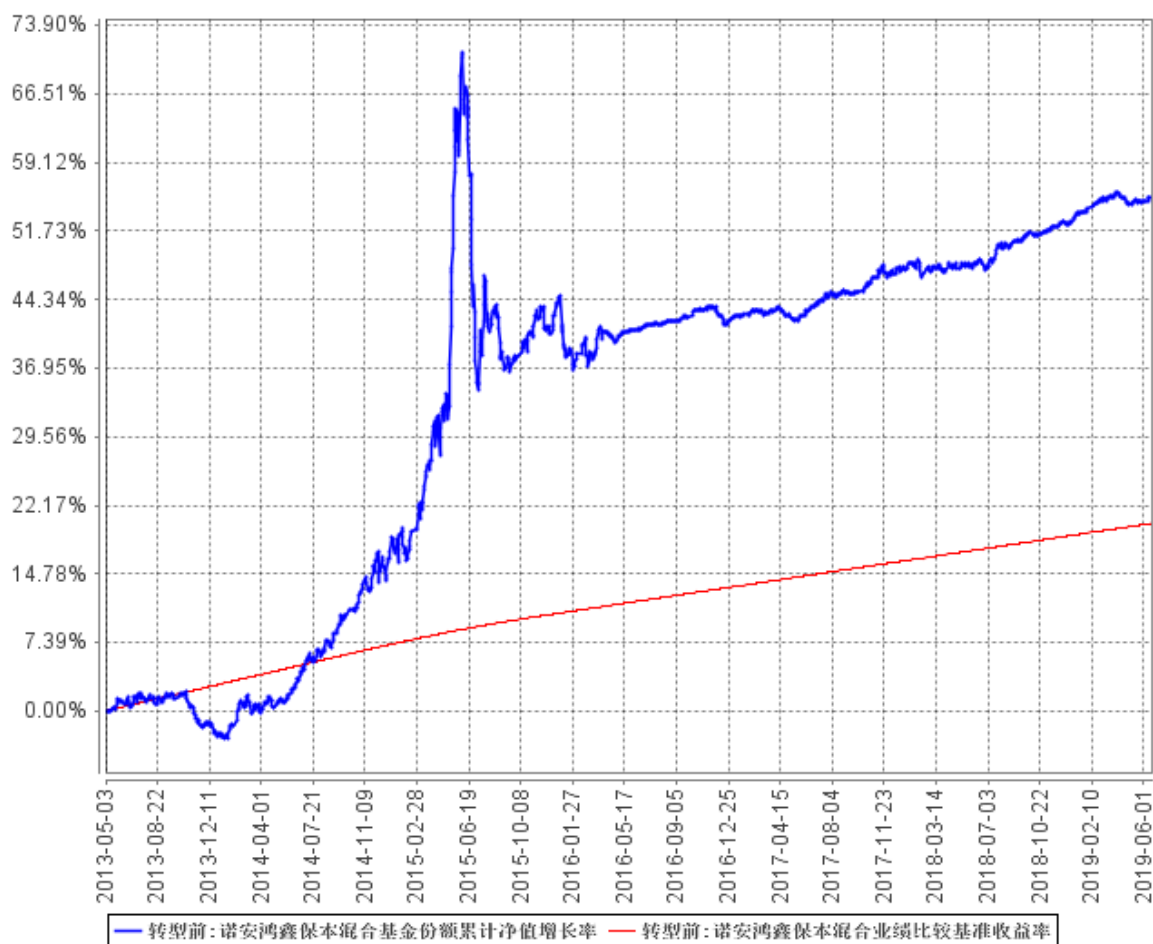
### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.27%	0.06%	0.13%	0.01%	0.14%	0.05%
过去三个月	-0.09%	0.09%	0.60%	0.01%	-0.69%	0.08%
过去六个月	1.66%	0.08%	1.28%	0.01%	0.38%	0.07%
过去一年	5.06%	0.09%	2.69%	0.01%	2.37%	0.08%
过去三年	9.88%	0.10%	8.27%	0.01%	1.61%	0.09%
自基金合同生效起至今	55.39%	0.46%	20.22%	0.01%	35.17%	0.45%

注：本基金的业绩比较基准为：保本周期同期限的 2 年期银行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



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
罗春蕾	本基金基金经理	2019年6月18日	-	12	硕士，曾先后任职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银华基金管理有限公司，从事医药行业研究工作。2011年12月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2015年9月起任诺安主题精选混合型证券投资基金经理，2019年1月起任诺安积极配置混合型证券投资基金基金经理，2019年2月起任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	-	2013年5月3日	2019年6月18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，

				<p>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月起任诺安汇利混合基金经理，2019年3月起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，离任日期为基金合同失效之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本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《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》和《诺安鸿鑫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，诺安鸿鑫混合一季度以中票和转债投资为主，二季度为迎接转型，进行了清仓操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型前最后一日，本基金份额净值为 1.101 元；截至报告期末，本基金份额净值为 1.1008 元。

本报告期内，本基金由诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安鸿鑫混合型证券投资基金。转型前，自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日，诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金份额净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为 1.28%；转型后，自 2019 年 6 月 18 日至 2019 年 6 月 30 日，诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金份额净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准收益率为 3.78%。

#### 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。

下一阶段，诺安鸿鑫混合已完成转型，将以股票投资为主要方向，重新进行投资运作。

#### 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**

转型后: 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 6 次, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

转型前: 本基金合同约定, 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益分配每年至多 6 次; 每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 20%。若基金合同生效不满三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鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安鸿鑫混合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，诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安鸿鑫混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安鸿鑫混合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。本报告期内诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安鸿鑫混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本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鸿鑫混合型证券投资基金 2019 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）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安鸿鑫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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	44,070,828.92
结算备付金		-
存出保证金		8,279.03
交易性金融资产	6.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	25,000,157.50
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	13,941.15
应收股利		-
应收申购款		1,390.48
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	36,617.00
资产总计		69,131,214.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		606,897.13
应付管理人报酬		332,384.77
应付托管费		55,397.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	27,706.34
应交税费		307,121.56
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	186,165.07
负债合计		1,515,672.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	43,588,301.97
未分配利润	6.4.7.10	24,027,239.77
所有者权益合计		67,615,541.74
负债和所有者权益总计		69,131,214.08

注：①报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1008 元，基金份额总额 61,425,865.70 份。

②本报告期为 2019 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安鸿鑫混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
<b>一、收入</b>		32,021.97
1. 利息收入		31,162.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,821.84
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		20,340.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
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	-
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	859.15
<b>减：二、费用</b>		55,876.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,240.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,706.78
3. 销售服务费		-



4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	8,929.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,854.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,854.67

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安鸿鑫混合型证券投资基金

本报告期：2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月18日(基金合同生效日)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)	61,897,580.13	34,152,045.27	96,049,625.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,854.67	-23,854.67
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)	-18,309,278.16	-10,100,950.83	-28,410,228.99
其中：1. 基金申购款	9,218.58	5,084.17	14,302.75
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-18,318,496.74	-10,106,035.00	-28,424,531.74
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)	43,588,301.97	24,027,239.77	67,615,541.74

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

诺安鸿鑫混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金

转型而来。2019 年 6 月 10 日起，诺安鸿鑫混合型证券投资基金保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，该基金保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“诺安鸿鑫混合型证券投资基金”。诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日（含第 5 个工作日），即 2019 年 6 月 10 日（含）至 2019 年 6 月 17 日（含）。自 2019 年 6 月 18 日诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金正式转型为诺安鸿鑫混合型证券投资基金。原诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2013〕171 号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2013 年 5 月 3 日生效。

原诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2013〕171 号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2013 年 5 月 3 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 946,263,644.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 349,068.18 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行的 A 股股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%，债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 0%-40%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一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、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 22 日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要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况、自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

所转移金融资产的账面价值

因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无

法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 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 6 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(d) 每一基金份额享有同等分配权；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估

值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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	44,070,828.92
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：	44,070,828.92

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	25,000,157.50	-
合计	25,000,157.50	-

##### 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	8,752.85
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,184.97
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.33
合计	13,941.15

注：此处其他列示的是应收存出保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	36,617.00
合计	36,617.00

注：此处待摊费用列示的是转型的律师费。

**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	269.36
银行间市场应付交易费用	27,436.98
合计	27,706.34

**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	14.04
预提费用	186,151.03
合计	186,165.07

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	87,230,207.15	61,897,580.13
本期申购	12,991.54	9,218.58
本期赎回(以“-”号填列)	-25,817,332.99	-18,318,496.74
本期末	61,425,865.70	43,588,301.97

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**

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	33,808,601.58	343,443.69	34,152,045.27
本期利润	-23,854.67	-	-23,854.67
本期基金份额交易产生的变动数	-9,999,360.33	-101,590.50	-10,100,950.83
其中：基金申购款	5,033.03	51.14	5,084.17

基金赎回款	-10,004,393.36	-101,641.64	-10,106,035.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,785,386.58	241,853.19	24,027,239.77

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	10,817.17
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	-
其他	4.67
合计	10,821.84

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月18日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
基金赎回费收入	859.15
合计	859.15

#### 6.4.7.19 交易费用

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月18日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	1,780.87
信息披露费	4,143.36
汇划费	418.00
律师费用	2,587.00
合计	8,929.23

### 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

本报告期内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
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
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

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止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

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止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

本基金自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,240.63
其中：支付销售机构的客户维护费	16,188.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,706.78

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 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

本基金的管理人自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间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 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	44,070,828.92	10,817.17

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

本基金的管理人自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止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

本基金的管理人自 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金 2019 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间内未进行利润分配。

#### 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 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

##### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.18.1 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。

###### 6.4.12.18.2 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工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。



#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 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；按照有关法律法規规定应对固定赎回，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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金在开放期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

金额单位：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	44,070,828.92	-	-	-	-	44,070,828.92
存出保证金	8,279.03	-	-	-	-	8,279.03
买入返售金融资产	25,000,157.50	-	-	-	-	25,000,157.50
应收利息	-	-	-	-	13,941.15	13,941.15
应收申购款	-	-	-	-	1,390.48	1,390.48
其他资产	-	-	-	-	36,617.00	36,617.00
资产总计	69,079,265.45	-	-	-	51,948.63	69,131,214.08
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	606,897.13	606,897.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	332,384.77	332,384.77
应付托管费	-	-	-	-	55,397.47	55,397.47

应付交易费用	-	-	-	-	27,706.34	27,706.34
应交税费	-	-	-	-	307,121.56	307,121.56
其他负债	-	-	-	-	186,165.07	186,165.07
负债总计	-	-	-	-	1,515,672.34	1,515,672.34
利率敏感度缺口	69,079,265.45	-	-	-	-1,463,723.71	67,615,541.74

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有对利率敏感的交易性债券资产。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易性金融资产。

#### 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内，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）
	基金投资组合的风险价值	102,125.04
	合计	102,125.04

#### 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无属于第一层次，第二层次和第三层次余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 17 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 17 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	26,992,585.27	2,162,473.79
结算备付金		-	-
存出保证金		8,279.03	18,224.55
交易性金融资产	6.4.7.2	-	967,221,862.76
其中：股票投资		-	470,353.66
基金投资		-	-
债券投资		-	966,751,509.10
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	96,000,168.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	39,265.76	18,672,003.71
应收股利		-	-
应收申购款		-	748.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	39,204.00	-
资产总计		123,079,502.06	988,075,313.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 17 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	52,379,801.43
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		26,169,074.08	999,347.62
应付管理人报酬		292,144.14	951,799.94
应付托管费		48,690.69	158,633.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,339.14	40,754.23
应交税费		307,121.56	362,141.35
应付利息		-	57,526.85

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	186,507.05	174,058.35
负债合计		27,029,876.66	55,124,063.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	61,897,580.13	610,192,159.81
未分配利润	6.4.7.10	34,152,045.27	322,759,090.70
所有者权益合计		96,049,625.40	932,951,250.51
负债和所有者权益总计		123,079,502.06	988,075,313.57

注：①报告截止日 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)，基金份额净值人民币 1.101 元，基金份额总额 87,230,207.15 份。

②本报告期为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 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 17 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		19,911,465.53	16,502,841.68
1. 利息收入		14,232,445.79	26,990,852.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,247.02	15,383.78
债券利息收入		12,998,785.19	26,203,142.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,191,413.58	772,326.13
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		15,760,720.89	435,656.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-123,492.61	2,348,600.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,884,213.50	-2,781,083.61
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	-	868,140.12
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-10,190,417.19	-11,845,136.94
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	108,716.04	921,469.31

<b>减：二、费用</b>		6,738,665.20	12,592,363.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,898,608.51	7,032,300.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	816,434.71	1,172,050.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,090.15	16,193.41
5. 利息支出		865,754.11	4,123,706.32
其中：卖出回购金融资产支出		865,754.11	4,123,706.32
6. 税金及附加		36,329.08	85,877.67
7. 其他费用	6.4.7.20	107,448.64	162,235.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,172,800.33	3,910,478.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,172,800.33	3,910,478.40

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 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）	610,192,159.81	322,759,090.70	932,951,250.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,172,800.33	13,172,800.33
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）	-548,294,579.68	-301,779,845.76	-850,074,425.44
其中：1. 基金申购款	2,343,537.63	1,288,402.58	3,631,940.21
2. 基金赎回款	-550,638,117.31	-303,068,248.34	-853,706,365.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	61,897,580.13	34,152,045.27	96,049,625.40
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金	841,435,747.20	399,849,485.16	1,241,285,232.36

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,910,478.40	3,910,478.40
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)	-205,092,690.47	-98,647,196.43	-303,739,886.90
其中:1.基金申购款	785,558.72	374,255.74	1,159,814.46
2.基金赎回款	-205,878,249.19	-99,021,452.17	-304,899,701.36
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)	636,343,056.73	305,112,767.13	941,455,823.86

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

诺安鸿鑫保本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”)《关于核准诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]171号)批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2013年5月3日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为946,263,644.84份基金份额,其中认购资金利息折合349,068.18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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金基金合同》和《诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行的A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。其中,本基金的投资组合比例为:股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的0%-40%,其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等稳健资产不低于基金资产的60%,其中基金保留的现金以及投资于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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 17 日的财务状况、自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日（基金合同失效前日）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 17 日
活期存款	26,992,585.27
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：	26,992,585.27

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 17 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	96,000,168.00	-
合计	96,000,168.00	-

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 17 日
----	------------------------

应收活期存款利息	34,010.58
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,223.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	31.40
合计	39,265.76

注：此处列示的其他应收保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月17日	上年度末 2018年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	39,204.00	-
合计	39,204.00	-

#### 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17日
交易所市场应付交易费用	269.36
银行间市场应付交易费用	26,069.78
合计	26,339.14

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月17日
应付赎回费	6,280.25
预提费用	180,226.80
合计	186,507.05

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月17日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	861,243,881.82	610,192,159.81

本期申购	3,307,698.17	2,343,537.63
本期赎回（以“-”号填列）	-777,321,372.84	-550,638,117.31
本期末	87,230,207.15	61,897,580.13

注：此处申购含转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	308,445,303.46	14,313,787.24	322,759,090.70
本期利润	23,363,217.52	-10,190,417.19	13,172,800.33
本期基金份额交易产生的变动数	-297,999,919.40	-3,779,926.36	-301,779,845.76
其中：基金申购款	1,203,921.39	84,481.19	1,288,402.58
基金赎回款	-299,203,840.79	-3,864,407.55	-303,068,248.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,808,601.58	343,443.69	34,152,045.27

#### 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17日
活期存款利息收入	42,153.32
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	-
其他	93.70
合计	42,247.02

注：此处其他列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

#### 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17日
卖出股票成交总额	779,756.67
减：卖出股票成本总额	903,249.28
买卖股票差价收入	-123,492.61

#### 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17日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	1,470,831,004.22

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,421,228,799.67
减：应收利息总额	33,717,991.05
买卖债券差价收入	15,884,213.50

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)期间内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)期间内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)期间内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日
1. 交易性金融资产	-10,190,417.19
——股票投资	141,356.82
——债券投资	-10,331,774.01
——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	-10,190,417.19

#### 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 17 日
基金赎回费收入	107,137.04
基金转换费收入	1,579.00
合计	108,716.04

#### 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 17 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	2,910.15
银行间市场交易费用	11,180.00
合计	14,090.15

#### 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17日
审计费用	23,014.32
信息披露费	57,212.48
汇划费	7,825.84
律师费用	796.00
账户维护费	18,600.00
合计	107,448.64

#### 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

本报告期内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
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
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

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有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 17 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,898,608.51	7,032,300.71
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	1,970,730.74	2,254,229.39

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.2%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。



**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	816,434.71		1,172,050.10	

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

**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**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止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**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间及上年度可比期间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**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间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。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	26,992,585.27	42,153.32	1,282,931.47	14,509.59

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**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间与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**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### **6.4.11 利润分配情况**

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止期间未进行过利润分配。

#### **6.4.12 期末（2019 年 6 月 17 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 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)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股票**

截至本报告期末 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)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 2019 年 6 月 17 日(基金合同失效前日)止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### **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 17 日(基金合同失效前日)止，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### **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工商银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 17 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	-	60,252,000.00
合计	-	60,252,000.00

注：未评级债券为政策性金融债、超短期融资债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月17日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	410,867,960.80
AAA 以下	-	286,099,548.30
未评级	-	209,532,000.00
合计	-	906,499,509.10

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，

除附注 6.4.12 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，本基金在开放期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

金额单位：人民币元

本期末 2019年6月 17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	26,992,585.27	-	-	-	-	26,992,585.27
存出保证金	8,279.03	-	-	-	-	8,279.03
买入返售金 融资产	96,000,168.00	-	-	-	-	96,000,168.00
应收利息	-	-	-	-	39,265.76	39,265.76
其他资产	-	-	-	-	39,204.00	39,204.00
资产总计	123,001,032.30	-	-	-	78,469.76	123,079,502.06
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	26,169,074.08	26,169,074.08
应付管理人 报酬	-	-	-	-	292,144.14	292,144.14
应付托管费	-	-	-	-	48,690.69	48,690.69
应付交易费 用	-	-	-	-	26,339.14	26,339.14
应交税费	-	-	-	-	307,121.56	307,121.56
其他负债	-	-	-	-	186,507.05	186,507.05
负债总计	-	-	-	-	27,029,876.66	27,029,876.66
利率敏感度 缺口	123,001,032.30	-	-	-	-26,951,406.90	96,049,625.40
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	2,162,473.79	-	-	-	-	2,162,473.79
存出保证金	18,224.55	-	-	-	-	18,224.55
交易性金融 资产	221,279,897.60	256,676,188.60	329,720,422.90	159,075,000.00	470,353.66	967,221,862.76
应收利息	-	-	-	-	18,672,003.71	18,672,003.71
应收申购款	-	-	-	-	748.76	748.76
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	223,460,595.94	256,676,188.60	329,720,422.90	159,075,000.00	19,143,106.13	988,075,313.57
负债						
卖出回购金 融资产款	52,379,801.43	-	-	-	-	52,379,801.43
应付赎回款	-	-	-	-	999,347.62	999,347.62
应付管理人 报酬	-	-	-	-	951,799.94	951,799.94
应付托管费	-	-	-	-	158,633.29	158,633.29
应付交易费 用	-	-	-	-	40,754.23	40,754.23
应付利息	-	-	-	-	57,526.85	57,526.85
应交税费	-	-	-	-	362,141.35	362,141.35
其他负债	-	-	-	-	174,058.35	174,058.35
负债总计	52,379,801.43	-	-	-	2,744,261.63	55,124,063.06
利率敏感度 缺口	171,080,794.51	256,676,188.60	329,720,422.90	159,075,000.00	16,398,844.50	932,951,250.51

#### 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17日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降27个基点	-	4,636,756.70
	市场利率上升27个基点	-	-4,636,756.70

#### 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17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	-	-	470,353.66	0.05
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	966,751,509.10	103.62
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	-	-	967,221,862.76	103.67

#### 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	120,750.53	1,885,835.22
	合计	120,750.53	1,885,835.22

#### 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 17 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次、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 46,340,059.86 元，属于第二层次的余额为 920,292,802.90 元，属于第三层次的余额为 589,000.00 元，其中列入属于第三层次的金融工具为未上市交易的股票和债券)。

(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 17 日(基金合同失效前日),本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2018 年 12 月 31 日:无)。

(2)其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 7 投资组合报告（转型后）

### 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	25,000,157.50	36.16
	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	44,070,828.92	63.75
8	其他各项资产	60,227.66	0.09
9	合计	69,131,214.08	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,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。**

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,279.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,941.15
5	应收申购款	1,390.48
6	其他应收款	-

7	待摊费用	36,617.00
8	其他	-
9	合计	60,227.66

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	96,000,168.00	78.00
	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	26,992,585.27	21.93
8	其他资产	86,748.79	0.07
9	合计	123,079,502.06	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	601233	桐昆股份	291,538.80	0.03

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	601233	桐昆股份	289,216.94	0.03
2	601319	中国人保	263,042.37	0.03
3	002673	西部证券	227,497.36	0.02

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	291,538.80
卖出股票收入（成交）总额	779,756.67

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,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。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,279.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,265.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	39,204.00
8	其他	-
9	合计	86,748.79

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.5 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（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,457	42,159.14	139,952.83	0.23%	61,285,912.87	99.77%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	99,470.94	0.1619%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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



## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,690	51,615.51	139,952.83	0.16%	87,090,254.32	99.84%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日（2019年6月18日）基金份额总额	87,230,207.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,991.54
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	25,817,332.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	61,425,865.70

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。

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日（2013年5月3日）基金份额总额	946,263,644.84
本报告期期初基金份额总额	861,243,881.82
本报告期基金总申购份额	3,307,698.17
减:本报告期基金总赎回份额	777,321,372.84
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	87,230,207.15

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

转型前，本基金的投资策略为：本基金采用恒定比例投资组合保险（CPPI，Constant Protection Portfolio Insurance）和基于期权的组合保险策略（OBPI，Option-Based Portfolio Insurance）。基金主要通过 CPPI 策略，在未来三年保本周期中，对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整，以达到保本和锁定部分收益的目的。同时，本基金通过积极稳健的股票投资策略，竭力为基金资产获取最高的增值回报。本基金的投资策略由三部分组成：资产配置策略、稳健资产投资策略、风险资产投资策略。

转型后，本基金的投资策略为：本基金的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略四个方面。

### 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（转型后）

#### 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	
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：本报告期增加 2 家证券公司的 2 个交易单元：中信建投证券股份有限公司（1 个交易单元）和招商证券股份有限公司（1 个交易单元）。

## 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

本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
中信建投	1	552,250.13	70.82%	514.35	70.83%	-
招商证券	1	227,497.36	29.18%	211.86	29.17%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。

(5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,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
中信建投	156,518,286.71	83.17%	-	-	-	-
招商证券	31,667,660.09	16.83%	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安鸿鑫混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2019年6月15日
2	诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同摘要	《上海证券报》	2019年6月15日
3	诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2019年6月15日
4	诺安鸿鑫混合型证券投资基金招募说明书	《上海证券报》	2019年6月15日
5	诺安基金管理有限公司关于诺安鸿鑫混合型证券投资基金转型后运作的提示性公告	《上海证券报》	2019年6月18日
6	诺安鸿鑫混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的提示性公告	《上海证券报》	2019年6月19日
7	诺安基金管理有限公司关于紫	《上海证券报》	2019年6月19日

	金农商银行不再代销诺安鸿鑫混合基金的公告		
8	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
9	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。

### 10.9 其他重大事件（转型前）

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	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《上海证券报》	2019年1月21日
4	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
5	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在桂林银行停止办理申（认）购、定投申购、转换的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019年3月1日
6	诺安基金管理有限公司关于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
7	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金 2018 年年度报告	基金管理人网站	2019年3月27日
8	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《上海证券报》	2019年3月27日
9	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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019年3月28日

	的公告		
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 3 月 30 日
11	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《上海证券报》	2019 年 4 月 19 日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京植信基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2019 年 4 月 19 日
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诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期第一次提示性公告	《上海证券报》	2019 年 5 月 23 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诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期第二次提示性	《上海证券报》	2019 年 5 月 30 日



	公告		
21	诺安基金管理有限公司关于诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为诺安鸿鑫股票型证券投资基金后运作相关业务规则的公告	《上海证券报》	2019年6月4日
22	诺安基金管理有限公司关于诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金份额净值精度的公告	《上海证券报》	2019年6月14日
23	诺安基金管理有限公司关于诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金转型的公告	《上海证券报》	2019年6月15日
24	诺安基金管理有限公司关于诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	《上海证券报》	2019年6月15日
25	诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）2019年第1期-摘要	《上海证券报》	2019年6月17日
26	诺安鸿鑫保本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6月17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	1	2019.01.02-2019.06.10	500,121,871.02	-	500,121,871.02	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

### 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鸿鑫保本混合型证券投资基金募集的文件。
- ②原诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安鸿鑫混合型证券投资基金的相关公告。
- ③《诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金合同》。
- ④《诺安鸿鑫混合型证券投资基金托管协议》。
- ⑤《诺安鸿鑫混合型证券投资基金招募说明书》。
- ⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑦诺安鸿鑫混合型证券投资基金 2019 年半年度报告正文。
- ⑧报告期内诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金和诺安鸿鑫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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日