

# 诺安优化收益债券型证券投资基金

基金管理人：诺安基金管理有限公司  
基金托管人：华夏银行股份有限公司  
送出日期：2018年8月27日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事、监事及高级管理人员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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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，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。

本半年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

| 基金简称    | 诺安优化收益债券    |
|---------|-------------|
| 基金代码    | 200004      |
| 基金运作方式  | 契约型开放式      |
| 基金合同生效日 | 2009年6月16日  |
| 基金管理人   | 诺安基金管理有限公司  |
| 基金托管人   | 华夏银行股份有限公司  |
| 基金类型    | 债券型基金       |
| 基金类别    | 债券型基金-债券型基金 |

注：原“诺安中期短期债券投资基金”的基金合同生效日为2006年7月17日，2007年8月29日《诺安优化收益债券型证券投资基金》基金合同生效，“诺安中期短期债券投资基金”转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

| 投资目标   | 通过本基金的精选和价值的挖掘，力争为投资者提供高于投资基准的回报。   |
|--------|---|
| 投资策略   | 本基金的投资策略主要通过宏观分析和微观分析相结合的方法，综合考虑宏观经济、政策环境、资金供求、利率水平、信用利差、流动性、信用风险等因素，对不同类别的债券品种进行配置，同时精选具有投资价值的个券进行投资。本基金将通过深入研究，精选具有投资价值的个券进行投资，从而达到较高的投资回报。   |
| 投资范围   | 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债、企业（公司）债（包括可转换、可交换债）、资产支持证券、银行存款、同业存单、回购、货币市场工具等固定收益类金融工具，以及中国证监会允许的其他固定收益类金融工具。但非固定收益类金融工具投资比例合计不超过基金资产的20%。因上述原因持有的股票和权证等资产，基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。基金通过二级市场买入股票或权证，现金或者经基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年末和年末未估价复核与基金会计数据的核对情况进行。 |
| 投资限制   | 本基金不得从事下列行为：（1）向他人贷款或提供担保；（2）从事承担无限责任的投资；（3）买卖其他基金份额，但是基金管理人管理的其他基金除外；（4）向基金管理人、基金托管人出资；（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；（6）向其基金管理人、基金托管人出资；（7）从事重大关联交易，但基金管理人、基金托管人按法规、规章、规范性文件的要求履行相关义务的除外；（8）从事证券衍生品种投资；（9）从事其他可能对基金财产造成不利影响的投资。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险及预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金。  |

### 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            | 华夏银行股份有限公司            |
| 住所     | 上海市徐汇区宛平南路88号         | 北京市东城区建国门内大街1号        |
| 联系人    | 陈红                    | 王军                    |
| 电话     | 010-63206000          | 010-62520000          |
| 电子邮箱   | zhangyong@ionfund.com | shuangqiu@cboc.com.cn |
| 客户服务电话 | 400-888-0808          | 95533                 |
| 传真     | 010-63206007          | 010-62520400          |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

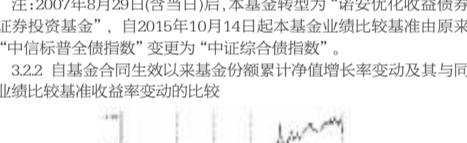
| 3.1.1 利润数据和利润表 |                | 报告期2018年1月1日至2018年6月30日 |                |
|----------------|----------------|-------------------------|----------------|
| 本期已实现收益        | -17,007,337.00 | 本期利润                    | -17,007,337.00 |
| 本期利润总额         | -17,007,337.00 | 加权平均基金份额本期利润            | -0.209%        |
| 本期基金份额变动       | -              | 期末基金份额总额                | -              |
| 报告期利润          | 0.0004         | 报告期期末基金资产净值             | 1,322,899.00   |
| 报告期期末基金资产净值    | 1,322,899.00   | 报告期期末可供分配基金份额总额         | 1,322,899.00   |

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，费用计算会影响实际收益水平。

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）、扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

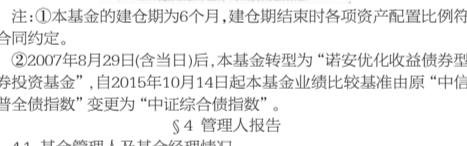
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

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

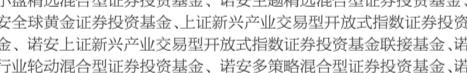


注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.3 基金份额净值表现

3.2.3.1 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

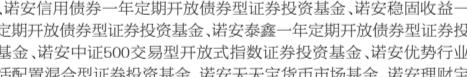


注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4 基金资产净值

3.2.4.1 基金资产净值

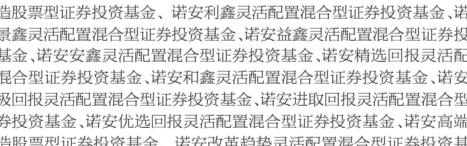


注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.2 基金份额净值

3.2.4.2.1 基金份额净值

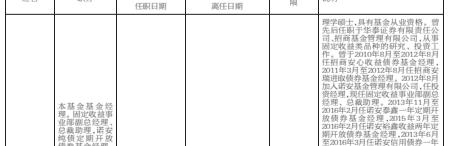


注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.3 基金资产净值

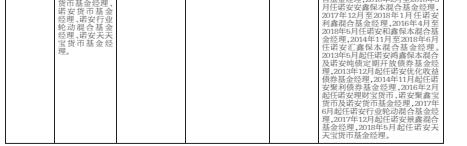
3.2.4.3.1 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.4 基金资产净值

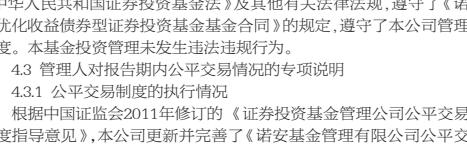


注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.5 基金资产净值

3.2.4.5.1 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.6 基金资产净值

3.2.4.6.1 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.7 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.8 基金资产净值

3.2.4.8.1 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.9 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②2007年8月29日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，自2015年10月14日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

3.2.4.10 基金资产净值



注：①本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。