诺安成长混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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: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,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。

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

本报告中财务资料未经审计 。

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	诺安成长混合
基金主代码	320007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月10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	444,031,838.75份
基金合同存续期	不定期

注:自2015年8月6日起,原“诺安成长股票型证券投资基金”变更为“诺安成长混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的企业,同时兼顾企业成长能力的可持续性,并对其投资价值做出定性及定量分析,力图在享受积极企业成长盛宴的同时获得长期稳定的回报。
投资策略	本基金具体的投资策略由资产配置,股票投资,债券投资和权证投资四部分构成: (1)在资产配置方面,本基金采用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方式进行。 (2)在股票投资方面,本基金投资于成长性企业的比例不小于本基金所持股票资产的80%。 (3)在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略,收益率曲线模拟策略,收益率溢价策略,个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取由于债券市场非均衡不平衡所带来的收益。 (4)在权证投资方面,本基金主要运用价值发现和价差策略,作为辅助性投资工具,本基金会结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	80%×标普中国A股综合指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国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	0755-83026888	(010)66105798
	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)66105799

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-65,260,676.40
本期利润	-66,038,214.07
加权平均基金份额本期利润	-0.1404
本期基金份额净值增长率	-15.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0712
期末基金资产净值	351,302,817.73
期末基金份额净值	0.791

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

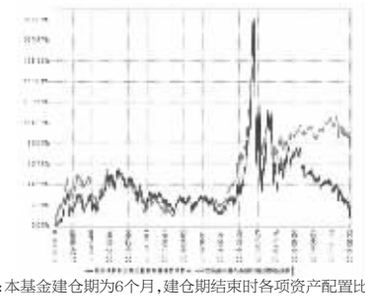
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.94%	2.26%	-7.11%	1.15%	4.17%	1.11%
过去三个月	-9.70%	1.65%	-9.72%	0.93%	0.02%	0.72%
过去六个月	-15.22%	1.53%	-12.40%	0.94%	-2.82%	0.59%
过去一年	-22.53%	1.22%	-9.44%	0.77%	-13.09%	0.45%
过去三年	-49.65%	2.17%	-23.68%	1.29%	-25.97%	0.88%
自基金合同生效起至今	18.48%	1.67%	83.15%	1.23%	-64.67%	0.44%

注:自2015年11月2日起,本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普A股综合指数以及上证国债指数的复合指数即:80%×中标综指+20%×上证国债指数”,更名为“标普中国A股综合指数以及上证国债指数的复合指数即:80%×标普中国A股综合指数+20%×上证国债指数”。

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: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2018年6月30日,本基金管理人共管理56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、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、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等。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王创练	本基金基金经理,研究部总监,首席投资顾问(总助理),诺安研究精选股票基金经理,诺安成长混合基金经理,诺安成长混合基金经理,诺安成长混合基金经理。	2018年6月13日	-	22	博士,曾先后任职于特区证券研究所,现任证券研究所,长城基金管理有限公司,2008年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究国际总监,现任研究部总监,首席策略师(助理级),2017年3月至2018年6月任诺安平衡证券投资基金基金经理,2015年3月起任诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理,2018年3月起任诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年6月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理。
李磊	无	2017年11月17日	2018年6月21日	14	硕士,曾先后任职于平安保险集团投资管理中心、光大证券研究所、大平洋资产管理有限责任公司,从事行业研究、投资工作。2014年加入诺安基金管理有限公司,历任基金经理助理。2014年6月至2017年11月任诺安平衡证券投资基金基金经理,2017年8月至2018年6月任诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年11月至2018年6月任诺安成长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、离职日期均为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安成长混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安成长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

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

报告期内基金净值涨跌主要原因:

1、系统性风险,由于中美贸易战的持续升温以及经济下行的潜在风险,各指数均出现了较大幅度的调整,基金净值也相应调整,同期跑赢各项指数;

2、由于一季度成长股的机会,二季度初期成长股布局较集中,没有及时减仓成长股,4、5月份成长股出现了较大幅度的回调,尤其是短期没有业绩的成长股出现了大幅度的回调,比如半导体,对净值影响较大;

3、政策影响。由于光伏补贴退坡,导致市场对补贴政策的恐慌,拖累了新能源汽车板块,之前布局的新能源板块出现了大幅度的调整。

操作策略上,进入6月份,做了几个重要的操作:首先,卖出新能源汽车板块;其次,卖出前期涨幅较大的医药板块;买入方面,买入稳定性较好的龙头股,由于减少了成长股的持仓,避免了净值的大幅下跌。

6月下旬,积极布局成长股反弹,主要加仓计算机中自主可控板块和电子的半导体板块,6月后两周,基金净值上涨7%,取得了良好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.791元。本报告期基金份额净值增长率为-15.22%,同期业绩比较基准收益率为-12.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央政治局会议定好后续发展基调, 积极财政政策要扩大内需,补短板要扩大基建。一是积极财政政策要在扩大内需和结构调整上发挥更大作用。考虑贸易冲突的不确定性,下半年经济增长下行压力将加大,积极财政政策将发力,约1万亿地方专项债额度有望加快发行。二是基建投资增速下半年有望显著反弹,基建要加大补短板的力度。上半年部分中西部省份投资增速下滑过快,我们认为高铁、高速、乡村振兴等相关的基建方向有望显著发力。

从行业来看,成长股比如计算机板块中报业绩预告披露情况,整体增速较去年同期提升,计算机150家公司净利润增速中位数15%,而主线云计算相关公司业绩集体爆发,普遍在40%以上。相对积极的财政政策预期叠加下个月中报集中披露,把握反弹机会,之后在大局势不明朗的情况下逢高减仓。

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

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六次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的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成长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,诺安成长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成长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,诺安成长混合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成长混合型证券投资基金2018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:诺安成长混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	61,087,376.73	46,293,613.34
结算备付金	4,905,061.28	11,439,887.68
存出保证金	346,747.55	327,442.62
交易性金融资产	301,523,197.28	363,139,276.95
其中:股票投资	301,523,197.28	363,139,276.95
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	-	-
买入返售金融资产	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	16,077,467.91
应收利息	14,169.06	-7,176.93
应收股利	-	-
应收申购款	42,960.94	47,816.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	367,919,512.84	466,318,317.95
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	14,473,622.45	-
应付赎回款	463,936.59	483,210.19
应付管理人报酬	432,359.03	591,312.89
应付托管费	72,059.82	98,552.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,067,691.93	1,517,434.97
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	116,825.29	151,056.66
负债合计	16,616,695.11	2,841,546.86
所有者权益:		
实收基金	444,031,838.75	496,634,018.87
未分配利润	-92,729,021.02	-33,157,247.78
所有者权益合计	351,302,817.73	463,476,771.09
负债和所有者权益总计	367,919,512.84	466,318,317.95

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.791元,基金份额总额444,031,838.75 份。

6.2 利润表

会计主体:诺安成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-58,609,752.06	-20,045,948.90
1.利息收入	689,962.34	684,563.56
其中:存款利息收入	262,364.36	362,914.45
债券利息收入	-	1,333.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	427,606.98	320,315.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-58,564,814.08	-113,178,771.26
其中:股票投资收益	-60,266,589.39	-114,670,451.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	19,789.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,701,775.31	1,471,891.40
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-777,537.67	92,374,387.08
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	42,637.35	73,871.72
减:二.费用	7,428,462.01	9,200,611.54
1. 管理人报酬	3,045,067.26	4,493,108.20
2. 托管费	507,511.19	748,851.44
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,754,134.33	3,829,079.98
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	121,749.23	129,571.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-66,038,214.07	-29,246,560.44
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-66,038,214.07	-29,246,560.44

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	496,634,018.87	-33,157,247.78	463,476,771.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-66,038,214.07	-66,038,214.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-52,602,180.12	6,466,440.83	-46,135,739.29
其中:1.基金申购款	12,496,267.92	-1,681,803.25	10,813,464.67
2.基金赎回款	-65,097,448.04	8,148,244.08	-56,949,203.96
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)	444,031,838.75	-92,729,021.02	351,302,817.73
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	606,757,620.56	42,376,604.58	648,134,225.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-29,246,560.44	-29,246,560.44
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)	-42,617,176.53	-1,526,882.13	-44,153,058.66
其中:1.基金申购款	24,187,976.82	759,338.17	24,947,314.99
2.基金赎回款	-66,805,153.35	-2,286,220.30	-69,100,373.65
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)	564,140,444.03	11,594,162.01	574,734,606.04

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

诺安成长混合型证券投资基金 (以下简称“本基金”)原名为诺安成长股票型证券投资基金。根据中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号) 规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月6日起, 诺安成长股票型证券投资基金名称变更为诺安成长混合型证券投资基金。原诺安成长股票型证券投资基金经中国证监会《关于核准诺安成长股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可 [2008] 1283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《诺安成长股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2009年3月10日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为1,167,838,082.92份基金份额,其中认购资金利息折合118,504.98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、《诺安成长混合型证券投资基金基金合同》和《诺安成长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所有在国内依法发行的,具有良好流动性的A股,主要投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票, 投资于这类股票的资产不低于基金股票投资的80%;债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债;权证等新的金融产品将在法律法规允许的范围内进行投资;现金资产主要投资于各类银行存款。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为60-95%; 债券现金等固定收益金融工具占基金资产的比例为5-40%, 其中现金和到期日在一年以内的政府债券的比例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;权证占基金资产净值的比例为0-3% 。

本基金的财务报表于2018年8月24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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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]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[2015] 125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2017] 56号文《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)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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)运营基金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。对基金在2018年1月1日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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(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)对基金取得的股票的股息、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, 股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的, 暂减按25%计入应纳税所得额, 股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时, 对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f)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。

(g)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
深圳市建隆投资有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,045,067.26	4,493,108.20
其中:支付销售机构的客户维护费	764,577.19	860,813.49

注:本基金的管理费率为年费率1.50% 。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	507,511.19	748,851.44

注:本基金的托管费率为年费率0.25% 。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
期初持有的基金份额	25,487,680.54	25,487,680.54
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	25,487,680.54	25,487,680.54
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.74%	4.53%

注:基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	61,087,376.73	207,405.36	41,721,201.68	342,021.73

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持