诺安低碳经济股票型证券投资基金 2019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:2019年8月23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2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2019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	诺安低碳经济股票
基金主代码	001208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月12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	810,906,788.81份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于低碳经济主题相关上市公司,在控制投资风险的同时,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略方面,本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略,根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,系统进行短期资产运动配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。 本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,动态优化投资组合,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。 2.低碳经济主题配置策略 a)低碳经济主题及其相关行业和公司的界定 走向低碳化时代是大势所趋,低碳经济也势在必行。低碳经济是一项系统工程,必须从经济和社会整体出发,着重在七个方面:能源低碳化如以新能源、节能减排、绿色发展等为主营业务,提供相关设备、技术、产品、服务等与能源节能减排相关的行业或公司,交通低碳化如新能源汽车等行业或公司,建筑低碳化如生产和用节能环保建筑材料的相关行业或公司,农业低碳化如林业、有机农业等行业或公司,工业低碳化如发展节能减排和循环经济等行业或公司,服务业低碳化如提倡智慧信息化服务的行业或公司,消费低碳化如提倡绿色消费及可循环消费的酒店、旅游等行业或公司。 未来随着经济增长方式转变和产业结构升级,从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述对低碳经济主题类股票的识别及认定。 b)行业配置策略 本基金将分别从以下几个方面对低碳经济的各个子行业进行分析: (1)政策分析:本基金将密切关注低碳经济相关国家产业政策以及财政税收政策和货币政策等变化对低碳经济主题相关行业的影响,积极配置政策扶持低碳经济行业。 (2)公司分析:技术水平将影响低碳经济主题相关公司的发展情况。本基金将密切跟踪低碳经济主题相关公司技术水平变化及发展趋势,重点关注技术水平提升较快且发展前景良好的上市公司。 (3)市场分析:低碳经济主题相关行业可能会处于各自不同的发展阶段及行业周期。本基金将重点关注处于行业上升阶段及上升周期的子行业进行投资。 3.个股投资策略方面,本基金将结合定量与定性分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力,选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资。 4.债券投资策略方面,本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。 5.权证投资策略方面,本基金将主要运用价值发现策略和股权交易策略等,作为辅助性投资工具,我们将结合目身资产状况审慎投资,力争获得最佳风险调整收益。 6.资产支持证券投资策略 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、提供提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以控低流动性风险。 未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证内地低碳经济主题指数收益率+20%×中证全债指数的混合指数,即:80%×中证内地低碳经济主题指数收益率+20%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	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@lionfundcom.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798

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.lionfundcom.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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	159,274,665.95
本期利润	216,950,420.75
加权平均基金份额本期利润	0.2301
本期基金份额净值增长率	20.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1637
期末基金资产净值	943,642,853.68
期末基金份额净值	1.164

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。

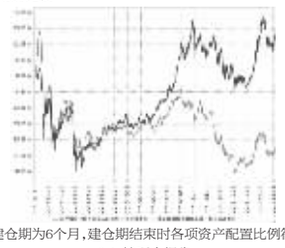
3.2 基金净值表现

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	3.47%	1.06%	1.19%	0.93%	2.28%	0.13%
过去三个月	-1.02%	1.30%	-6.42%	1.24%	5.40%	0.06%
过去六个月	20.87%	1.21%	10.12%	1.24%	10.75%	-0.03%
过去一年	8.08%	1.26%	-5.15%	1.21%	13.23%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.40%	1.44%	-29.54%	1.42%	45.94%	0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:80%×中证内地低碳经济主题指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

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、诺安聚财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡宇滨	本基金基金经理	2019年1月22日	-	9	硕士,曾先后任职于IMI亚太总部、招商证券,2014年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、投资经理。2017年12月起任诺安平衡证券投资基金基金经理,2018年4月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理,2019年1月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。
盛震山	无	2018年7月27日	2019年1月22日	9	硕士/MBA,曾任职于中国电信集团北京市电信有限公司、中国移动通信有限公司研究院,后任职于光大证券股份有限公司,从事行业研究工作。2012年1月加入诺安基金管理有限公司,任研究员。2015年9月至2019年1月任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理,2018年1月至2019年1月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年3月至2019年1月任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年7月至2019年1月任诺安积极配置混合型证券投资基金基金经理,2018年9月至2019年1月任诺安优化配置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、离任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《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,诺安低碳经济股票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《诺安低碳经济股票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

2019年二季度本基金涨幅为-1.02%,跑赢沪深300指数(-1.21%)0.19个百分点。上半年收益20.87%,跑输沪深300指数(27.07%)6.2个百分点。主要在一季度股市上涨过程中配置较为保守,因此有一定程度的跑输指数。

回顾2019年二季度,川普宣布对中国2000亿美元出口商品加税后,股市出现了明显的调整,从3200调整至2800,基本上也中止了从年初以来的这波上涨行情,但在调整过程中,中小盘股调整幅度较深,龙头白马在六月的反弹中却创了新高。正如上一季度所说,行情的上涨一方面来自于减税降费政策利好和流动性改善,也来自于市场从极低估值开始的悲观预期修复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.164元;本报告期基金份额净值增长率为20.87%,同期业绩比较基准收益率为10.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前这个时点,我们认为从悲观预期的估值修复基本结束,从宏观基本面看企业利润并未出现改善,下半年仍有下行压力,但龙头公司的估值却已在历史估值区间最高5%分位。因此这个时候的A股市场风险已经大于收益,往上的空间比较有限。

一季度全球股市反弹主要来自于全球央行转向,流动性改善,二季度美国股市创新高来自于美联储7月降息预期,那么展望三季度,我们认为全球权益市场将对流动性改善预期开始麻木,会更关注降息背后反映的全球经济衰退的现实。本人认为下一轮由美股引领的全球股市调整或在不远的将来会到来。因此,我们仍将心存谨慎,配置景气度底部改善和基本面比较稳健的公司。

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、监察稽核部和风险控制部、固定收益事业部、权益投资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4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

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低碳经济股票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,诺安低碳经济股票型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安低碳经济股票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,诺安低碳经济股票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低碳经济股票型证券投资基金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)

6.1 资产负债表

会计主体:诺安低碳经济股票型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	54,992,142.92	57,823,398.04
结算备付金	9,732,382.84	3,192,347.14
存出保证金	563,402.90	368,347.27
交易性金融资产	774,542,412.29	869,350,818.85
其中:股票投资	774,542,412.29	869,350,818.85
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	100,000,000.00	150,000,000.00
应收证券清算款	14,176,606.35	-
应收利息	17,316.21	160,669.70
应收股利	-	-
应收申购款	279,983.11	185,403.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	954,304,246.62	1,081,080,984.12
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,983,798.71	-
应付赎回款	2,008,411.18	614,933.11
应付管理人报酬	1,135,346.89	1,376,261.97
应付托管费	189,224.47	229,376.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,146,641.27	743,459.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	197,970.42	171,008.51
负债合计	10,661,392.94	3,135,040.39
所有者权益:		
实收基金	810,906,788.81	1,119,576,184.96
未分配利润	132,736,064.87	-41,630,241.23
所有者权益合计	943,642,853.68	1,077,945,943.73
负债和所有者权益总计	954,304,246.62	1,081,080,984.12

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.164元,基金份额总额810,906,788.81份。

6.2 利润表

会计主体:诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一,收入	233,149,520.53	-15,153,795.38
1.利息收入	1,971,946.93	1,643,343.13
其中:存款利息收入	434,966.62	518,221.28
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	1,536,980.31	1,125,121.85
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	173,029,315.19	143,558,823.96
其中:股票投资收益	162,088,001.65	128,714,100.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	10,941,313.54	14,844,723.86
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	57,675,754.80	-161,719,130.51
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	472,503.61	1,363,168.04
减:二,费用	16,199,099.78	16,343,149.34
1. 管理人报酬	7,729,935.12	10,160,546.43
2. 托管费	1,288,322.49	1,693,424.44
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,084,413.17	4,349,999.21
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	96,429.00	139,179.26
三,利润总额(亏损总额以"-"号填列)	216,950,420.75	-31,496,944.72
减:所得税费用	-	-
四,净利润(净亏损以"-"号填列)	216,950,420.75	-31,496,944.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一,期初所有者权益(基金净值)	1,119,576,184.96	-41,630,241.23	1,077,945,943.73
二,本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	216,950,420.75	216,950,420.75
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)	-308,669,396.15	-42,584,114.65	-351,253,510.80
其中:1.基金申购款	78,500,061.88	8,460,317.47	86,960,379.35
2.基金赎回款	-387,169,458.03	-51,044,432.12	-438,213,890.15
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)	810,906,788.81	132,736,064.87	943,642,853.68
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(基金净值)	1,513,794,598.28	174,448,090.07	1,688,242,688.35
二,本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-31,496,944.72	-31,496,944.72
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)	-342,478,681.94	-53,326,459.71	-395,805,141.65
其中:1.基金申购款	407,187,641.81	58,370,294.16	465,557,935.97
2.基金赎回款	-749,666,323.75	-111,696,753.87	-861,363,077.62
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)	1,171,315,916.34	89,624,685.64	1,260,940,601.98

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

诺安低碳经济股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予诺安低碳经济股票型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]475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《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年5月12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3,785,949,626.11份基金份额,其中认购资金利息折合1,083,452.93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、《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》和《诺安低碳经济股票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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、权证、股指期货等权益类投资工具,国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券(含分离交易可转债)、央票、中期票据、资产支持证券等固定收益类品种,短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具,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。

本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产净值的比例不低于基金资产的80%,其中投资于低碳经济主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%;权证占基金资产净值的比例不超过3%;扣除股指期货合约缴纳的保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于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。

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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本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《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 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

本基金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
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
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

6.4.8 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不存在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 2019年1月1日至2019年6月30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	7,729,935.12	10,160,546.43
其中:支付销售机构的客户维护费	3,186,440.83	4,129,878.56

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×1.5%÷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、休息日等,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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	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托管费	1,288,322.49	1,693,424.44

注:本基金的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提,托管费的计算方法如下:

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、休息日等,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。

6.4.8.3 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