诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	诺安益鑫混合
基金主代码	002292
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月30日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,827,707.86份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由诺安益鑫保本混合型证券投资基金首个保本周期到期后转型而来，并自2018年1月30日起转型正式生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过积极配置大类资产，动态控制组合风险，并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。 1、大类资产配置 本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。 2、股票投资分析 本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。 3、固定收益资产投资策略 本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。 4、可转换债券投资策略 本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。 5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。 6、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 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沪深300指数与中证全债指数的混合指数，即：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%
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，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益的品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	贺倩
	联系电话	0755-83026688	010-66060069
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95599
传真		0755-83026677	010-68121816

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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	17,221,147.00
本期利润	23,605,432.22
加权平均基金份额本期利润	0.1513
本期基金份额净值增长率	13.04%
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	0.0839
期末基金资产净值	120,905,638.92
期末基金份额净值	1.1009

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。

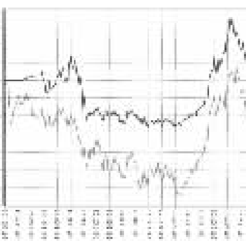
3.2 基金净值表现

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	1.33%	0.60%	3.47%	0.69%	-2.14%	-0.09%
过去三个月	0.61%	0.82%	-0.30%	0.91%	0.91%	-0.09%
过去六个月	13.04%	0.75%	16.82%	0.92%	-3.78%	-0.17%
过去一年	8.76%	0.60%	8.72%	0.91%	0.04%	-0.31%
自基金合同生效起至今	6.06%	0.63%	-2.00%	0.86%	8.06%	-0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×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。

§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

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		
吴博俊	本基金基金经理	2019年1月22日	-	11	硕士，2008年加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014年6月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年6月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
罗春蕾	本基金基金经理	2019年2月20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。
曲泉儒	本基金基金经理	2019年4月19日	-	7	硕士，具有基金从业资格，曾任远策投资管理有限公司研究员、长盛基金管理有限公司投资经理。2016年加入诺安基金管理有限公司，任投资经理。2019年4月起任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
盛震山	-	2018年1月30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月任诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年6月至2019年1月任诺安策略精选股票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此处盛震山的任职日期为基金合同生效之日，盛震山的离任日期、吴博俊、罗春蕾及曲泉儒的任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《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，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《诺安益鑫灵活配置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

回顾2019年上半年市场，主要经历了一季度的“流动性驱动”和“基本面期待”两个阶段。市场从去年的极度悲观依靠估值的快速拉升回归正常。坚信市场会从估值活转 向业绩强，虽然损失了一部分估值提升对组合净值的拉动，但获得了距离盈利预期改善更近的机会，但前提是要保障持仓盈利改善的确定性。

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1.1009元；本报告期基金份额净值增长率为13.04%，同期业绩比较基准收益率为16.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场估值体系在流动性和贸易关系的边际变化中反复。乱花渐欲迷人眼。对于期冀给投资人创造持续稳健回报的管理人来讲，我们更关注宏观上经济预期改善的可能性、中观上行业产业趋 势的变化性以及微观上企业盈利的确定性。 宏观上，从中周期来看，目前经济处于中周期的下行尾声，预计下半年会企稳并小幅回升。 从长周期来看，经济仍处于新旧动能转换的阶段，结构比增速更重要，高质量发展路径长期不变。 中观上，我们关注部分好行业、好公司业绩和估值的预期加速，同时更关注受宏观经济影响当期 行业景气度不佳但基本面的均值回归。微观上，深入研究并配置三类公司，一是业绩持续稳健增长、成长空间大、行业格局日渐清晰、存在一定认知差、估值合理的公司；二是技术储备深厚、产业地位重要、能算出一定市值安全边际和市值想象空间的公司，可接受当期估值容忍度；三是当期业绩较差、但只是受行业周期影响未来有业绩改善空间的公司。如前所述，部分行业当期盈 利和当期盈利预期不好，未来市场有系统性向上机会一个可靠的路径应该是部分行业走出盈利底 部、看到盈利改善预期，所以对这些行业和龙头公司进行提前储备。

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

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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金管理人—诺安基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，诺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：诺安益鑫灵活配置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	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	51,770,484.10	73,601,166.76
结算备付金	28,166.68	1,746,390.98
存出保证金	79,512.60	130,549.49
交易性金融资产	69,766,498.74	51,571,523.22
其中：股票投资	69,766,498.74	51,571,523.22
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	-	84,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,831.57	97,242.70
应收股利	-	-
应收申购款	875.71	198.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	121,655,369.40	211,147,071.52
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	-	-
应付赎回款	345,700.98	903,974.55
应付管理人报酬	151,867.25	270,725.89
应付托管费	25,311.23	45,120.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	42,587.44	111,344.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	184,263.58	170,453.00
负债合计	749,730.48	1,501,619.22
所有者权益：		
实收基金	109,827,707.86	215,271,412.84
未分配利润	11,077,931.06	-5,625,960.54
所有者权益合计	120,905,638.92	209,645,452.30
负债和所有者权益总计	121,655,369.40	211,147,071.52

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.1009元，基金份额总额109,827,707.86份。

6.2 利润表

会计主体：诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金

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30日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	25,604,442.97	-216,363.93
1.利息收入	751,528.95	2,465,814.48
其中：存款利息收入	230,294.06	596,873.33
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	521,234.89	1,868,941.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	18,410,881.00	1,468,457.73
其中：股票投资收益	17,597,016.25	67,038.59
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	813,864.75	1,401,419.14
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,384,285.22	-8,941,336.13
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	57,747.80	4,790,699.99
减：二、费用	1,999,010.75	3,560,540.79
1. 管理人报酬	1,219,739.69	2,394,782.49
2. 托管费	203,289.98	399,130.48
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	467,034.62	626,147.16
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	108,946.46	140,480.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	23,605,432.22	-3,776,904.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	23,605,432.22	-3,776,904.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金

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)	215,271,412.84	-5,625,960.54	209,645,452.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,605,432.22	23,605,432.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-105,443,704.98	-6,901,540.62	-112,345,245.60
其中：1.基金申购款	2,376,258.91	182,314.20	2,558,573.11
2.基金赎回款	-107,819,963.89	-7,083,854.82	-114,903,818.71
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)	109,827,707.86	11,077,931.06	120,905,638.92
项目	上年度可比期间 2018年1月30日(基金合同生效日)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)	306,537,841.69	11,592,672.71	318,130,514.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,776,904.72	-3,776,904.72
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)	-56,072,431.71	-4,755,489.15	-60,827,920.86
其中：1.基金申购款	776,707,859.64	30,323,010.95	807,030,870.59
2.基金赎回款	-832,780,291.35	-35,078,500.10	-867,858,791.45
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)	250,465,409.98	3,060,278.84	253,525,688.82

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

诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由诺安益鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。2018年1月22日，诺安益鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《诺安益鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，该基金第一个保本周期到期并完成过渡后，正式转型为诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金。诺安益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2018年1月22日至2018年1月29日。自2018年1月30日诺安益鑫保本混合型证券投资基金正式转型为诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金。原诺安益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”)《关于准予诺安益鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可 [2015] 2924号) 核准，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《诺安益鑫保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年1月22日生效。原诺安益鑫保本混合型证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为4,054,621,650.70份基金份额，其中认购资金利息折合807,704.37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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安益鑫灵活配置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)、债券 (包含国债、金融债、公司债/企业债、次级债、可转换债券 (含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金为混合型基金，股票资产占基金资产的比例为0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。

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
中国农业银行股份有限公司	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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,219,739.69	2,394,782.49
其中：支付销售机构的客户维护费	620,376.66	1,400,729.80

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

H＝E×1.2%÷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首日起3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，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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	203,289.98	399,130.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷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。由基金托管人复核后于次月前3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，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

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月30日(基金合同生效日)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
中国农业银行股份有限公司	51,770,484.10	199,488.78	93,775,977.08	538,402.43

注：本基金的银行存款由基金托管人农业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(2019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有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注：截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券及权证。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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中属于第一层次的余额为69,709,522.20元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为56,976.54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。(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51,571,523.22元， 无属于第二层次及第三层次的余额。)

(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(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

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	69,766,498.74	57.35
	其中：股票	69,766,498.74	57.35
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	-	-
	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	51,798,650.78	42.58
8	其他各项资产	90,219.88	0.07
9	合计	121,655,369.40	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	69,888.85	0.06
C	制造业	37,602,182.32	31.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,796,830.08	22.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,574,465.21	3.78
J	金融业	163,787.94	0.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,165.74	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	526,178.60	0.44
S	综合	-	-
	合计	69,766,498.74	57.70

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002422	科伦药业	400,372	11,903,059.56	9.84
2	601021	春秋航空	262,621	11,817,945.00	9.77
3	002120	韵达股份	367,835	11,336,674.70	9.38
4	600104	上汽集团	321,900	8,208,450.00	6.79
5	002601	龙蟒佰利	425,703	6,313,175.49	5.22
6	300271	华宇软件	225,844	4,291,036.00	3.55
7	300395	菲利华	143,200	2,533,208.00	2.10
8	601872	招商轮船	564,800	2,462,528.00	2.04
9	601098	中南传媒	39,800	503,072.00	0.42
10	002014	永新股份	55,950	455,992.50	0.38

注： 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.lionfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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	601021	春秋航空	19,238,095.40	9.18
2	002422	科伦药业	11,659,444.00	5.56
3	300271	华宇软件	11,176,425.31	5.33
4	600873	梅花生物	10,207,214.30	4.87
5	002120	韵达股份	9,990,595.50	4.77
6	600104	上汽集团	8,144,296.00	3.88
7	002024	苏宁易购	8,111,053.00	3.87
8	002601	龙蟒佰利	6,850,860.21	3.27
9	600066	宇通客车	6,098,650.98	2.91
10	601318	中国平安	6,091,692.00	2.91
11	600978	宜华生活	6,082,414.00	2.90
12	600340	华夏幸福	4,184,541.00	2.00
13	002920	德赛西威	3,028,541.00	1.44
14	300395	菲利华	2,492,232.00	1.19
15	601872	招商轮船	2,472,307.00	1.18
16	600332	白云山	2,298,066.00	1.10
17	300418	昆仑万维	2,069,237.00	0.99
18	600258	首旅酒店	1,999,084.00	0.95
19	002555	三七互娱	1,998,934.00	0.95
20	000333	美的集团	1,684,503.99	0.80

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	300498	温氏股份	17,131,941.22	8.17
2	601021	春秋航空	13,761,779.86	6.56
3	002299	圣农发展	10,552,337.55	5.03
4	300271	华宇软件	10,525,121.51	5.02
5	600873	梅花生物	10,287,024.44	4.91
6	600340	华夏幸福	9,276,761.00	4.42
7	002024	苏宁易购	9,206,353.00	4.39
8	600978	宜华生活	7,734,528.30	3.69
9	000002	万 科A	7,510,583.00	3.58
10	601318	中国平安	7,280,064.00	3.47
11	600900	长江电力	7,190,776.24	3.43
12	600066	宇通客车	6,432,610.00	3.07
13	002920	德赛西威	4,282,591.00	2.04
14	600332	白云山	3,307,901.00	1.58
15	000998	隆平高科	3,130,138.94	1.49
16	002555	三七互娱	3,056,329.36	1.46
17	002422	科伦药业	2,727,403.92	1.30
18	300418	昆仑万维	2,357,859.00	1.12
19	600258	首旅酒店	1,930,282.20	0.92
20	000333	美的集团	1,709,945.40	0.82

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	150,771,171.47
卖出股票收入(成交)总额	156,557,497.42

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前十名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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除龙蟒佰利外，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。

2018年8月3日，绵竹市环保局对龙蟒钛业进行执法检查，发现龙蟒钛业存在夜间下雨时5千方渗滤液收集池外溢废水未经处理排放的情形。德阳市环境监测中心站出具的监测报告显示外溢废水中污染物指标超过了《污水综合排放标准》。上述行为违反了《中华人民共和国环境保护法》第四十二条第四款“严禁通过暗管、渗井、渗坑、灌注或者篡改、伪造监测数据，或者不正常运行防治污染设施等逃避监管的方式违法排放污染物”的规定。

截止本报告期末，龙蟒佰利(002601)为本基金前十大重仓股。目前龙蟒钛业生产经营正常，以上行政处罚不会对公司的生产、经营造成重大影响，上述处罚措施不会影响公司的长期竞争力。因此本基金继续持有龙蟒佰利。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	79,512.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,831.57
5	应收申购款	875.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,219.88

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,214	49,606.01	-	-	109,827,707.86	100.00%

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	276,909.06	0.2521%

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

单位：份

基金合同生效日(2018年1月30日)基金份额总额	270,859,540.27
本报告期期初基金份额总额	215,271,412.84
本报告期基金总申购份额	2,376,258.91
减：本报告期基金总赎回份额	107,819,963.89
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	109,827,707.86

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

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。此外，本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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	
渤海证券	2	304,836,755.95	100.00%	283,896.00	100.00%	-

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
渤海证券	-	-	3,688,000,000.00	100.00%	-	-

§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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未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。							

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。

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查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019年8月23日