

诺安低碳经济股票型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 29 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 2016 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37

§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	38
§9 开放式基金份额变动	39
§10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
§11 备查文件目录	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安低碳经济股票型证券投资基金
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	2,526,081,064.43 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	<p>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，积极进行短期资产灵活配置，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。</p> <p>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。</p> <p>2、低碳经济主题配置策略</p> <p>a) 低碳经济主题及其相关行业和公司的界定</p> <p>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，着重在七个方面实现。低碳经济主题相关行业和公司来自于这七个方面：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、服务等与能源产业链相关的行业或公司，交通低碳化如新能源汽车等行业或公司，建筑低碳化如生产使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积极参与碳排放交易与治理的工业行业或公司，服务低碳化如提倡智能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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>b) 行业配置策略</p> <p>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：</p> <p>（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，积极配置收益于政策变化的行业。</p> <p>（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趋势良好的上市公司。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>5、权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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、预估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，以降低流动性风险。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为中证内地低碳经济主题指数与中证全债指数的混合指数，即：$80\% \times \text{中证内地低碳经济主题指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$。</p>
风险收益特征	<p>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。</p>

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	陈勇	洪渊
	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	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-275,445,024.50
本期利润	-286,200,850.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1105
本期加权平均净值利润率	-15.53%
本期基金份额净值增长率	-12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-794,782,521.26
期末可供分配基金份额利润	-0.3146
期末基金资产净值	1,908,524,090.80
期末基金份额净值	0.756

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.40%

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。

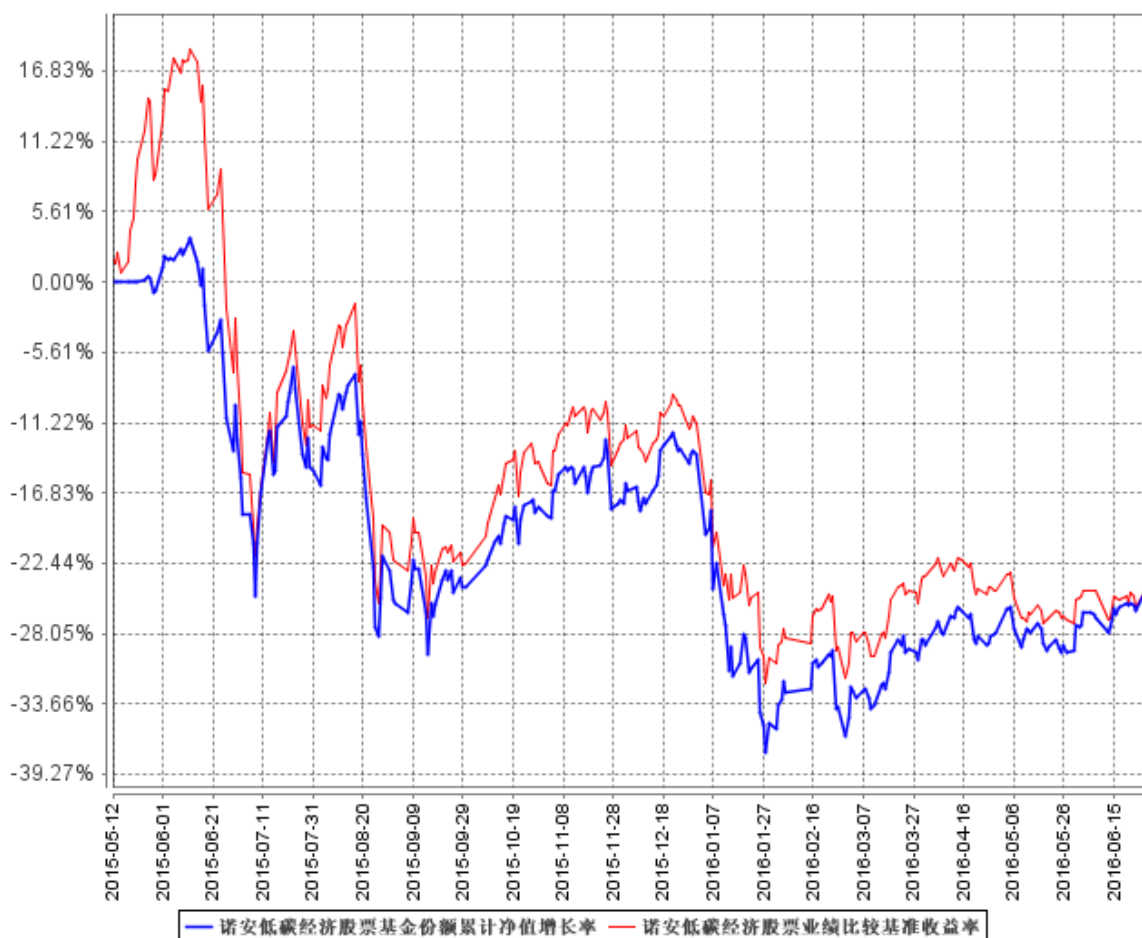
3.2 基金净值表现

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	4.13%	0.81%	1.46%	1.02%	2.67%	-0.21%
过去三个月	5.88%	1.06%	-1.17%	1.03%	7.05%	0.03%
过去六个月	-12.30%	2.03%	-14.74%	1.81%	2.44%	0.22%
过去一年	-16.19%	2.21%	-22.10%	2.15%	5.91%	0.06%
自基金合同生效起至今	-24.40%	2.16%	-24.32%	2.23%	-0.08%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证内地低碳经济主题指数收益率 $+20\% \times$ 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 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、诺安保本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、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、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、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本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、诺安和鑫保本混合型证券投资基金。

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		
盛震山	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理	2015 年 9 月 26 日	-	6	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 月起任诺安低碳经济股票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合规守信情况的说明

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

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

2016 年上半年，市场先是于开年之际经历了一轮向下迅速探底的过程，进入第二季度后有所回暖，但更多呈现震荡走势和结构性行情。在此期间，组合保持了相对较低仓位。投资策略方面，坚持采用自上而下配置行业、自下而上选择个股的策略，不断优化组合的持仓结构。首先，行业配置方面，在一季度末基础上，进一步向大消费领域倾斜，食品饮料、医药、家电和家居，均是组合重点配置的行业。与此同时，一些具备长期成长性的自下而上的品种得以保留，并且处于不断的补充、调整过程中。仓位方面，在股票型基金 80%最低仓位要求的基础上，组合始终保持了相对较低仓位，以有效应对系统性风险及控制回撤。

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 0.756 元。本报告期基金份额净值增长率为-12.30%，同期业绩比较基准收益率为-14.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，从全球来看，来自海外的不确定性有所降低。英国脱欧公投已经结束，在美国 GDP 增速放缓，以及全球经济面临更多挑战的情况下，对美联储年内加息的预期进一步回落。从金融角度，尽管全球市场经历了大幅波动，但暂时还看不到新一轮金融危机出现的迹象，且资金有从以美国为首的发达国家回流新兴市场的迹象。国内方面，最新的经济数据表明，结构调整仍然面临很大挑战。民间投资增速显著下滑，不仅由预期不佳和需求乏力导致，也是政府和国企主导的投资对民资挤出效应的结果，这种状况不利于长期的就业改善和内需提升。如果政府继续加大货币刺激，必然导致实体经济进一步加杠杆，淘汰过剩产能只能是南辕北辙，短期矛盾政策的代价是放大长期风险。综上，我们认为未来更多不确定性来自于政策主导的国内经济，在经济结构调整已步入关键阶段的 2016 年中后期，市场对政策导向的变化也会十分敏感，我们拭目以待。

当前，博弈的氛围依然很重，风险偏好持续上行很难出现，更多会体现为结构性机会。组合所采取的中长期投资策略目标，不能以博弈短期的政策放松作为投资策略的重心。未来，组合将继续坚持自上而下配置行业、自下而上选择个股，同时保持组合具备较高的持仓集中度。行业策略方面，将继续在消费升级、宏观调结构受益的行业中寻找龙头公司；个股方面，组合将继续重点布局有中长期投资价值的标的，在选股上坚持成长性和安全边际并重。

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

中国证券监督管理委员会颁布的《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、合规与风险控制部、固定收益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

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。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期末有收益分配事项。

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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	349,754,477.64	346,516,205.45
结算备付金		5,651,089.56	15,451,098.75
存出保证金		1,431,207.10	2,516,944.74
交易性金融资产	6.4.7.2	1,588,473,532.94	1,887,945,349.47
其中：股票投资		1,588,473,532.94	1,887,945,349.47
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	-	-
应收证券清算款		12,458,504.31	93,450,520.83
应收利息	6.4.7.5	70,501.97	82,833.46
应收股利		-	-
应收申购款		20,624.21	53,184.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,957,859,937.73	2,346,016,136.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			

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		40,630,779.13	56,924,744.26
应付赎回款		2,717,055.85	3,269,606.52
应付管理人报酬		2,302,702.87	2,888,522.00
应付托管费		383,783.81	481,420.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,157,733.22	7,174,300.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	143,792.05	107,115.84
负债合计		49,335,846.93	70,845,709.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,526,081,064.43	2,638,021,727.96
未分配利润	6.4.7.10	-617,556,973.63	-362,851,300.67
所有者权益合计		1,908,524,090.80	2,275,170,427.29
负债和所有者权益总计		1,957,859,937.73	2,346,016,136.96

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.756 元，基金份额总额 2,526,081,064.43 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 12 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-257,122,564.15	-348,113,505.30
1.利息收入		1,246,223.39	2,526,050.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,246,223.39	2,526,050.78
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-247,761,608.95	-26,341,691.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-266,453,818.47	-32,991,561.22
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	18,692,209.52	6,649,869.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,755,825.74	-325,278,332.72
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	148,647.15	980,468.44
减：二、费用		29,078,286.09	12,514,439.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,758,448.62	7,495,213.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,293,074.70	1,249,202.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	12,887,696.77	3,742,077.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	139,066.00	27,946.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-286,200,850.24	-360,627,945.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-286,200,850.24	-360,627,945.02

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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	2,638,021,727.96	-362,851,300.67	2,275,170,427.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-286,200,850.24	-286,200,850.24
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）	-111,940,663.53	31,495,177.28	-80,445,486.25
其中：1.基金申购款	33,046,042.02	-9,249,658.66	23,796,383.36
2.基金赎回款	-144,986,705.55	40,744,835.94	-104,241,869.61

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）	2,526,081,064.43	-617,556,973.63	1,908,524,090.80
项目	上年度可比期间 2015年5月12日(基金合同生效日)至2015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）	3,785,949,626.11	-	3,785,949,626.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-360,627,945.02	-360,627,945.02
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）	-261,578,029.15	16,697,677.66	-244,880,351.49
其中：1.基金申购款	16,460,152.84	-640,401.01	15,819,751.83
2.基金赎回款	-278,038,181.99	17,338,078.67	-260,700,103.32
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）	3,524,371,596.96	-343,930,267.36	3,180,441,329.60

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(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2015]475号文《关于准予诺安低碳经济股票型证券投资基金注册的批复》核准,于2015年4月23日至2015年5月7日向社会进行公开募集,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资,募集的有效认购金额为人民币3,785,949,626.11元,其中净认购额为人民币3,784,866,173.18元,折合3,784,866,173.18份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币

1,083,452.93 元,折合 1,083,452.93 份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为 2015 年 5 月 12 日,合同生效日基金份额为 3,785,949,626.11 份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》、《诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 25 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

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“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编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

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 号文《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[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》、财税[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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 号文《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

(2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

(7) 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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	349,754,477.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	349,754,477.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,561,942,822.70	1,588,473,532.94	26,530,710.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,561,942,822.70	1,588,473,532.94	26,530,710.24

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**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	67,633.67
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	2,288.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	579.60
合计	70,501.97

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,157,733.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,157,733.22

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,113.73
预提费用	138,678.32
合计	143,792.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,638,021,727.96	2,638,021,727.96
本期申购	33,046,042.02	33,046,042.02
本期赎回(以“-”号填列)	-144,986,705.55	-144,986,705.55
本期末	2,526,081,064.43	2,526,081,064.43

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

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	-554,390,718.20	191,539,417.53	-362,851,300.67
本期利润	-275,445,024.50	-10,755,825.74	-286,200,850.24
本期基金份额交易产生的变动数	35,053,221.44	-3,558,044.16	31,495,177.28
其中：基金申购款	-9,173,743.74	-75,914.92	-9,249,658.66
基金赎回款	44,226,965.18	-3,482,129.24	40,744,835.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-794,782,521.26	177,225,547.63	-617,556,973.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	1,171,064.61
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	60,907.45
其他	14,251.33
合计	1,246,223.39

注：本报告期内“其他”为申购款利息收入及保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,248,784,204.62
减：卖出股票成本总额	4,515,238,023.09
买卖股票差价收入	-266,453,818.47

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	18,692,209.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,692,209.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,755,825.74
——股票投资	-10,755,825.74
——债券投资	-
——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	-
合计	-10,755,825.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	126,327.94
基金转换费收入	22,319.21
合计	148,647.15

注：本报告期内“其他”为募集期撤单利息。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	12,887,696.77
银行间市场交易费用	-
合计	12,887,696.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	98,896.76
汇划费	387.68

合计	139,066.00
----	------------

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。

6.4.9.2 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
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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期内不存在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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年5月12日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,758,448.62	7,495,213.74

其中：支付销售机构的客户维护费	7,162,124.48	3,986,384.16
-----------------	--------------	--------------

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月12日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,293,074.70	1,249,202.28

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

本基金本报告期内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。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月12日(基金合同生效日)至2015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	349,754,477.64	1,171,064.61	1,147,715,375.74	2,508,988.10

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

本基金本报告期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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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2016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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项	9.97	2016年7月11日	10.97	1,000,912	10,014,153.28	9,979,092.64	-

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 2016 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险, 并设定适当的投资限额, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成: 第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导; 第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、合规与风险控制部所监控; 第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 并且通过分散化投资以降低信用风险。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, 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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 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。本基金所持有金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的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一定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、债券投资及买入返售金融资产等。

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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

单位：人民币元

本期末 2016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	349,754,477.64	-	-	-	-	349,754,477.64
结算备付金	5,651,089.56	-	-	-	-	5,651,089.56

存出保证金	1,431,207.10	-	-	-	-	1,431,207.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-1,588,473,532.94	1,588,473,532.94
应收证券清算款	12,458,504.31	-	-	-	-	12,458,504.31
应收利息	-	-	-	-	70,501.97	70,501.97
应收申购款	-	-	-	-	20,624.21	20,624.21
资产总计	369,295,278.61	-	-	-	-1,588,564,659.12	1,957,859,937.73
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	40,630,779.13	40,630,779.13
应付赎回款	-	-	-	-	2,717,055.85	2,717,055.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,302,702.87	2,302,702.87
应付托管费	-	-	-	-	383,783.81	383,783.81
应付交易费用	-	-	-	-	3,157,733.22	3,157,733.22
其他负债	-	-	-	-	143,792.05	143,792.05
负债总计	-	-	-	-	49,335,846.93	49,335,846.93
利率敏感度缺口	369,295,278.61	-	-	-	-1,539,228,812.19	1,908,524,090.80
上年度末 2015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	346,516,205.45	-	-	-	-	346,516,205.45
结算备付金	15,451,098.75	-	-	-	-	15,451,098.75
存出保证金	2,516,944.74	-	-	-	-	2,516,944.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-1,887,945,349.47	1,887,945,349.47
应收证券清算款	-	-	-	-	93,450,520.83	93,450,520.83
应收利息	-	-	-	-	82,833.46	82,833.46
应收申购款	-	-	-	-	53,184.26	53,184.26
资产总计	364,484,248.94	-	-	-	-1,981,531,888.02	2,346,016,136.96
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	56,924,744.26	56,924,744.26
应付赎回款	-	-	-	-	3,269,606.52	3,269,606.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,888,522.00	2,888,522.00
应付托管费	-	-	-	-	481,420.31	481,420.31
应付交易费用	-	-	-	-	7,174,300.74	7,174,300.74
其他负债	-	-	-	-	107,115.84	107,115.84
负债总计	-	-	-	-	70,845,709.67	70,845,709.67
利率敏感度缺口	364,484,248.94	-	-	-	-1,910,686,178.35	2,275,170,427.29

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。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。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资，本基金有效降低了投资组合的其他价格风险，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。

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%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,588,473,532.94	83.23	1,887,945,349.47	82.98
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	1,588,473,532.94	83.23	1,887,945,349.47	82.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化
----	------------

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	83,981,101.81	106,980,672.53
2. 业绩比较基准下降 5%	-83,981,101.81	-106,980,672.53	

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。

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. 置信度：95%		
	2. 观察期：一年		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	基金投资组合的风险价值	39,265,455.18	81,435,679.93
	合计	39,265,455.18	81,435,679.93

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. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

② 各层级金融工具公允价值

于 2016 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级的余额为 1,578,494,440.30 元，无属于第二层级的余额为 9,979,092.64 元，无属于第三层级的余额（2015

年 12 月 31 日，第一层级的余额为 281,991,055.48 元，第二层级的余额为 1,327,655,939.07 元，无属于第三层级的余额。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和交易所上市的可转换债券的公允价值列入第一层级，相关固定收益品种(除交易所上市可转换债券外)的公允价值层次列入第二层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,588,473,532.94	81.13
	其中：股票	1,588,473,532.94	81.13
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	355,405,567.20	18.15
7	其他各项资产	13,980,837.59	0.71
8	合计	1,957,859,937.73	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	29,823,192.64	1.56
C	制造业	899,948,163.00	47.15

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,506,786.56	4.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	255,682,161.51	13.40
G	交通运输、仓储和邮政业	9,588,000.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,090,578.72	7.13
J	金融业	90,079,442.63	4.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	90,755,207.88	4.76
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,588,473,532.94	83.23

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

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	600337	美克家居	12,161,100	158,215,911.00	8.29
2	600887	伊利股份	9,246,961	154,146,839.87	8.08
3	002508	老板电器	4,149,601	152,580,828.77	7.99
4	600050	XD 中国联	35,719,312	136,090,578.72	7.13
5	002294	信立泰	4,592,759	124,923,044.80	6.55
6	600566	济川药业	3,887,762	100,070,993.88	5.24
7	601328	交通银行	15,999,901	90,079,442.63	4.72
8	601888	中国国旅	1,800,000	79,164,000.00	4.15
9	002084	海鸥卫浴	6,873,196	74,367,980.72	3.90
10	600998	九州通	4,062,243	71,129,874.93	3.73
11	002078	太阳纸业	14,262,326	69,600,150.88	3.65
12	000910	大亚科技	4,444,793	68,672,051.85	3.60
13	600305	恒顺醋业	5,200,000	59,904,000.00	3.14

14	600900	长江电力	4,499,900	56,203,751.00	2.94
15	002570	贝因美	3,000,000	38,370,000.00	2.01
16	600323	瀚蓝环境	1,599,924	20,303,035.56	1.06
17	600547	山东黄金	510,000	19,844,100.00	1.04
18	600201	生物股份	674,901	18,445,044.33	0.97
19	600993	马应龙	799,826	16,660,375.58	0.87
20	600519	贵州茅台	50,000	14,596,000.00	0.76
21	600138	中青旅	599,959	11,591,207.88	0.61
22	002038	双鹭药业	351,483	10,607,756.94	0.56
23	600497	驰宏锌锗	1,000,912	9,979,092.64	0.52
24	601021	春秋航空	200,000	9,588,000.00	0.50
25	601607	上海医药	500,000	9,025,000.00	0.47
26	300146	汤臣倍健	399,924	5,414,970.96	0.28
27	300296	利亚德	100,000	3,166,000.00	0.17
28	000581	威孚高科	100,000	2,016,000.00	0.11
29	002390	信邦制药	100,000	924,000.00	0.05
30	600498	烽火通信	30,000	728,400.00	0.04
31	000028	国药一致	10,000	651,000.00	0.03
32	002572	索菲亚	10,000	560,200.00	0.03
33	603866	桃李面包	10,000	447,600.00	0.02
34	300267	尔康制药	20,000	286,400.00	0.02
35	002317	众生药业	10,000	119,900.00	0.01

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	600519	贵州茅台	223,456,974.67	9.82
2	600887	伊利股份	190,774,179.52	8.39
3	600030	中信证券	159,745,521.10	7.02
4	600485	信威集团	157,051,987.70	6.90
5	600337	美克家居	155,707,369.54	6.84
6	600050	中国联通	152,271,020.53	6.69
7	600547	山东黄金	147,074,477.09	6.46
8	002508	老板电器	143,994,324.75	6.33
9	002084	海鸥卫浴	115,975,678.68	5.10
10	600497	驰宏锌锗	100,049,688.97	4.40

11	600566	济川药业	94,727,264.90	4.16
12	002572	索菲亚	88,893,108.17	3.91
13	601328	交通银行	86,100,639.33	3.78
14	000423	东阿阿胶	85,186,747.94	3.74
15	002294	信立泰	84,579,063.36	3.72
16	300033	同花顺	84,104,861.00	3.70
17	000910	大亚科技	79,010,135.72	3.47
18	002078	太阳纸业	73,051,383.70	3.21
19	600029	南方航空	72,348,746.69	3.18
20	000060	中金岭南	70,864,149.93	3.11
21	601607	上海医药	70,510,410.40	3.10
22	600998	九州通	69,567,885.91	3.06
23	600585	海螺水泥	66,281,627.87	2.91
24	300498	温氏股份	59,601,289.53	2.62
25	600305	恒顺醋业	57,858,912.46	2.54
26	600028	中国石化	57,623,241.18	2.53
27	600900	长江电力	56,270,757.38	2.47
28	300070	碧水源	53,484,822.03	2.35
29	300383	光环新网	52,836,183.00	2.32
30	300207	欣旺达	52,569,236.23	2.31
31	600993	马应龙	52,458,596.01	2.31
32	002032	苏泊尔	51,209,223.06	2.25
33	601555	东吴证券	48,359,544.32	2.13
34	002405	四维图新	47,972,637.68	2.11

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	300296	利亚德	237,622,358.05	10.44
2	600519	贵州茅台	226,188,745.81	9.94
3	601021	春秋航空	174,375,852.90	7.66
4	600030	中信证券	160,965,861.82	7.07
5	002304	洋河股份	150,852,661.55	6.63
6	600547	山东黄金	140,723,534.31	6.19
7	600485	信威集团	124,640,901.72	5.48

8	002200	云投生态	118,049,718.72	5.19
9	300059	东方财富	111,358,059.94	4.89
10	600497	驰宏锌锗	97,789,200.17	4.30
11	002572	索菲亚	97,762,136.12	4.30
12	002004	华邦健康	87,126,555.28	3.83
13	000423	东阿阿胶	85,266,773.14	3.75
14	300033	同花顺	80,017,359.57	3.52
15	000060	中金岭南	74,271,639.96	3.26
16	600674	川投能源	73,280,628.31	3.22
17	600585	海螺水泥	66,612,775.36	2.93
18	601607	上海医药	62,471,402.86	2.75
19	600029	南方航空	62,117,638.13	2.73
20	300498	温氏股份	60,348,099.62	2.65
21	002084	海鸥卫浴	59,910,120.44	2.63
22	600028	中国石化	59,206,437.00	2.60
23	002714	牧原股份	58,376,328.28	2.57
24	600887	伊利股份	55,789,175.24	2.45
25	300207	欣旺达	54,345,148.58	2.39
26	002032	苏泊尔	52,388,332.26	2.30
27	300070	碧水源	52,214,039.89	2.29
28	002294	信立泰	51,931,448.32	2.28
29	002360	同德化工	51,210,490.89	2.25
30	300072	三聚环保	50,970,472.69	2.24
31	000028	国药一致	49,996,510.56	2.20
32	002712	思美传媒	49,514,427.25	2.18

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	4,226,522,032.30
卖出股票收入（成交）总额	4,248,784,204.62

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	1,431,207.10
2	应收证券清算款	12,458,504.31

3	应收股利	-
4	应收利息	70,501.97
5	应收申购款	20,624.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,980,837.59

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
33,736	74,877.91	7,084,242.89	0.28%	2,518,996,821.54	99.72%

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	711,776.56	0.0282%

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（2015年5月12日）基金份额总额	3,785,949,626.11
本报告期期初基金份额总额	2,638,021,727.96
本报告期基金总申购份额	33,046,042.02
减：本报告期基金总赎回份额	144,986,705.55
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	2,526,081,064.43

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

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

2016年6月，针对深圳证监局向公司出具的《关于对诺安基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，以及对相关人员的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
招商证券	1	4,002,378,456.79	47.22%	3,727,417.19	47.26%	-
国都证券	1	3,870,812,695.60	45.67%	3,604,886.55	45.71%	-
申万宏源	2	303,928,703.86	3.59%	283,053.08	3.59%	-
平安证券	1	298,186,380.67	3.52%	271,738.15	3.45%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期新增 4 家证券公司的 5 个交易单元：申万宏源证券股份有限公司（2 个交易单元）、平安证券股份有限公司（1 个交易单元）、华创证券有限公司（1 个交易单元）、海通证券股份有限公司（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无其他证券投资。

10.8 其他重大事件

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关于旗下部分基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金 2015 年最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 6 日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江金观诚网费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 6 日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票国药一致估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 8 日
7	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持有停牌股票光环新网估值调整的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 12 日
8	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 21 日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加渤海银行费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 1 月 22 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下基	《上海证券报》、	2016 年 2 月 4 日

	金所持停牌股票信威集团估值调整的公告	《中国证券报》	
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通定投、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》	2016 年 2 月 25 日
12	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2015 年年度报告	基金管理人网站	2016 年 3 月 30 日
13	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 3 月 30 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 4 月 1 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票四维图新估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 4 月 6 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行关于“财智组合”基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 4 月 7 日
17	诺安基金管理有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股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》	2016 年 4 月 12 日
18	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 4 月 20 日
19	诺安基金管理有限公司关于增加北京汇成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》	2016 年 4 月 28 日
20	诺安基金管理有限公司关于增加珠	《证券时报》、	2016 年 5 月 10 日

	海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开展定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	
21	诺安基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理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》	2016 年 5 月 10 日
22	诺安基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理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》	2016 年 5 月 10 日
23	诺安基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）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》	2016 年 5 月 24 日
24	诺安基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 5 月 27 日
25	诺安基金管理有限公司关于直销账户变更的公告	《中国证券报》	2016 年 6 月 14 日
26	诺安基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）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》	2016 年 6 月 15 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下部	《证券时报》、	2016 年 6 月 17 日

	分基金在上海陆金所资产管理有 限公司开通定投业务及开展优惠费率 活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	
28	诺安基金管理有限公司关于增加昆 仑银行股份有限公司为旗下部分基 金代销机构并开通定投、转换业务 的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 6 月 24 日
29	诺安低碳经济股票型证券投资基金 招募说明书（更新）2016 年第 1 期- 摘要	《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 6 月 25 日
30	诺安低碳经济股票型证券投资基金 招募说明书（更新）2016 年第 1 期- 正文	基金管理人网站	2016 年 6 月 25 日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下基 金参加交通银行网上银行、手机银 行基金申购费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2016 年 6 月 30 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 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安低碳经济股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安低碳经济股票型证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安低碳经济股票型证券投资基金 2016 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安低碳经济股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 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 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日