

诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30  
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  
报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人及董事承诺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责任。  
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7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2019年4月1日起每半年更新一次。  
本报告日期2019年4月1日起至9月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金简称	诺安永鑫一年定期开放债券
场内简称	
基金代码	900510
基金运作方式	契约型基金
基金合同生效日	2014-06-24
报告期末基金份额总额	85,014,422.85
投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下，力求资产持续稳健增值，为投资者提供较好的非货币资产管理工具。
投资策略	1、封闭期投资策略 在封闭期内，为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。 2、开放期投资策略 在开放期，本基金管理人采取各种有效管理措施，保障基金运作安全，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况，进行相应压力测试，制定开放期流动性风险管理预案，做好应对极端情况下巨额赎回的准备。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

主要财务指标

主要财务指标	报告期(2019-04-01至2019-06-30)	单位:人民币元
本期已实现收益	608,851.89	
本期利润	385,173.90	
加权平均基金份额本期利润	0.0045	
期末基金资产净值	89,078,967.66	
期末基金份额净值	1.048	

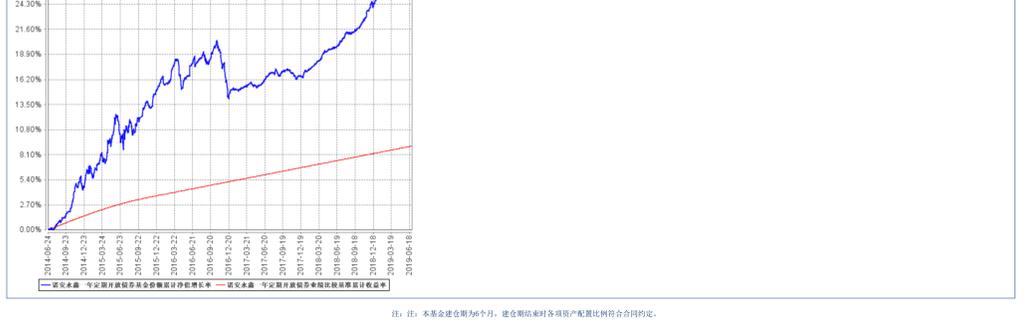
注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.48%	0.08%	0.38%	0.08%	0.10%	0.06%

注：注：本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）。

自基金合同生效以来基金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：注：本基金建仓期为6个月，建仓结束前各项资产配置比例符合合同约定。

其他指标

其他指标	报告期(2019-04-01至2019-06-30)	单位:人民币元
其他指标	报告期(2019-06-30)	

基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理任期		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张鸣翔	本基金基金经理	2017-08-30	-	8	硕士，曾先后任职于华融湘江银行股份有限公司、浙江浙商证券资产管理有限公司，任投资经理。2015年12月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理，从事债券投资工作。2016年2月至2017年4月任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金经理。2016年7月至2018年5月任诺安天天宝货币市场基金基金经理。2016年2月起担任诺安利源债券型证券投资基金基金经理。2016年7月起担任诺安双利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年9月起担任诺安先行灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月起担任诺安双利债券型证券投资基金基金经理。2017年1月起担任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年2月起担任诺安永鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018年11月起担任诺安永鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：①此表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行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，诺安永鑫收益一年定期开放债券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《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金合同》的规定，遵守了本公司内部控制制度，本基金投资管理未发生违法违规行。

公平交易专项说明

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、投资风格和股票来源的不同，建立不同投资组合的授权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，公司建立了一致的研究管理平台，所有对外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保留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，如果多个投资组合对同一证券下达了相同方向的交易指令，并且部分指令因流动性原因未能成交，交易系统会自动将待执行的证券交易单按照自动按比例分拆到各投资组合；对于场外交易，非公开发行证券申购等非公平交易指令分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立确定申购价格和数量，并申购指令下达交易和中心，公司在按照制度规定，按照价格优先原则进行分配，如果申购价格相同，则按照申购比例分配；对于银行间市场交易，通过固定平台、交易所大宗交易、交易所集中竞价交易等交易方式，由交易对手向银行间市场或交易所对手报价，成交确认，并依据“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。  
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。

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5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年2季度，公布的经济数据先强后弱，叠加月份中美摩擦再起，权益类资产价格冲高回落，债券类资产收益率先上后下。具体而言，十年期国债上行约20bp，十年期国债下行约20bp，两者间利差进一步收窄，配置型机构的持仓相对较稳；信用债方面，虽然违约不断，叠加信用债事件，但信用利差和期限利差基本维持。综合2季度业绩表现的优异于转债、股票。  
2季度组合规模稳定，管理人减持了利率债，替换了持仓中剩余期限较短和收益率较低的信用债，组合持仓结构以中高等信用等级债为主，组合维持了一定信用评级。

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1.048元；本报告期基金份额净值增长率为0.48%，同期业绩比较基准收益率为0.38%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未发生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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	117,994,507.20	94.92
	其中：债券	117,994,507.20	94.92
3	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	银行存拆放同业款项	3,948,111.17	3.18
8	其他资产	2,371,237.58	1.91
9	合计	124,313,855.96	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者必需品	-	-
C 消费品用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-

报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	56,013,600.00	62.88
5	企业短期融资券	51,176,200.00	57.43
6	中期票据	7,900,000.00	8.94
7	可转债(可交换债)	2,844,707.20	3.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,994,507.20	132.46

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011900006	19国债(国开23001)	80,000	8,041,600.00	9.03
2	011900005	19国债(中票27001)	80,000	8,035,200.00	9.02
3	222176	22中债债	80,000	8,020,800.00	9.00
4	011900073	19双创债(苏7001)	80,000	8,019,200.00	9.00
5	011908877	19皖能源(苏7001)	80,000	8,016,800.00	9.00

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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明

公允价值变动总额合计(元)  
股指期货投资本期收益(元)  
股指期货投资本期公允价值变动(元)

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)  
国债期货投资本期收益(元)  
国债期货投资本期公允价值变动(元)

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金本报告投资的前十名证券的发行主体，本报告期间没有出现在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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

其他资产构成

序号	名称	金额(元)	单位:人民币元
1	存出保证金	15.19	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,371,237.40	
5	应收申购款	-	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	2,371,237.59	

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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。

开放式基金份额变动

项目	数量	单位:份
报告期初基金份额总额	85,014,422.85	
报告期基金份额申购份额	-	
减:报告期基金份额赎回份额	-	
报告期基金份额拆入份额	-	
报告期基金份额拆出份额	-	
报告期末基金份额总额	85,014,422.85	

注：注：①申购份额含红利再投资、转换入份额、②赎回份额含转出份额。

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	基金份额	单位:份
报告期末基金管理人持有的基金份额	-	

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
合计					

注：本报告期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	-	-	-	-	
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金管理人基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

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	持有基金份额比例达到或超过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	3	2018.04.01-2019.06.28	24,237,408.00	-	24,237,408.00	28.51%
个人						-

注：注：①产品持有风险  
本报告期内，本基金单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，敬请投资者留意由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。

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。

备查文件目录

- ①中国证监会注册备案诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金合同》。
- ③《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格、营业执照。
- ⑤诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金2019年第二季度报告全文。
- ⑥报告期内诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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。  
投资者对本报告如有疑义，可致电本基金管理人全国统一客户服务热线：400-888-9998，亦可至基金管理人网站：www.noanfund.com.cn查阅详情。