诺安优化收益债券型证券投资基金2019年度报告

2019-12-31

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告日期：2020-01-20

重要提示

重要提示：

基金管理人的董事会、董事及其高级管理人员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法律责任。

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，但不保证投资一定盈利，也不保证投资收益不低于同期银行存款利息或任何投资回报。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、基金合同及其更新等相关法律文件，并充分考虑自己的投资目的、风险承受能力、投资期限和投资品种的流动性等因素后，基于自己的独立判断进行投资，并承担因投资于本基金而引致的一切风险。

本报告中财务指标或净值表现未经审计。

本报告中所载资料截止日为2019年12月31日。

本报告正文有中英文版本，在对本报告内容的理解发生异议时，以中文版本为准。

基金简介

基金简称	诺安优化收益债券	基金主代码	320001
交易代码	320001	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007-08-20	报告期末基金份额总额	215,205,929.43份
基金管理人名称	诺安基金管理有限公司		
基金托管人名称	华夏银行股份有限公司		
下属两类基金的基金简称	诺安优化收益债券A	诺安优化收益债券C	
下属两类基金的交易代码	320001	320002	
报告期末下属两类基金的份额总额	215,205,929.43份	0.00份	

主要财务指标、业绩和净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-06-30）
1.本期已实现收益	-692,342.44
2.本期利润	-12,420,729.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0600
4.期末基金资产净值	278,992,384.32
5.期末基金份额净值	1.2965

注：1)、2)、3)、表下述业绩指标等内容同样。

注：本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动损益后的余额。

基金净值表现

本期各类别基金份额净值收益率及为达到业绩比较基准所采取的措施

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
过去一个月	-1.81 %	0.85 %	-0.34 %	0.08 %	-1.47 %	0.77 %

注：2)、本报告涉及的相关比较期为一个自完整会计年度。

诺安优化收益债券累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率变动比较图

注：2)、2)本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项投资比例均符合合同约定。

注：根据《中国证券报》公告公告，从本基金管理人网站公告，本基金从2007年8月20日起成为基金业绩比较基准由原“中信标普300指数”更变为“中证综合债指数”。

管理人报告

管理人及其投资主管简介	姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限
基金经理	杨金金经理	基金经理	2013-12-20		13

注：1)、2)、2)表述基金经理的任职日期为公司内部决定的日期，基金合同生效日期前的，填写了基金合同生效日期；2)、2)表述基金经理的证券从业年限是指从事证券业务的年限。

管理人对报告期内本基金运作遵守有关法律法规情况的说明

报告期内，诺安优化收益债券基金管理人管理运作严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其配套法规的要求，遵守了《诺安优化收益债券基金管理合同》的有关规定，勤勉尽责地为基金持有人谋利益。本报告期管理人未发生违法违规行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内，我们按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司管理的全部投资组合均纳入公平交易的范围，按照内部控制流程执行交易授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资流程，在研究支持、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，公平地对待所有投资组合。

报告期内，公司一直以公司内部管理办法及时跟踪市场监管动向，及时调整内部控制制度，并对公平交易的流程、内容、记录等内容进行不定期检查，以确保公平交易制度及其执行情况的有效性。报告期内，公司内部控制制度及其执行情况未发生重大变化，公平交易制度能够有效执行。

报告期内，公司一直以来对投资组合实施公平交易，通过投资决策委员会下设的投资组合管理委员会对投资组合的投资管理进行监督。投资决策委员会对投资组合的投资管理进行监督，主要内容包括：投资组合的投资决策是否符合公司投资决策委员会的决议；投资组合的投资决策是否符合投资组合的投资目标和投资风格；投资组合的投资决策是否符合公司内部风控指标；投资组合的投资决策是否有利于投资组合的利益；投资组合的投资决策是否有利于防范投资风险；投资组合的投资决策是否有利于投资组合的投资绩效；投资组合的投资决策是否有利于公司整体利益；投资组合的投资决策是否有利于公司信誉；投资组合的投资决策是否有利于公司长期发展；投资组合的投资决策是否有利于公司长期投资者的利益；投资组合的投资决策是否有利于公司投资理念的贯彻；投资组合的投资决策是否有利于公司投资流程的执行；投资组合的投资决策是否有利于公司投资纪律的执行；投资组合的投资决策是否有利于公司投资风格的维持；投资组合的投资决策是否有利于公司投资文化的传播；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的培养；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的稳定；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的发挥；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的成长；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的奖惩；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理流动；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理使用；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理配置；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理分工；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理考核；投资组合的投资决策是否有利于公司投资人才的合理