

重要提示

基金管理人及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责任。
基金管理人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，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，也不保证最低收益。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2019年4月1日起至4月30日止。

基金基本情况

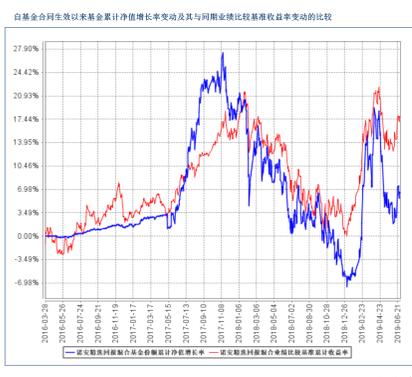
Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日期 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Fund Shares at Reporting End), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Period Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金份额净值 (Net Asset Value per Share).

基金净值表现

Table with 5 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Standard Deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Std Dev), ①-③ (Difference), ②-④ (Difference).



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-06-30).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (Resignation Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks). Lists the fund manager and their background.

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，诺安精选回报灵活配置混合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《诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金合同》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。

公平交易专项说明

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证券、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、业绩评估等环节。

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年二季度，受风险偏好继续升温、后续中美贸易摩擦反复以及经济数据转弱等因素影响，市场开始下行，有色金属涨幅较大的中小盘、科技板块调整幅度较大，资金进一步向价值白马集中。纵观二季度，中证100上涨1.58%，中小板下跌10.89%，创业板下跌10.17%，成长板块跑输大盘值。本基金对市场风格风险敞口进行风格切换，同时利用量化手段把握行情，获取结构性机会。

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0.924元；本报告期基金份额净值增长率为-5.13%，业绩比较基准收益率为-0.30%。

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，本基金存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定程序进行。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产比例 (%) (Percentage of Total Assets).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (克) (Quantity in Grams), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).