

诺安汇鑫保本混合型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015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:中国银行股份有限公司 送出日期:2015年8月25日

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 1 (重要提示), 2 (基金简介), 3 (主要会计数据和财务指标), 4 (基金管理人及基金经理情况), 5 (基金投资组合), 6 (基金份额变动), 7 (基金业绩比较基准), 8 (风险收益特征), 9 (基金管理人承诺), 10 (基金托管人承诺), 11 (基金经理承诺), 12 (基金经理承诺), 13 (基金管理人承诺), 14 (基金托管人承诺), 15 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 16 (基金业绩比较基准), 17 (风险收益特征), 18 (基金管理人承诺), 19 (基金托管人承诺), 20 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 21 (基金业绩比较基准), 22 (风险收益特征), 23 (基金管理人承诺), 24 (基金托管人承诺), 25 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 26 (基金业绩比较基准), 27 (风险收益特征), 28 (基金管理人承诺), 29 (基金托管人承诺), 30 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 31 (基金业绩比较基准), 32 (风险收益特征), 33 (基金管理人承诺), 34 (基金托管人承诺), 35 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 36 (基金业绩比较基准), 37 (风险收益特征), 38 (基金管理人承诺), 39 (基金托管人承诺), 40 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 41 (基金业绩比较基准), 42 (风险收益特征), 43 (基金管理人承诺), 44 (基金托管人承诺), 45 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 46 (基金业绩比较基准), 47 (风险收益特征), 48 (基金管理人承诺), 49 (基金托管人承诺), 50 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 51 (基金业绩比较基准), 52 (风险收益特征), 53 (基金管理人承诺), 54 (基金托管人承诺), 55 (基金经理承诺).

Table with 2 columns: Item and Content. Contains sections 56 (基金业绩比较基准), 57 (风险收益特征), 58 (基金管理人承诺), 59 (基金托管人承诺), 60 (基金经理承诺).

及管理人部分不在托管人复核范围内,投资组合报告等数据真实、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:诺安汇鑫保本混合型证券投资基金 报告截止日:2015年6月30日

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年6月30日 and 2014年12月31日.

基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2014年1月1日至2014年6月30日.

Table with 2 columns: Item and Content. Balance sheet for 2015年1月1日至2015年6月30日.

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

Table with 2 columns: Item and Content. Table of securities sold.

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成本总额

Table with 2 columns: Item and Content. Table of securities bought and sold.

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额列示,不考虑相关交易费用。 7.5 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组合

Table with 2 columns: Item and Content. Table of top 5 bond investments.

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额列示,不考虑相关交易费用。 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组合

Table with 2 columns: Item and Content. Table of top 5 bond investments.

注:截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止,本基金无因认购/申购/增发/增发而于期末持有的流通受限股票。 6.4.5.1 因认购/申购/增发/增发而于期末持有的流通受限股票

Table with 2 columns: Item and Content. Table of restricted securities.

注:截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止,本基金无因认购/申购/增发/增发而于期末持有的流通受限股票。 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

Table with 2 columns: Item and Content. Table of restricted securities.

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为质押的债券 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末 2015 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

Table with 2 columns: Item and Content. Table of securities.

6.4.5.3.3 交易对手信用风险 截至本报告期末 2015 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

6.4.5.4 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。

6.4.5.5 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.6 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。

6.4.5.7 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.8 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。

6.4.5.9 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.10 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。

6.4.5.11 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.12 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。

6.4.5.13 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.14 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。

6.4.5.15 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.16 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。

6.4.5.17 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.18 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。

6.4.5.19 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.20 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。

6.4.5.21 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级

6.4.5.22 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。

6.4.5.23 公允价值计量的金融工具 本基金对以公允价值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

的输入数据进行公允价值计量层级。 2015 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 119,336,885.4 元,属于第二层级的余额为 671,885,549.14 元,属于第三层级的余额 2014 年 12 月 31 日:第一层级