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

诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安中证500ETF
场内简称	诺安500
基金主代码	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年2月7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
报告期末基金份额总额	9,090,964.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014-03-10

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%且不低于非现金基金资产的80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证500指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	王永民
	联系电话	0755-83026688	010-66594896
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95566
传真		0755-83026677	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	16,770,281.00
本期利润	15,374,747.96
加权平均基金份额本期利润	0.9570
本期基金份额净值增长率	63.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.1906
期末基金资产净值	19,914,765.95
期末基金份额净值	2.1906

注:① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或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。

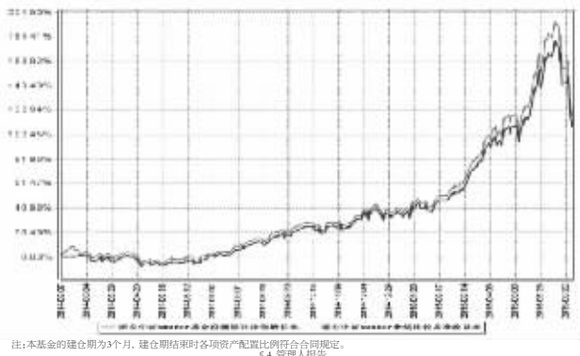
3.2 基金净值表现

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	-10.12%	3.55%	-10.64%	3.79%	0.52%	-0.24%
过去三个月	21.77%	2.72%	22.79%	2.90%	-1.02%	-0.18%
过去六个月	63.72%	2.15%	67.32%	2.28%	-3.60%	-0.13%
过去一年	122.83%	1.72%	126.91%	1.81%	-4.08%	-0.09%
自基金合同生效起至今	119.06%	1.56%	129.22%	1.68%	-10.16%	-0.12%

注:本基金的业绩比较基准为:中证500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:本基金的建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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2015年6月,本基金管理人共管理42只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、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、诺安小盘精选股票型证券投资基金、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、诺安红利股票证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安鸿鹄逸致债券型证券投资基金(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、诺安鸿鹄逸致定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿利定期开放债券型证券投资基金、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、诺安稳固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。

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		
梅律吾	指数组副总监、诺安中证100指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理	2014年2月7日	-	18	硕士,具有基金从业资格,曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司,2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数组副总监,曾于2007年11月至2009年10月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2011年9月至2012年12月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理,2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2014年2月起任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年6月起任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

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遵规守信情况的说明

报告期间,诺安中证500交易型开放式指数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《诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金合同》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。

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,明确授权层级及权责员会、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,对于证券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方配,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,公司在执配固定确定后,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。本报告期内本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 管理人对报告期内本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

2015上半年A股市场波势如虹,牛市行情来向高潮,距2007年牛市顶峰已近在咫尺,但目前经济基本面与2007年不可同日而语,中国经济上半年仍在探底之中,投资、消费与出口都非常低迷,CPI回到1时代,PPI通缩越来越严重,国内大城市上半年房地产销量,房价开启新一轮上涨,但并没有拉动房地产投资,由此可见,上半年A股牛市并非基本面驱动,动力源自宽松的货币环境,以及投资者对中国经济转型与改革的美好预期。

中国央行上半年连续降息&降准,目前一年期存款利率降至2%,一年期贷款利率降至5%以内,基准利率下调至非常低的水平,此外央行还在公开市场注入大量的流动性,将市场利率维持非常低的水平,因此宽松的货币环境是驱动A股牛市的主要动力。

由于中国的赚钱效应,以及对中国经济转型与改革牛市的憧憬,散户投资者大量涌入市,新投资开户数都创出了历史新高,公募基金上半年发行大发,但乏基金堡垒,而且一天售罄,大量的新增资金源源不断流向A股市场,将牛市推向高潮。

上半年A股牛市呈现结构分化局面,由于中国政府倡导“全民创业与万众创新”,以及投资者对经济改革与转型的向往,因此以创业板为代表的中小市值股票成为A股牛市的急先锋,大盘监筹股在上半年A股牛市中表现较为平淡。

中证500指数是中小市值股票的典型代表,因此市场表现强劲,上半年实现96%的涨幅,遥遥领先于其他指数。本基金完全复制中证500指数,有效管理跟踪误差,通过对该指数的紧密跟踪,为本基金持有人实现了牛市主厚的投资回报。

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2.1906元,本报告期基金份额净值增长率为63.72%,同期业绩比较基准收益率为67.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望情况

A股牛市向纵向高潮之后,释放系统风险已成为必然要求,6月份上证综指跨越5000点,创业板指数冲破4000点,市盈率超过百倍,牛市顶峰已经显现,6月中旬A股市场开始快速回落,释放系统风险的序幕已经开启,下半年A股市场将继续释放系统风险,直至估值水平回归合理。

下半年A股市场除了释放系统风险之外,还要面临内外两大风险的考验,外部风险来自美国加息,下半年美国加息是大概率事件,在美国加息前后,国际资本都选择回流美国本土市场,这会然会冲击亚洲等新兴市场,中国是全球最大的新兴市场,A股不可避免会受到美国加息的负面影响。

内部风险来自国内通胀,国内猪肉价格经历前所未有的低迷期之后,今年5月份开启了新一轮的上涨周期,猪肉价格这一轮上涨预计要持续到2016年春节以后,猪肉价格上涨必然带动国内CPI回升,CPI在2015年底回到2时代是大概率事件,而目前一年期存款基准利率仅为2%,因此下半年国内通胀回升,必然制约货币政策进一步放松,央行货币政策将进入观望期,这对A股不是利好。

概而言之,下半年A股市场快速要要降低期望值,不能沉溺于牛市的美好回忆之中,控制风险是第一要务。在控制风险的前提之下,寻求合适的投资机会,比较理想的情形是A股市场系统风险释放完毕,中国经济探底结束并开始回暖,这样会迎来新一轮的上涨行情,而且是中国政府希望的慢牛行情。

本基金在下半年继续复制中证500指数,有效管理跟踪误差,通过对该指数的紧密跟踪,为本基金持有人创造合理的投资回报。

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同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历,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

本基金合同规定,本基金的收益分配原则为:每份基金份额享有同等分配权;基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,基金管理人有权进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配12次,每次基金收益分配权益的确定原则为:按收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;本基金收益分配采取现金方式;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

截止2015年6月30日,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

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,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五十万元的情形,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、退市清盘、与其他基金合并等,并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

§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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未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:诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	952,010.38	5,065,217.71
结算备付金	4,178.05	441.77
存出保证金	17,236.95	45,534.00
交易性金融资产	19,115,155.66	65,723,804.25
其中:股票投资	19,115,155.66	65,723,804.25
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	3,686.54	-
应收利息	180.57	210.85
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	20,092,448.15	70,835,208.58
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	533,135.18
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	9,592.76	18,031.71
应付托管费	1,918.53	3,606.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	16,993.77	33,973.75
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	149,177.14	1,888,373.53
负债合计	177,682.20	2,477,120.48
所有者权益:		
实收基金	9,090,964.00	51,090,964.00
未分配利润	10,823,801.95	17,267,124.10
所有者权益合计	19,914,765.95	68,358,088.10
负债和所有者权益总计	20,092,448.15	70,835,208.58

注:报告截止日2015年06月30日,基金份额净值2.1906元,基金份额总额9,090,964.00份。

6.2 利润表

会计主体:诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年2月7日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一.收入	15,735,143.20	-14,546,224.12
1.利息收入	5,731.09	2,281,578.92
其中:存款利息收入	5,731.09	323,209.22
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	-	1,958,369.70
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	16,919,994.72	-11,895,011.69
其中:股票投资收益	16,862,222.21	-13,585,489.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	57,772.51	1,690,477.91
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,395,533.04	-3,943,069.34
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	204,950.43	-989,722.01
减:二.费用	360,395.24	3,013,548.50
1.管理人报酬	70,708.13	855,578.58
2.托管费	14,141.59	171,115.73
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	84,472.90	1,830,786.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	191,072.62	156,067.79
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	15,374,747.96	-17,559,772.62
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	15,374,747.96	-17,559,772.62

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	51,090,964.00	17,267,124.10	68,358,088.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,374,747.96	15,374,747.96
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)	-42,000,000.00	-21,818,070.11	-63,818,070.11
其中:1.基金申购款	4,000,000.00	2,637,117.83	6,637,117.83
2.基金赎回款	-46,000,000.00	-24,455,187.94	-70,455,187.94
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)	9,090,964.00	10,823,801.95	19,914,765.95
项目	上年度可比期间 2014年2月7日(基金合同生效日)至2014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)	879,090,964.00	-	879,090,964.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,559,772.62	-17,559,772.62
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)	-644,000,000.00	13,595,091.45	-630,404,908.55
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-644,000,000.00	13,595,091.45	-630,404,908.55
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)	235,090,964.00	-3,964,681.17	231,126,282.83

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 重要会计政策和会计估计

除6.4.2.2所述会计估计变更外,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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),本基金自2015年3月26日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月26 日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

6.4.2.3 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.3.2 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、直销机构
中国银行股份有限公司	托管人

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年2月7日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,708.13	855,578.58
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提,管理费的计算方法如下:

H=E×0.5 % ÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3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、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年2月7日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,141.59	171,115.73

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,托管费的计算方法如下:

H=E×0.1% ÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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可比期间内无其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年2月7日(基金合同生效日)至2014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
中国银行股份有限公司	952,010.38	5,255.13	2,844,993.87	294,855.95

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	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
600110	中科英华	2015年6月26日	重大资产重组	13.73	-	-	4,400	27,375.11	60,412.00	-
600175	美都能源	2015年6月29日	重大事项	10.64	2015年7月20日	9.58	5,600	33,608.36	59,584.00	-
000592	平潭发展	2015年6月30日	重大事项	29.76	2015年7月14日	30.00	2,000	93,200.00	59,520.00	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	重大资产重组	29.64	-	-	2,000	42,536.38	59,280.00	-
000959	首钢股份	2015年4月23日	重大资产重组	6.15	-	-	9,000	39,844.78	55,350.00	-
600312	平高电气	2015年6月23日	重大事项	22.58	-	-	2,400	36,211.14	54,192.00	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大事项	21.54	-	-	2,400	16,296.65	51,696.00	-
000650	仁和药业	2015年6月12日	重大事项	17.17	-	-	3,000	19,926.90	51,510.00	-
600967	北方创业	2015年4月13日	重大资产重组	17.12	-	-	3,000	40,979.37	51,360.00	-
600482	风帆股份	2015年5月28日	重大资产重组	42.38	-	-	1,200	15,582.06	50,856.00	-
002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项	31.15	-	-	1,600	18,961.02	49,840.00	-
002308	威创股份	2015年6月12日	重大事项	31.00	-	-	1,600	16,020.27	49,600.00	-
000887	中鼎股份	2015年6月30日	重大事项	24.75	-	-	2,000	27,721.06	49,500.00	-
002269	美邦服饰	2015年5月22日	重大事项	11.86	2015年7月2日	10.67	4,000	22,153.98	47,440.00	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项	37.76	2015年7月13日	34.65	1,200	62,457.00	45,312.00	-
601311	骆驼股份	2015年6月18日	重大事项	28.20	2015年7月15日	25.38	1,549	21,184.14	43,681.80	-
000543	皖能电力	2015年6月15日	重大事项	21.36	2015年7月14日	19.22	2,000	22,455.66	42,720.00	-
000979	中弘股份	2015年5月25日	重大资产重组	6.04	-	-	7,040	18,443.82	42,521.60	-
600366	宁波韵升	2015年5月22日	重大资产重组	35.09	2015年8月12日	31.58	1,200	20,138.86	42,108.00	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项	34.20	2015年7月2日	30.78	1,227	23,178.46	41,963.40	-
001696	宗申动力	2015年6月30日	重大事项	17.25	-	-	2,400	19,031.06	41,400.00	-
000697	炼石有色	2015年5月18日	重大资产重组	33.83	-	-	1,200	22,752.06	40,596.00	-
002309	中利科技	2015年6月2日	重大事项	33.39	2015年7月21日	30.05	1,200	24,978.69	40,068.00	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大资产重组	65.52	-	-	600	19,383.88	39,312.00	-
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大资产重组	22.64	2015年7月20日	20.35	1,600	19,274.06	36,224.00	-
600790	轻纺城	2015年5月25日	重大事项	13.38	2015年8月18日	12.04	2,700	16,770.74	36,126.00	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项	27.70	2015年7月1日	30.00	1,200	22,443.81	33,240.00	-
002414	高德红外	2015年5月13日	重大事项	39.36	-	-	800	17,068.93	31,488.00	-
600702	沱牌舍得	2015年6月29日	重大事项	26.11	2015年8月20日	28.00	1,200	18,846.62	31,332.00	-
002203	海亮股份	2015年4月27日	重大事项	12.71	-	-	2,400	18,654.08	30,504.00	-
600335	国机汽车	2015年6月15日	重大事项	37.93	2015年7月21日	34.14	800	15,111.78	30,344.00	-
002574	明牌珠宝	2015年6月4日	重大事项	22.90	-	-	1,314	14,948.82	30,090.60	-
002345	潮宏基	2015年5月22日	重大事项	19.58	-	-	1,520	12,946.38	29,761.60	-
000669	金鸿能源	2015年5月4日	重大事项	37.72	2015年7月23日	33.95	768	20,269.57	28,968.96	-
002143	印纪传媒	2015年6月30日	重大事项	32.01	2015年7月1日	33.50	800	31,120.00	25,608.00	-
000788	北大医药	2015年5月25日	重大资产重组	20.72	2015年7月21日	18.65	1,200	18,279.50	24,864.00	-
600078	澄星股份	2015年6月9日	重大事项	15.23	2015年7月1日	13.71	1,600	10,676.14	24,368.00	-
002069	獐子岛	2015年6月1日	重大事项	19.76	-	-	1,200	16,162.91	23,712.00	-
000519	江南红箭	2