诺安中小盘精选混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安中小盘精选混合
交易代码	320011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月28日
报告期末基金份额总额	693,566,644.28份
投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资,在有效控制组合风险的基础上,力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为四部分:资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及权证投资策略。 1、资产配置策略 本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择达到在承受一定风险的前提下获取较高收益的资产组合。 2、股票投资策略 本基金的股票投资策略分三步进行,首先是确定基本股票池,其次是进行个股基本面鉴别,最后是股票组合最终确认。 3、债券投资策略 本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield spread analysis)以及个券估值策略(Valuation analysis)等。 4、权证投资策略 本基金的权证投资部分主要运用的投资策略包括:价值发现策略和价差策略。作为辅助性投资工具,本基金会结合自身资产状况审慎投资于权证资产,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:自2015年8月6日起,原"诺安中小盘精选股票型证券投资基金"变更为"诺安中小盘精选混合型证券投资基金"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-28,869,866.37
2.本期利润	-56,779,892.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0831
4.期末基金资产净值	1,278,599,248.59
5.期末基金份额净值	1.844

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。

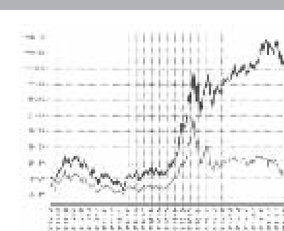
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-4.65%	0.91%	-6.29%	1.07%	1.64%	-0.16%

注:本基金的业绩比较基准为:中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

3.2.2 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:①本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

②自2015年8月7日起,本基金的业绩比较基准由原来的"(60%×天相中盘指数+40%×天相小盘指数)×80%+20%×中证全债指数",变更为"中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%"。

§4 管理人报告

4.1 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩冬燕	本基金基金经理	2016年9月13日	-	14	硕士,曾任职于华夏基金管理有限公司,先后从事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司,从事行业研究工作,现任权益投资事业部副总经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为本公司作出决定并对外公告之日;

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,诺安中小盘精选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《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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分配,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。公司在获配额度确定后,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

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于采用量化策略的投资组合调仓导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

为持有人实现长期稳健的投资回报是我们的职业追求,相应投资策略的制定,我们努力做到着眼于长远,每一阶段尽量走得扎实。用发展的观点看问题,我们需要做一名长期乐观主义者,需要看到事物发展的总趋势是前进的,但也必须理性的认识到,事物发展中各个具体阶段和每一步的方向,可能是前进的,也可能是停滞的甚至是倒退的,量变需要时间,质变更需要时间,好的投资策略要前瞻性地预判和运用大的量变和质变的契机。

我们投资所处的宏观经济环境方向上处于从高速向高质的转变期,但过程会是渐进的,曲折和反复不可避免。金融和实体经济互相依赖,互相影响,并且金融由于是"快变量",顺周期时金融是"加速器",逆周期时经济金融则容易陷入"两难境地"。宏观经济经历前几年的调整,实体经济过剩产能和库存风险在一定程度上被消化,金融风险被拖延甚至在处理库存风险的过程中进一步加大,当前的金融风险隐患实质上是实体经济结构性失衡的镜像反映。经济发展质量提升和产业结构转型需要进一步的改革开放红利,也更需要市场本身的力量,例如创新,而这些都是渐进的慢变量,叠加外围包括中美贸易冲突、中东地缘政治风险导致的石油价格上升等影响甚至冲击,经济转型的过程将更为曲折。在此过程中,资本市场将大概率地会被宏观映射。目前,不管是市场还是宏观经济环境基本面都已经处于曲折的过程中,变化已现,改变已有,革新尚需等待,过度悲观已不需要,但我们仍然需要足够的耐心。

我们3季度对应的投资策略是仍然保持低仓位,更加精选行业个股。我们预判2018年投资机会的核心大概率会在于估值和成长性的匹配,且成长须是高质量、可持续的成长。在结构上偏重的行业主要是长期行业发展空间较大、估值没有明显高估、能以时间换空间的行业,例如消费、医药、电信和电子行业等;适度考虑基本面有边际正向变化、低估值且存在预期差的,例如石化和金融行业。我们在个股选择上不囿于简单的"价值"和"成长"风格之分,而是在面向未来的基础上深刻地理解价值所在,审慎权衡成长性和估值的匹配度,持续地研判价值和价格之间的偏离。

衷心感谢持有人把投资的任务托付给我们!

4.5 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1.844元。本报告期基金份额净值增长率为-4.65%,同期业绩比较基准收益率为-6.29%。

4.6 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,本基金未出现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。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	781,194,785.02	46.88
	其中:股票	781,194,785.02	46.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	398,000,000.00	23.89
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	486,086,092.58	29.17
8	其他资产	995,527.23	0.06
9	合计	1,666,276,404.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	60,007,423.40	4.69
C	制造业	422,915,696.00	33.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	104,101.83	0.01
E	建筑业	116,580.74	0.01
F	批发和零售业	61,341,295.28	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	60,889.49	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,184,866.90	6.90
J	金融业	148,173,728.26	11.59
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	32,356.83	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	257,846.29	0.02
S	综合	-	-
	合计	781,194,785.02	61.10

5.3 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(%)
1	600015	华夏银行	12,589,780	102,858,502.60	8.04
2	600050	中国联通	15,800,000	88,006,000.00	6.88
3	600332	白云山	2,043,408	74,788,732.80	5.85
4	000869	张 裕A	1,784,114	65,334,254.68	5.11
5	000538	云南白药	838,633	62,545,249.14	4.89
6	601607	上海医药	2,989,280	61,280,240.00	4.79
7	600305	恒顺醋业	5,021,919	57,701,849.31	4.51
8	600028	中国石化	8,088,700	57,591,544.00	4.50
9	600690	青岛海尔	3,329,999	55,011,583.48	4.30
10	600887	伊利股份	2,014,097	51,722,010.96	4.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	241,891.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	74,167.50
5	应收申购款	679,468.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	995,527.23

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000538	云南白药	62,545,249.14	4.89	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	578,786,328.58
报告期期间基金总申购份额	140,305,623.57
减:报告期期间基金总赎回份额	25,525,307.87
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	693,566,644.28

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	1	-	-	-	-	-	-
个人	1	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内,本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,敬请投资者留意。							

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中小盘精选股票型证券投资基金募集的文件。

②《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》。

③《诺安中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》。

④《诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥诺安中小盘精选混合型证券投资基金2018年第三季度报告正文。

⑦报告期内诺安中小盘精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2018年10月26日

诺安全球黄金证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安全球黄金(QDII-FOF)	
交易代码	320013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月13日	
报告期末基金份额总额	661,625,663.99份	
投资目标	本基金主要通过投资于境外有实物支持的黄金ETF,紧密跟踪金价走势,为投资者提供一类可有效分散组合风险的黄金类金融工具。	
投资策略	本基金主要通过投资于有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪金价的投资目标。本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金ETF,之后基本上采取买入持有的投资策略,但根据标的ETF跟踪误差、流动性等因素定期进行调整和再平衡。本基金只买卖和持有黄金ETF份额,不直接买卖或持有实物黄金。本基金的具体投资策略包括ETF组合管理策略以及现金管理策略两部分组成。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。	
风险收益特征	本基金为基金中基金,主要投资于实物黄金支持的黄金ETF,投资目标为紧密跟踪黄金价格,预期风险收益水平与黄金价格相似,在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
境外投资顾问	英文名称:无	
	中文名称:无	
境外资产托管人	英文名称:Brown Brothers Harriman & Co.	
	中文名称:布朗兄弟哈里曼银行	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,333,645.97
2.本期利润	-6,563,266.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0099
4.期末基金资产净值	501,369,649.24
5.期末基金份额净值	0.758

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-1.30%	0.62%	-1.29%	0.58%	-0.01%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)。

3.2.2 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:本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋青	本基金基金经理	2011年11月14日	-	10	学士学位,具有基金从业资格。曾先后任职于香港富海企业有限公司、中国银行广西分行、中国银行伦敦分行、深圳航空集团公司、道富环球投资管理亚洲有限公司上海代表处,从事外汇交易、证券投资、固定收益及贵金属商品交易等投资工作。2010年10月加入诺安基金管理有限公司,任国际业务部总监。2011年11月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2012年7月起任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理。

注:①此处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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间,诺安全球黄金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《诺安全球黄金证券投资基金基金合同》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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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分配,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。公司在获配额度确定后,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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于采用量化策略的投资组合调仓导致。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年三季度现货黄金先是延续了二季度跌势,从1252.60美元/盎司持续下跌至1174.16美元/盎司,随后在1190至1210美元/盎司间盘整。整个季度现货黄金下跌了4.93%,季末收于1190.88美元/盎司。同期,COMEX黄金期货下跌5.54%;上海黄金期货下跌2.14%;全球黄金ETF持有量减少86.85吨。汇率方面,美元指数微跌0.34%,人民币兑美元贬值3.88%。

7月公布的欧元区就业、工业产出及工厂订单等经济数据显示欧元区的经济在增长。美国非农新增就业强劲明显高于预期,CPI与核心CPI同比持续增长,并创2012年2月以来最高。数据显示经济增长强劲、通胀压力增大,美联储会议纪要也显示多数参与者认为在2019年或2020年继续加息至中性利率以上是合适选择,态度偏鹰派。美国10年期债券收益率也自2011年11月以来首次突破3%。7月整体格局为欧美经济预期差继续收敛,欧元兑美元在7月基本走平,美元指数走势也较为稳定。但8月初公布的欧元区通胀数据虽然仍在增长,但是2季度环比和同比GDP增速都低于预期,反观美国则就业、通胀数据继续维持强劲,欧弱美强下欧元兑美元再次下跌,美元指数上涨从而压制了黄金价格。但美元走强也增加了对新兴市场的冲击,使得如阿根廷、巴西等双赤字的新兴经济体股债汇市出现较大回撤,市场避险风险有所提升。9月数据看美国经济继续强劲,欧元区基本符合预期。另外,美联储9月会议如期加息,并认为美国经济强劲未来可能加息至超过中性利率政策,9月末美国加拿大达成新的贸易协议,美联储鹰派叠加避险情绪下降,美债需求减少使得美国10年期国债收益率飙升至3.25%的高位。但美债收益率的过快飙升会使得全球风险资产、新兴市场汇率承压,事实是VIX恐慌指数也在大幅上涨。

我们在二季报及中报揭示下半年至中长期看需要关注:一是欧元区经济有望边际改善;二是美国经济维持高增长;三是全球流动性在边际缩紧;四是随着欧日货币政治逐渐正常化,对美债收益率的拖累将减弱,美国10年期国债收益率将再次上升,并对资产价格造成影响;五是美元中长期处于贬值通道。三季度宏观经济及市场情况基本按我们提及的情形演进。对于四季度黄金投资而言,美国经济将继续保持强劲势头,美国经济的强劲或使得美联储偏鹰派,市场对美加息幅度的预期可能更高,影响主要反映在美债收益率的上升。另外更需要关注事件如美中期选举、英国脱欧峰会、美欧日央行购债规模的拐点变化。美国中期选举共和党失去众议院多数席位的概率上升,一旦共和党失去了对众议院的掌控,特朗普往后推动政策将有阻力。英国脱欧目前尚未就脱欧达成共识,并且不排除明年3月英国硬脱欧情况。上述两事件对市场构成不确定性,我们预期的基准情形为中期选举民主党赢得众议院多数席位,英国达成协议脱欧。另外在美欧日央行当中,美国已在缩表,欧央行4季度将将有机会缩减量化宽松规模,日本或有机会明年削减QQE。总体影响是美债收益率将上升。而历次美债收益率的飙升都会对全球金融市场造成明显扰动,这也使得我们对四季度及未来美股看法变得更为谨慎,而黄金与风险资产低相关性的特征使其具有明显的避险效果,我们认为黄金进一步下跌的风险较低,建议投资者配置。

操作上我们维持高仓位跟踪。

4.6 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0.758元。本报告期基金份额净值增长率为-1.30%,同期业绩比较基准收益率为-1.29%。

4.7 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,本基金未出现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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	472,246,387.87	93.70
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,449,094.73	6.24
8	其他资产	303,469.82	0.06
9	合计	503,998,952.42	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本项主要列示按国际权威评级机构(标普、穆迪)的债券信用评级情况。本基金本报告期末未持有此类债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	UBS ETF CH-GOLD USA-I	ETF基金	契约型开放式	UBS Fund Management Switzerland	96,772,997.41	19.30
2	ISHARES GOLD TRU	ETF基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisor	95,399,854.12	19.03
3	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	ETF Securities USA LLC	93,927,393.08	18.73
4	JB-PHY GOLD-A$	ETF基金	契约型开放式	Swiss & Global Asset Management AG	93,872,736.32	18.72
5	CSETF GOLD	ETF基金	契约型开放式	Credit Suisse Asset Management Funds/Zurich	65,842,653.76	13.13
6	ZKB-GOLD-A USD	ETF基金	契约型开放式	Zuercher Kantonalbank	15,687,327.68	3.13
7	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	World Gold Trust Services LLC	10,743,425.50	2.14

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被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。

5.10.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,315.32
5	应收申购款	302,154.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	303,469.82

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	672,287,379.05
报告期期间基金总申购份额	15,650,850.84
减:报告期期间基金总赎回份额	26,312,565.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	661,625,663.99

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内,本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,敬请投资者留意。							

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安全球黄金证券投资基金募集的文件。

②《诺安全球黄金证券投资基金基金合同》。

③《诺安全球黄金证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安全球黄金证券投资基金2018年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安全球黄金证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2018年10月26日

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安上证新兴产业ETF
场内简称	新兴ETF
交易代码	510260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月7日
报告期末基金份额总额	15,482,658.00份
投资目标	本基金的标的指数是上证新兴产业指数。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金;本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金上市交易的证券交易所为"上海证券交易所",基金的二级市场交易简称为"新兴ETF",基金的申购、赎回简称为"新兴申赎",申购、赎回代码为"510261"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,600,381.14
2.本期利润	-1,499,874.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0428
4.期末基金资产净值	16,097,856.10
5.期末基金份额净值	1.040

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。

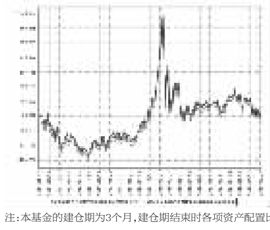
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-2.62%	1.29%	-2.98%	1.45%	0.36%	-0.16%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率。

3.2.2 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: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约定。

§4 管理人报告

4.1 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梅律吾	本基金基金经理	2017年8月8日	-	21	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,现任指数组负责人。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11月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理,2017年8月至2017年10月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2017年8月至2018年8月任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月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年6月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2017年8月起担任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年8月起任诺安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。

注:①此处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《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,上证新兴产业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《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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分配,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。公司在获配额度确定后,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

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于采用量化策略的投资组合调仓导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内,本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整和申购赎回,原因是在较小的最小申赎单位下,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。本基金管理人完全遵循被动投资,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 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1.040元。本报告期基金份额净值增长率为-2.62%,同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

4.6 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,本基金自2018年8月16日至2018年9月28日期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	15,334,360.44	94.04
	其中:股票	15,334,360.44	94.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	银行存款和结算备付金合计	969,538.32	5.95
8	其他资产	2,214.04	0.01
9	合计	16,306,112.80	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	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	191,520.00	1.19
C	制造业	10,601,866.90	65.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	831,197.00	5.16
E	建筑业	989,600.00	6.15
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	信息传输、软件和信息技术服务业	1,503,064.15	9.34
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、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,117,248.05	87.70

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	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	采掘业	-	-
C	制造业	1,217,112.39	7.56
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	信息传输、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、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,217,112.39	7.56

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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(%)
1	603019	中科曙光	7,892	369,976.96	2.30
2	600271	航天信息	13,200	367,356.00	2.28
3	600588	用友网络	13,000	361,660.00	2.25
4	600183	生益科技	33,857	356,514.21	2.21
5	601186	中国铁建	31,300	348,995.00	2.17
6	601390	中国中铁	43,300	336,441.00	2.09
7	600276	恒瑞医药	5,289	335,851.50	2.09
8	600406	国电南瑞	18,858	332,843.70	2.07
9	600309	万华化学	7,800	331,266.00	2.06
10	600660	福耀玻璃	13,000	330,850.00	2.06

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(%)
1	600485	信威集团	83,421	1,217,112.39	7.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,032.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	181.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,214.04

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	1,217,112.39	7.56	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	53,482,658.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	38,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	15,482,658.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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	1	2018.07.02-2018.08.15	38,000,000.00	-	38,000,000.00	-	0.00%
产品特有风险							
报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,敬请投资者留意可能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。							

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件。

②《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金2018年第三季度报告正文。

⑥报告期内上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2018年10月26日