

信息披露 disclosure

诺安研究精选股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

1. 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...

2. 本基金业绩比较基准为: 90%×沪深300指数+10%×中证全债指数。

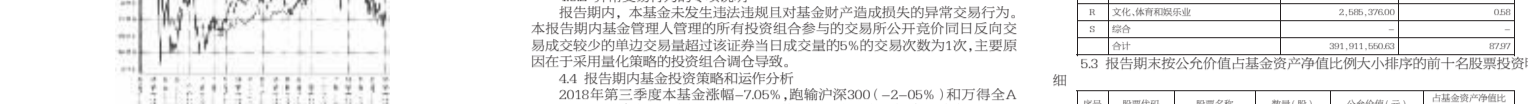
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 期间, 净值增长率, 业绩比较基准收益, 收益差, ①-③, ②-④

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。

3.2.2 本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变动的比较



注: ①2015年3月30日(含当日)起,本基金转型为“诺安研究精选股票型证券投资基金”,转型后,本基金的业绩比较基准为: 90%×沪深300指数+10%×中证全债指数。

②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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

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《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于报告期内本基金投资遵规守信情况的说明

报告期内,诺安纯债定期开放债券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《诺安纯债定期开放债券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。

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数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合导导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

截至报告期末,本基金仓位为0.8847%。本报告期基金份额净值增长率为-7.05%,同期业绩比较基准收益率为-1.87%。

4.5 报告期内基金业绩表现

截至报告期末,诺安纯债基金基金份额净值为1.120元。本报告期基金份额净值增长率为2.28%,同期业绩比较基准收益率为0.70%。

4.6 报告期内基金持有人数量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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 代码, 名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 代码, 名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本期国债期货投资评价

5.11 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.12 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.13 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.14 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.15 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.16 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.17 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.18 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.19 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.20 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.21 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.22 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.23 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.24 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.25 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.26 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.27 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.28 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.29 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.30 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.31 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.32 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.33 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.34 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.35 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

5.36 诺安纯债定期开放债券型证券投资基金投资组合公告

诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

1. 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...

2. 本基金业绩比较基准为: 90%×沪深300指数+10%×中证全债指数。

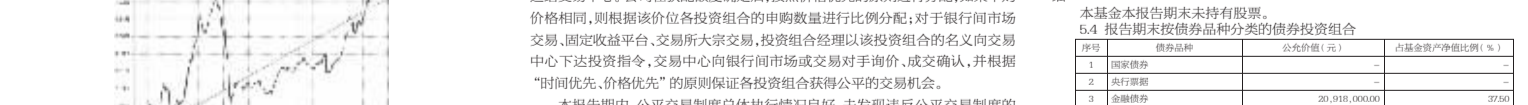
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 期间, 净值增长率, 业绩比较基准收益, 收益差, ①-③, ②-④

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。

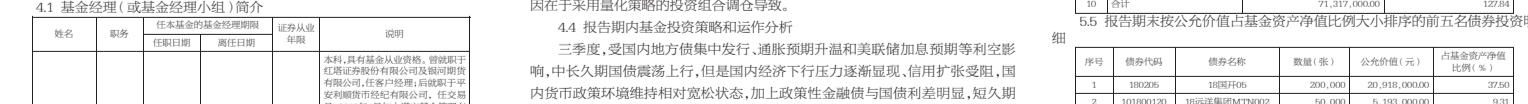
3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



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。

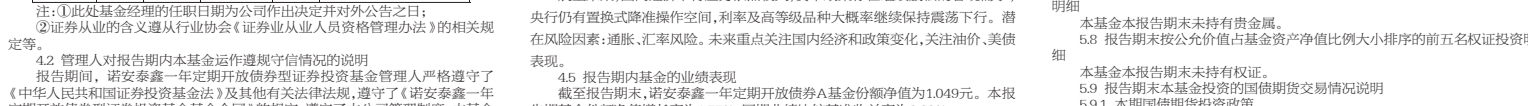
3.2.3 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



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。

3.2.4 本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变动的比较



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。

3.2.5 本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变动的比较

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。

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 本基金本报告期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

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在受流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.12 开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 诺安研究, 诺安研究

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的份额。

5.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.20 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.22 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.23 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.24 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.25 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.26 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.27 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.28 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.29 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.30 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.31 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.32 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.33 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.34 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.35 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.36 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.37 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.38 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.39 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.40 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.41 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.42 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.43 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.44 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.45 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.46 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.47 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.48 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.49 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.50 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.51 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.52 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.53 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.54 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.55 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.56 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.57 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.58 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.59 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.60 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.61 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.62 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.63 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.64 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.65 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.66 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.67 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.68 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.69 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.70 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.71 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.72 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.73 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.74 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.75 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.76 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.77 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.78 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.79 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.80 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.81 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.82 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.83 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.84 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.85 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月26日

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。

基金托管人交通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预示其未来表现,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投资招募说明书。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

2. 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标

1. 投资目标

2. 投资策略

3. 业绩比较基准

4. 风险收益特征

5. 基金管理人承诺

6. 基金托管人

7. 基金合同生效日期

8. 基金管理人

9. 基金托管人

10. 基金管理人

11. 基金管理人

12. 基金管理人

13. 基金管理人

14. 基金管理人

15. 基金管理人

16. 基金管理人

17. 基金管理人

18. 基金管理人

19. 基金管理人

20. 基金管理人

21. 基金管理人

22. 基金管理人

23. 基金管理人

24. 基金管理人

25. 基金管理人

26. 基金管理人

27. 基金管理人

28. 基金管理人

29. 基金管理人

30. 基金管理人

31. 基金管理人

32. 基金管理人

33. 基金管理人

34. 基金管理人

35. 基金管理人

36. 基金管理人

37. 基金管理人

38. 基金管理人

39. 基金管理人

40. 基金管理人

41. 基金管理人

42. 基金管理人

43. 基金管理人

44. 基金管理人

45. 基金管理人

46. 基金管理人

47. 基金管理人

48. 基金管理人

49. 基金管理人

50. 基金管理人

51. 基金管理人

52. 基金管理人

53. 基金管理人

54. 基金管理人

55. 基金管理人

56. 基金管理人

57. 基金管理人

58. 基金管理人

59. 基金管理人

</