

## 诺安中小盘精选股票型证券投资基金

[2014]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:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、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2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、净值公告、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。

本报告中财务资料未经审计。

报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

诺安中小盘精选股票型基金

320011

契约型开放式

2010/4/28

511,281,828.98份

投资目标

通过具备成长潜力且估值合理的中小盘股票的投资，把握在控制风险的前提下，力争实现基金的长期稳健增值。

本基金的投资策略分为两个部分：资产配置策略、股票投资策略。倚靠投资策略，倚靠投资策略以资产配置策略为基础，通过资产配置策略和股票投资策略的结合，积极进行资产配置，把握时机选择达到在承受一定风险的前提下获得较高收益的投资机会。

1. 资产配置策略

本基金的资产配置策略分为三个步骤：首先，根据宏观经济和市场情况对中小盘股票的投资，其次是进行行业基本面筛选，最后对个股进行最终筛选。

2. 股票投资策略

本基金的股票投资策略主要通过行业基本面的分析和个股的精选，选择具有成长性、估值合理的股票进行投资。

3. 倚靠投资策略

本基金的股票投资策略分为两个部分：资产配置策略和股票投资策略，具体包括行业基本面筛选和个股精选。

4. 行业基本面筛选

本基金的股票投资策略主要通过行业基本面的分析和个股的精选，选择具有成长性、估值合理的股票进行投资。

5. 个股精选

本基金的股票投资策略主要通过行业基本面的分析和个股的精选，选择具有成长性、估值合理的股票进行投资。

6. 行业银行和准备金

7. 其他资产

8. 合计

641,816,863.29 100.00

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 14,625,623.48 2.30

B 采矿业 23,761,331.33 3.74

C 制造业 274,364,042.87 43.12

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 39,789.83 0.01

E 建筑业 40,429,680.83 6.35

F 批发和零售业 100 0.00

G 交通运输、仓储和邮政业 29,528,632.12 4.64

H 住宿和餐饮业 100 0.00

I 信息传输、软件和信息技术服务业 6,666.16 0.00

J 金融业 116,226,581.54 18.27

K 房地产业 39,453,049.41 6.20

L 租赁和商务服务业 100 0.00

M 科学研究和技术服务业 100 0.00

N 水利、环境和公共设施管理业 100 0.00

O 居民服务、修理和其他服务业 100 0.00

P 教育 100 0.00

Q 卫生和计划生育 100 0.00

R 文化、体育和娱乐业 100 0.00

S 住宿和餐饮业 100 0.00

9. 合计 538,437,599.57 84.63

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 601668 中国建筑 11,915,089 40,392,151.71 6.35

2 600014 上汽集团 2,063,354 37,305,440.32 5.86

3 000370 金地集团 1,315,686 32,684,507.68 5.14

4 601009 中国神华 6,699,020 32,481,180.00 5.11

5 601939 建设银行 7,914,434 32,211,746.38 5.06

6 000776 广发证券 31,556,345.00 4.96

7 000203 海螺水泥 1,260,289 29,831,046.63 4.69

8 601006 大秦铁路 3,799,454 29,526,632.12 4.64

9 300096 长江证券 1,395,240 27,049,237.00 4.26

10 600000 中国平安 1,497,762 25,926,260.22 4.08

5.4 报告期末按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五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本基金投资明细

本基金本报告期末未持有本基金。

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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.10 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11 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。

5.12 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.13 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本基金投资明细

本基金本报告期末未持有本基金。

5.14 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。

5.15 报告期末前十名股票中因涉嫌违法违规被实施停牌的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在因涉嫌违法违规被实施停牌的情况。

5.16 报告期内组合报告附注的其文本描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计存在差异。

5.17 公司所涉及的重大诉讼

本基金本报告期末未涉及重大诉讼。

5.18 公司所涉及的重大仲裁

本基金本报告期末未涉及重大仲裁。

5.19 公司所涉及的重大资产交易

本基金本报告期末未涉及重大资产交易。

5.20 公司所涉及的重大关联交易

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.21 公司所涉及的重大关联交易的说明

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.22 公司所涉及的重大关联交易的批准文件

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.23 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.24 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.25 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.26 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.27 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.28 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.29 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.30 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.31 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.32 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.33 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.34 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.35 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.36 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.37 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.38 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.39 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.40 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.41 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.42 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.43 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.44 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.45 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.46 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.47 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.48 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.49 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.50 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.51 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.52 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.53 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.54 公司所涉及的重大关联交易的定价依据

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.55 公司所涉及的重大关联交易的定价政策

本基金本报告期末未涉及重大关联交易。

5.56 公司所涉及的重大关联交易的定价依据