诺安天天宝货币市场基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安天天宝货币
交易代码	000559
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25日
报告期末基金份额总额	406,547,638.79份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

下属四级基金的基金简称	下属四级基金的交易代码	报告期末下属四级基金的份额总额
诺安天天宝货币A	000559	255,654,306.58份
诺安天天宝货币E	000560	10,697,501.66份
诺安天天宝货币B	000625	132,561,756.51份
诺安天天宝货币C	000818	7,634,074.04份

§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		1.本期已实现收益	2.本期利润	3.期末基金资产净值
报告期(2014年7月1日－2014年9月30日)	诺安天天宝货币A	3,581,043.51	3,581,043.51	255,654,306.58
	诺安天天宝货币E	120,298.53	120,298.53	10,697,501.66
	诺安天天宝货币B	1,098,075.62	1,098,075.62	132,561,756.51
	诺安天天宝货币C	3,800.88	3,800.88	7,634,074.04

注:①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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

②本基金自2014年4月28日起,增加诺安天天宝B类基金份额类别;自2014年9月24日期,增加诺安天天宝C类份额。增加基金份额类别后,本基金将分设A类、E类、B类及C类四类基金份额,详情请参阅相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安天天宝货币A

主要财务指标	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0324%	0.0043%	0.0894%	0.0000%	0.9430%	0.0043%

诺安天天宝货币E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0714%	0.0043%	0.0894%	0.0000%	0.9820%	0.0043%

诺安天天宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1632%	0.0043%	0.0894%	0.0000%	1.0738%	0.0043%

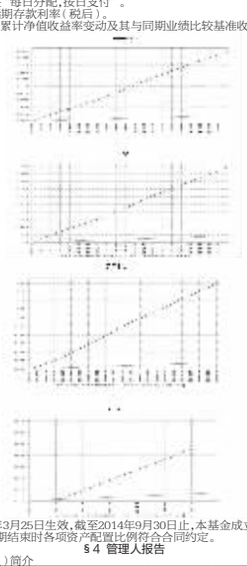
诺安天天宝货币C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.0694%	0.0071%	0.0068%	0.0000%	0.0626%	0.0071%

注:①本基金的利润分配方式是"每日分配,按日支付"。

②本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金基金合同于2014年3月25日生效,截至2014年9月30日止,本基金成立未满1年。

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 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		
张乐骐	固定收益总监,诺安货币市场基金基金经理,诺安积鑫保本混合型证券投资基金基金经理,诺安汇鑫保本混合型证券投资基金基金经理,诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理,诺安天天宝货币市场基金基金经理,诺安理财宝货币市场基金基金经理及诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理	2014年3月25日	-	10	硕士,具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心;2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任固定收益部总监。曾于2009年8月至2012年1月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006年8月起担任诺安货币市场基金的基金经理;2014年5月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理;2012年5月起担任诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理;2014年3月起担任诺安天天宝货币市场基金基金经理;2014年5月起担任诺安理财宝货币市场基金基金经理;2014年9月起担任诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理。

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 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,诺安天天宝货币市场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《诺安天天宝货币市场基金基金合同》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于询价、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 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86天,影子定价偏离度为0.0411%。本报告期诺安天天宝货币A基金份额净值收益率为1.0324%,诺安天天宝货币A的同期业绩比较基准收益率为0.0894%;本报告期诺安天天宝货币E基金份额净值收益率为1.0714%,诺安天天宝货币E的同期业绩比较基准收益率为0.0894%;本报告期诺安天天宝货币B基金份额净值收益率为1.1632%,诺安天天宝货币B的同期业绩比较基准收益率为0.0894%;本报告期诺安天天宝货币C基金份额净值收益率为0.0694%,诺安天天宝货币C的同期业绩比较基准收益率为0.0068%。

§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	固定收益投资	220,328,748.49	54.14
	其中:债券	220,328,748.49	54.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	150,701,138.55	37.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,422,954.29	0.60
4	其他资产	33,494,741.16	8.23
5	合计	406,947,582.49	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.06	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	占基金资产净值的比例(%)	占基金负债净值的比例(%)
1	30天以内	45.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	17.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	22.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.47	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,981,818.59	4.92
	其中:政策性金融债	19,981,818.59	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,346,929.90	49.28
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	220,328,748.49	54.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041461025	14粤佛塑CP001	300,000	30,164,684.81	7.42
2	011499026	14宏图SCP001	300,000	29,997,244.11	7.38
3	041453051	14北盘江CP001	200,000	20,123,822.85	4.95
4	041460068	14惠天CP001	200,000	20,038,727.78	4.93
5	041469038	14中材科技CP001	200,000	20,026,229.28	4.93
6	041464055	14连城投CP002	200,000	20,002,590.75	4.92
7	1490158	14华西CP05	200,000	19,997,191.86	4.92
8	071442002	14西部证券CP002	200,000	19,995,587.67	4.92
9	011489002	14鞍钢股SCP002	200,000	19,994,101.99	4.92
10	110418	11农发18	200,000	19,981,818.59	4.92

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0609%
报告期内偏离度的最低值	-0.0171%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0220%

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 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内不存在"持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券"的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本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

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,921,378.08
3	应收利息	2,573,363.08
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	33,494,741.16

5.8.5 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

项目	报告期期初基金份额总额	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	报告期期末基金份额总额
诺安天天宝货币A	395,809,067.31	162,068,152.40	302,222,913.13	255,654,306.58
诺安天天宝货币E	745,252.62	60,691,290.06	50,739,041.02	10,697,501.66
诺安天天宝货币B	22,410,940.37	550,962,415.12	440,811,598.98	132,561,756.51
诺安天天宝货币C	-	8,908,239.69	1,274,165.65	7,634,074.04

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没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安天天宝货币市场基金公开募集的文件。

②《诺安天天宝货币市场基金基金合同》。

③《诺安天天宝货币市场基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安天天宝货币市场基金2014年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安天天宝货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 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
2014年10月24日

诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

【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2014年10月21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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安稳固收益一年定期开放债券
交易代码	000235
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	2,090,309,790.01份
投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力求资产持续稳妥地保值增值,为投资者提供较好的养老资产管理工具。
投资策略	1.封闭期投资策略 在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 2.开放期投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准3.0%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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:本基金为一年定期开放基金,首个开放期时间为2014 年8月22日——2014 年9月17日,开放期内本基金接受申购、赎回申请。自2014 年9月18日起至一年后对应日的前一日(2015 年9月17日)为本基金的第二个封闭期,封闭期内本基金不接受申购、赎回申请。

§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(2014年7月1日－2014年9月30日)
1.本期已实现收益	52,942,751.47
2.本期利润	22,545,309.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0108
4.期末基金资产净值	2,096,446,807.39
5.期末基金份额净值	1.003

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。

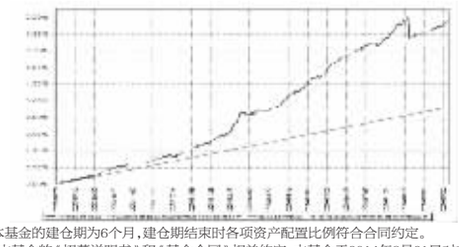
3.2 基金净值表现

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	1.15%	0.12%	0.74%	0.01%	0.41%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准3.0%。

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。

②根据本基金的《招募说明书》和《基金合同》相关约定,本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了管理费的计提,并于2014年9月17日(份额折算日)进行份额折算,折算后基金份额净值为1.000元。

§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		
谢志华	诺安纯债定期开放债券基金经理,诺安鸿鹄保本混合基金经理,诺安货币基金经理,诺安积极回报基金经理,诺安稳固收益一年期定期开放债券基金经理,诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理,诺安优化收益债券基金经理及诺安永鑫一年定期开放债券基金经理	2013年8月21日	-	8	理学硕士,具有基金从业资格,曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司、从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理,2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,2013年5月起任诺安鸿鹄保本混合型证券投资基金及诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任诺安货币基金经理,2013年6月起任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起任诺安稳固收益一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理,2014年6月起任诺安永鑫收益一年定期开放债券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基金合同生效之日;

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 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,诺安稳固收益一年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《诺安稳固收益一年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。

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于询价、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 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1.003元。本报告期基金份额净值增长率为1.15%,同期业绩比较基准收益率为0.74%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,617,423,000.00	77.11
	其中:债券	1,617,423,000.00	77.11
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	430,000,225.00	20.50
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	31,106,753.37	1.48
7	其他资产	19,151,015.45	0.91
8	合计	2,097,680,993.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

姓名	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,691,000.00	12.91
	其中:政策性金融债	270,691,000.00	12.91
4	企业债券	192,261,000.00	9.17
5	企业短期融资券	952,918,000.00	45.45
6	中期票据	201,553,000.00	9.61
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,617,423,000.00	77.15

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

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(%)
1	140224	14国开24	700,000	70,826,000.00	3.38
2	124390	13朝岛01	500,000	50,900,000.00	2.43
3	140344	14进出44	500,000	50,560,000.00	2.41
4	124385	13龙岩汇	500,000	50,245,000.00	2.40
5	140362	14进出62	500,000	50,230,000.00	2.40

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投资资产支持证券。

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9.2 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持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	53,576.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,097,439.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,151,015.45

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处于转股期的可转换债券。

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	2,492,597,264.38
报告期期间基金总申购份额	1,783,082,912.45
减:报告期期间基金总赎回份额	2,291,911,896.12
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	106,541,509.30
报告期期末基金份额总额	2,090,309,790.01

§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没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的文件。

②《诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》。

③《诺安稳固收益一年定期开放债券型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诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金2014年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 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
2014年10月24日

诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金

【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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安信用债一年定期开放债券
交易代码	000151
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月18日
报告期末基金份额总额	158,306,512.97份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.封闭期投资策略 在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 2.开放期投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备。
业绩比较基准	中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于证券市场中的中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金、普通债券型基金,低于股票型基金。
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

§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(2014年7月1日－2014年9月30日)
1.本期已实现收益	3,718,960.20
2.本期利润	7,492,535.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0473
4.期末基金资产净值	166,157,449.02
5.期末基金份额净值	1.050

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。

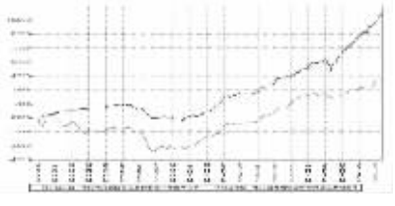
3.2 基金净值表现

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	4.79%	0.13%	1.43%	0.06%	3.36%	0.07%

注:本基金的业绩比较标准为:中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

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