

诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

2015] 第一季度报告

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：2015年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及其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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31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	2,099,369,790.01份
投资目标	本基金在充分考虑资金安全、有控制风险的前提下，力求资产持续稳定的增值，为投资者提供相对较好的长期回报。
1.封闭期投资策略	在封闭期内，为合理安排本基金的防御功能，满足基金份额的流动性需求，本基金在投资组合中持有部分的组合比例不超过5%，封闭期结束后，本基金将根据市场情况，在开放式基金的申购赎回安排下，将主要投资于高流动性的债券品种，减少基金净值的波动。
2.开放期投资策略	在开放期内，基金管理人将采取适当的流动性管理措施，确保基金能够满足投资人申购和赎回的需要。在开放期根据市场情况，执行相应的操作，制定合理的操作方案和应急预案，应对极端情况下可能出现的赎回压力。
业绩比较基准	固定收益类理财产品
风险收益特征	本基金为债券型基金，其收益率和风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	22,657,258.68
2.本期利润	20,892,441.61
3.加权平均基金份额利润	0.0100
4.期末基金份额净值	2,149,725,322.17
5.期末基金份额总额	1,028

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率将低于所列数字。

②本公司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，本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③基金净值=基金资产总值/基金份额总数。

④本基金的业绩比较基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

⑤本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

⑥自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

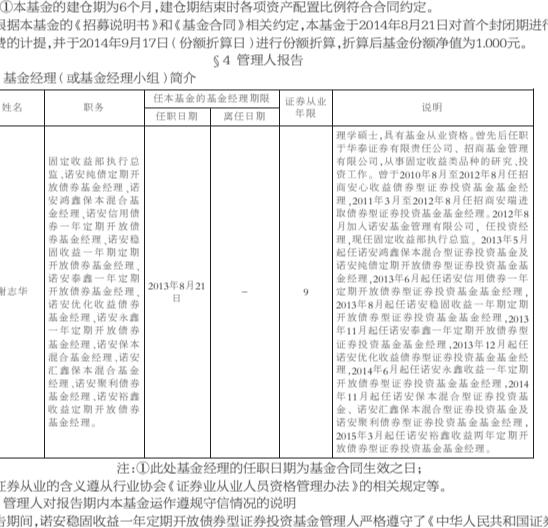
阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

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根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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



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根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.98% 0.09% 0.71% 0.05% 0.27% 0.08%

注：①本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

②根据基金的招募说明书和《基金合同》的相关规定，本基金于2014年8月21日对首个封闭期进行了费用计提，但对于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。

③本基金的业绩基准为：固定收益类理财产品*30%，该业绩基准适用于本基金第一个封闭期，其他封闭期的业绩基准由基金管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

④本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长 rate (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 8.80% 10.6% 1.13% -18% -0.31%

注：①本基金的业绩基准为：95%×沪深300指数收益率+4%×恒生指数收益率+4%×业绩比较基准。

②本基金成立以来绩效评价以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长 rate (%) 净值增长率② (%) 业绩比较基准③ (%) 业绩比较基准④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 8.80% 10.6% 1.13% -18% -0.31%