

诺安研究精选股票型证券投资基金

2015 第二季度报告

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：2015年7月18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。 基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月16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，保证基金相关信息真实、准确。除上述数据和事项外，其他部分的内容由基金管理人负责。 基金的投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。													
2 基金产品概况													
<table><tr><td>基金简称</td><td>诺安研究精选股票</td></tr><tr><td>交易代码</td><td>300022</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2015年3月30日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>1,521,709,336.67份</td></tr></table>				基金简称	诺安研究精选股票	交易代码	300022	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2015年3月30日	报告期末基金份额总额	1,521,709,336.67份
基金简称	诺安研究精选股票												
交易代码	300022												
基金运作方式	契约型开放式												
基金合同生效日	2015年3月30日												
报告期末基金份额总额	1,521,709,336.67份												
投资目标 本基金通过深入研究报告精选具有长期发展潜力的行业和上市公司，分享中国中期经济增长的大背景下的可持续增长、中高速增长基金资产的长期增值收益。													
本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将科学、规范的投资方法与积极主动的投资风险控制相结合，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。 1. 大类资产配置策略 本基金采取战略资产配置和战术资产配置相结合的策略配置策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行资产配置灵活调整，力求通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。 2. 股票投资策略 本基金在基金管理人的研究平台、遵循科学、系统的研究方法和决策机制，研究公司的基本面、财政企业价值的核心驱动因素，优选个股。 3. 债券投资策略 本基金重点对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等因素影响利率和债券市场走势的变动趋势，进行基本面分析，综合分析市场利率和信用债的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置等多种投资策略进行债券投资，把握债券市场投资机会，以获取稳健收益。 4. 资产支持证券投资策略 本基金将主要投资于符合信用评级（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还情况等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。 5. 权证投资策略 本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等，作为辅助性投资工具，并将在充分分析资产状况和风险特征，力求获得最佳风险调整后收益。 6. 股指期货投资策略 本基金在符合股指期货投资的前提下，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的合约品种，通过证券组合的套期保值操作，对冲基金组合中的特定风险，降低资产净值波动，实现基金合同约定的投资目标，通过多空头头寸交易和期货头寸进行套期保值操作。 7. 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×中证全指指数的收益率，由：95%×沪深300指数收益率+10%×中证全指指数的收益率。 本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险，较高预期收益的特征。													
业绩比较基准													
风险收益特征													
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													

注：诺安研究精选股票基金合同规定诺安研究精选股票基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×中证全指指数的收益率，由：95%×沪深300指数收益率+10%×中证全指指数的收益率。诺安研究精选股票基金业绩比较基准为“诺安研究精选股票基金业绩比较基准”					
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	000078	海王生物	3,772,769	83,000,720.00	5.47
2	300049	福耀玻璃	675,704	78,804,602.96	5.12
3	300223	北京君正	2,009,700	71,846,320.00	4.79
4	301036	佳信通信	2,799,638	67,100,988.20	4.62
5	600540	新赛股份	598,685	68,508,000.00	4.59
6	000089	华侨城A	4,969,915	64,898,896.70	4.28
7	700963	华东医药	1,024,630	64,803,126.00	4.28

诺安优化收益债券型证券投资基金

2015 第二季度报告

基金管理人：诺安基金管理有限公司
 基金托管人：华夏银行股份有限公司
 报告送出日期：2015年7月18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。
 基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月16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，保证基金相关信息真实、准确。除上述数据和事项外，其他部分的内容由基金管理人负责。
 基金的投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
 本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金简称	诺安优化收益债券
交易代码	320004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月20日
报告期末基金份额总额	445,003,244.23份
投资目标	确保本金的稳健和价值的稳定，力争为投资者提供高于投资业绩比较基准的增值收益。 本基金的投资策略为：在严格控制风险的前提下，力争为投资者提供高于投资业绩比较基准的增值收益。 本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争为投资者提供高于投资业绩比较基准的增值收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争为投资者提供高于投资业绩比较基准的增值收益。 本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争为投资者提供高于投资业绩比较基准的增值收益。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

注：前“诺安优化收益债券基金”的基金合同生效日为2006年7月17日，2007年8月20日《诺安优化收益债券基金资产组合公告》生效，“诺安优化收益债券基金”转型为“诺安优化收益债券基金”。

3.1 主要财务指标

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	1,071,271,512.40	90.78
3	其中：债券	1,071,271,512.40	90.78
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	111,631,382.75	9.29
7	其他资产	97,153,049.96	8.23
8	合计	1,180,056,945.11	100.00

3.2 基金业绩比较基准
 中证综合债指数收益率

3.3 基金净值表现
 本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力，谨慎做出投资决策。
 本基金自2015年4月1日起至6月30日止，基金净值表现如下：

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	1,071,271,512.40	90.78
3	其中：债券	1,071,271,512.40	90.78
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	111,631,382.75	9.29
7	其他资产	97,153,049.96	8.23
8	合计	1,180,056,945.11	100.00

3.4 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.5 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.6 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.7 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.8 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.9 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.10 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.11 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.12 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.13 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.14 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.15 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.16 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.17 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.18 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.19 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.20 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.21 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.22 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.23 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.24 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.25 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.26 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.27 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.28 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.29 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.30 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.31 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.32 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.33 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.34 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.35 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.36 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.37 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.38 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.39 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.40 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.41 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.42 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.43 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.44 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.45 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.46 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.47 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.48 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.49 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.50 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.51 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.52 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.53 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.54 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.55 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.56 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.57 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.58 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.59 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.60 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.61 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.62 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.63 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.64 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.65 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.66 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.67 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.68 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.69 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.70 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.71 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.72 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.73 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.74 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.75 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.76 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.77 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.78 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.79 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.80 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.81 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.82 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.83 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.84 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.85 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.86 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.87 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.88 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.89 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.90 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.91 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.92 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.93 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.94 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.95 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.96 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.97 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.98 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.99 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

3.100 报告期末基金资产净值
 445,003,244.23元

主要财务指标		报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益		311,722,906.39	2.56
2.本期公允价值变动损益		304,497,719.80	2.56
3.加:期初未实现收益		1,517,201,797.94	2.56
4.期末基金净值		1,521,709,336.67	2.56

注:本基金本报告期末无持有待售资产。

5.6 截至报告期末基金份额持有人数量及持有基金份额集中度符合《证券投资基金运作管理办法》的有关规定。

5.7 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.8 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.10 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.11 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.12 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.13 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.14 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.15 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.16 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.17 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.18 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.19 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.20 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.21 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.22 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.23 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.24 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.25 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.26 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.27 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.28 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.29 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.30 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.31 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.32 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.33 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.34 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.35 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.36 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.37 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.38 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.39 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.40 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.41 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.42 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.43 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.44 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.45 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.46 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.47 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.48 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.49 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.50 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.51 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.52 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.53 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.54 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.55 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.56 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.57 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.58 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.59 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.60 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.61 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.62 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.63 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.64 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.65 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.66 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.67 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.68 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.69 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.70 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.71 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.72 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.73 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.74 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.75 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.76 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.77 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.78 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.79 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.80 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.81 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.82 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.83 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.84 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.85 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.86 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.87 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.88 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.89 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.90 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.91 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.92 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.93 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.94 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

5.95 截至报告期末本基金无权证持仓。

5.96 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

5.97 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

5.98 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

5.99 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.00 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.01 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.02 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.03 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.04 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.05 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.06 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.07 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.08 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.09 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.10 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.11 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.12 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.13 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.14 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.15 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.16 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.17 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.18 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.19 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.20 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.21 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.22 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.23 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.24 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.25 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.26 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.27 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.28 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.29 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.30 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.31 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.32 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.33 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.34 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.35 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.36 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.37 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.38 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.39 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.40 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.41 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.42 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.43 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.44 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.45 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.46 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.47 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.48 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.49 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.50 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.51 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.52 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.53 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.54 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.55 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.56 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.57 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.58 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.59 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.60 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.61 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.62 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.63 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.64 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.65 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.66 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.67 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.68 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.69 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.70 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.71 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.72 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.73 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.74 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.75 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.76 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.77 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.78 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.79 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.80 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.81 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.82 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.83 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.84 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.85 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.86 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.87 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.88 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.89 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.90 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.91 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.92 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.93 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.94 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

6.95 截至报告期末本基金无权证持仓。

6.96 截至报告期末本基金无贵金属持仓。

6.97 截至报告期末本基金无股指期货持仓。

6.98 截至报告期末本基金无国债期货持仓。

6.99 截至报告期末本基金无资产支持证券持仓。

7.00 截至报告期末本基金无权证持仓。

				5.7 报告期末本公司前十名权益资产净值比例大排序的前三名权益投资明细 本基金本报告期末未有投资。	
		5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大排序的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未有投资。		5.9 报告期末本基金投资的股指期货期间交易情况说明 5.9.1 本期股指期货投资策略 本基金本报告期末无股指期货持仓。 5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末无股指期货持仓。	
		5.10 报告期末本基金投资的国债期货情况说明 5.10.1 本期国债期货投资策略 本基金本报告期末无国债期货持仓。 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末无国债期货持仓。		5.11 投资组合报告附注 5.11.1 本基金本报告期末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,也没有在 本报告编制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未有超出基金合同规定的股票。 5.11.3 其他资产构成	
注:1.基金的建仓期为6个月,建仓期结束后各项资产配置比例符合合同约定。 2.2007年8月20日(含当日),本基金简介为“浙江安化收益债券型证券投资基金”,业绩比较基准是“上证综指全值指数”。					
§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 任职日期	离任日期	证券 从业年限	说明
固定收益部执行 总监、基金经理 定期开放混合					理学硕士,具有基金从业资格,曾先后任职于华泰证券有限公司、招银基金管理有限公司,从事固定收益类证券投资研究、投资工作,曾于2010年8月至2012年3月担任安化收益债券型证券投资基金基金经理,2011
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	160,540.39			
2	应收证券清算款	69,990,507.93			
3	应收股利	-			

4.1 基金管理人及基金托管人 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	4.2 基金业绩比较基准 中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%
--	--

4.1 基金管理人及基金托管人 基金管理人：诺安基金管理有限公司 基金托管人：华夏银行股份有限公司	4.2 基金业绩比较基准 中证综合债指数收益率
--	-----------------------------------

5.1 基金管理人及基金托管人 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	5.2 基金业绩比较基准 中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%
--	--

5.1 基金管理人及基金托管人 基金管理人：诺安基金管理有限公司 基金托管人：华夏银行股份有限公司	5.2 基金业绩比较基准 中证综合债指数收益率
--	-----------------------------------

诺安中证100指数证券投资基金

2015 第二季度报告

基金简称	诺安中证100指数	注：①此处的基金投资的任取日期为基金管理人对外公告之日； ②此处的含义是从任取日期的《证券投资基金从业人员职业道德守则》的相关规定等。 4.2 管理人根据报告期内基金净值增长率与业绩比较基准表现的差异，对基金管理人投资行为进行了评价。 报告期内，诺安中证100指数证券投资基金严格按照了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规，遵守了《诺安中证100指数证券投资基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资运作未发生违规行为。
交易代码	320010	4.3 公平交易专项说明
基金运作方式	契约型开放式	4.3.1 公平交易制度的执行情况
基金合同生效日	2009年10月27日	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》，制度的适用范围包括：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，包括：授权、研究分析、投资决策、集中交易、清算交收、业绩评估等投资管理活动各个环节。
报告期末基金份额总额	176,586,473.88份	4.3.2 公平交易制度的执行情况
投资目标	本基金采用被动式投资策略，紧密跟踪中证100指数的表现，力求实现基金资产的长期增值收益。在正常市场条件下，本基金日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，年度跟踪误差不超过2.4%。	4.3.3 公平交易制度的执行情况
投资策略	本基金采用被动式投资策略，紧密跟踪中证100指数的表现，力求实现基金资产的长期增值收益。在正常市场条件下，本基金日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，年度跟踪误差不超过2.4%。	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》，制度的适用范围包括：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，包括：授权、研究分析、投资决策、集中交易、清算交收、业绩评估等投资管理活动各个环节。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%	4.3.4 公平交易制度的执行情况
风险收益特征	本基金为股票指数基金，可获取资本市场平均收益率，其风险收益特征与股票指数基金类似。	4.3.5 公平交易制度的执行情况
基金管理人	诺安基金管理有限公司	4.3.6 公平交易制度的执行情况
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	4.3.7 公平交易制度的执行情况
1 主要财务指标	§ 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4月1日 - 2015年6月30日	
1.本期已实现收益	97,698,902.27	
2.本期利润	41,975,237.26	
3.期末可供基金份额持有人分配的利润	1,738	
4.期末基金资产净值	216,709,122.67	
5.期末基金份额净值	1.227	
2.2 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的比较	1.227	
① 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
② 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
③ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
④ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑤ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑥ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑦ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑧ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑨ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑩ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑪ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑫ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑬ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑭ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑮ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑯ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑰ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑱ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑲ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
⑳ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉑ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉒ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉓ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉔ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉕ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉖ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉗ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉘ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉙ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉚ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉛ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉜ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉝ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉞ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㉟ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊱ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊲ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊳ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊴ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊵ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊶ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊷ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊸ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊹ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊺ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊻ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊼ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊽ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊾ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资组合，其公允价值变动损益不计入公允价值变动损益。		
㊿ 本基金的投资组合中不包括有交易基金的投资		

5.2 报告期末按股票投资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	10,027,710.51	4.69
C	制造业	57,718,364.69	26.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,721,134.32	3.10
E	建筑业	10,662,198.05	4.92
F	批发和零售业	2,019,838.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	5,434,079.78	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,673,913.39	1.70
J	金融业	98,918,562.83	45.65
K	房地产业	7,119,469.52	3.29
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	1,362,069.28	0.63
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		283,267,064.84	93.80

5.2.2 报告期末按股票投资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	-	-
C	制造业	772,532.65	0.36
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		772,532.65	0.36

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	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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债券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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十名资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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权证投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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十名资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

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资产支持证券投资明细			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.14 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.15 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.16 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.17 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.18 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.19 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.20 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.21 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.22 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.23 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.24 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.25 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.26 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.27 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.28 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.29 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.30 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.31 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.32 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.33 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.34 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.35 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.36 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.37 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.38 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.39 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.40 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.41 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.42 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.43 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.44 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.45 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.46 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.47 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.48 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.49 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.50 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.51 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.52 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.53 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.54 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.55 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.56 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.57 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.58 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.59 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.60 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.61 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.62 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.63 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.64 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.65 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.66 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.67 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.68 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.69 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.70 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.71 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.72 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.73 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.74 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.75 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.76 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.77 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.78 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.79 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.80 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.81 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.82 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.83 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.84 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.85 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.86 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.87 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.88 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.89 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.90 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.91 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.92 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.93 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.94 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.95 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.96 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.97 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

5.98 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			
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)
1	000263	东阿阿胶	772,532.65

4.1 基金管理人及基金托管人 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	4.2 基金业绩比较基准 中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%
--	--

4.1 基金管理人及基金托管人 基金管理人：诺安基金管理有限公司 基金托管人：华夏银行股份有限公司	4.2 基金业绩比较基准 中证综合债指数收益率
--	-----------------------------------