

2017年9月30日

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：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售代理人：以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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，投资人面临风险，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。

§ 2 基金产品概况

基金简称：诺安增利债券

交易代码：320008

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年5月27日

报告期末基金资产净值总额：130,412,496.58份

投资目标：本基金通过积极的投资操作，在充分考虑流动性的情况下，力争在控制风险的前提下，为投资者创造稳定的收益。

本基金的资产配置策略为：资产配置策略和增强类资产配置策略。

投资策略：本基金在综合分析宏观经济形势、利率走势、资金面情况、信用环境、政策导向、市场情绪等的基础上，通过自上而下的资产配置，力争在控制风险的前提下，为投资者创造稳定的收益。

业绩比较基准：债券型基金平均收益率+0.6%。

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混合型基金、股票型基金，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：中国工商银行股份有限公司

基金类别：债券型基金

基金费率：申购费率为0；赎回费率为0；管理费率为0.6%，托管费率为0.2%。

报告期末下属分级基金的份额总额：320008 320009

报告期末下属分级基金的资产净值总额：108,004,421.93份 21,608,074.65份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

主要财务指标：1.本期已实现收益 193,754.03 -43,641.26

2.本期利润 -2,597,746.96 -693,039.09

3.加权平均基金份额本期利润 147,657,143.87 27,938,041.49

4.期末基金资产净值 1,357 1,293

5.期末基金份额净值 1.357 1.293

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，计算费用后实际收益水平将低于上述数字。(2)本基金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，本期利息收入为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值信息

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.2 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

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，计算费用后实际收益水平将低于上述数字。(2)本基金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，本期利息收入为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 基金净值信息

3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

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，计算费用后实际收益水平将低于上述数字。(2)本基金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，本期利息收入为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3.1 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.2 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.3 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.4 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.5 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.6 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.7 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.8 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.9 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.10 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.11 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.12 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.13 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

过去三个月 -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%

注：(1)本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普债基指数”变更为“诺安增利债券

3.2.3.14 本报告期基金份额净值增长率为零及其与同期业绩比较基准收益差的比率

报告期：2015年10月12日起至2015年10月12日止

阶段 净值增长长 ① -1.74% 0.19% 0.03% -2.37% 0.16%