

诺安优化收益债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

度。本基金投资管理人未发生违法违纪行为。

4.3 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》。制度的范围包括买卖上市股票、债券、一级市场申购、一级市场交易等投资管理活动。制度的执行情况由监察稽核部定期对公平交易制度的执行情况进行评价。

基金经理的公平交易行为不违反本制度。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不存在虚假记载、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。

基金管理人、诺安基金管理有限公司

华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月25日

§ 2 基金产品概况

基金简称：诺安优化收益债券

交易代码：520004

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年8月20日

报告期末基金份额总额：1,264,120,160份

投资目标：通过精选具有稳定收益和到期收益率的固定收益类品种投资策略，力争为投资者提供高于银行同期存款利率的收益。

本基金的资产配置分为固定收益类品种投资策略和股权投资部分。

(1)固定收益类品种投资策略包括资产配置、期限配置、具体券种选择和信用风险管理。

(2)股权投资策略：本基金在充分研究股权投资市场的投资机会和风险后，根据对股权投资的可投资性、流动性、风险收益比的综合评估，选择具有稳定收益的股权投资品种。

基金经理的公平交易行为不违反本制度。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。

注：原“诺安短期债券投资基金”的基金合同生效日为2006年7月17日，2007年8月20日《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》生效，“诺安短期债券投资基金”变更为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。

§ 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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 10,229,211.64

2.本期利润 18,943,124.21

3.加权平均基金份额本期利润 0.0150

4.期末基金份额净值 1,298,882,400.10

5.期末基金份额净值 1.0366

注：(1)本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算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 本基金份额在报告期内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(%) 净值增长率(标准差) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(标准差) ① - ③ ② - ④

过去三个月 1.44% 0.14% 0.63% 0.03% 0.01% 0.11%

注：(1)本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算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。

3.2.2 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.3 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.4 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.5 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.6 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.7 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.8 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.9 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.10 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.11 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.12 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.13 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.14 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.15 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.16 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.17 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.18 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.19 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.20 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.21 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.22 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.23 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.24 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.25 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.26 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.27 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.28 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.29 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.30 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.31 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.32 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.33 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.34 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.35 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.36 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.37 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.38 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.39 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.40 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.41 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.42 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.43 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.44 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.45 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.46 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.47 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.48 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.49 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.50 本基金合同类型以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：本基金的财务指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.51 本基金合同类型以