# 诺安聚鑫宝货币市场基金

## 2017年第三季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:江苏银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26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。

基金托管人江苏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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安聚鑫宝货币 |
| 交易代码 | 000771 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月1日 |
| 报告期末基金份额总额 | 17,718,852,268.71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 | 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 | 江苏银行股份有限公司 |

| 下属分级基金的基金简称 | 下属分级基金的交易代码 | 报告期末下属分级基金的份额总额 |
|---|---|---|
| 诺安聚鑫宝货币A | 000771 | 8,855,986,896.24份 |
| 诺安聚鑫宝货币B | 000779 | 6,381,476,735.67份 |
| 诺安聚鑫宝货币C | 001669 | 197,451,202.64份 |
| 诺安聚鑫宝货币D | 001867 | 2,283,937,434.16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(2017年7月1日 - 2017年9月30日) | 诺安聚鑫宝货币A | 195,173,646.56 | 195,173,646.56 | 8,855,986,896.24 |
| | 诺安聚鑫宝货币B | 63,408,277.58 | 63,408,277.58 | 6,381,476,735.67 |
| | 诺安聚鑫宝货币C | 1,634,175.60 | 1,634,175.60 | 197,451,202.64 |
| | 诺安聚鑫宝货币D | 22,730,936.25 | 22,730,936.25 | 2,283,937,434.16 |

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自2014年9月4日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额;自2015年8月4日起,本基金增加诺安聚鑫宝C类基金份额;自2015年9月24日起,本基金增加诺安聚鑫宝D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

诺安聚鑫宝货币A

| 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 | 0.9682% | 0.0008% | 0.0894% | 0.0000% | 0.8788% | 0.0008% |

诺安聚鑫宝货币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 | 0.9690% | 0.0008% | 0.0894% | 0.0000% | 0.8796% | 0.0008% |

诺安聚鑫宝货币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 | 0.9695% | 0.0008% | 0.0894% | 0.0000% | 0.8801% | 0.0008% |

诺安聚鑫宝货币D

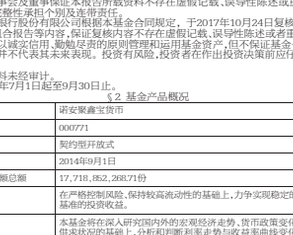
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.9717% | 0.0008% | 0.0894% | 0.0000% | 0.8823% | 0.0008% |

注:①本基金的利润分配方式是"每日分配,按日支付"。

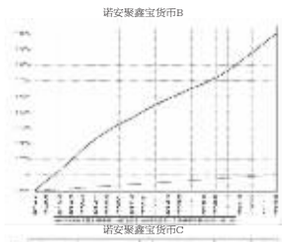
②本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

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

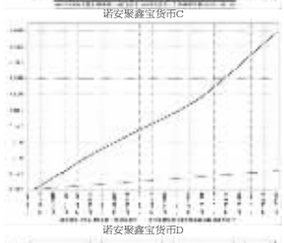
诺安聚鑫宝货币A



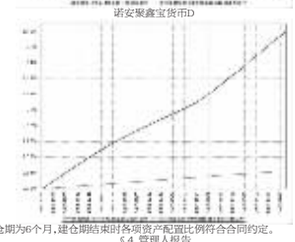
诺安聚鑫宝货币B



诺安聚鑫宝货币C



诺安聚鑫宝货币D



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 | | |
| 谢志华 | 固定收益事业部副总经理、总裁助理,诺安纯债定期开放债券基金经理、诺安鸿鹄短债债券基金经理、诺安优化收益债券基金经理、诺安行业轮动混合基金经理、诺安红鑫保本混合基金经理、诺安利债债券基金经理、诺安利丰债券基金经理、诺安利益债券基金经理、诺安安盛债券基金经理、诺安安享债券基金经理、诺安安心债券基金经理、诺安安益债券基金经理、诺安安泰债券基金经理、诺安安和债券基金经理、诺安安福债券基金经理、诺安安欣债券基金经理、诺安安乐债券基金经理、诺安安利债券基金经理、诺安安鑫债券基金经理、诺安安瑞债券基金经理、诺安安祺债券基金经理、诺安安顺债券基金经理、诺安安惠债券基金经理、诺安安康债券基金经理、诺安安宁债券基金经理、诺安安丰债券基金经理、诺安安睿债券基金经理、诺安安裕债券基金经理、诺安安逸债券基金经理、诺安安怡债券基金经理、诺安安悦债券基金经理、诺安安娱债券基金经理、诺安安欢债券基金经理、诺安安喜债券基金经理、诺安安庆债券基金经理、诺安安美债券基金经理、诺安安美债券基金经理、诺安安美