



Disclosure 信息披露

2013年10月24日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

诺安平衡证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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,也不保证基金保本。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

基金概况	
基金简称	诺安平衡混合
交易代码	320001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末基金份额总额	7,231,523,835.70元
投资目标	在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在目标收益的前提下,力争取得高于市场平均水平的收益水平,在控制风险的前提下,谋求资产的稳定增值及长期的资本增值。
投资策略	本基金采用积极的投资策略,在股票资产配置面,本基金关注市场资金在各个资本市场的流动,动态调整股票资产和债券资产的配置比例,在资产配置层面,本基金注重把握宏观经济变化和结构性机会,通过行业轮动、个股选择等方式,实现资产增值化配置;在债券资产配置方面,本基金采用自上而下和自下而上的方法,在债券资产方面,本基金采用中期策略,收益主要来自国债、收益丰富的可转债以及无风险利率等投资资产,力求获得高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	65%×中证指数+35%×上证国债指数
风险收益特征	诺安平衡证券投资基金属于中型基金,风险低于股票型基金,收益高于债券型基金。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-82,020,837.28
2.本期利润	551,366,627.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0730
4.期末基金资产净值	4,845,444,630.43
5.期末基金份额净值	0.6700

注:①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

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。

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准收益率之差②	业绩比较基准收益率③	净值增长率与业绩比较基准收益率之差④	①-③	②-④
过去三个月	12.23%	0.72%	9.33%	0.86%	2.90%	-0.14%

注：本基金业绩比较基准为：65%×中信指数+35%×上证指数指数。

3.2.2 自基金合同生效以来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:本基金业绩比较基准为:65%×中证指数+35%×上证国债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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。

姓名	职务	任本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
夏俊杰	诺安平衡证券投资基金基金经理	2011年4月16日	-	7

注:上述基金的任职日期和离任日期为基金公司公告作出决定并对外公告之日。

②基金合同约定的基金经理(证券基金从业人员资格管理办法)的相关规定。

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

报告期内,诺安平衡证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安平衡证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

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》,制度的范围包括场内、二级市场、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

4.4 报告期内基金投资运作和业绩表现

报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资比例、投资限制等,严格执行了公平交易制度,确保了基金资产的公平交易。本基金管理人严格遵守了《诺安平衡证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.5 报告期内基金投资运作和业绩表现

报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资比例、投资限制等,严格执行了公平交易制度,确保了基金资产的公平交易。本基金管理人严格遵守了《诺安平衡证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,228,670,265.45	61.16
2	固定收益投资	1,662,619,000.00	31.49
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	170,000,000.00	3.22
5	银行存款和结算备付金合计	181,010,922.72	3.43
6	其他资产	36,996,227.28	0.70
7	合计	5,279,296,416.55	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,228,670,265.45	61.16
2	固定收益投资	1,662,619,000.00	31.49
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	170,000,000.00	3.22
5	银行存款和结算备付金合计	181,010,922.72	3.43
6	其他资产	36,996,227.28	0.70
7	合计	5,279,296,416.55	100.00

注:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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。

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	100,898,031.44	2.08
B	采矿业	6,052,096.88	0.12
C	制造业	1,289,197,989.95	26.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	465,792,954.19	9.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	321,243,749.16	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	37,609,200.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	592,586,701.66	12.23
J	金融业	408,859,367.62	8.27
K	房地产业	11,169,965.99	0.23
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	1,257,464.16	0.03
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	2,002,745.00	0.04
S	综合	-	-
合计		3,228,670,265.45	66.63

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	600570	恒生电子	16,000.00	344,960,000.00	7.12
2	600111	华能国际	35,000.00	187,950,000.00	3.88
3	601318	中国平安	52,308.58	187,014,735.60	3.86
4	600887	伊利股份	3,685,232	164,656,165.76	3.40
5	600511	国药股份	8,622,746	162,339,860.04	3.35
6	600027	华能国际	45,291.475	139,950,657.75	2.89
7	601213	石基信息	35,484.094	134,827,572.00	2.81
8	300079	华能国际	5,000.000	132,850,000.00	2.74
9	600111	华能国际	4,386.000	123,685,200.00	2.55
10	000423	东方阿拉	3,000.000	121,230,000.00	2.50

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600570	恒生电子	16,000,000	344,960,000.00	7.1
2	600011	华能国际	35,000,000	187,950,000.00	3.8
3	601318	亨通光电	1,925,500	10,701,425.00	0.3
4	600087	中国石化	3,045,232	164,458,000.00	3.3
5	600511	国药股份	8,662,746	162,339,960.04	3.3
6	600027	华电国际	45,291,475	139,950,657.75	2.8
7	021533	石基信息	3,548,094	134,827,572.00	2.7
8	300079	数码视讯	5,000,000	132,850,000.00	2.7
9	601111	宝钢稀土	4,386,000	123,685,200.00	2.5
10	004423	东阿阿胶		121,250,000.00	2.5

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,228,670,265.45	61.16
2	固定收益投资	1,662,619,000.00	31.49
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	170,000,000.00	3.22
5	银行存款和结算备付金合计	181,010,922.72	3.43
6	其他资产	36,996,227.28	0.70
7	合计	5,279,296,416.55	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,228,670,265.45	61.16
2	固定收益投资	1,662,619,000.00	31.49
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	170,000,000.00	3.22
5	银行存款和结算备付金合计	181,010,922.72	3.43
6	其他资产	36,996,227.28	0.70
7	合计	5,279,296,416.55	100.00

注:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本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:本基金的投资建仓以来本基金累计净值增长率变动及其