# 诺安中证100指数证券投资基金

## 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 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。

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2013年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安中证100指数 |
| 交易代码 | 320010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年10月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,088,821,761.18份 |
| 投资目标 | 本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。 |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当调整成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,以使跟踪误差控制在限定的范围之内。 |
| 业绩比较基准 | 中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金,可获取资本市场平均收益率,其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 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 |

### §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(2013年7月1日—2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -22,949,653.86 |
| 2.本期利润 | 56,412,705.07 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0519 |
| 4.期末基金资产净值 | 748,097,863.53 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.687 |

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,计入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。

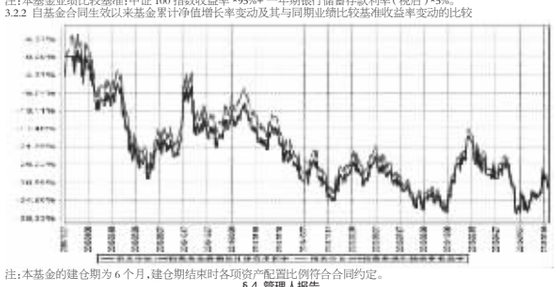
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额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① | 净值增长率标准差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 | 8.53% | 1.45% | 7.17% | 1.44% | 1.36% | 0.01% |

注:本基金业绩比较基准:中证100指数收益率*95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)*5%。

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:本基金的建仓期为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 | | |
| 梅律吾 | 指数投资组副总监、诺安中证100指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理 | 2012年7月28日 | - | 15 | 硕士,具有基金从业资格,曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司;2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监。曾于2007年11月至2009年10月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2011年9月至2012年12月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理,2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。 |

注:①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安中证100指数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《诺安中证100指数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

4.3.1 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》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,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。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过授权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经历了六月底的钱荒后,三季度央行不定期地向市场投放流动性,缓解短期资金紧张的局面,因此并没有出现预期中的流动性紧张局面,美国经济的复苏和QE退出也一波三折,进程慢于市场预期,加上国内经济在低位企稳,股票市场出现了较为明显的反弹,创业板指数涨幅更高。

从结构看,由于经济低迷,投资者对传统周期性行业已经不抱任何期望,大盘股票的估值持续下降,而符合转型方向的部分行业,估值持续提升,大小盘风格股票的估值差异达到了历史较高的水平。

三季度,由于对流动性和美元指数的判断出现失误,基金保持较低仓位,同时我们认为,在经济低迷的情况下,真正能穿越周期的股票较少,部分小盘股业绩不达预期的可能性极大,因此,在部分小盘股出现泡沫化倾向的时候,我们过早回避了这部分股票,投资的主要方向是金融、农业、交运港口等板块。

展望四季度,我们认为经济仍然可能弱势震荡,但流动性紧张的可能性依然存在,而市场层面看,小盘股的泡沫化正在进程当中,从历史经验看,这一进程何时结束无法预测。综合上述情况,我们相对看好具备安全边际的大盘蓝筹、而战略新兴产业的成色有待时间和业绩的检验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.857元,本报告期基金份额净值增长率为6.99%,同期业绩比较基准收益率为11.42%。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 707,608,496.35 | 94.34 |
| | 其中:股票 | 707,608,496.35 | 94.34 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 42,116,120.17 | 5.61 |
| 6 | 其他资产 | 374,301.83 | 0.05 |
| 7 | 合计 | 750,098,918.35 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按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 | 82,840,578.97 | 7.06 |
| C | 制造业 | 184,149,846.66 | 24.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 20,312,671.97 | 2.72 |
| E | 建筑业 | 26,558,683.01 | 3.55 |
| F | 批发和零售业 | 12,220,093.00 | 1.63 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,444,771.88 | 2.20 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,781,058.98 | 1.44 |
| J | 金融业 | 340,496,970.69 | 45.52 |
| K | 房地产业 | 30,752,451.73 | 4.11 |
| 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 | 4,410,865.20 | 0.59 |
| 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 | 6,357,585.12 | 0.85 |
| | 合计 | 705,325,577.21 | 94.28 |

5.2.2 报告期末积极投资按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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,282,919.14 | 0.31 |
| 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 | 2,282,919.14 | 0.31 |

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

5.3.1 报告期末指数投资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 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 4,837,667 | 46,248,096.52 | 6.18 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 3,479,457 | 37,995,670.44 | 5.08 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 2,461,480 | 27,494,731.60 | 3.68 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 715,774 | 25,553,131.80 | 3.42 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 2,427,485 | 24,493,323.65 | 3.27 |
| 6 | 601939 | 建设银行 | 5,110,161 | 21,973,692.30 | 2.94 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 1,752,842 | 21,928,053.42 | 2.93 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 2,031,297 | 18,545,741.61 | 2.48 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 1,474,678 | 18,123,792.62 | 2.42 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 3,387,850 | 14,567,755.00 | 1.95 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 600251 | 冠农股份 | 140,834 | 2,282,919.14 | 0.31 |

注:本基金本报告期末仅持有上述积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体。除中国平安外,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2013年10月15日,中国平安保险(集团)股份有限公司董事会披露公告,中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司收到了中国证监会关于"万福生科"事件的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号)。中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

本基金属于指数基金,采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。截至本报告期末,中国平安(601318)为中证100指数的前十大权重股。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 235,667.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 117,748.25 |
| 4 | 应收利息 | 7,997.28 |
| 5 | 应收申购款 | 12,889.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 374,301.83 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,133,631,689.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 160,683,313.74 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 205,493,242.52 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,088,821,761.18 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2013年7月6日发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》的公告,自2013年7月6日起,负责审计本基金基金财产的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证100指数证券投资基金募集的文件。

②《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》。

③《诺安中证100指数证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安中证100指数证券投资基金2013年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安中证100指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。

**诺安基金管理有限公司**
**2013年10月24日**

# 诺安增利债券型证券投资基金

## 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 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。

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2013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 |
| 报告期末基金份额总额 | 67,988,977.50份 |
| 投资目标 | 本基金通过在核心固定收益类资产上进行增强型配置,力图在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力,使基金资产在风险可控的基础上得到最大化增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略分为核心类资产配置策略和增强类资产配置策略两大部分。<br>1.核心类资产配置策略<br>国债、金融债、短期融资券、企业债、公司债、可转债、央行票据、回购、资产支持证券等较低风险高流动性固定收益类资产为本基金的核心资产,此部分资产力图在控制组合风险的前提下获取市场平均收益,而非追逐承受风险溢价下的超额收益。<br>2.增强类资产配置策略<br>股票(包括新股中签)、权证等非固定收益类金融工具为本基金的增强类资产,此部分资产在承担合理风险的基础上追求超越基准的最大化增值。增强类资产配置策略由股票投资策略和权证投资策略组成。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普全债指数 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 诺安增利债券A 诺安增利债券B |
| 下属两级基金的交易代码 | 320008 320009 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 62,848,035.84份 5,140,941.66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 | 报告期(2013年7月1日—2013年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 诺安增利债券A | 诺安增利债券B |
| 1. 本期已实现收益 | 2,459,305.15 | 212,801.67 |
| 2. 本期利润 | 1,998,628.05 | 152,172.34 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0344 | 0.0269 |
| 4. 期末基金资产净值 | 71,563,063.58 | 5,723,730.55 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.139 | 1.113 |

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,计入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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

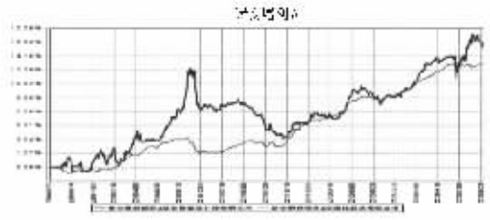
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.08% | 0.27% | 0.38% | 0.04% | 2.70% | 0.23% |

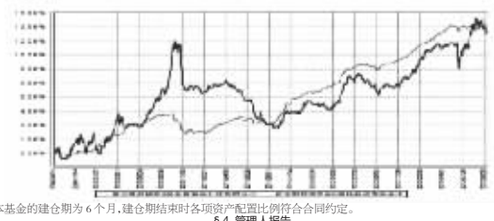
诺安增利债券B

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差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 | 2.87% | 0.27% | 0.38% | 0.04% | 2.49% | 0.23% |

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

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:本基金的建仓期为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 | | |
| 汪洋 | 诺安增利债券型证券投资基金基金经理、诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2011年12月14日 | - | 2 | 硕士,具有基金从业资格。曾任职于招商银行总行,从事债券投资工作。2011年7月加入诺安基金管理有限公司,任基金经理助理。于2011年12月起任诺安增利债券型证券投资基金基金经理,2012年1月起任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理,2012年11月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年3月起任诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

注:①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安增利债券型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《诺安增利债券型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

4.3.1 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》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,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。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过授权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济增长动力减弱,通胀略为反弹,三季度末上升到3.1%附近。第三季度,市场资金面维持在高位,七天回购一直在高位运行。国内股市三季度大幅反弹;而债券市场受资金面与利率市场化改革的影响,收益率维持在高位,收益率曲线扁平化;可转债市场随股市同向运动,转债指数表现度略输大盘。

报告期内,我们采取偏稳健的投资策略,稳固了高票息信用债投资,控制组合债券合久期,调整了一部分转债仓位,并适当增加了股票仓位。

展望第四季度,外围市场因美国可能推迟退出QE情绪乐观。国内经济方面,经济增速仍保持下行趋势,但有望在四季度见底,CPI有望小幅上行。货币政策方面,央行动用降准手段调控市场可能性较小,货币市场利率会保持在高位较长时间。债券市场方面,利率债、高评级信用债仍有交易性机会,高票息信用债将面临回调风险局面,年内不排除有信用事件发生,应加强对信用风险的管理;股市或会持续反弹;转债随股市走牛将有交易性机会,但品种选择需要细致。第四季度,我们将奉行稳健投资原则,积极寻找债市、股市中的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末诺安增利债券A基金份额净值为1.139元,本报告期基金份额净值增长率为3.08%;

截至报告期末诺安增利债券B基金份额净值为1.113元,本报告期基金份额净值增长率为2.87%,业绩比较基准中信标普全债指数收益率为0.38%。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 3,653,953.03 | 4.58 |
| | 其中:股票 | 3,653,953.03 | 4.58 |
| 2 | 固定收益投资 | 51,735,794.40 | 64.82 |
| | 其中:债券 | 51,735,794.40 | 64.82 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 10,000,000.00 | 12.53 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,904,586.16 | 9.90 |
| 6 | 其他资产 | 6,519,005.29 | 8.17 |
| 7 | 合计 | 79,813,338.88 | 100.00 |

5.2 报告期末按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 | 1,851,812.40 | 2.40 |
| 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 | 1,802,140.63 | 2.33 |
| 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 | 3,653,953.03 | 4.73 |

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 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002601 | 佰利联 | 97,208 | 1,851,812.40 | 2.40 |
| 2 | 300010 | 立思辰 | 164,279 | 1,802,140.63 | 2.33 |

注:本基金本报告期末仅持有上述股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 12,360,765.00 | 15.99 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 29,857,428.90 | 38.63 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 9,517,600.50 | 12.31 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 51,735,794.40 | 66.94 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 122686 | 12白药债 | 100,000 | 10,220,000.00 | 13.22 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 73,600 | 7,588,160.00 | 9.82 |
| 3 | 122949 | 09常投债 | 75,690 | 7,565,972.40 | 9.79 |
| 4 | 110023 | 民生转债 | 50,000 | 5,290,500.00 | 6.85 |
| 5 | 122033 | 09富力债 | 44,000 | 4,483,600.00 | 5.80 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金本报告期投资的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,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 36,111.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 797,437.11 |
| 5 | 应收申购款 | 5,685,456.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,519,005.29 |

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 110023 | 民生转债 | 5,290,500.00 | 6.85 |
| 2 | 113003 | 重工转债 | 2,835,222.00 | 3.67 |
| 3 | 110015 | 石化转债 | 978,900.00 | 1.27 |
| 4 | 110022 | 同仁转债 | 412,978.50 | 0.53 |

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 诺安增利债券A | 诺安增利债券B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 46,583,266.40 | 5,242,395.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 92,949,942.77 | 9,750,089.62 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 76,685,173.33 | 9,851,542.97 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 62,848,035.84 | 5,140,941.66 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2013年7月6日发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》的公告,自2013年7月6日起,负责审计本基金基金财产的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安增利债券型证券投资基金募集的文件。

②《诺安增利债券型证券投资基金基金合同》。

③《诺安增利债券型证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安增利债券型证券投资基金2013年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安增利债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。

**诺安基金管理有限公司**
**2013年10月24日**

# 诺安成长股票型证券投资基金

## 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 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