诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1 基金产品情况

基金简称	诺安上证新兴产业ETF联接
交易代码	320014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月7日
报告期末基金份额总额	532,926,978.70份
投资目标	通过将绝大部分基金财产投资于上证新兴产业ETF,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为上证新兴产业ETF的联接基金,主要通过投资于上证新兴产业ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证新兴产业ETF或本基金日身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为上证新兴产业ETF的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月7日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年6月8日
基金管理人名称	诺安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

注:本基金上市交易的证券交易所为“上海证券交易所”,基金的二级市场交易简称为“新兴ETF”,基金的申购、赎回简称为“新兴申赎”,申购、赎回代码为“510261”。

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	本基金的标的指数是上证新兴产业指数。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金,混合基金;本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险,较高预期收益的品种。

§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	-5,960,350.71
2.本期利润	79,044,131.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1368
4.期末基金资产净值	431,707,634.69
5.期末基金份额净值	0.810

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。

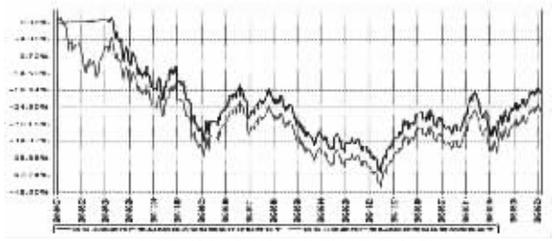
3.2 基金净值表现

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	19.82%	1.39%	20.48%	1.47%	-0.66%	-0.08%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利息(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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		
宋德舜	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。	2011年4月7日	-	6	经济学博士,具有基金从业资格,曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理,泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010年4月加入诺安基金管理有限公司,曾任诺安基金管理有限公司投资经理。2011年4月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年12月起任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《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,诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接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《诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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,公司设立公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,超过投资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

报告期内,本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的不同,本基金管理人在量化分析基础上,借助适当的组合优化模型,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

截止到报告期末,虽然以蓝筹为主的公司业绩没有明显的下降趋势,但是,在国际上QE3开始退出,国内流动性开始偏紧,经济结构必须调整的假设下,市场机会只能来自于下跌,所以,在坚持趋势的投资原则下,未来短期难见大的行情,仍将以防御为主,但是一旦政策变化导致出现趋势性投资机会,则要积极参与。

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0.810元。本报告期基金份额净值增长率为19.82%,同期业绩比较基准收益率为20.48%。

§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	1,089,628.75	0.25
	其中:股票	1,089,628.75	0.25
2	基金投资	402,776,000.00	93.06
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	28,837,464.20	6.66
7	其他资产	97,315.85	0.02
8	合计	432,800,408.80	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	1,089,628.75	0.25
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	1,089,628.75	0.25

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	601989	中国重工	135,400	825,940.00	0.19
2	600038	哈飞股份	7,500	193,050.00	0.04
3	600436	片仔癀	575	70,638.75	0.02

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

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投资股指期货。

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,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。

5.10.2 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	91,170.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,642.06
5	应收申购款	1,503.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,315.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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情况。

5.11.6 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	616,830,238.78
报告期期间基金总申购份额	1,325,892.37
减:报告期期间基金总赎回份额	85,229,152.45
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	532,926,978.70

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上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件。

②《诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。

③《诺安上证新兴产业交易型开放式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诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接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

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

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	诺安上证新兴产业ETF
交易代码	510260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月7日
报告期末基金份额总额	654,482,658.00份
投资目标	本基金的标的指数是上证新兴产业指数。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金;本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
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

注:本基金上市交易的证券交易所为“上海证券交易所”,基金的二级市场交易简称为“新兴ETF”,基金的申购、赎回简称为“新兴申赎”,申购、赎回代码为“510261”。

§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	3,734,023.07
2.本期利润	100,963,560.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.1414
4.期末基金资产净值	520,967,621.46
5.期末基金份额净值	0.796

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。

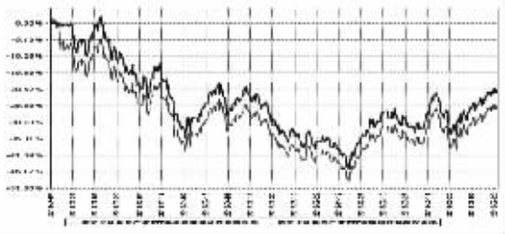
3.2 基金净值表现

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	21.16%	1.48%	21.61%	1.55%	-0.45%	-0.07%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率。

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3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		
宋德舜	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。	2011年4月7日	-	6	经济学博士,具有基金从业资格,曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理,泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010年4月加入诺安基金管理有限公司,曾任诺安基金管理有限公司投资经理。2011年4月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年12月起任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《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,诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接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《诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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,公司设立公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,超过投资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

报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的不同,这是因为在较小的最小申赎单位下,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。本基金管理人在量化分析基础上,借助适当的组合优化模型,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

截止到报告期末,虽然以蓝筹为主的公司业绩没有明显的下降趋势,但是,在国际上QE3开始退出,国内流动性开始偏紧,经济结构必须调整的假设下,市场机会只能来自于下跌,所以,在坚持趋势的投资原则下,未来短期难见大的行情,仍将以防御为主,但是一旦政策变化导致出现趋势性投资机会,则要积极参与。

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0.796元。本报告期基金份额净值增长率为21.16%,同期业绩比较基准收益率为21.61%。

§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	507,899,397.75	97.37
	其中:股票	507,899,397.75	97.37
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	13,694,360.09	2.63
6	其他资产	14,721.73	0.00
7	合计	521,608,479.57	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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	12,049,071.84	2.31
B	采矿业	19,978,439.46	3.83
C	制造业	378,150,193.76	72.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,481,225.76	3.93
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	77,240,466.93	14.83
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	507,899,397.75	97.49

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	603000	人民网	180,100	16,911,390.00	3.25
2	600804	鹏博士	754,900	13,995,846.00	2.69
3	600037	歌华有线	1,388,419	13,259,401.45	2.55
4	600588	用友软件	943,888	12,987,898.88	2.49
5	601989	中国重工	2,035,252	12,415,037.20	2.38
6	600267	海正药业	651,009	12,382,191.18	2.38
7	600089	特变电工	1,019,600	12,306,572.00	2.36
8	600108	亚盛集团	1,299,792	12,049,071.84	2.31
9	601929	吉视传媒	1,351,854	12,031,500.60	2.31
10	600537	亿晶光电	874,600	11,894,560.00	2.28

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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投资股指期货。

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,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。

5.10.2 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	12,253.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,468.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,721.73

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未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的情况。

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	756,982,658.00
报告期期间基金总申购份额	40,500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	143,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	654,482,658.00

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中国证监会批准上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件。

②《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《上证新兴产业交易型开放式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上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告正文。

⑥报告期内上证新兴产业交易型开放式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

诺安保本混合型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	诺安保本混合
交易代码	320015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月13日
报告期末基金份额总额	1,316,399,811.76份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术运作,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,通过安全资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)策略和时间不变性投资组合保险(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)策略,在未来三年保本周期中,对资产配置严格按照公司严发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报。 本基金的投资策略由四部分组成:资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	本基金保本周期是自基金合同生效日起三年,其流动性与银行三年期定期存款相似,因此本基金的业绩比较基准为:与保本期同期限的三年期银行定期存款税后收益率。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金保证人	中国投资担保有限公司

§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	32,106,709.33
2.本期利润	127,410,361.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0912
4.期末基金资产净值	1,529,431,916.27
5.期末基金份额净值	1.162

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	8.40%	0.43%	1.09%	0.01%	7.31%	0.42%

注:本基金的业绩比较基准:为与保本期同期限的三年期银行定期存款税