



Disclosure 信息披露

2013年10月24日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B104

诺安多策略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:招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。

基金管理人中国建银投资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预示其未来业绩,投资者有风险,投资存在由投资决策失误而导致基金亏损的风险。

本报告自2013年9月17日起至9月30日止。

基金名称	诺安多策略股票
交易代码	320016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月19日
报告期末基金份额总额	371,121,345.93份
投资目标	本基金主要通过量化手段优化投资策略,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于流动性化资产,股票、债券和现金,我们将以宏观、中观、微观三个层面和基本面、估值、技术分析、风险控制等因素,根据市场不同信号和行情情况灵活配置各类资产。
业绩比较基准	沪深300指数*75%+上证国债指数*25%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于较高风险、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	中国建银投资银行股份有限公司

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	-5,973,890.42
2.本期利润	51,662,742.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.1328
4.期末基金资产净值	339,711,886.15
5.期末基金份额净值	0.915

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要低于所列数字。						
2)本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益和其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金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	17.16%	1.01%	7.26%	1.07%	9.90%	-0.06%
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数*75%+上证国债指数*25%。						
3.2.2 本基金自成立以来的业绩比较基准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。				
4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限 (任职日期 离任日期)	证券从业年限	说明
杨谷	副总经理、投资总监、诺安多策略股票基金基金经理、诺安中证500指数基金基金经理、诺安中证800指数基金基金经理、诺安中证100指数基金基金经理	2013年4月13日 -	15	经济学硕士, CPA。具有基金从业资格。曾任教于中国人民大学,历任中国银河证券研究所研究员;2003年10月加入诺安基金管理有限公司,历任公司研究员、基金经理助理,并于2006年11月至2007年11月担任公司首席增长基金经理;投资资金是基金业绩,2006年12月担任基金经理,管理诺安多策略股票基金。2010年9月起担任上述多策略股票证券投资基金基金经理。2013年4月13日起任诺安多策略股票证券投资基金基金经理。

注:1)此基金业绩指标的统计期间为公司作出决定并对外公告之日。

2)证券从业年限从(证券从业从业人员资格管理办法)的相关规定起算。

3)基金经理杨谷自2013年4月13日起担任诺安多策略股票基金基金经理,此前由杨谷担任诺安多策略股票基金基金经理,自2013年4月13日起由杨谷担任诺安多策略股票基金基金经理。

报告期间,诺安多策略股票基金基金经理杨谷严格遵守了《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《诺安多策略股票证券投资基金合同》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、货币、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、研究支持、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。

4.3.2 研究支持、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,公司设立公平交易所有投资管理活动适用的证券池,在此基础上,不同投资组合根据投资目标、投资风格和投资策略的不同,建立不同投资组合的证券池,并在此基础上,不同投资组合根据投资目标、投资风格和投资策略的不同,建立不同投资组合的证券池,并在此基础上,不同投资组合根据投资目标、投资风格和投资策略的不同,建立不同投资组合的证券池。

4.3.3 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》,制度的范围包括境内上市股票、债券、货币、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、研究支持、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。

4.3.4 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、货币、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、研究支持、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。

5.1 报告期末基金资产组合情况		§5 投资组合报告	
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	282,417,928.58	81.82
	其中:股票	282,417,928.58	81.82
2	固定收益投资	21,734,238.19	6.30
	其中:债券	21,734,238.19	6.30
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

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

1.1 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。

基金管理人中国建银投资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预示其未来业绩,投资者有风险,投资存在由投资决策失误而导致基金亏损的风险。

本报告自2013年9月17日起至9月30日止。

基金名称	诺安油气能源股票(LOF-FOF)
交易代码	162208
基金运作方式	上市型契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年7月27日
报告期末基金份额总额	216,734,490.73份
投资目标	本基金主要投资于全球范围内优质的石油、天然气等能源行业股票,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于全球范围内优质的石油、天然气等能源行业股票,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证油气能源指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于较高风险、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	招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	8,293,480.53
2.本期利润	17,500,749.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0647
4.期末基金资产净值	225,196,384.28
5.期末基金份额净值	1.039

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要低于所列数字。						
2)本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益和其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金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	5.70%	0.70%	4.45%	0.71%	1.25%	-0.01%

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	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,471,796.14	10.86
7	其他资产	3,561,186.15	1.03
8	合计	345,185,149.06	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	172,575,109.72	50.80
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	36,996,545.81	10.87
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	24,652,467.84	7.26
J	金融业	12,083,000.00	3.56
K	房地产业	4,728,675.60	1.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,419,409.61	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	16,633,000.00	4.90
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	5,331,720.00	1.57
S	综合	5,058,000.00	1.49
T	合计	282,417,928.58	83.13

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	600887	伊利股份	720,000	32,169,600.00	9.47
2	002024	苏宁云商	1,700,000	21,845,000.00	6.43
3	600429	三元股份	2,063,554	18,571,986.00	5.47
4	300010	立讯精密	1,300,242	14,263,654.74	4.20
5	600309	万华化学	814,921	13,242,466.25	3.92
6	000069	华侨城A	2,050,000	11,890,000.00	3.50
7	000895	双汇发展	250,000	11,612,500.00	3.42
8	600597	光明乳业	420,000	9,907,800.00	2.92
9	600196	复星医药	430,000	5,972,700.00	1.76
10	002557	洽洽食品	236,129	5,270,399.28	1.55

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	-	-	-	
2	央行票据	-	-	-	
3	金融债券	-	-	-	
	其中:政策性金融债	-	-	-	
4	企业债券	-	-	-	
5	企业短期融资券	-	-	-	
6	中期票据	-	-	-	
7	可转债	21,734,238.19	6.40		
8	其他	-	-	-	
9	合计	21,734,238.19	6.40		
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量 (元)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	188,850	19,982,218.50	5.88
2	110020	南山转债	16,120	1,626,508.00	0.48
3	128002	东华转债	1,010	125,511.69	0.04

本基金本报告期末持有以下三证券：
5.1 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。
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.3 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.3.1 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.3.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.4 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.4.1 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.4.2 报告期内本基金投资的国债期货投资持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.5 报告期末本基金投资的国债期货投资持仓
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.6 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资产支持证券投资明细	
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	
5.12 投资组合报告期末基金资产净值	
5.13 投资组合报告期末基金资产净值	
5.14 投资组合报告期末基金资产净值	
5.15 投资组合报告期末基金资产净值	
5.16 投资组合报告期末基金资产净值	
5.17 投资组合报告期末基金资产净值	
5.18 投资组合报告期末基金资产净值	
5.19 投资组合报告期末基金资产净值	
5.20 投资组合报告期末基金资产净值	
5.21 投资组合报告期末基金资产净值	
5.22 投资组合报告期末基金资产净值	
5.23 投资组合报告期末基金资产净值	
5.24 投资组合报告期末基金资产净值	
5.25 投资组合报告期末基金资产净值	
5.26 投资组合报告期末基金资产净值	
5.27 投资组合报告期末基金资产净值	
5.28 投资组合报告期末基金资产净值	
5.29 投资组合报告期末基金资产净值	
5.30 投资组合报告期末基金资产净值	
5.31 投资组合报告期末基金资产净值	
5.32 投资组合报告期末基金资产净值	
5.33 投资组合报告期末基金资产净值	
5.34 投资组合报告期末基金资产净值	
5.35 投资组合报告期末基金资产净值	
5.36 投资组合报告期末基金资产净值	
5.37 投资组合报告期末基金资产净值	
5.38 投资组合报告期末基金资产净值	
5.39 投资组合报告期末基金资产净值	
5.40 投资组合报告期末基金资产净值	
5.41 投资组合报告期末基金资产净值	
5.42 投资组合报告期末基金资产净值	
5.43 投资组合报告期末基金资产净值	
5.44 投资组合报告期末基金资产净值	
5.45 投资组合报告期末基金资产净值	
5.46 投资组合报告期末基金资产净值	
5.47 投资组合报告期末基金资产净值	
5.48 投资组合报告期末基金资产净值	
5.49 投资组合报告期末基金资产净值	
5.50 投资组合报告期末基金资产净值	
5.51 投资组合报告期末基金资产净值	
5.52 投资组合报告期末基金资产净值	
5.53 投资组合报告期末基金资产净值	
5.54 投资组合报告期末基金资产净值	
5.55 投资组合报告期末基金资产净值	
5.56 投资组合报告期末基金资产净值	
5.57 投资组合报告期末基金资产净值	
5.58 投资组合报告期末基金资产净值	
5.59 投资组合报告期末基金资产净值	
5.60 投资组合报告期末基金资产净值	
5.61 投资组合报告期末基金资产净值	
5.62 投资组合报告期末基金资产净值	
5.63 投资组合报告期末基金资产净值	
5.64 投资组合报告期末基金资产净值	
5.65 投资组合报告期末基金资产净值	
5.66 投资组合报告期末基金资产净值	
5.67 投资组合报告期末基金资产净值	
5.68 投资组合报告期末基金资产净值	
5.69 投资组合报告期末基金资产净值	
5.70 投资组合报告期末基金资产净值	
5.71 投资组合报告期末基金资产净值	
5.72 投资组合报告期末基金资产净值	
5.73 投资组合报告期末基金资产净值	
5.74 投资组合报告期末基金资产净值	
5.75 投资组合报告期末基金资产净值	
5.76 投资组合报告期末基金资产净值	
5.77 投资组合报告期末基金资产净值	
5.78 投资组合报告期末基金资产净值	
5.79 投资组合报告期末基金资产净值	
5.80 投资组合报告期末基金资产净值	
5.81 投资组合报告期末基金资产净值	
5.82 投资组合报告期末基金资产净值	
5.83 投资组合报告期末基金资产净值	
5.84 投资组合报告期末基金资产净值	
5.85 投资组合报告期末基金资产净值	
5.86 投资组合报告期末基金资产净值	
5.87 投资组合报告期末基金资产净值	
5.88 投资组合报告期末基金资产净值	
5.89 投资组合报告期末基金资产净值	
5.90 投资组合报告期末基金资产净值	
5.91 投资组合报告期末基金资产净值	
5.92 投资组合报告期末基金资产净值	
5.93 投资组合报告期末基金资产净值	
5.94 投资组合报告期末基金资产净值	
5.95 投资组合报告期末基金资产净值	
5.96 投资组合报告期末基金资产净值	
5.97 投资组合报告期末基金资产净值	
5.98 投资组合报告期末基金资产净值	
5.99 投资组合报告期末基金资产净值	
6.00 投资组合报告期末基金资产净值	

6.1 投资组合报告期末基金资产净值	
6.2 投资组合报告期末基金资产净值	
6.3 投资组合报告期末基金资产净值	
6.4 投资组合报告期末基金资产净值	
6.5 投资组合报告期末基金资产净值	
6.6 投资组合报告期末基金资产净值	
6.7 投资组合报告期末基金资产净值	
6.8 投资组合报告期末基金资产净值	
6.9 投资组合报告期末基金资产净值	
6.10 投资组合报告期末基金资产净值	
6.11 投资组合报告期末基金资产净值	
6.12 投资组合报告期末基金资产净值	
6.13 投资组合报告期末基金资产净值	
6.14 投资组合报告期末基金资产净值	
6.15 投资组合报告期末基金资产净值	
6.16 投资组合报告期末基金资产净值	
6.17 投资组合报告期末基金资产净值	
6.18 投资组合报告期末基金资产净值	
6.19 投资组合报告期末基金资产净值	
6.20 投资组合报告期末基金资产净值	
6.21 投资组合报告期末基金资产净值	
6.22 投资组合报告期末基金资产净值	
6.23 投资组合报告期末基金资产净值	
6.24 投资组合报告期末基金资产净值	
6.25 投资组合报告期末基金资产净值	
6.26 投资组合报告期末基金资产净值	
6.27 投资组合报告期末基金资产净值	
6.28 投资组合报告期末基金资产净值	
6.29 投资组合报告期末基金资产净值	
6.30 投资组合报告期末基金资产净值	
6.31 投资组合报告期末基金资产净值	
6.32 投资组合报告期末基金资产净值	
6.33 投资组合报告期末基金资产净值	
6.34 投资组合报告期末基金资产净值	
6.35 投资组合报告期末基金资产净值	
6.36 投资组合报告期末基金资产净值	
6.37 投资组合报告期末基金资产净值	
6.38 投资组合报告期末基金资产净值	
6.39 投资组合报告期末基金资产净值	
6.40 投资组合报告期末基金资产净值	
6.41 投资组合报告期末基金资产净值	
6.42 投资组合报告期末基金资产净值	
6.43 投资组合报告期末基金资产净值	
6.44 投资组合报告期末基金资产净值	
6.45 投资组合报告期末基金资产净值	
6.46 投资组合报告期末基金资产净值	
6.47 投资组合报告期末基金资产净值	
6.48 投资组合报告期末基金资产净值	
6.49 投资组合报告期末基金资产净值	
6.50 投资组合报告期末基金资产净值	
6.51 投资组合报告期末基金资产净值	
6.52 投资组合报告期末基金资产净值	
6.53 投资组合报告期末基金资产净值	
6.54 投资组合报告期末基金资产净值	
6.55 投资组合报告期末基金资产净值	
6.56 投资组合报告期末基金资产净值	
6.57 投资组合报告期末基金资产净值	
6.58 投资组合报告期末基金资产净值	
6.59 投资组合报告期末基金资产净值	
6.60 投资组合报告期末基金资产净值	
6.61 投资组合报告期末基金资产净值	
6.62 投资组合报告期末基金资产净值	
6.63 投资组合报告期末基金资产净值	
6.64 投资组合报告期末基金资产净值	
6.65 投资组合报告期末基金资产净值	
6.66 投资组合报告期末基金资产净值	
6.67 投资组合报告期末基金资产净值	
6.68 投资组合报告期末基金资产净值	
6.69 投资组合报告期末基金资产净值	
6.70 投资组合报告期末基金资产净值	
6.71 投资组合报告期末基金资产净值	
6.72 投资组合报告期末基金资产净值	
6.73 投资组合报告期末基金资产净值	
6.74 投资组合报告期末基金资产净值	
6.75 投资组合报告期末基金资产净值	
6.76 投资组合报告期末基金资产净值	
6.77 投资组合报告期末基金资产净值	
6.78 投资组合报告期末基金资产净值	
6.79 投资组合报告期末基金资产净值	
6.80 投资组合报告期末基金资产净值	
6.81 投资组合报告期末基金资产净值	
6.82 投资组合报告期末基金资产净值	
6.83 投资组合报告期末基金资产净值	
6.84 投资组合报告期末基金资产净值	
6.85 投资组合报告期末基金资产净值	
6.86 投资组合报告期末基金资产净值	
6.87 投资组合报告期末基金资产净值	
6.88 投资组合报告期末基金资产净值	
6.89 投资组合报告期末基金资产净值	
6.90 投资组合报告期末基金资产净值	
6.91 投资组合报告期末基金资产净值	
6.92 投资组合报告期末基金资产净值	
6.93 投资组合报告期末基金资产净值	
6.94 投资组合报告期末基金资产净值	
6.95 投资组合报告期末基金资产净值	
6.96 投资组合报告期末基金资产净值	
6.97 投资组合报告期末基金资产净值	
6.98 投资组合报告期末基金资产净值	
6.99 投资组合报告期末基金资产净值	
7.00 投资组合报告期末基金资产净值	

诺安基金管理有限公司
2013年10月24日

诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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

The chart displays two data series over time from July 2017 to July 2020. The Y-axis represents the percentage of cumulative net value growth rate, ranging from -10.00% to 120.00% in increments of 10.00%. The X-axis shows monthly intervals with labels for each month (e.g., 2017年7月, 2017年8月, etc.). The top line, representing the fund's performance, starts at 0% in July 2017, rises to approximately 10% by September 2017, then fluctuates with a general upward trend, reaching about 100% by July 2020. The bottom line, representing the benchmark return rate, starts at 0% in July 2017, remains relatively flat until late 2017, then shows a steady decline, reaching approximately -10% by late 2018, and remains around -10% through July 2020.

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。