

诺安平衡证券投资基金

2014 第三季度报告

2014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:2014年10月24日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金资产净值不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。
本报告自2014年7月1日起至9月30日止。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	63,275,811.32	1.30
B	采矿业	30,857,262.31	0.63
C	制造业	1,792,727,134.95	35.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	282,110,844.24	5.79
K	建筑业	54,571,386.58	1.12
J	批发和零售业	256,334,444.95	5.26
G	交通运输、仓储和邮政业	44,192,066.10	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	658,788,153.01	13.51
J	金融业	503,404,912.62	10.32
K	房地产业	49,204,215.55	1.01
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	1,558,500.00	0.03
P	教育、体育、健康和休闲业	-	-
Q	慈善、文化、娱乐业	-	-
0	国防和军工	-	-
R	其他行业	56,241,471.60	1.13
S	综合	-	-
合计		3,740,267,363.27	76.70

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	600207	中国铝业	1,616,080	315,941,294.00	6.48
2	600750	宁德时代	6,655,441	286,853,041.38	5.78
3	600511	国药股份	9,193,923	247,506,724.85	5.03
4	600138	中国平安	4,638,300	191,664,042.00	3.98
5	002570	联益基金	1,022,466	185,067,204.14	3.80
6	601336	新华保险	7,296,227	178,611,628.96	3.66
7	600709	中信银行	10,000,000	162,300,000.00	3.33
8	600088	中国中免	1,500,000	157,000,000.00	3.24
9	600027	华鲁恒升	3,200,000	128,960,000.00	2.64
10	600423	青岛啤酒	3,700,000	126,945,000.00	2.64

5.4 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债券投资明细				
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	12国债07	-	-	-
2	12国债08	-	-	-
3	12国债09	-	-	-
4	12国债10	-	-	-
5	12国债11	-	-	-
6	12国债12	-	-	-
7	12国债13	-	-	-
8	12国债14	-	-	-
9	12国债15	-	-	-
10	12国债16	-	-	-

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资产支持证券明细					
序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	130243	13国债03	2,100,000	201,000,000.00	4.31
2	110418	11国债18	1,600,000	159,000,000.00	3.28
3	140404	14国债04	1,200,000	120,000,000.00	2.47
4	120301	12国债01	1,100,000	109,750,000.00	2.25
5	120302	12国债02	1,000,000	100,700,000.00	2.08

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五名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130903	13国债03	2,100,000	201,000,000.00	4.31
2	110418	11国债18	1,600,000	159,000,000.00	3.28
3	140404	14国债04	1,200,000	120,000,000.00	2.47
4	120301	12国债01	1,100,000	109,750,000.00	2.25
5	120302	12国债02	1,000,000	100,700,000.00	2.08

5.7 基金资产净值及基金份额净值	
项目	金额(元)
1 资产净值	1,190,681.51
2 负债	-
3 净资产	1,190,681.51
4 基金份额	30,168,696.16
5 基金份额净值	61.71, 80.73
6 基金份额累计净值	62.80

5.8 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.9 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.10 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.11 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.12 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.13 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.14 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.15 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.16 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.17 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.18 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.19 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.20 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.21 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,687,278.26	23.00
5	应收款项	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,428,193,528.96	100.00

5.22 投资组合报告			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,740,267,363.27	68.90
2	固定收益投资	3,740,267,363.27	68.90
3	衍生金融资产	1,248,687,278.26	23.00
4	买入返售金融资产	1,248,68	