



诺安先锋混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:2018年7月18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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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,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。

本报告期内基金未发生涉及基金财产的诉讼。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	诺安先锋混合型
交易代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月19日
报告期末基金份额总额	2,518,600,803.53
投资目标	以中国证监会规定的投资范围和资产配置为框架,灵活运用价值投资策略,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用深度价值投资策略,资产配置策略稳健。本基金允许将部分基金资产投资于科创板股票,科创板股票占本基金资产净值的比例不得超过10%。本基金管理人认为科创板股票具有较高投资价值,在符合科创板上市条件的前提下,本基金管理人将积极参与科创板股票投资,在科创板股票投资方面,本基金将适当多种投资策略,力求获得高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	沪深300价格指数×60%+中证全指综合指数×20%+中证红利指数×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险和收益水平高于债券基金,高于货币型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。
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:1.本基金自2018年1月1日起,“诺安先锋混合型证券投资基金”更名为“诺安先锋混合型证券投资基金”,基金合同相应修订,基金名称相应变更,“诺安先锋混合型证券投资基金”更名为“诺安先锋混合型证券投资基金”,基金合同相应修订,基金名称相应变更。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-179,807,729.69
2.本期利润	-238,698,676.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1034
4.期末基金份额净值	3.043,614,141.35
5.期末基金资产净值	7,662,128,282.25

注:上述基金业绩指标不包括持有人申购或赎回所产生的交易费用和基金管理人未实现的公允价值变动损益。本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,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。

§ 3.2 基金净值表现

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-0.48%	1.01%	-7.98%	0.91%	-1.60%	0.28%

注:本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

§ 3.3 基金业绩比较基准

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-0.48%	1.01%	-7.98%	0.91%	-1.60%	0.28%

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 投资组合报告

姓名	职务	任本基金的基本信息	任职起始日期	任职终止日期	说明
姓名	职务	任本基金的基本信息	任职起始日期	任职终止日期	说明

注:本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

§ 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	600661	中国石化	6,028,897	102,947,628.45	4.07
2	601318	中国平安	3,742,122	100,613,286.36	3.93
3	601666	兴业银行	3,508,700	95,523,500.00	3.68
4	601628	中国人寿	1,562,971	35,198,196.92	1.31
5	600285	海螺水泥	1,507,260	34,532,040.00	0.96
6	600019	宝钢股份	7,918,400	34,358,496.00	0.94
7	600802	海信电器	1,219,526	29,895,092.26	0.87
8	600900	青岛啤酒	1,750,804	27,580,096.26	0.87
9	600332	白云山	71,166	27,058,833.00	0.76
10	300418	聚龙股份	187,622	24,078,448.68	0.90

§ 5.2 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	中期票据(可交换债)	343,543,676.39	10.86
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	343,543,676.39	10.86

§ 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	127066	长江转债	487,448	17,528,278.08	0.56
2	127066	长江转债	154,987	15,134,485.55	0.48
3	127061	招商转债	149,893	13,037,778.11	0.41
4	128012	浦发转债	126,288	12,534,891.88	0.40
5	125015	招商转债	117,450	11,317,482.00	0.36

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人申购或赎回所产生的交易费用和基金管理人未实现的公允价值变动损益。本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,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。

注:2.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:3.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:4.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:5.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:6.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:7.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:8.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:9.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:10.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:11.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:12.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:13.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:14.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:15.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:16.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:17.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:18.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:19.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:20.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:21.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:22.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:23.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:24.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:25.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:26.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:27.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:28.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:29.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:30.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:31.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:32.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:33.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:34.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:35.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:36.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:37.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:38.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:39.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:40.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:41.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:2018年7月18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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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,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。

本报告期内基金未发生涉及基金财产的诉讼。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	诺安稳固收益一年定期开放债券型
交易代码	004235
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月21日
报告期末基金份额总额	303,424,171.49
投资目标	本基金投资于固定收益类资产,有效控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	1. 资产配置策略 在严格控制风险的前提下,本基金采取稳健的投资策略,在严格控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期增值。本基金投资于固定收益类资产,有效控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期增值。本基金投资于固定收益类资产,有效控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+一年期定期存款利率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于混合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

注:1.本基金自2018年1月1日起,“诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金”更名为“诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金”,基金合同相应修订,基金名称相应变更。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	8,274,919.73
2.本期利润	6,032.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0202
4.期末基金份额净值	316,727,613.75
5.期末基金资产净值	1,081

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人申购或赎回所产生的交易费用和基金管理人未实现的公允价值变动损益。本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,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。

注:2.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:3.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:4.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:5.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:6.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:7.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:8.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:9.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:10.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:11.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:12.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:13.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:14.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:15.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:16.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:17.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:18.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:19.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:20.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:21.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:22.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:23.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:24.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:25.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:26.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:27.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:28.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:29.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:30.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:31.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:32.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:33.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:34.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:35.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:36.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

注:37.本基金的投资组合为“80%×沪深300指数+20%×中证红利指数”。

利率变动表现。

2. 季度基金规模稳定,管理人增加了组合久