诺安全球500指数增强型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-04-19

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日：2019-04-19

重要提示

诺安基金管理有限公司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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等数据，基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行对基金托管人应负的责任。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	诺安全球500指数
交易代码	000216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010-01-22
报告期末基金份额总额	137,498,755.39
投资目标	本基金力图获得较高收益，在有效控制投资组合偏离风险的前提下，追求指数增强型投资收益，力争获得超越业绩比较基准的收益率。
投资策略	1、资产配置策略 本基金在股票投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过资产配置与行业配置两个层面，在全球范围内进行资产配置和行业配置，以获得超越基准收益率的收益。 本基金在股票投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响股票收益率的因素进行分析，在全球范围内进行股票的选择，以获得超越基准收益率的收益。 2、股票投资策略 本基金在股票投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响股票收益率的因素进行分析，在全球范围内进行股票的选择，以获得超越基准收益率的收益。 3、固定收益投资策略 本基金在固定收益投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响固定收益证券收益率的因素进行分析，在全球范围内进行固定收益证券的选择，以获得超越基准收益率的收益。 4、股指期货投资策略 本基金在股指期货投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响股指期货收益率的因素进行分析，在全球范围内进行股指期货的选择，以获得超越基准收益率的收益。 5、股票期权投资策略 本基金在股票期权投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响股票期权收益率的因素进行分析，在全球范围内进行股票期权的选择，以获得超越基准收益率的收益。 6、资产支持证券投资策略 本基金在资产支持证券投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响资产支持证券收益率的因素进行分析，在全球范围内进行资产支持证券的选择，以获得超越基准收益率的收益。 7、其他投资策略 本基金在其他投资部分采用全球指数增强型投资策略，本基金通过定量分析方法，对影响其他投资收益率的因素进行分析，在全球范围内进行其他投资的选择，以获得超越基准收益率的收益。
业绩比较基准	扣除费用后的MSCI World Index（净值）指数收益率×95%+银行活期存款税后利息×5%
风险收益特征	本基金为指数型股票基金，其风险收益特征应与标的指数所代表的证券市场的风险收益特征相一致。
基金托管人	中国银行股份有限公司

注：1、业绩比较基准中采用的银行活期存款税后利息，按照税后利息的5%计算。

主要财务指标

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
1.本期已实现收益	-1,179,179.79
2.本期利润	-5,795,148.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0040
4.期末基金资产净值	106,357,192.30
5.期末基金份额净值	0.8032

注：1、2、3、4、5 业绩指标表中的数字为报告期末数字。

4、5 期末基金资产净值、期末基金份额净值为报告期末数字。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及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
过去一个季度	-4.22 %	1.87 %	-3.87 %	1.72 %	-0.35 %	0.15 %

注：2、业绩比较基准收益率：扣除费用后的MSCI World Index（净值）×95%+银行活期存款税后利息×5%

诺安全球500指数增强型证券投资基金2019年1季度累计净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注：2、业绩比较基准收益率：扣除费用后的MSCI World Index（净值）×95%+银行活期存款税后利息×5%

诺安全球500指数增强型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注：2、业绩比较基准收益率：扣除费用后的MSCI World Index（净值）×95%+银行活期存款税后利息×5%

管理人对报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，基金运作合规，没有发生违反法律法规的行为。

对于报告期内管理情况的说明

公平交易制度的执行情况

报告期内我公司公平对待旗下所有投资组合，公司严格执行公平交易制度，本报告期内未发生违反公平交易制度的情况。

报告期内我公司公平对待旗下所有投资组合的投资决策及交易，在投资决策、交易执行、信息传递、业绩评估等方面，公司均采取公平对待的原则。公司投资决策委员会、投资决策小组、投资经理、交易员、风险管理人员、监察稽核人员等人员均参与公平交易制度的执行