# 诺安行业轮动混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

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：2019-07-18

## 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和连带责任。

基金托管人根据其所担责任范围以及相关法律规定，于2019年7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

## 基金基本情况

| 项目 | 内容 |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安行业轮动混合 |
| 交易代码 | 320011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011-08-31 |
| 报告期末基金份额总额 | 236,177,391.22 |
| 投资目标 | 深挖行业轮动机会，捕捉行业景气度，力争获取超额收益和资本增值。在股票选择上严格精选精配。 |
| 投资策略 | 诺安行业轮动混合型证券投资基金将在深入研究国民经济发展方向的基础上，根据宏观经济运行的周期性特征，对国民经济行业发展趋势作出前瞻性判断，根据行业轮动周期与经济周期的关系，分析国民经济各个行业的景气状况，在股票资产的配置上，根据行业轮动的规律，实施积极的资产配置，以期获取较高的收益。在股票选择上，根据国民经济发展的方向和原则，在不同国民经济周期阶段的国民经济发展方向，选择具有较大成长空间、具有较强竞争力、具有较高盈利能力的行业，以期获取较高的资本增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×75%+中证全债指数×25% |
| 风险收益特征 | 诺安行业轮动混合型证券投资基金属于较高风险、较高收益的证券投资基金品种，其长期风险和预期收益均高于债券型基金、货币市场基金等品种。 |
| 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 |

## 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2019-04-01 至 2019-06-30） |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -6,206,375.75 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0400 |
| 期末基金资产净值 | 201,320,202.1 |
| 期末基金份额净值 | 1.1207 |

注：1、注记表基金业绩指标不包括持有人交易费及赎回费等，以大额申购交易和交易费不计入的情况下。

2、业绩指标计算期间按基金本期开放日计。期间申购、赎回的，本期计入当日申购/赎回的份额计算期末份额净值。本期间内未有已实现收益，本期间内未有已实现收益。

## 基金净值表现

### 本期内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 | 业绩比较基准收益率② | 业绩比较基准收益率标准差③ | ①-② | ②-③ |
|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -3.47 % | -1.19 % | -0.39 % | -2.28 % | -0.80 % |

注：1、业绩比较基准=沪深300指数×75%+中证全债指数×25%，相当于，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中证全债指数收益率。

### 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1、业绩比较基准=沪深300指数×75%+中证全债指数×25%，相当于，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中证全债指数收益率。

诺安基金的管理人在本基金合同生效日的6个月内使投资组合达到基金合同规定的各项投资比例。

## 其他指标

单位：人民币元

| 其他指标 | 报告期（2019-04-01至2019-06-30） |
|---|---|
| 其他指标 | 0.00 |

## 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈飞扬 | 本基金基金经理。 | 2017-06-13 | - | 13 | 硕士，曾任职于华商基金管理有限公司，先后从事于基金研究、行业研究工作。2009年2月加入诺安基金管理有限公司，从事行业研究工作，现任诺安股票型基金经理、诺安行业轮动混合型证券投资基金经理、诺安中证500指数增强型证券投资基金经理。2010年5月起担任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。2011年8月起担任诺安平衡证券投资基金基金经理。2012年6月起担任诺安优势行业混合型证券投资基金基金经理。2013年12月起担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理。2015年12月起担任诺安新兴产业混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、首次基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限计算标准按照证券业从业人员年度考核相关规定执行。

## 管理人对报告期内本基金运作遵守合规性的说明

本报告期内，诺安行业轮动混合型证券投资基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、维护了基金持有人的利益。在投资决策方面，管理人制定了各项投资管理制度，本基金投资管理严格执行制度规定的程序。

## 公平交易专项说明

### 公平交易制度的执行情况

报告期内根据法律法规的规定，诺安基金管理有限公司公平交易制度等规定，本公司管理的所有投资组合（包括公募基金、社保基金、企业年金、特定客户资产管理计划、QDII证券投资基金、社保基金投资管理人投资组合、基本养老保险基金投资组合、企业年金基金投资组合、特定客户资产管理计划、QDII证券投资基金