

诺安成长股票证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009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
送出日期:2009年8月25日

重要提示
基金管理人及基金托管人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法律责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。本报告期内,基金管理人及基金托管人严格遵守法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,运用诚实信用原则,公平对待基金财产,保护基金份额持有人的合法权益,不存在任何违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人及基金托管人不存在任何违法违规行为,不存在损害基金份额持有人的合法权益,不存在任何违法违规行为,不存在损害基金份额持有人的合法权益。

本半年度报告所载摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中所列财务数据未经审计。
本报告自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

1.2 基金简介

基金名称	诺安成长股票
交易代码	320007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月10日
报告期末基金份额总额	709,002,414.54份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的企业,同时兼顾企业成长能力的可持续性,并对投资价值做出定量及定性分析,力图在享受企业成长溢价的同时保持长期稳定的回报。
部分构成	本基金具体的投资策略由资产配置、股票投资、债券投资和权证投资四部分构成: ① 资产配置方面,本基金采用长期资产配置 AAA 短期资产配置 TAA 相结合的方式进行。 ② 股票投资方面,本基金投资于成长性企业的不比例小于于本基金所持资产的 80%。 ③ 债券投资方面,本基金将采用利率预期策略、收益率曲线策略、收益增强型策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于债券市场平均水平的投资回报。 ④ 权证投资方面,本基金主要运用价值发现和价差策略,作为辅助性投资工具,本基金结合自身资产状况审慎投资,力争获得最佳风险调整后收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准由中证综合指数 A 股价格指数以及上证国债指数的复合指数构成: 80%×中证综合 A 股指数 + 20%×上证国债指数 如果今后法律法规发生变化,或者有更合理的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数,本基金将以相应中证综合指数基金更合适的业绩比较基准并及时公告。
风险收益特征	本基金为股票型基金,投资风险高于纯债型基金,属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 魏松云 联系电话: 0755-83026688 电子邮箱: info@noanfund.com.cn 客户服务热线: 400-888-8998	姓名: 魏松云 联系电话: 010-66105799 电子邮箱: custody@icbc.com.cn 客户服务热线: 010-66105798

2.4 信息披露方式

诺安基金半年度报告正文的互联网网址	www.noanfund.com
诺安基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 诺安基金管理有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年03月10日至2009年06月30日)
本期已实现收益	70,078,694.29
加权平均基金份额本期利润	173,791,532.74
加权平均基金份额本期净值	0.1666
本期基金份额净值增长率(%)	19.47
3.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额净值	0.0185
期末基金份额净值	803,625,686.82
期末基金份额持有人数	1,133

注:①上基金业绩指标不包括持有交易性金融资产公允价值变动损益,以及公允价值变动损益,且未扣除相关费用。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。
③期末可供分配利润是采用资产负债表中的未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
④本基金合同于 2009 年 3 月 10 日生效,截至 2009 年 6 月 30 日止,本基金成立未满一年。

3.2 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	13.68%	1.07%	9.11%	0.85%	4.57%	0.22%
过去三个月	17.71%	0.87%	18.33%	1.20%	-0.62%	-0.33%
自基金合同生效起至今	19.47%	0.78%	31.78%	1.20%	-12.31%	-0.42%

3.2.2 基金份额持有人以基金份额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

项目	本期
	2009年03月10日至2009年06月30日
当期应支付的基金管理费	5,001,529.97
其中:当期已支付	3,942,473.30
期末未支付	1,059,056.67

6.4 关联交易

6.4.1 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人
中国工商银行股份有限公司	托管人

6.4.2 关联交易政策

6.4.2.1 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.2 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.3 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.4 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.5 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.6 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.7 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.8 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.9 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.10 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.11 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.12 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.13 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.14 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.15 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.16 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.17 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.18 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.19 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.20 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.21 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.22 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.23 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.24 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.25 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.26 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.27 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.28 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.29 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.30 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.31 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.32 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.33 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.34 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.35 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.36 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

6.4.2.37 基金管理人运用基金买卖股票自 2009 年 9 月 19 日起,调整股票交易印花为单边征收方式,卖出股票按 1%征收,买入股票不征收。

单位:人民币元

资产	2009年06月30日
银行存款	110,446,629.83
结算备付金	4,959,367.05
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	690,680,043.36
其中:股票投资	690,680,043.36
债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
应收款项	9,317,668.27
预付款项	32,687.73
应收股利	964,233.00
应收利息	1,876,574.00
其他资产	0.00
资产总计	818,445,210.51

单位:人民币元

负债和所有者权益	2009年06月30日
负债:	
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付账款	10,728,266.41
应付利息	1,059,056.67
应付管理人报酬	176,508.78
应付托管费	2,163,911.60
应交税费	0.00
应付利息	0.00
其他负债	691,784.15
负债合计	14,819,523.69
所有者权益:	
实收基金	709,002,414.54
未分配利润	94,223,728.27
所有者权益合计	803,625,686.82
负债和所有者权益总计	818,445,210.51

注:报告期末于 2009 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.133 元,基金份额总额 709,002,414.54 份。

会计主体:诺安成长股票证券投资基金
本报告期:2009年03月10日至2009年06月30日

单位:人民币元

项目	本期
	2009年03月10日至2009年06月30日
-收入	184,327,467.97
1.利息收入	1,306,218.05
其中:存款利息收入	1,306,218.05
债券利息收入	0.00
资产支持证券利息收入	0.00
衍生金融工具收入	0.00
其他利息收入	0.00
2.投资收益(损失以“-”号填列)	78,431,630.74
其中:股票投资收益	75,084,560.90
债券投资收益	0.00
资产支持证券投资	0.00
衍生工具收益	0.00
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	3,247,606.98
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	103,712,408.43
4.其他收入(损失以“-”号填列)	876,700.88
-费用(以“-”号填列)	-10,535,935.18
1.管理人报酬	-5,001,529.97
2.托管费	-831,588.32
3.销售服务费	-
4.其他费用	-4,548,427.19
5.利息支出	0.00
其中:卖出回购金融资产支出	0.00
6.其他费用	-152,344.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	173,791,532.74

6.3 所有者权益变动表

6.3.1 所有者权益变动表

6.3.2 所有者权益变动表

6.3.3 所有者权益变动表

6.3.4 所有者权益变动表

6.3.5 所有者权益变动表

6.3.6 所有者权益变动表

6.3.7 所有者权益变动表

6.3.8 所有者权益变动表

6.3.9 所有者权益变动表

6.3.10 所有者权益变动表

6.3.11 所有者权益变动表

6.3.12 所有者权益变动表

6.3.13 所有者权益变动表

6.3.14 所有者权益变动表

6.3.15 所有者权益变动表

6.3.16 所有者权益变动表

6.3.17 所有者权益变动表

6.3.18 所有者权益变动表

6.3.19 所有者权益变动表

6.3.20 所有者权益变动表

6.3.21 所有者权益变动表

6.3.22 所有者权益变动表

6.3.23 所有者权益变动表

6.3.24 所有者权益变动表

6.3.25 所有者权益变动表

6.3.26 所有者权益变动表

6.3.27 所有者权益变动表

6.3.28 所有者权益变动表

6.3.29 所有者权益变动表

6.3.30 所有者权益变动表

6.3.31 所有者权益变动表

6.3.32 所有者权益变动表

6.3.33 所有者权益变动表

6.3.34 所有者权益变动表

6.3.35 所有者权益变动表

6.3.36 所有者权益变动表

6.3.37 所有者权益变动表

6.3.38 所有者权益变动表

6.3.39 所有者权益变动表

6.3.40 所有者权益变动表

6.3.41 所有者权益变动表

6.3.42 所有者权益变动表

6.3.43 所有者权益变动表

6.3.44 所有者权益变动表

6.3.45 所有者权益变动表

6.3.46 所有者权益变动表

6.3.47 所有者权益变动表

6.3.48 所有者权益变动表

6.3.49 所有者权益变动表

6.3.50 所有者权益变动表

6.3.51 所有者权益变动表

6.3.52 所有者权益变动表

6.3.53 所有者权益变动表

6.3.54 所有者权益变动表

6.3.55 所有者权益变动表

6.3.56 所有者权益变动表

6.3.57 所有者权益变动表

6.3.58 所有者权益变动表

单位:人民币元

资产	2009年06月30日
银行存款	110,446,629.83
结算备付金	4,959,367.05
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	690,680,043.36
其中:股票投资	690,680,043.36
债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
应收款项	9,317,668.27
预付款项	32,687.73
应收股利	964,233.00
应收利息	1,876,574.00
其他资产	0.00
资产总计	818,445,210.51

单位:人民币元