

诺安平衡证券投资基金 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

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。

基金管理人诺安基金管理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,基金管理人遵守法律法规,恪守基金合同,勤勉尽责,不存在任何违法违规行为,也未发生任何重大风险事件。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。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及其更新。

本年度报告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。

本报告自2009年7月1日起至2009年6月30日止。

1.2 基金基本情况
基金简称:诺安平衡混合
基金代码:320001

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年5月21日
报告期末基金份额总额:12,325,091,284.48份

2.1 基金产品说明
投资目标:在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超越业绩比较基准,即在承担与市场同等风险的情况下,取得高于市场平均水平的收益水平。

投资策略:本基金采取积极的投资策略,在类别资产配置层面,本基金关注市场情绪,在行业配置层面,本基金注重把握中国经济结构及消费结构变化的趋势。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:65%*沪深300指数+35%*上证国债指数。
风险收益特征:诺安平衡证券投资基金属于混合型基金,风险低于股票型基金,收益水平高于债券型基金。

2.2 基金管理人及基金托管人
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

2.3 主要会计数据和财务指标
3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

3.2 基金业绩表现
3.2.1 基金净值表现
3.2.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.3 主要财务指标和基金净值表现
3.3.1 期间数据和指标
3.3.2 期末数据和指标

3.4 基金管理人及基金托管人
3.4.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.4.2 基金管理人及基金托管人

3.5 基金业绩表现
3.5.1 基金净值表现
3.5.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.6 基金管理人及基金托管人
3.6.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.6.2 基金管理人及基金托管人

3.7 基金业绩表现
3.7.1 基金净值表现
3.7.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.8 基金管理人及基金托管人
3.8.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.8.2 基金管理人及基金托管人

3.9 基金业绩表现
3.9.1 基金净值表现
3.9.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.10 基金管理人及基金托管人
3.10.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.10.2 基金管理人及基金托管人

3.11 基金业绩表现
3.11.1 基金净值表现
3.11.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.12 基金管理人及基金托管人
3.12.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.12.2 基金管理人及基金托管人

3.13 基金业绩表现
3.13.1 基金净值表现
3.13.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.14 基金管理人及基金托管人
3.14.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.14.2 基金管理人及基金托管人

3.15 基金业绩表现
3.15.1 基金净值表现
3.15.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.16 基金管理人及基金托管人
3.16.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.16.2 基金管理人及基金托管人

3.17 基金业绩表现
3.17.1 基金净值表现
3.17.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.18 基金管理人及基金托管人
3.18.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.18.2 基金管理人及基金托管人

3.19 基金业绩表现
3.19.1 基金净值表现
3.19.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.20 基金管理人及基金托管人
3.20.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.20.2 基金管理人及基金托管人

3.21 基金业绩表现
3.21.1 基金净值表现
3.21.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.22 基金管理人及基金托管人
3.22.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.22.2 基金管理人及基金托管人

3.23 基金业绩表现
3.23.1 基金净值表现
3.23.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.24 基金管理人及基金托管人
3.24.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.24.2 基金管理人及基金托管人

3.25 基金业绩表现
3.25.1 基金净值表现
3.25.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.26 基金管理人及基金托管人
3.26.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.26.2 基金管理人及基金托管人

3.27 基金业绩表现
3.27.1 基金净值表现
3.27.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.28 基金管理人及基金托管人
3.28.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.28.2 基金管理人及基金托管人

3.29 基金业绩表现
3.29.1 基金净值表现
3.29.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.30 基金管理人及基金托管人
3.30.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.30.2 基金管理人及基金托管人

3.31 基金业绩表现
3.31.1 基金净值表现
3.31.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.32 基金管理人及基金托管人
3.32.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.32.2 基金管理人及基金托管人

3.33 基金业绩表现
3.33.1 基金净值表现
3.33.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.34 基金管理人及基金托管人
3.34.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.34.2 基金管理人及基金托管人

3.35 基金业绩表现
3.35.1 基金净值表现
3.35.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.36 基金管理人及基金托管人
3.36.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.36.2 基金管理人及基金托管人

3.37 基金业绩表现
3.37.1 基金净值表现
3.37.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.38 基金管理人及基金托管人
3.38.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.38.2 基金管理人及基金托管人

3.39 基金业绩表现
3.39.1 基金净值表现
3.39.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.40 基金管理人及基金托管人
3.40.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.40.2 基金管理人及基金托管人

3.41 基金业绩表现
3.41.1 基金净值表现
3.41.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.42 基金管理人及基金托管人
3.42.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.42.2 基金管理人及基金托管人

3.43 基金业绩表现
3.43.1 基金净值表现
3.43.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.44 基金管理人及基金托管人
3.44.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.44.2 基金管理人及基金托管人

3.45 基金业绩表现
3.45.1 基金净值表现
3.45.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.46 基金管理人及基金托管人
3.46.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.46.2 基金管理人及基金托管人

3.47 基金业绩表现
3.47.1 基金净值表现
3.47.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.48 基金管理人及基金托管人
3.48.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.48.2 基金管理人及基金托管人

3.49 基金业绩表现
3.49.1 基金净值表现
3.49.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.50 基金管理人及基金托管人
3.50.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.50.2 基金管理人及基金托管人

3.51 基金业绩表现
3.51.1 基金净值表现
3.51.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.52 基金管理人及基金托管人
3.52.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.52.2 基金管理人及基金托管人

3.53 基金业绩表现
3.53.1 基金净值表现
3.53.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.54 基金管理人及基金托管人
3.54.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.54.2 基金管理人及基金托管人

3.55 基金业绩表现
3.55.1 基金净值表现
3.55.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.56 基金管理人及基金托管人
3.56.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.56.2 基金管理人及基金托管人

3.57 基金业绩表现
3.57.1 基金净值表现
3.57.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.58 基金管理人及基金托管人
3.58.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.58.2 基金管理人及基金托管人

3.59 基金业绩表现
3.59.1 基金净值表现
3.59.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.60 基金管理人及基金托管人
3.60.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.60.2 基金管理人及基金托管人

3.61 基金业绩表现
3.61.1 基金净值表现
3.61.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.62 基金管理人及基金托管人
3.62.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.62.2 基金管理人及基金托管人

3.63 基金业绩表现
3.63.1 基金净值表现
3.63.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.64 基金管理人及基金托管人
3.64.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.64.2 基金管理人及基金托管人

3.65 基金业绩表现
3.65.1 基金净值表现
3.65.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.66 基金管理人及基金托管人
3.66.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.66.2 基金管理人及基金托管人

3.67 基金业绩表现
3.67.1 基金净值表现
3.67.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.68 基金管理人及基金托管人
3.68.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.68.2 基金管理人及基金托管人

3.69 基金业绩表现
3.69.1 基金净值表现
3.69.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.70 基金管理人及基金托管人
3.70.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.70.2 基金管理人及基金托管人

3.71 基金业绩表现
3.71.1 基金净值表现
3.71.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.72 基金管理人及基金托管人
3.72.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.72.2 基金管理人及基金托管人

3.73 基金业绩表现
3.73.1 基金净值表现
3.73.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.74 基金管理人及基金托管人
3.74.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.74.2 基金管理人及基金托管人

3.75 基金业绩表现
3.75.1 基金净值表现
3.75.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.76 基金管理人及基金托管人
3.76.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.76.2 基金管理人及基金托管人

3.77 基金业绩表现
3.77.1 基金净值表现
3.77.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.78 基金管理人及基金托管人
3.78.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.78.2 基金管理人及基金托管人

3.79 基金业绩表现
3.79.1 基金净值表现
3.79.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.80 基金管理人及基金托管人
3.80.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.80.2 基金管理人及基金托管人

3.81 基金业绩表现
3.81.1 基金净值表现
3.81.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.82 基金管理人及基金托管人
3.82.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.82.2 基金管理人及基金托管人

3.83 基金业绩表现
3.83.1 基金净值表现
3.83.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.84 基金管理人及基金托管人
3.84.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.84.2 基金管理人及基金托管人

3.85 基金业绩表现
3.85.1 基金净值表现
3.85.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.86 基金管理人及基金托管人
3.86.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.86.2 基金管理人及基金托管人

3.87 基金业绩表现
3.87.1 基金净值表现
3.87.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.88 基金管理人及基金托管人
3.88.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.88.2 基金管理人及基金托管人

3.89 基金业绩表现
3.89.1 基金净值表现
3.89.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.90 基金管理人及基金托管人
3.90.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.90.2 基金管理人及基金托管人

3.91 基金业绩表现
3.91.1 基金净值表现
3.91.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.92 基金管理人及基金托管人
3.92.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.92.2 基金管理人及基金托管人

3.93 基金业绩表现
3.93.1 基金净值表现
3.93.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.94 基金管理人及基金托管人
3.94.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.94.2 基金管理人及基金托管人

3.95 基金业绩表现
3.95.1 基金净值表现
3.95.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.96 基金管理人及基金托管人
3.96.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.96.2 基金管理人及基金托管人

3.97 基金业绩表现
3.97.1 基金净值表现
3.97.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.98 基金管理人及基金托管人
3.98.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.98.2 基金管理人及基金托管人

3.99 基金业绩表现
3.99.1 基金净值表现
3.99.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.100 基金管理人及基金托管人
3.100.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.100.2 基金管理人及基金托管人

3.101 基金业绩表现
3.101.1 基金净值表现
3.101.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.102 基金管理人及基金托管人
3.102.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.102.2 基金管理人及基金托管人

3.103 基金业绩表现
3.103.1 基金净值表现
3.103.2 基金合同生效以来基金业绩表现

3.104 基金管理人及基金托管人
3.104.1 基金管理人及其管理基金的经验
3.104.2 基金管理人及基金托管人

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵守法律、行政法规、基金合同及托管协议的说明
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

6.1 资产负债表
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年06月30日, 2008年12月31日, 2009年06月30日. Rows include assets, liabilities, and net assets.

6.2 利润表
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include income, expenses, and net profit.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include net assets and components.

6.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.2 会计政策变更的说明
6.4.3 会计估计变更的说明

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.5 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.6 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.7 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.8 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.9 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.10 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.11 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.12 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.13 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.14 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.15 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.16 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.17 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.18 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.19 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.20 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.21 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.22 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.23 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.24 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.25 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.26 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.27 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.28 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.29 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.30 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.31 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.32 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.33 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.34 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.35 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.36 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.37 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.38 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.39 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.40 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.41 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.42 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.43 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.44 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.45 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.46 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.47 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

A.基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*1.5%/当年天数
E为每日应支付的基金管理费

B.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法如下:
H=E*0.25%/当年天数
E为每日应支付的基金托管费

6.4.2.1 基金托管费
6.4.2.2 基金托管费

6.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.5 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.6 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.7 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.8 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.9 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.10 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至2008年06月30日, 2009年06月30日. Rows include bank interbank market transactions.

6.4.11 与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2009年01月01日至2009年06月30日, 2008年01月01日至20