华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2010年1月21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2010年1月18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。 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。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	475,395,402.01份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属两级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属两级基金的份额总额	255,881,307.06份	219,514,094.95份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	4,344,471.28	6,121,705.64
2.本期利润	6,026,206.12	8,165,044.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0311
4.期末基金资产净值	270,720,040.58	231,443,784.12
5.期末基金份额净值	1.0580	1.0543

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、华宝兴业增强收益债券A:

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3个月	2.98%	0.26%	-0.25%	0.05%	3.23%	0.21%

2、华宝兴业增强收益债券B:

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3个月	2.87%	0.26%	-0.25%	0.05%	3.12%	0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年2月17日至2009年12月31日)

1.华宝兴业增强收益债券A:

2.华宝兴业增强收益债券B:

注:1、本基金基金合同生效于2009年2月17日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。 2、按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2009年8月16日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾丽琼	本基金基金经理兼任华宝兴业现金宝货币基金基金经理	2009-2-18	-	8年	本科。曾在杭州市商业银行总行资金营运部从事流动性管理及债券交易,2004年9月加入本公司,任宝康债券基金、本基金经理助理,2007年2月任现金宝基金基金经理,2009年2月兼任增强收益基金基金经理。
牟旭东	本基金基金经理兼任华宝兴业多策略股票基金基金经理	2009-2-18	-	12年	硕士。1997年9月至2003年1月在南方证券有限公司从事证券研究工作,2003年1月加入本公司,任高级分析师,2004年9月起任研究部副总经理,2007年9月起任研究部总经理,2007年10月任多策略基金基金经理,2009年2月兼任增强收益基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。 本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

四季度债券收益率曲线总体震荡。前三季度持续增长的信贷投放、固定资产的快速增长,宏观经济向好的预期不断得到数据支持,10月大盘股IPO以及二级市场股指的一路走高,对债市资金面构成一定压力,当月中国债券总指数略微下探,收益率曲线略微向上平移;进入11月以后,经济复苏迹象更强,股市的继续上涨,债市延续10月份走势;进入12月份以来,受债券供需矛盾以及经济进一步复苏确立影响,债市继续略微调整,收益率曲线略微上行,目前调整走势仍在延续。

华宝兴业增强收益债券基金在四季度延续了前期整体投资思路即以债券防御、权益添利为主,基金业绩超越比较基准。固定收益部分投资策略偏保守,组合久期维持在较低水平,针对四季度企业债供需不平衡矛盾突出状况,本基金适时提高了信用债的配置比例,提升组合的利息收益;权益类资产配置方面,四季度市场呈现出典型的上涨行情,本基金投资一方面注重选择对组合的积极贡献,另一方面把握一定结构性机会,权益资产同样给基金带来了正回报;同时,本基金在控制整体锁定股票比例下,有选择性地积极参与网下申购,博取一二级差价,获得了良好收益。

展望2010年,我们维持前期的看法,认为随着翘尾因素的减弱以及大宗商品价格上涨传导的影响,CPI有望继续上涨。在目前供给缺口存在的背景下,我们认为出现全面通胀的基础并不牢固,通胀有远虑无近忧。货币政策方面,在管理层确认经济将持续复苏之前,货币政策总体基调应当不会发生变化。未来基于国内外良好经济形势及通胀上行,同时在来年债券供需矛盾短时间难以化解的情形下,收益率曲线仍会面临一定调整压力。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,457,554.76	10.98
	其中:股票	65,457,554.76	10.98
2	固定收益投资	403,587,728.20	67.71
	其中:债券	403,587,728.20	67.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	114,694,193.56	19.24
6	其他资产	12,330,945.78	2.07
7	合计	596,070,422.30	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	738,480.72	0.15
B	采掘业	-	-
C	制造业	38,121,863.80	7.59
C0	食品、饮料	4,030,982.33	0.80
C1	纺织、服装、皮毛	849,136.00	0.17
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	629,811.00	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,194,491.68	1.43
C5	电子	2,292,274.60	0.46
C6	金属、非金属	5,911,139.32	1.18
C7	机械、设备、仪表	12,027,622.07	2.40
C8	医药、生物制品	5,186,406.80	1.03
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	249,283.68	0.05
E	建筑业	402,838.38	0.08
F	交通运输、仓储业	5,211,199.76	1.04
G	信息技术业	6,441,554.19	1.28
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	2,805,000.00	0.56
J	房地产业	6,157,903.70	1.23
K	社会服务业	4,048,387.80	0.81
L	传播与文化产业	1,281,042.73	0.26
M	综合类	-	-
	合计	65,457,554.76	13.04

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	002001	新和成	119,999	5,867,951.10	1.17
2	600973	宝胜股份	249,926	4,973,527.40	0.99
3	600216	浙江医药	130,000	4,624,100.00	0.92
4	000418	小天鹅A	269,200	3,938,396.00	0.78
5	601111	中国国航	400,000	3,884,000.00	0.77
6	000655	金岭矿业	200,000	3,776,000.00	0.75
7	601299	中国北车	606,695	3,719,040.35	0.74
8	000528	柳工	160,301	3,483,340.73	0.69
9	600519	贵州茅台	20,000	3,396,400.00	0.68
10	000918	嘉凯城	199,994	3,209,903.70	0.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	56,612,831.40	11.27
2	央行票据	193,521,000.00	38.54
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	101,881,696.80	20.29
5	企业短期融资券	50,134,000.00	9.98
6	可转债	1,438,200.00	0.29
7	其他	-	-
8	合计	403,587,728.20	80.37

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801008	08央行票据08	1,000,000	102,550,000.00	20.42
2	010110	21国债(10)	489,240	50,044,359.60	9.97
3	0901063	09央行票据63	500,000	49,835,000.00	9.92
4	0801038	08央行票据38	400,000	41,136,000.00	8.19
5	126012	08上港债	260,000	25,350,000.00	5.05

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.2 本基金采取定量与定性相结合的个股精选策略,使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序,并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研,深入研究企业的基本面和长期发展前景,挑选出预期表现将超过大盘的个股,构建核心组合,没有特定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,156,930.35
5	应收申购款	3,924,015.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,330,945.78

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601299	中国北车	3,719,040.35	0.74	网下新股申购

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	211,378,192.72	311,574,149.31
报告期期间基金总申购份额	121,428,521.22	25,453,756.84
报告期期间基金总赎回份额	76,925,406.88	117,513,811.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	255,881,307.06	219,514,094.95

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;华宝兴业增强收益债券型证券投资基金托管协议;基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十一日

诺安中证100指数证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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:2010年1月21日

§1 重要提示

本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。

本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2010年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证复核内容的真实性、准确性和完整性,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。

本报告财务资料未经审计。

本基金于2009年10月27日成立,本报告期自2009年10月27日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安中证100指数
基金主代码	320010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月27日
报告期末基金份额总额	2,109,735,626.33份
投资目标	本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,以使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5% 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在履行适当程序后,变更业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,可获取资本市场平均收益率,其风险和预期收益均高于债券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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月27日至2009年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,741,242.30
2.本期利润	3,112,026.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015
4.期末基金资产净值	2,112,847,652.63
5.期末基金份额净值	1.001

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③本基金基金合同于2009年10月27日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	0.10%	1.06%	3.52%	1.65%	-3.42%	-0.59%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

注:本基金基金合同于2009年10月27日生效,截至2009年12月31日止,本基金成立未满1年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王坚	本基金的基金经理	2009年10月27日	-	6	清华大学会计学专业,CFA,具有基金从业资格。曾任长城证券研究所研究员、太平资产管理公司投资经理;2008年3月加入诺安基金管理有限公司,历任诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理,2009年10月起担任诺安中证100指数证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期为诺安中证100指数证券投资基金基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安中证100指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金于2009年10月27日成立,之后中证100指数实际处于宽幅震荡的格局之中,开于3355.01(10月27日),最低3240.87(12月22日),最高3578.53(12月07日),收于3506.17(12月31日)。涨幅为4.5%,振幅为10.4%;

在市场的宽幅震荡中,我们匀速建仓,在12月中旬将仓位加到90%,基本完成了建仓操作。

2010年1月份初将有一次集中成分股调整;另外市场经过这轮调整后,如果出现明显的回升趋势,我们会择机将仓位加到上限,完成建仓。

随着建仓的完成,控制跟踪误差在尽量小的范围将是我们投资管理的目标。我们将采用合理的指数交易策略和恰当的现金管理,来弥补成分股调整、申购赎回冲击以及管理成本等带来的负偏离。

4.1.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.001元。本报告期基金份额净值增长率为0.1%,业绩比较基准收益率为3.52%。本基金本报告期仍处于建仓期。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	1,896,653,814.99	89.63
	其中:股票	1,896,653,814.99	89.63
2	固定收益类投资	0.00	0.00
	其中:债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	219,345,658.61	10.37
6	其他资产	74,156.75	0.00
7	合计	2,116,073,630.35	100.00

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合(指数基金)

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	24,545.00	0.00
C0	食品、饮料	10,050.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,495.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	0.00	0.00
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	0.00	0.00
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	76,020.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	100,565.00	0.00

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合(指数基金)

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,067,820.98	0.86
B	采掘业	223,758,036.48	10.59
C	制造业	397,056,094.78	18.79
C0	食品、饮料	75,735,784.64	3.58
C1	纺织、服装、皮毛	8,118,345.00	0.38
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	15,258,025.31	0.72
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	143,102,081.68	6.77
C7	机械、设备、仪表	154,841,858.15	7.33
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	75,867,677.59	3.59
E	建筑业	30,056,149.40	1.42
F	交通运输、仓储业	95,241,777.23	4.51
G	信息技术业	51,361,422.38	2.43
H	批发和零售贸易	27,879,383.10	1.32
I	金融、保险业	867,875,371.98	41.08
J	房地产业	85,140,125.11	4.03
K	社会服务业	15,158,335.12	0.72
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	9,091,055.84	0.43
	合计	1,896,553,249.99	89.76

5.3.1 指数投资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	600036	招商银行	5,497,028	99,221,355.40	4.70
2	601328	交通银行	9,080,144	84,899,346.40	4.02
3	601318	中国平安	1,443,770	79,537,289.30	3.76
4	600016	民生银行	9,417,424	74,491,823.84	3.53
5	600030	中信证券	2,334,359	74,162,585.43	3.51
6	601166	兴业银行	1,795,627	72,381,724.37	3.43
7	601088	中国神华	1,653,228	57,565,398.96	2.72
8	600000	浦发银行	2,649,284	57,462,969.96	2.72
9	000002	万科A	4,819,531	52,099,130.11	2.47
10	601939	建设银行	7,682,075	47,552,044.25	2.25

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
2	300037	新宙邦	500	14,495.00	0.00
3	002329	皇氏乳业	500	10,050.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	0.00
2	应收证券清算款	29,175.90
3	应收股利	0.00
4	应收利息	44,980.85
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	74,156.75

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601117	中国化学	76,020.00	0.00	新发流通受限
2	300037	新宙邦	14,495.00	0.00	新发流通受限
3	002329	皇氏乳业	10,050.00	0.00	新发流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	2,109,735,626.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	0.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	2,109,735,626.33

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证100指数证券投资基金募集的文件。
②《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》。
③《诺安中证100指数证券投资基金托管协议》。
④基金管理人业务资格批件、营业执照。
⑤诺安中证100指数证券投资基金2009年第四季度报告正文。
⑥报告期内诺安中证100指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人客户服务中心电话:0755-83026888,或全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可登陆基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2010年1月21日

诺安货币市场基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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:2010年1月21日

§1 重要提示

本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。

本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2010年1月18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,保证复核内容的真实性、准确性和完整性,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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺安货币
基金主代码	320002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年12月6日
报告期末基金份额总额	3,000,062,352.43份
投资目标	确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况,判断短期利率的走势,进行自上而下的整体资产策略配置和资产组合配置;同时,根据定量和定性方法,在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金流动性高,风险低并且收益相对较为稳定。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月1日至2009年12月31日)
1.本期已实现收益	2,694,155.88
2.本期利润	2,694,155.88
3.期末基金资产净值	3,000,062,352.43

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.2678%	0.0004%	0.0907%	0.0000%	0.1771%	0.0004%

注:本基金收益分配是按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张乐赛	本基金的基金经理,诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。	2006年8月19日	-	5	毕业于南京财经大学金融学院,具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心;2004年12月加入诺安基金管理有限公司,2006年8月起担任诺安货币市场基金基金经理,2009年8月起担任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》等相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间,诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规,遵守了《诺安货币市场基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金继续坚持"确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益"的投资目标,始终将投资安全性与资产的流动性放在首位,在投资管理过程中严格控制投资与交易风险,注重资产的流动性管理,对基金资产进行了合理配置。

2009年四季度,本基金取得的投资回报,超过业绩比较基准,为持有人取得了良好的投资回报。期间,诺安货币市场基金资产保持了较强的流动性,保障了投资者随时申购、赎回的需求,突出体现了诺安货币市场基金作为投资者"现金管理工具"的本色。

在投资组合方面,本基金依旧以中央银行票据、短期金融债,以及高评级短期融资券为主要投资对象,并坚持对各投资品种进行分散投资。

2010年一季度,银行贷款增长将出现一个新的高峰,为了对此加以控制和调整,政府很有可能出台一些量化的货币政策,这将对债券短端收益率将产生压力,一年央行票据的发行利率有可能向上,准备金率也有上调的可能。此外新股仍然会不断发行,市场资金面也将受到一定的影响。本基金将继续注重跟踪分析宏观经济变化与货币政策趋向,根据短期债券市场形势变化,积极研究投资品种与投资机会,在保证基金投资安全、保障基金资产流动性的前提下,为持有人争取较好的投资回报,实现其"现金管理工具"的职能。

4.1.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金投资组合的剩余期限为33天,影子定价偏离度为正的0.0406%。本报告期基金份额净值收益率为0.2678%,同期业绩比较基准收益率为0.0907%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	519,004,679.46	17.29
	其中:债券	519,004,679.46	17.29
	资产支持证券	0.00	0.00
2	买入返售金融资产	1,692,724,696.96	56.39
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	512,421,246.51	17.07
3	银行存款和结算备付金合计	785,599,183.58	26.17
4	其他资产	4,334,614.79	0.14
5	合计	3,001,663,174.79	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.99	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	33
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

无。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	20.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	7.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—180天	6.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	180天(含)—397天(含)	3.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	99.92	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	179,881,204.36	6.00
	其中:政策性金融债	99,775,949.43	3.33
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	339,123,475.10	11.30
6	其他	0.00	0.00
7	合计	519,004,679.46	17.30
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.00	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	050603	05中行02浮	800,000	80,105,254.93	2.67
2	0981145	09华侨城CP01	500,000	50,064,464.88	1.67
3	0981079	09中水CP01	500,000	50,000,292.72	1.67
4	0981131	09鲁商CP01	500,000	49,970,958.48	1.67
5	050406	05农发06	500,000	49,902,602.85	1.66
6	050207	05国开07	500,000	49,873,346.58	1.66
7	0981088	09格力CP01	300,000	30,000,532.41	1.00
8	0981037	09鲁西CP01	200,000	20,019,576.12	0.67
9	0981113	09天业CP01	200,000	20,000,249.28	0.67
10	0981085	09西电CP01	200,000	20,000,175.01	0.67

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值(%)	0.14
报告期内偏离度的最低值(%)	0.04
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值(%)	0.10

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内不存在"持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券"的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	4,332,914.79
4	应收申购款	1,700.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
8	合计	4,334,614.79

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	943,843,806.33
本报告期基金总申购份额	3,240,798,072.56
减:本报告期基金总赎回份额	1,184,579,526.46
本报告期期末基金份额总额	3,000,062,352.43

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安货币市场基金募集的文件
②《诺安货币市场基金基金合同》。
③《诺安货币市场基金托管协议》。
④基金管理人业务资格批件、营业执照。
⑤诺安货币市场基金2009年第四季度报告正文。
⑥报告期内诺安货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人客户服务中心电话:0755-83026888,或全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可登陆基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2010年1月21日