诺安中证100指数证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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
送出日期:2011年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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2011年3月25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。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	1,754,637,724.39份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年10月27日至2009年12月31日
本期已实现收益	-131,279,163.29	-3,741,242.30
本期利润	-322,998,712.76	3,112,026.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1616	0.0015
本期基金份额净值增长率	-18.48%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1845	-0.0018
期末基金资产净值	1,430,987,201.20	2,112,847,652.63
期末基金份额净值	0.816	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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	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
过去三个月	5.15%	1.68%	5.27%	1.69%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	14.77%	1.47%	15.04%	1.46%	-0.27%	0.01%
过去一年	-18.48%	1.51%	-18.22%	1.50%	-0.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	-18.40%	1.44%	-15.35%	1.53%	-3.05%	-0.09%

注:本基金的业绩比较基准为:中证100指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: 2009年10月27日至2010年4月26日为本基金的建仓期,建仓期结束后本基金的各项资产配置比例均符合基金合同规定。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金基金合同于2009年10月27日生效,2009年本基金净值增长率按本基金实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2009年10月27日生效,截止2010年12月31日,本基金未进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]132号文批准,公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司,公司注册资本为1.5亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、紧急应变制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。截至2010年12月31日,公司共管理十一只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	-	7	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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年A股市场整体先抑后扬,上半年从年初开始即呈下跌走势,到7月份开始逐步走强,至11月份中有一定幅度回落。更显著的是,大小盘不同风格指数的表现差异巨大,中小板、创业板主导了2010年的A股市场。以中证100为代表的蓝筹股指数下跌19.28%;以中小盘指数则上涨了21.26%。

我们的基金以跟踪中证100指数为目的,作为标准的被动型指数基金,在投资运作中尽量的减小跟踪误差,因此从净值表现上讲,不如人意。

4.4.2报告期内基金业绩的表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.816元。本报告期基金份额净值增长率为-18.48%,业绩比较基准收益率为-18.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好以中证100为代表的蓝筹指数在2011年的表现。截至2011年2月20日,中证100指数在新的一年里相对中小盘、创业板指数走强约6%,我们认为这预示着一个新的开始。

相对而言,蓝筹股的流通市值较大,一般而言较难出现爆发性的行情,需要较长时间的酝酿。我们有理由相信,蓝筹指数在2011年将会有较好表现,有以下几个主要原因:

1)蓝筹股的绝对投资价值随着时间推移,不断增大。中证100指数按2010年的盈利估值为13倍,而目前预期2011年将有20%的利润增长,市盈率将下降到11倍。而且在经济平稳发展的大背景下,整体未来三年的利润增长保守估计有15%。

2)相对投资价值巨大,风格转换在2011年实现是大概率事件。2010年中小盘、创业板主导着市场。许多中小市值公司在今年实现了巨大的涨幅,而同期蓝筹板块还是下跌的。中小盘对蓝筹股的溢价率和持续时间已经创了历史记录。但这种不对称的市场风格已经累积了巨大的风格互换动力。中小板和创业板的继续扩容和利润增长低于预期的将会带来估值的临界点。目前中小板和创业板有548家上市企业(截止2012年2月20日),这两个板块今年估计会有300家企业上市。另外相对蓝筹股,整体增长率并没有表现出很大的优势。越来越多的主动型基金已经认识到2011年调仓的首选方向就是估值极低的金融等大蓝筹板块,这会触发中小盘对大盘股溢价率的回调。

3)经济形式和政策不断明朗,经济仍在相对平稳的发展,制约大盘蓝筹股的不确定因素减少。以中证100指数中权重较大的银行股为例,虽然存款准备金率不断提升等负面因素仍在,但随着在加息和信贷收紧,利差事实上的扩大已成不可逆转的趋势,因此银行股今年的利润增长有望大幅度超过市场预期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金2010年期末可分配利润为负值,根据基金合同规定,本基金本期不进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010年,本基金托管人在对诺安中证100指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年, 诺安中证100指数证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安中证100指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安中证100指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安中证100指数证券投资基金2010年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

利安达会计师事务所及其经办注册会计师门熹、陈静于2011年3月15日出具了利安达审字[2011]第1013号“无保留意见的审计报告”。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:诺安中证100指数证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	88,514,787.54	205,913,849.95
结算备付金	659,664.72	13,431,808.66
存出保证金	500,000.00	-
交易性金融资产	1,340,390,907.64	1,896,653,814.99
其中:股票投资	1,340,390,907.64	1,896,653,814.99
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	3,322,000.00	29,175.90
应收利息	19,377.92	44,980.85
应收股利	-	-
应收申购款	484,050.89	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,433,890,788.71	2,116,073,630.35
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	484,680.96	-
应付管理人报酬	984,178.42	1,319,813.44
应付托管费	196,835.68	263,962.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	886,053.60	1,592,201.56
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	351,838.85	50,000.00
负债合计	2,903,587.51	3,225,977.72
所有者权益:		
实收基金	1,754,637,724.39	2,109,735,626.33
未分配利润	-323,650,523.19	3,112,026.30
所有者权益合计	1,430,987,201.20	2,112,847,652.63
负债和所有者权益总计	1,433,890,788.71	2,116,073,630.35

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.816元,基金份额总额1,754,637,724.39份。

7.2利润表

会计主体:诺安中证100指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年10月27日(基金合同生效日)至2009年12月31日
一、收入	-303,654,174.90	8,464,006.53
1.利息收入	734,086.32	1,462,706.35
其中:存款利息收入	718,603.34	1,462,706.35
债券利息收入	15,482.98	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-114,750,431.53	52,020.00
其中:股票投资收益	-134,017,424.24	52,020.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,128,896.92	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	18,138,095.79	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-191,719,549.47	6,853,268.60
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,081,719.78	96,011.58
减:二、费用	19,344,537.86	5,351,980.23
1.管理人报酬	12,508,969.94	2,788,081.10
2.托管费	2,501,794.00	557,616.24
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,917,346.60	1,946,249.39
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	416,427.32	60,033.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-322,998,712.76	3,112,026.30
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-322,998,712.76	3,112,026.30

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安中证100指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,109,735,626.33	3,112,026.30	2,112,847,652.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-322,998,712.76	-322,998,712.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-355,097,901.94	-3,763,836.73	-358,861,738.67
其中:1.基金申购款	1,548,551,547.36	-242,100,484.85	1,306,451,062.51
2.基金赎回款	-1,903,649,449.30	238,336,648.12	-1,665,312,801.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,754,637,724.39	-323,650,523.19	1,430,987,201.20

项目	上年度可比期间 2009年10月27日(基金合同生效日)至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,109,735,626.33	-	2,109,735,626.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,112,026.30	3,112,026.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,109,735,626.33	3,112,026.30	2,112,847,652.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4财务报表由下列负责人签署:

奥成文	薛有为	薛有为
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4会计报表附注

7.4.1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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定,自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。因上述估值事项而进行的会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。

本基金所持有的股票中信证券(600030)自2010年4月20日起,采用指数收益法进行估值,此项会计估计变更对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币4,666,435.46元。根据中信证券复牌后的市场表现及基金的实际情况,经与基金托管人协商一致,于2010年5月5日起对该股票恢复采用市价估值方法进行估值。

本基金所持有的股票中国平安(601318)自2010年6月30日起,采用指数收益法进行估值,此项会计估计变更对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币2,927,120.36元。根据中国平安复牌后的市场表现及基金的实际情况,经与基金托管人协商一致,2010年9月2日起对该股票恢复采用市价估值方法进行估值。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
北京中关村科学城建设股份有限公司	管理人股东
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
中国中化股份有限公司	管理人股东母公司
中国中化集团公司	管理人股东最终控制方

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年10月27日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,508,969.94	2,788,081.10
其中:支付销售机构的客户维护费	2,256,472.07	184,539.77

注:A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.75%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年10月27日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,501,794.00	557,616.24

注:A. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年10月27日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	88,514,787.54	680,206.43	205,913,849.95	1,449,073.10

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-01-07	新发流通受限	5.99	5.99	6,000	35,940.00	35,940.00	-
002537	海立美达	2010-12-31	2011-01-10	新发流通受限	40.00	40.00	500	20,000.00	20,000.00	-

注:①可流通日以公告为准。

②本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限债券和权证。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无债券作为质押。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0.00元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,340,390,907.64	93.48
	其中:股票	1,340,390,907.64	93.48
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	89,174,452.26	6.22
6	其他各项资产	4,325,428.81	0.30
7	合计	1,433,890,788.71	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,470,630.03	0.66
B	采掘业	190,807,924.63	13.33
C	制造业	298,019,933.06	20.83
C0	食品、饮料	66,599,646.99	4.65
C1	纺织、服装、皮毛	4,790,156.28	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,291,728.40	0.65
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	73,470,001.86	5.13
C7	机械、设备、仪表	143,868,399.53	10.05
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	41,434,895.73	2.90
E	建筑业	42,847,771.46	2.99
F	交通运输、仓储业	47,712,585.68	3.33
G	信息技术业	36,577,699.70	2.56
H	批发和零售贸易	22,167,007.80	1.55
I	金融、保险业	586,880,248.43	41.01
J	房地产业	49,007,420.14	3.42
K	社会服务业	7,448,144.40	0.52
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,961,731.56	0.42
	合计	1,338,335,992.62	93.53

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	35,940.00	0.00
B	采掘业	-	-
C	制造业	81,100.00	0.01
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	81,100.00	0.01
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	1,937,875.02	0.14
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,054,915.02	0.14

8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,301,320	73,082,131.20	5.11
2	600036	招商银行	5,365,541	68,732,580.21	4.80
3	601328	交通银行	9,079,725	49,756,893.00	3.48
4	600016	民生银行	9,623,460	48,309,769.20	3.38
5	601166	兴业银行	1,767,310	42,503,805.50	2.97
6	600000	浦发银行	3,006,758	37,253,731.62	2.60
7	600030	中信证券	2,762,199	34,776,085.41	2.43
8	601939	建设银行	7,020,252	32,222,956.68	2.25
9	601088	中国神华	1,286,431	31,787,710.01	2.22
10	601601	中国太保	1,387,188	31,766,605.20	2.22

提示:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.lionfund.com.cn网站的年度报告正文。

8.3.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000046	泛海建设	215,799	1,937,875.02	0.14
2	601118	海南橡胶	6,000	35,940.00	0.00
3	601126	四方股份	1,000	31,110.00	0.00
4	002537	海立美达	500	20,000.00	0.00
5	002533	金杯电工	500	17,330.00	0.00

提示:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.lionfund.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	57,724,394.05	2.73
2	601318	中国平安	46,802,548.86	2.22
3	601328	交通银行	41,977,819.48	1.99
4	601166	兴业银行	36,166,009.64	1.71
5	600016	民生银行	35,320,047.10	1.67
6	601668	中国建筑	33,540,790.33	1.59
7	600000	浦发银行	31,096,240.38	1.47
8	600547	山东黄金	27,003,651.58	1.28
9	601601	中国太保	25,697,729.83	1.22
10	601899	紫金矿业	23,926,469.48	1.13
11	600030	中信证券	22,753,375.72	1.08
12	601939	建设银行	22,326,565.50	1.06
13	601288	农业银行	22,056,640.00	1.04
14	601088	中国神华	21,286,578.03	1.01
15	000002	万 科A	19,213,835.89	0.91
16	601988	中国银行	18,691,053.48	0.88
17	601169	北京银行	17,070,044.22	0.81
18	600489	中金黄金	16,958,682.14	0.80
19	000783	长江证券	16,880,130.67	0.80
20	601618	中国中冶	16,868,945.92	0.80

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	62,881,074.48	2.98
2	601318	中国平安	56,375,408.79	2.67
3	600016	民生银行	44,942,412.73	2.13
4	601328	交通银行	44,339,624.25	2.10
5	601166	兴业银行	41,060,580.38	1.94
6	600000	浦发银行	36,573,685.18	1.73
7	600030	中信证券	36,017,873.89	1.70
8	000002	万 科A	33,640,100.16	1.59
9	601088	中国神华	32,295,596.88	1.53
10	601601	中国太保	28,687,974.63	1.36
11	601939	建设银行	26,638,475.52	1.26
12	000858	五 粮 液	24,158,668.46	1.14
13	600519	贵州茅台	23,862,866.56	1.13
14	601169	北京银行	21,674,744.41	1.03
15	002024	苏宁电器	21,002,504.77	0.99
16	600900	长江电力	19,701,361.16	0.93
17	600837	海通证券	18,828,115.05	0.89
18	000001	深发展A	18,101,378.43	0.86
19	600547	山东黄金	17,891,736.05	0.85
20	601988	中国银行	17,686,456.92	0.84

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,131,419,903.64
卖出股票收入(成交)总额	1,361,925,037.28

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	3,322,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	19,377.92
5	应收申购款	484,050.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,325,428.81

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601118	海南橡胶	35,940.00	0.00	新发流通受限
2	002537	海立美达	20,000.00	0.00	新发流通受限

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,548	89,760.47	666,296,460.75	37.97%	1,088,341,263.64	62.03%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	247,448.49	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年10月27日)基金份额总额	2,109,735,626.33
本报告期期初基金份额总额	2,109,735,626.33
本报告期基金总申购份额	1,548,551,547.36
减:本报告期基金总赎回份额	1,903,649,449.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,754,637,724.39

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本年度未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人在本报告期内无重大人事变动。

经证监会审批,晏秋生任本基金托管人的资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。本年度应付未付给所聘任会计师事务所的审计费为10万元,其已提供审计服务的连续年限:2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
日信证券有限责任公司	1	924,828,252.81	37.60%	786,106.43	37.94%	-
新时代证券有限责任公司	1	89,990,164.69	3.66%	73,116.96	3.53%	-
东海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	1,040,229,191.01	42.29%	884,194.17	42.67%	-
国元证券股份有限公司	1	404,508,766.36	16.45%	328,666.43	15.86%	-

注:1、本报告期租用证券公司交易单元无变更情况。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

(1)实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3 亿元人民币。

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3)经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
日信证券有限责任公司	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-
东海证券有限责任公司	-	-
国都证券有限责任公司	25,503,379.90	100.00%
国元证券股份有限公司	-	-

注:本基金租用的证券公司交易单元本期无债券回购交易和权证交易。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998或客户服务中心电话:0755-83026888,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
2011年3月29日