诺安货币市场基金

2011 半年度 报告摘要

2011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：2011年8月25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2011年8月23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。

本半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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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	1,445,887,572.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性，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，风险低并且收益稳定。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	26,528,982.85
本期利润	26,528,982.85
本期净值收益率	1.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末基金资产净值	1,445,887,572.83
期末基金份额净值	1.0000

注：① 本基金的利润分配是按月结转份额。

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，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

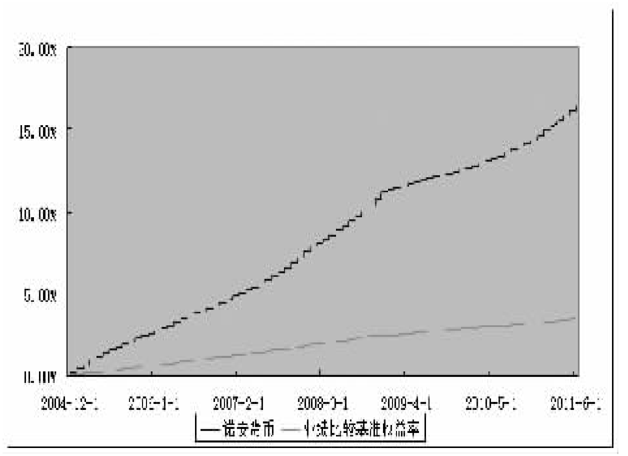
3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2822%	0.0016%	0.0411%	0.0000%	0.2411%	0.0016%
过去三个月	0.7912%	0.0022%	0.1233%	0.0001%	0.6679%	0.0021%
过去六个月	1.6406%	0.0026%	0.2176%	0.0002%	1.4230%	0.0024%
过去一年	2.7214%	0.0047%	0.3991%	0.0002%	2.3223%	0.0045%
过去三年	6.7268%	0.0065%	1.2562%	0.0003%	5.4706%	0.0062%
自基金合同生效起至今	16.4808%	0.0052%	3.4424%	0.0004%	13.0384%	0.0048%

注：①本基金的利润分配是按月结转份额。

② 本基金的业绩比较基准为：当期银行个人活期储蓄利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2011年6月30日，公司共管理十五只开放式基金：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、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金。

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		
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、诺安保本混合型证券投资基金的基金经理	2006年8月19日	-	6	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的基金经理，2009年8月起担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理，2011年5月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

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 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

2011年上半年面对居高不下的通胀，国家采取了一系列的紧缩措施，加息、上调存款准备金率频频出台。债券市场收益率高起，资金面紧张，回购利率大幅上升。流动性成了市场关注的焦点。面对如此环境，诺安货币市场基金继续坚持"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，压缩组合久期，对基金资产进行了合理配置。在投资组合方面，诺安货币市场基金依旧以中央银行票据、短期金融债、逆回购、定期存款以及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。

4.4.2 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92天，影子定价偏离度为正的0.0508%。本报告期基金份额净值收益率为1.6406%，同期业绩比较基准收益率为0.2176%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年下半年，通胀压力仍将继续，到4季度可能会出现好转，但预期也不能太乐观。资金面仍将呈现一种较为紧张的状态，资金利率维持高位。流动性管理依然是焦点。下一阶段，诺安货币市场基金将继续注重跟踪分析宏观经济变化与货币政策走向，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。

4.6 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

根据本基金基金合同约定，本基金收益"每日分配、按月支付"。本基金本期实现收益为26,528,982.85元，应分配利润26,528,982.85元，已实施利润分配26,528,982.85元。

本基金本期无应分配而尚未分配的利润情况。

§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

2011年上半年，本基金托管人在对诺安货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年，诺安货币市场基金的管理人--诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半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货币市场基金2011年半年度报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：诺安货币市场基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	426,979,451.14	27,473,730.66
结算备付金	-	1,789,090.91
存出保证金	-	-
交易性金融资产	791,961,615.40	762,291,239.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	791,961,615.40	762,291,239.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	194,830,852.25	629,301,978.95
应收证券清算款	-	-
应收利息	13,946,357.60	8,783,331.58
应收股利	-	-
应收申购款	20,982,744.02	2,100.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,448,701,020.41	1,429,641,471.82
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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	-	-
应付管理人报酬	441,677.79	407,722.53
应付托管费	133,841.80	123,552.26
应付销售服务费	334,604.40	308,880.76
应付交易费用	21,818.52	12,039.99
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	-	-
应付利润	1,266,081.46	1,060,124.81
递延所得税负债	-	-
其他负债	197,823.61	104,500.00
负债合计	2,813,447.58	2,434,420.35
所有者权益：		
实收基金	1,445,887,572.83	1,427,207,051.47
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,445,887,572.83	1,427,207,051.47
负债和所有者权益总计	1,448,701,020.41	1,429,641,471.82

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,445,887,572.83份。

6.2 利润表

会计主体：诺安货币市场基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入	32,583,707.52	12,773,217.76
1.利息收入	30,946,816.13	11,685,710.56
其中：存款利息收入	6,513,786.46	1,918,826.53
债券利息收入	11,187,931.48	5,838,445.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,245,098.19	3,928,438.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,636,891.39	1,087,507.20
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,636,891.39	1,087,507.20
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减：二、费用	6,054,724.67	4,360,399.28
1.管理人报酬	2,688,019.63	1,920,459.97
2.托管费	814,551.48	581,957.60
3.销售服务费	2,036,378.44	1,454,893.94
4.交易费用	-	-
5.利息支出	289,758.61	174,665.79
其中：卖出回购金融资产支出	289,758.61	174,665.79
6.其他费用	226,016.51	228,421.98
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	26,528,982.85	8,412,818.48
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	26,528,982.85	8,412,818.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安货币市场基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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)	1,427,207,051.47	-	1,427,207,051.47	3,000,062,352.43	-	3,000,062,352.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,528,982.85	26,528,982.85	-	8,412,818.48	8,412,818.48
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)	18,680,521.36	-	18,680,521.36	-2,151,783,059.39	-	-2,151,783,059.39
其中：1.基金申购款	4,854,144,480.04	-	4,854,144,480.04	2,398,033,449.50	-	2,398,033,449.50
2.基金赎回款	-4,835,463,958.68	-	-4,835,463,958.68	-4,549,816,508.89	-	-4,549,816,508.89
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)	-	-26,528,982.85	-26,528,982.85	-	-8,412,818.48	-8,412,818.48
五、期末所有者权益(基金净值)	1,445,887,572.83	-	1,445,887,572.83	848,279,293.04	-	848,279,293.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4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

6.4 报表附注

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

本基金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一致。

6.4.2差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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。

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,688,019.63	1,920,459.97
其中：支付销售机构的客户维护费	155,231.60	132,708.41

注：A.基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×0.33%/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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	814,551.48	581,957.60

注：A.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%/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。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,370,683.40
中国工商银行股份有限公司(托管人)	236,738.94
合计	1,607,422.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	914,518.99
中国工商银行股份有限公司(托管人)	214,596.73
合计	1,129,115.72

注：A. 基金销售服务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

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

B. 基金销售服务费每日计算，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销售机构。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日 债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	20,002,508.20	50,587,355.62	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	19,959,800.82	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市捷隆投资有限公司	216,009,920.44	14.94%	-	-

6.4.4.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	26,979,451.14	76,435.27	2,233,575.42	64,200.65

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 其他关联事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.5 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发而形成的流通受限证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年6月30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，无债券作为抵押。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年6月30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。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	791,961,615.40	54.67
	其中：债券	791,961,615.40	54.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	194,830,852.25	13.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	426,979,451.14	29.47
4	其他各项资产	34,929,101.62	2.41
5	合计	1,448,701,020.41	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	0.94	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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个交易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%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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

无。

7.3.2 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	25.73	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.94	0.00
2	30天(含)—60天	23.52	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	19.48	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.57	0.00
4	90天(含)—180天	13.83	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	15.22	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	97.78	0.00

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	49,913,464.01	3.45
3	金融债券	179,963,472.76	12.45
	其中：政策性金融债	179,963,472.76	12.45
4	企业债券	102,054,166.81	7.06
5	企业短期融资券	460,030,511.82	31.82
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	791,961,615.40	54.77
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	151,970,878.30	10.51

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	100226	10国开26	800,000	79,987,848.16	5.53
2	078058	07华谊债	500,000	51,653,776.17	3.57
3	058017	05首都机场债	500,000	50,400,390.64	3.49
4	080414	08农发14	500,000	50,058,913.11	3.46
5	110221	11国开21	500,000	49,916,711.49	3.45
6	1101025	11央行票据25	500,000	49,913,464.01	3.45
7	1181279	11北营钢CP01	400,000	40,001,321.85	2.77
8	1081439	10建发集CP02	300,000	30,000,495.52	2.07
9	1081396	10珠海港CP01	200,000	20,009,460.06	1.38
10	1181290	11岳阳CP01	200,000	20,006,515.64	1.38

7.6 "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	-
报告期内偏离度的最高值	0.20%
报告期内偏离度的最低值	-0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1基金计价方法说明

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。

7.8.2 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。

7.8.3 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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,946,357.60
4	应收申购款	20,982,744.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,929,101.62

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
7,281	198,583.65	1,207,469,719.79	83.51%	238,417,853.04	16.49%

8.2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	2,504,395.28	0.17%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年12月6日)基金份额总额	1,573,598,040.62
本报告期期初基金份额总额	1,427,207,051.47
本报告期基金总申购份额	4,854,144,480.04
减：本报告期基金总赎回份额	4,835,463,958.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,445,887,572.83

注：总申购含红利再投、转换入份额，总赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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。

10.2 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

本基金基金管理人、托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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		应支付该券商的佣金		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	
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金租用证券公司交易单元没有进行股票投资。

2、本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

3、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席位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》。

10.7.2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

卷商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券股份有限公司	930,000,000.00	100.00%

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无债券交易和权证交易。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

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，亦可至基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2011年8月25日