

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

1.1 重要提示

基金管理人、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。

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信为本,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。投资者有风险,投资需谨慎。

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。本报告中所列数据未经审计。

本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

2.2 基金资产说明

投资目标:通过具备良好成长潜力及合理估值水平的小市值股票的投资,在有效控制组合风险的基础上,力图实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金的投资策略分为四部分:资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及权证投资策略。

资产配置策略:本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,动态进行短期资产配置调整,力争通过时机选择达到在承受一定风险的前提下获取超额收益的资产组合。

股票投资策略:本基金的股票投资策略分三步进行。首先是确定本基金股票池,其次是进行个股基本面鉴别,最后是股票组合最终确认。

债券投资策略:本基金的债券投资组合部分采用稳健的投资策略,具体包括利率预期策略、久期策略、期限配置策略、行业配置策略、溢价分析策略、Yield spread analysis以及个券估值策略、Valuation analysis等。

权证投资策略:本基金的权证投资部分主要运用的投资策略包括:价值发现策略、价差策略、作为辅助性投资工具,本基金将结合自身资产状况审慎投资于权证资产,力争获得最佳风险调整后收益。

业绩比较基准:60%×天相中盘指数+40%×天相小盘指数×80%+20%×中证全指指数

风险收益特征:本基金为股票型基金,预期风险和收益都处于较高水平。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Includes contact information for 诺安基金管理有限公司 and 中国工商银行股份有限公司.

2.4 信息披露方式

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
信息披露网址:www.noanfund.com

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(2011年1月1日至2011年6月30日)

本期已实现收益:40,823,427.41
本期利润:-113,793,477.11

加权平均基金份额本期利润:-0.0632
本期基金份额净值增长率:-1.91%

3.1.2 期末数据和指标:报告期末(2011年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:0.1797
期末基金份额净值:2,725,316,061.14

期末基金份额净值:1.180

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。

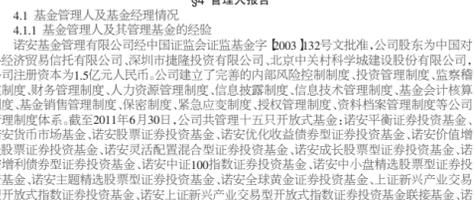
3.2 基金净值表现

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

Table with 6 columns: 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. Includes data for 1M, 3M, 6M, 1Y, and since inception.

注:本基金的业绩比较基准为:60%×天相中盘指数+40%×天相小盘指数×80%+20%×中证全指指数。

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:本基金的建仓期为2010年4月28日至2010年10月27日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至2011年6月30日止,本基金建仓期结束未满1年。

4.1 基金管理人及基金基本情况

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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.2 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.3 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.4 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.5 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.6 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.7 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.8 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.9 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.10 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.11 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.12 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.13 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.14 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.15 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.16 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.17 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.18 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.19 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.20 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.21 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

4.1.22 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、深圳市地隆投资有限公司、北京中关村科技园区建设股份有限公司,公司注册资本本为1.5亿元人民币。

诺安中小盘精选股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

报告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

基金管理人公司负责人 主管会计工作负责人
基金管理人公司负责人 主管会计工作负责人

6.1 本报告期末采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明
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。

6.2 差错更正的说明
本基金本报告期无差错更正。

6.3 关联方关系
6.3.1 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
本基金本报告期不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。

6.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Lists 诺安基金管理有限公司 and 中国工商银行股份有限公司 as related parties.

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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.1.1 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。

6.4.1.2 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。

6.4.1.3 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支付关联方的佣金。

6.4.2 关联方报酬
6.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Shows management fees for 2011 and 2010.

注:A. 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:
H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
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日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.2.2 托管费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Shows custody fees for 2011 and 2010.

注:A. 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费
E为前一日基金资产净值
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日内从基金资产中一次性支取。

6.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 回购/ 交易
本基金于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 回购/ 交易。

6.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Shows investment by the manager for 2011 and 2010.

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.4.2 本报告期除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.5 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

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Shows interest income for 2011 and 2010.

6.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金在承销期内未参与关联方承销证券的情况。

6.4.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.8 期末持有的流通受限证券
6.4.8.1 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/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
单位:人民币元

Table with 10 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值单价, 复牌日期, 复牌开盘价, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额, 备注. Lists 000759 and 000876.

注:自2011年5月23日起,中百集团 000759 采用指数收益法进行估值,截至2011年6月30日,中百集团 000759 尚未发布复牌公告。

6.4.8.3 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余额为0.00元,无债券作为质押。

6.4.8.4 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余额为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。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
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基金持有的非停牌股票进行估值。

本基金所持有的股票中中百集团 000759 自2011年5月23日起,采用指数收益法进行估值,对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币3,064,334.24元,对本报告期净利润及净值的影响为减少人民币4,631,323.98元。截至2011年6月30日,中百集团尚未发布复牌公告。

本基金所持有的股票中中百集团 000759 自2011年5月23日起,采用指数收益法进行估值,对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币3,064,334.24元,对本报告期净利润及净值的影响为减少人民币4,631,323.98元。截至2011年6月30日,中百集团尚未发布复牌公告。

7.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额. Shows asset composition for 2011.

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.3 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
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

7.4.2 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

Table with 5 columns: 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(%)

7.4.3 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

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows buy and sell totals for 2011.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Shows other assets for 2011.

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额

8.2 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额数量, 占基金总份额比例

8.3 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日, 基金份额总额. Shows share changes for 2011.

注:①此处林健标先生的任职日期为诺安中小盘精选股票型证券投资基金基金合同的生效之日;②林健标先生的离任日期和周心鹏先生的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日;③“任职”的含义遵从《证券业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,诺安中小盘精选股票型证券投资基金管理人严格遵守《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《诺安中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了《本公司管理期间,本基金投资管理未发生违法违规行为》。

4.3 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待持有不同基金和组合,并根据《证券投资基金管理人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,并通过系统和技术手段在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期末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 报告期内基金投资策略和运作分析
在报告期内,本基金保持了相对较高的仓位,换手率相对较低,行业配置上较为侧重权重行业与农业,同时适当配置了部分自下而上的选择中小市值个股。

从报告期内运行情况来看,所选持有的个股获得了一定超额收益,对权重行业的配置也在一定程度上获得了相对收益,但是,由于对市场的波动幅度估计不足,报告期内的操作不够灵活,未能充分利用市场波动带来的波段收益。

4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.180元,本报告期基金份额净值增长率为-1.91%,同期业绩比较基准收益率为-3.50%。

7.3 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

Table with 5 columns: 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(%)

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.noanfund.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

7.4.2 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

Table with 5 columns: 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(%)

7.4.3 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

Table with 2 columns: 项目, 金额. Shows buy and sell totals for 2011.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Shows other assets for 2011.

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额

8.2 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额数量, 占基金总份额比例

8.3 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日, 基金份额总额. Shows share changes for 2011.

注:①此处林健标先生的任职日期为诺安中小盘精选股票型证券投资基金基金合同的生效之日;②林健标先生的离任日期和周心鹏先生的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日;③“任职”的含义遵从《证券业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,诺安中小盘精选股票型证券投资基金管理人严格遵守《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《诺安中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了《本公司管理期间,本基金投资管理未发生违法违规行为》。

4.3 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待持有不同基金和组合,并根据《证券投资基金管理人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,并通过系统和技术手段在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期末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 报告期内基金投资策略和运作分析
在报告期内,本基金保持了相对较高的仓位,换手率相对较低,行业配置上较为侧重权重行业与农业,同时适当配置了部分自下而上的选择中小市值个股。

从报告期内运行情况来看,所选持有的个股获得了一定超额收益,对权重行业的配置也在一定程度上获得了相对收益,但是,由于对市场的波动幅度估计不足,报告期内的操作不够灵活,未能充分利用市场波动带来的波段收益。

4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.180元,本报告期基金份额净值增长率为-1.91%,同期业绩比较基准收益率为-3.50%。

4.4.3 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待持有不同基金和组合,并根据《证券投资基金管理人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,并通过系统和技术手段在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期末未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.4.4 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。

4.4.5 报告期内基金投资策略和运作分析
在报告期内,本基金保持了相对较高的仓位,换手率相对较低,行业配置上较为侧重权重行业与农业,同时适当配置了部分自下而上的选择中小市值个股。