

诺安股票证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3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

重要提示:基金管理人及基金托管人承诺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。

基金产品概况:基金名称:诺安股票;交易代码:320002;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日期:2005年12月19日;报告期末基金份额总额:15,416,913,160.14份

投资目标:以中国企业的比较优势和全球化为发展视角,发掘具有投资价值的企业,获得稳定中长期资本增值收益。

投资策略:本基金采取分散的投资策略,在严格控制风险的前提下,本基金采用自上而下和自下而上的投资策略,在严格控制风险的前提下,本基金采用自上而下和自下而上的投资策略。

业绩比较基准:80%*诺安中国6000指数+20%*中国国债全价指数

风险收益特征:本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效规避风险并相应地获得较高的投资收益。

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

主要财务指标和基金净值表现:单位:人民币元

主要财务指标:报告期(2012年1月1日至2012年3月31日)

1.本期已实现收益:-624,968,803.01

2.本期加权平均基金份额本期利润:267,564,969.18

3.本期加权平均基金份额本期净值:0.0171

4.期末基金份额净值:12,422,892,127.74

5.期末基金份额净值增长率:0.858%

注:1.上述基金净值增长率不包括持有人申购或交易的各项费用,计入申购以后收益水平低于同期利率。

2.本基金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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

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:阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

注:1.业绩比较基准为:80%*诺安中国6000指数+20%*中国国债全价指数

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



4.1 基金经理(基金经理小组)简介:姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨谷 诺安股票证券投资基金基金经理 2006年6月22日 - 14

张翔 诺安股票证券投资基金基金经理 2010年10月14日 - 19

注:1.上述基金经理自任职日期起担任本基金的基金经理职务。

2.基金经理的离任日期为基金管理人公告之日。

3.基金经理的离任日期为基金管理人公告之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.7 备查文件目录

1. 基金合同

2. 基金招募说明书

3. 基金托管协议

4. 基金管理人基金业务资格批复

5. 基金管理人基金业务资格批复

6. 基金管理人基金业务资格批复

7. 基金管理人基金业务资格批复

8. 基金管理人基金业务资格批复

9. 基金管理人基金业务资格批复

10. 基金管理人基金业务资格批复

11. 基金管理人基金业务资格批复

12. 基金管理人基金业务资格批复

13. 基金管理人基金业务资格批复

14. 基金管理人基金业务资格批复

15. 基金管理人基金业务资格批复

16. 基金管理人基金业务资格批复

17. 基金管理人基金业务资格批复

18. 基金管理人基金业务资格批复

19. 基金管理人基金业务资格批复

20. 基金管理人基金业务资格批复

21. 基金管理人基金业务资格批复

22. 基金管理人基金业务资格批复

23. 基金管理人基金业务资格批复

24. 基金管理人基金业务资格批复

25. 基金管理人基金业务资格批复

26. 基金管理人基金业务资格批复

27. 基金管理人基金业务资格批复

28. 基金管理人基金业务资格批复

29. 基金管理人基金业务资格批复

30. 基金管理人基金业务资格批复

31. 基金管理人基金业务资格批复

32. 基金管理人基金业务资格批复

33. 基金管理人基金业务资格批复

34. 基金管理人基金业务资格批复

35. 基金管理人基金业务资格批复

36. 基金管理人基金业务资格批复

37. 基金管理人基金业务资格批复

38. 基金管理人基金业务资格批复

39. 基金管理人基金业务资格批复

40. 基金管理人基金业务资格批复

诺安平衡证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3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

重要提示:基金管理人及基金托管人承诺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。

基金产品概况:基金名称:诺安平衡;交易代码:320001;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日期:2004年5月21日;报告期末基金份额总额:9,592,838,382.37份

投资目标:在主动管理的前提下,本基金的投资目标是在控制风险的前提下,实现当期收益与长期增值。

投资策略:本基金采取分散的投资策略,在严格控制风险的前提下,本基金采用自上而下和自下而上的投资策略。

业绩比较基准:60%*沪深300指数+40%*中国国债全价指数

风险收益特征:本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效规避风险并相应地获得较高的投资收益。

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

主要财务指标和基金净值表现:单位:人民币元

主要财务指标:报告期(2012年1月1日至2012年3月31日)

1.本期已实现收益:-242,852,542.34

2.本期加权平均基金份额本期利润:227,660,297.25

3.本期加权平均基金份额本期净值:6,627,623,616.83

4.期末基金份额净值:12,422,892,127.74

5.期末基金份额净值增长率:0.858%

注:1.上述基金净值增长率不包括持有人申购或交易的各项费用,计入申购以后收益水平低于同期利率。

2.本基金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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

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:阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

注:1.业绩比较基准为:60%*沪深300指数+40%*中国国债全价指数

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



4.1 基金经理(基金经理小组)简介:姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

夏晓光 诺安平衡证券投资基金基金经理 2010年3月22日 - 6

注:1.上述基金经理自任职日期起担任本基金的基金经理职务。

2.基金经理的离任日期为基金管理人公告之日。

3.基金经理的离任日期为基金管理人公告之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2012年一季度是市场波动较为剧烈的一个季度,流动性宽松预期在物价下行中开始形成,但通胀预期仍较强烈。

4.7 备查文件目录

1. 基金合同

2. 基金招募说明书

3. 基金托管协议

4. 基金管理人基金业务资格批复

5. 基金管理人基金业务资格批复

6. 基金管理人基金业务资格批复

7. 基金管理人基金业务资格批复

8. 基金管理人基金业务资格批复

9. 基金管理人基金业务资格批复

10. 基金管理人基金业务资格批复

11. 基金管理人基金业务资格批复

12. 基金管理人基金业务资格批复

13. 基金管理人基金业务资格批复

14. 基金管理人基金业务资格批复

15. 基金管理人基金业务资格批复

16. 基金管理人基金业务资格批复

17. 基金管理人基金业务资格批复

18. 基金管理人基金业务资格批复

19. 基金管理人基金业务资格批复

20. 基金管理人基金业务资格批复

21. 基金管理人基金业务资格批复

22. 基金管理人基金业务资格批复

23. 基金管理人基金业务资格批复

24. 基金管理人基金业务资格批复

25. 基金管理人基金业务资格批复

26. 基金管理人基金业务资格批复

27. 基金管理人基金业务资格批复

28. 基金管理人基金业务资格批复

29. 基金管理人基金业务资格批复

30. 基金管理人基金业务资格批复

31. 基金管理人基金业务资格批复

32. 基金管理人基金业务资格批复

33. 基金管理人基金业务资格批复

34. 基金管理人基金业务资格批复

35. 基金管理人基金业务资格批复

36. 基金管理人基金业务资格批复

37. 基金管理人基金业务资格批复

38. 基金管理人基金业务资格批复

39. 基金管理人基金业务资格批复

40. 基金管理人基金业务资格批复

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 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(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 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(%)

5.6 报告期末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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9 报告期末持有的其他权证投资明细

5.10 报告期末持有的其他权证投资明细

5.11 报告期末持有的其他权证投资明细

5.12 报告期末持有的其他权证投资明细

5.13 报告期末持有的其他权证投资明细

5.14 报告期末持有的其他权证投资明细

5.15 报告期末持有的其他权证投资明细

5.16 报告期末持有的其他权证投资明细

5.17 报告期末持有的其他权证投资明细

5.18 报告期末持有的其他权证投资明细

5.19 报告期末持有的其他权证投资明细

5.20 报告期末持有的其他权证投资明细

5.21 报告期末持有的其他权证投资明细

5.22 报告期末持有的其他权证投资明细

5.23 报告期末持有的其他权证投资明细

5.24 报告期末持有的其他权证投资明细

5.25 报告期末持有的其他权证投资明细

5.26 报告期末持有的其他权证投资明细

5.27 报告期末持有的其他权证投资明细

5.28 报告期末持有的其他权证投资明细

5.29 报告期末持有的其他权证投资明细

5.30 报告期末持有的其他权证投资明细

5.31 报告期末持有的其他权证投资明细

5.32 报告期末持有的其他权证投资明细

5.33 报告期末持有的其他权证投资明细

5.34 报告期末持有的其他权证投资明细

5.35 报告期末持有的其他权证投资明细

5.36 报告期末持有的其他权证投资明细

5.37 报告期末持有的其他权证投资明细

5.38 报告期末持有的其他权证投资明细

5.39 报告期末持有的其他权证投资明细

5.40 报告期末持有的其他权证投资明细

5.41 报告期末持有的其他权证投资明细

5.42 报告期末持有的其他权证投资明细

5.43 报告期末持有的其他权证投资明细

5.44 报告期末持有的其他权证投资明细

5.45 报告期末持有的其他权证投资明细

5.46 报告期末持有的其他权证投资明细

5.47 报告期末持有的其他权证投资明细

5.48 报告期末持有的其他权证投资明细

5.49 报告期末持有的其他权证投资明细

5.50 报告期末持有的其他权证投资明细

5.51 报告期末持有的其他权证投资明细

5.52 报告期末持有的其他权证投资明细

5.53 报告期末持有的其他权证投资明细

5.54 报告期末持有的其他权证投资明细

5.55 报告期末持有的其他权证投资明细

5.56 报告期末持有的其他权证投资明细

5.57 报告期末持有的其他权证投资明细

5.58 报告期末持有的其他权证投资明细

5.59 报告期末持有的其他权证投资明细

5.60 报告期末持有的其他权证投资明细

5.61 报告期末持有的其他权证投资明细

5.62 报告期末持有的其他权证投资明细

5.63 报告期末持有的其他权证投资明细

5.64 报告期末持有的其他权证投资明细

5.65 报告期末持有的其他权证投资明细

5.66 报告期末持有的其他权证投资明细

5.67 报告期末持有的其他权证投资明细

5.68 报告期末持有的其他权证投资明细

诺安货币市场基金

2012 第一季度 报告

2012年3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

重要提示:基金管理人及基金托管人承诺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

主要财务指标和基金净值表现:单位:人民币元

主要财务指标:报告期(2012年1月1日至2012年3月31日)

1.本期已实现收益:16,358,179.79

2.本期加权平均基金份额本期利润:16,358,179.79

3.本期加权平均基金份额本期净值:1.00000%

4.期末基金份额净值:1.00000%

5.期末基金份额净值增长率:0.00000%

注:1.上述基金净值增长率不包括持有人申购或交易的各项费用,计入申购以后收益水平低于同期利率。

2.本基金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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

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:阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

注:1.业绩比较基准为:1.00000%

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