# 诺安全球黄金证券投资基金

## 2013 第一季度 报告

2013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
报告送出日期:2013年4月19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2013年4月16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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安全球黄金(QDII-FOF) |
| 交易代码 | 320013 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年1月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,366,883,196.98份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于境外有实物支持的黄金ETF,紧密跟踪金价走势,为投资者提供一类可有效分散组合风险的黄金类金融工具。 |
| 投资策略 | 本基金主要通过投资于有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪金价的投资目标。本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金ETF,之后基本上采取买入持有的投资策略,但根据标的ETF跟踪误差、流动性等因素定期进行调整和再平衡。本基金只买卖和持有黄金ETF份额,不直接买卖或持有实物黄金。本基金的具体投资策略包括ETF组合管理策略以及现金管理策略两部分组成。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。 |
| 风险收益特征 | 本基金为基金中基金,主要投资于实物黄金支持的黄金ETF,投资目标为紧密跟踪黄金价格,预期风险收益水平与黄金价格相似,在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。 |
| 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 |

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | 无 | Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文 | 无 | 布朗兄弟哈里曼银行 |

§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(2013年1月1日 — 2013年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -5,549,098.55 |
| 2.本期利润 | -62,403,971.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0460 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,345,421,762.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.984 |

注:①上述基金业绩指标不包括持有人申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。

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。

3.2 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 | -4.47% | 0.75% | -3.75% | 0.73% | -0.72% | 0.02% |

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)。

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 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 | | |
| 宋青 | 国际业务部总监、诺安全球黄金证券投资基金基金经理、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理 | 2011年11月14日 | - | 4 | 学士学位,具有基金从业资格。曾先后任职于香港富海企业有限公司、中国银行广西分行、中国银行伦敦分行、深圳航空集团公司、道富环球投资管理亚洲有限公司上海代表处,从事外汇交易、证券投资、固定收益及贵金属商品交易等投资工作。2010年10月加入诺安基金管理有限公司,任国际业务部总监。2011年11月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2012年7月起任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理。 |

注:①此处宋青先生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》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间,诺安全球黄金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《诺安全球黄金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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初至今,全球股票市场的上扬和以美国为首的发达国家市场的经济恢复导致了投资者逐步减持黄金资产。虽然美国经济数据也时有反复,但是联储的会议纪要显示对于量化宽松的是否持续略有分歧,由此造成了黄金价格的大幅波动。那怕是欧洲局部地区的经济反复,意大利选举的僵局和塞浦路斯的退欧风险事件都没能把黄金再推上以往的高峰。

全球投资者的黄金ETF持有量在一季度减持了150多吨。其他一些机构投资者如索罗斯于去年四季度大幅减持黄金ETF基金,减持了大约60万股的SPDR黄金ETF。

虽然在相对的低位,仍然有国家的名字出没在市场上,但是远没有去年那么踊跃。

黄金今年从1700美元附近滑落,最低见到1520美元附近,再反弹到1600美元附近。从技术图形上看后市不太乐观,预期会在1520美元至1650美元之间盘整一段时间。

投资操作上我们没有太多变化,觉得目前是盘整阶段,在没有明确趋势之前,适当减持一些仓位,以不要太频繁操作为上策。

展望二季度,虽然全球仍然维持宽松货币政策,日本也加入量化宽松,真实利率仍然为负收益,但是美国经济的复苏在经济数据上得到越来越多支持,全球一季度的股票市场全面上扬促使投资者的风险喜好逐步提高,如果目前的经济继续维持,即没有明显通货膨胀的压力,黄金有可能承受越来越大的投资者调减仓位,转投其他资产的压力。至于是否趋势反转,要看价格能否站稳在1520美元以上。

4.5.2 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0.984元。本报告期基金份额净值增长率为-4.47%,同期业绩比较基准收益率为-3.75%。

§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(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:普通股 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 1,260,038,722.87 | 91.38 |
| 3 | 固定收益投资 | 60,088,000.00 | 4.36 |
| | 其中:债券 | 60,088,000.00 | 4.36 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | 126,500.00 | 0.01 |
| | 其中:远期 | 126,500.00 | 0.01 |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 56,014,746.16 | 4.06 |
| 8 | 其他资产 | 2,693,317.51 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 1,378,961,286.54 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

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十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本项主要列示按国际权威评级机构(标普、穆迪)的债券信用评级情况。本基金本报告期末未持有此类债券。

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(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 120019 | 12附息国债19 | 400,000 | 40,060,000.00 | 2.98 |
| 2 | 130002 | 13附息国债02 | 200,000 | 20,028,000.00 | 1.49 |

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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 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金融衍生品投资明细

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 远期投资 | 汇率远期(美元兑人民币) | 62,500.00 | 0.00 |
| 2 | 远期投资 | 汇率远期(美元兑人民币) | 42,000.00 | 0.00 |
| 3 | 远期投资 | 汇率远期(美元兑人民币) | 22,000.00 | 0.00 |

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ISHARES GOLD TRU | ETF基金 | 契约型开放式 | BlockRock Fund Advisors | 246,217,695.54 | 18.30 |
| 2 | SPDR GOLD TRUST | ETF基金 | 契约型开放式 | World Gold Trust Services LLC | 241,438,233.02 | 17.95 |
| 3 | JB-PHY GOLD-A$ | ETF基金 | 契约型开放式 | Swiss & Global Asset Management AG | 237,282,092.06 | 17.64 |
| 4 | ETFS GOLD TRUST | ETF基金 | 契约型开放式 | ETF Securities USA LLC | 209,499,817.25 | 15.57 |
| 5 | UBS-GOLD ETF $-A | ETF基金 | 契约型开放式 | UBS Fund Management Switzerland | 157,228,834.60 | 11.69 |
| 6 | CSETF GOLD | ETF基金 | 契约型开放式 | Credit Suisse Asset Management Funds/Zurich | 148,677,799.54 | 11.05 |
| 7 | ZKB-GOLD-A USD | ETF基金 | 契约型开放式 | Zuercher Kantonalbank | 19,694,250.86 | 1.46 |

注:本基金本报告期末仅持有上述基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告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。

5.10.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 650,893.85 |
| 5 | 应收申购款 | 2,042,423.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,693,317.51 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§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 | 1,316,725,995.93 |
| 本报告期基金总申购份额 | 174,337,721.18 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 124,180,520.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,366,883,196.98 |

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。

§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全球黄金证券投资基金募集的文件。

②《诺安全球黄金证券投资基金基金合同》。

③《诺安全球黄金投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安全球黄金证券投资基金2013年第一季度报告正文。

⑥报告期内诺安全球黄金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
2013年4月19日

# 诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)

## 2013 第一季度 报告

2013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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月19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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月16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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安油气能源(QDII-FOF-LOF) |
| 交易代码 | 163208 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2011年9月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 425,033,161.35份 |
| 投资目标 | 在有效控制组合风险的前提下,通过在全球范围内精选优质的石油、天然气等能源行业类基金(包括ETF)以及公司股票进行投资,为投资者实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金具体的投资策略由资产配置策略,"核心"组合投资策略,"卫星"组合投资策略,债券投资策略和现金管理策略五部分构成。<br>1、资产配置策略<br>本基金在资产配置上采用"双重配置"策略。第一层是大类资产类别配置,第二层是在权益类资产内的"核心"组合和"卫星"组合的配置。权益类资产包括基金(包括ETF)和股票。<br>2、"核心"组合投资策略<br>在"核心"组合中,本基金将主要投资于石油天然气等能源行业基金,主要包括:(1)以跟踪石油、天然气等能源类行业公司股票指数为投资目标的ETF及指数基金;(2)以超越石油、天然气等能源类行业公司股票指数为投资目标的主动管理型基金。<br>3、"卫星"组合投资策略<br>在"卫星"组合中,本基金将主要投资于:(1)以跟踪石油、天然气等能源品商品价格或商品价格指数为投资目标的能源类商品ETF;(2)全球范围内优质的石油、天然气等能源类公司股票。<br>4、债券投资策略<br>本基金将在全球范围内进行债券资产配置,根据基金管理人的债券选择标准,运用相应的债券投资策略,构造债券组合。<br>5、现金管理策略<br>现金管理是本基金投资管理的一个重要环节,主要包含以下三个方面的内容:现金流预测、现金持有比例管理、现金资产收益管理。 |
| 业绩比较基准 | 标普能源行业指数(净收益)(S&P 500 Energy Sector Index(NTR)) |
| 风险收益特征 | 本基金将会投资于全球范围内优质的石油、天然气等能源行业基金(包括ETF)及公司股票,在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。 |
| 基金管理人 | 诺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

注:本基金的场内交易简称为"诺安油气",交易代码为"163208"。截止报告期末,本基金尚未在深交所上市交易。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | 无 | Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文 | 无 | 布朗兄弟哈里曼银行 |

§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(2013年1月1日 — 2013年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,068,529.92 |
| 2.本期利润 | 42,307,378.73 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0825 |
| 4.期末基金资产净值 | 437,501,474.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.029 |

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。

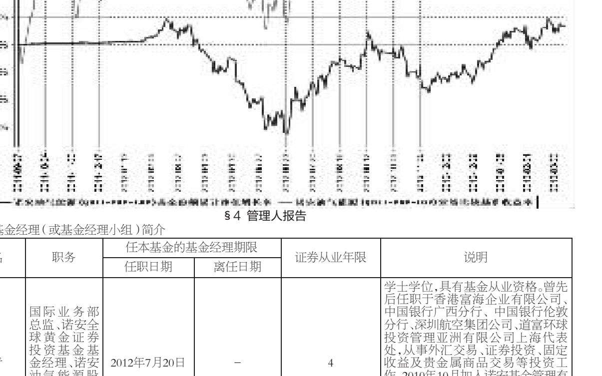
3.2 基金净值表现

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 | 8.09% | 0.81% | 9.80% | 0.90% | -1.71% | -0.09% |

注:本基金的业绩比较基准为:标普能源行业指数(净收益)(S&P 500 Energy Sector Index(NTR))。

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 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 | | |
| 宋青 | 国际业务部总监、诺安全球黄金证券投资基金基金经理、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理 | 2012年7月20日 | - | 4 | 学士学位,具有基金从业资格。曾先后任职于香港富海企业有限公司、中国银行广西分行、中国银行伦敦分行、深圳航空集团公司、道富环球投资管理亚洲有限公司上海代表处,从事外汇交易、证券投资、固定收益及贵金属商品交易等投资工作。2010年10月加入诺安基金管理有限公司,任国际业务部总监。2011年11月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2012年7月起任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理。 |

注:①此处宋青先生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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间,诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)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《诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司对不同投资组合不同时间区间(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行了分析,未发现投资组合之间存在违反公平交易原则的异常情况。此外,不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

油气能源市场在2013 年有一个好的开始。

如市场预期,美国众议院投票通过了短期调高债务上限的法案,意味着美国政府的财政悬崖又被推迟,避免了短期内政府债务违约的风险。日本推出大规模刺激方案,推出约合2262亿美元的大规模经济刺激计划,以克服通缩、刺激经济增长。该计划将令日本实际GDP增加约2%,并创造约60万个就业岗位。美联储维持宽松政策,继续执行每月购买400亿美元抵押贷款支撑证券和450亿美元长期国债的"开放式"量化宽松政策,并将利率保持在接近于零的历史低位,直至失业率降至6.5%且中长期通胀率不超过2.5%。欧洲银行业提前还贷。278家银行向欧央行偿还1,370亿欧元,还款规模超过了银行业从欧洲央行借款总量4,890亿美元的四分之一。市场预期美国经济将继续温和增长,就业市场将改善。

2月份的经济数据终于显示美劳动力市场大幅回暖。2月美国非农就业增长23.6万人,大幅高于预期增长16.5万人。2月美国失业率降至7.7%,预期为7.9%,为2008年12月以来新低。美国就业市场的数据大幅回暖,说明美国国内就业市场在逐步得到改善,也显示美国经济的稳步复苏。欧洲方面,塞浦路斯援助计划引发银行业危机。为换取100亿欧元的援助,塞浦路斯政府被迫牺牲银行储户的存款利益,造成市场波动。最后塞浦路斯政府不得不让银行停业和实施资本管制一周来缓和市场。另外,欧元区经济数据不佳,意大利政府陷入组阁僵局。全球三大原油机构下调原油需求预期。

全球原油市场在一月份稳步上扬,二月份大幅回落,三月份重拾升势。但是以股票类资产为主的能源行业指数则跟随美国经济的稳步回升一季度走出了相当可喜的上扬态势。

投资操作上根据我们今年充满信心地看好股票类资产,所以自1月开始迅速提高整体仓位,从7成加到9成以上;调减商品资产,超配股票类资产(能源行业ETF),因此充分享受了一季度能源行业的上涨趋势。基金最高涨幅近10%,业绩排在行业同期的前十名。

整个一季度,基金涨幅8.09%,基金净值1.029元。

对于油气市场后市,市场宽松的货币政策和温和的通胀数据,支持强周期的股票类资产继续看好。同时,由于一季度的涨幅可观,我们不排除二季度会有调整和一些波动。

4.5.2 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1.029元。本报告期基金份额净值增长率为8.09%,同期业绩比较基准收益率为9.80%。

§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(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:普通股 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 410,677,051.17 | 88.65 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 52,187,447.25 | 11.26 |
| 8 | 其他资产 | 415,499.89 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 463,279,998.31 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

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十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | SPDR-ENER-GY SEL | ETF基金 | 契约型开放式 | SSGA Funds Management | 91,096,491.76 | 20.82 |
| 2 | VANGUARD ENERG E | ETF基金 | 契约型开放式 | The Vanguard Group Inc. | 90,944,850.08 | 20.79 |
| 3 | ISHARES-DJ ENERG | ETF基金 | 契约型开放式 | Black Rock Fund Advisers. | 90,500,976.79 | 20.69 |
| 4 | SPDR OIL EXP | ETF基金 | 契约型开放式 | SSGA Funds Management,Inc. | 90,144,793.50 | 20.60 |
| 5 | ISHARES-GLB ENRG | ETF基金 | 契约型开放式 | Black Rock Fund Advisers. | 28,358,432.98 | 6.48 |
| 6 | ETFS BRENT 1MTH | ETF基金 | 契约型开放式 | ETFS Securities. Ltd. | 11,672,876.98 | 2.67 |
| 7 | Brent Oil Fund LP | ETF基金 | 契约型开放式 | United States Commodity Funds LLC | 7,299,381.78 | 1.67 |
| 8 | ETFS NATURAL GAS | ETF基金 | 契约型开放式 | ETFS Commodity Securities Ltd. | 585,389.88 | 0.13 |
| 9 | UNITED STS OIL FD LP UNITS | ETF基金 | 契约型开放式 | United States Commodities Fund,LLC | 65,353.28 | 0.01 |
| 10 | US NAT GAS FD LP | ETF基金 | 契约型开放式 | United States Commodity Funds LLC | 8,504.14 | 0.00 |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告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。

5.10.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 375,811.90 |
| 4 | 应收利息 | 2,269.23 |
| 5 | 应收申购款 | 37,418.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 415,499.89 |

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§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 | 574,879,910.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,597,313.51 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 155,444,062.85 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 425,033,161.35 |

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。

§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油气能源股票证券投资基金(LOF)募集的文件。

②《诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金合同》。

③《诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)2013年第一季度报告正文。

⑥报告期内诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)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
2013年4月19日

# 诺安多策略股票型证券投资基金

## 2013 第一季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月19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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月16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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 诺安多策略股票 |
| 交易代码 | 320016 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年8月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 439,025,089.31份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过数量化手段优化投资策略,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将实施积极主动的投资策略,具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略以及股指期货投资策略五部分组成。<br>1.资产配置策略<br>本基金主要投资的大类资产是股票、债券和现金,我们将从宏观面、政策面、资金面和基本面等全面研究、综合分析,发掘择时因子,根据择时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。<br>2.股票投资策略<br>本基金以"定量投资"为主,辅以"定性投资",力争实现稳定超额回报。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。<br>4.权证投资策略<br>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究,结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值,进行稳健投资。<br>5.股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎性原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×75%+上证国债指数×25% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 诺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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(2013年1月1日 — 2013年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 20,262,680.59 |
| 2.本期利润 | 34,743,987.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0735 |
| 4.期末基金资产净值 | 366,110,501.47 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.834 |

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。

3.2 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 | 9.59% | 1.24% | -0.49% | 1.17% | 10.08% | 0.07% |

注:本基金的业绩比较基准为:75%沪深300指数+25%上证国债指数。

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

注:本基金的建仓期为2011年8月9日至2012年2月8日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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 | | |
| 王永宏 | 诺安多策略股票型证券投资基金基金经理 | 2011年8月9日 | - | 15 | 经济学博士,具有基金从业资格。曾先后任职于海通证券股份有限公司、大成基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司,2010年加入诺安基金管理有限公司。曾于2009年3月至2010年9月担任嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金经理。2011年8月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。 |

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《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,诺安多策略股票型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《诺安多策略股票型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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

1季度,以周期股为主的大盘蓝筹股表现不佳,拖累市场冲高回落。而以医药股、科技股为代表的成长股则表现出色,本基金1季度多使用了低估值的因子以及成长性因子,具体表现在组合上,就是超配了银行股、医药股、食品股以及部分成长股,基金1季度取得了9.6%的收益,跑赢了本基金的比较基准,也跑赢了同行的平均水平。

4.4.2 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0.834元。本报告期基金份额净值增长率为9.59%,同期业绩比较基准收益率为-0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在市场信心缺乏的时候,低估值的股票反而表现会更差,这个大概就是1季度后2个月,低估值股票跑输市场的原因。经济复苏的表现让市场失望,市场选择了将资金退缩到少数成长股之中规避风险。但是当过多资金有类似行为的时候,会导致部分成长股估值过高,带来新的风险。因此,本基金在下一阶段的选股模型中,会减少成长性因子的使用。

§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 | 312,604,434.94 | 83.91 |
| | 其中:股票 | 312,604,434.94 | 83.91 |
| 2 | 固定收益投资 | 11,099,723.20 | 2.98 |
| | 其中:债券 | 11,099,723.20 | 2.98 |
| | 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 | 46,397,183.29 | 12.45 |
| 6 | 其他资产 | 2,438,771.59 | 0.65 |
| 7 | 合计 | 372,540,113.02 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,380,000.00 | 0.38 |
| C | 制造业 | 165,086,849.70 | 45.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,281,250.00 | 1.72 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 34,594,129.25 | 9.45 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,946,903.20 | 3.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,156,047.35 | 5.23 |
| J | 金融业 | 54,182,687.64 | 14.80 |
| K | 房地产业 | 11,175,821.80 | 3.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 8,591,724.00 | 2.35 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 209,022.00 | 0.06 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 312,604,434.94 | 85.39 |

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 | 600887 | 伊利股份 | 912,172 | 28,897,608.96 | 7.89 |
| 2 | 000895 | 双汇发展 | 202,227 | 16,339,941.60 | 4.46 |
| 3 | 600309 | 烟台万华 | 714,921 | 13,004,412.99 | 3.55 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 250,000 | 10,442,500.00 | 2.85 |
| 5 | 600196 | 复星医药 | 801,023 | 9,692,378.30 | 2.65 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 1,000,000 | 9,640,000.00 | 2.63 |
| 7 | 002368 | 太极股份 | 521,751 | 9,584,565.87 | 2.62 |
| 8 | 600436 | 片仔癀 | 70,745 | 8,940,045.65 | 2.44 |
| 9 | 000415 | 渤海租赁 | 1,208,400 | 8,591,724.00 | 2.35 |
| 10 | 600867 | 通化东宝 | 527,602 | 7,439,188.20 | 2.03 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 11,099,723.20 | 3.03 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 11,099,723.20 | 3.03 |

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 | 110023 | 民生转债 | 88,850 | 9,410,992.00 | 2.57 |
| 2 | 110020 | 南山转债 | 16,120 | 1,688,731.20 | 0.46 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 186,619.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,193,292.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 33,470.25 |
| 5 | 应收申购款 | 25,389.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,438,771.59 |

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§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 | 485,946,024.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 13,303,407.06 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 60,224,342.21 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 439,025,089.31 |

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。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

2013年4月13日,基金管理人发布公告,杨谷先生担任本基金基金经理,王永宏先生不再担任本基金基金经理。

杨谷先生简介:经济学硕士,CFA,具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监。曾于2006年11月至2007年11月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2006年2月起任诺安股票证券投资基金基金经理,2010年9月起任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理,2013年4月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安多策略股票型证券投资基金募集的文件。

②《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》。

③《诺安多策略股票型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诺安多策略股票型证券投资基金2013年第一季度报告正文。

⑥报告期内诺安多策略股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 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
2013年4月19日