

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

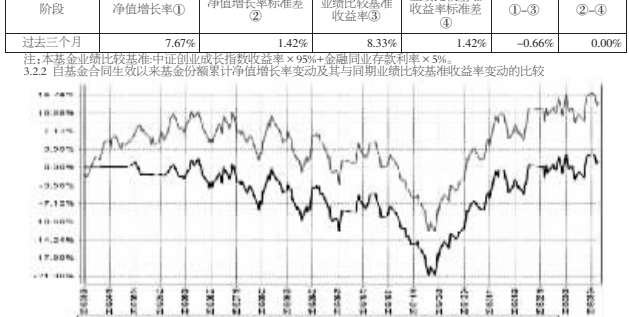
基金简称	诺安中证创业成长指数分级
交易代码	162309
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月28日
报告期末基金份额总额	109,750,685.88份
投资目标	本基金采用被动式投资,通过严格的跟踪偏离度风险控制管理手段,力争实现跟踪误差最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不得超过4%。
投资策略	本基金完全复制标的指数,跟踪标的资产在沪深创业板指数中的成分基金权重构成,并根据标的指数的变动进行相应调整。当跟踪误差较大时,基金管理人可在不影响跟踪标的指数表现的前提下,对基金投资组合进行适当调整和配置,采取合理措施,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,诺安进取份额具有低风险、收益相对稳定的特征;诺安成长份额具有高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属二级基金名称	诺安进取
下属二级基金代码	162309
下属二级基金报告期末基金份额总额	102,558,254.88份
下属二级基金的风险收益特征	较低风险,较高预期收益。低风险,收益相对稳定。高风险,高预期收益。

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-1936,091.87	
2.本期利润	9,471,182.06	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0748	
4.期末基金份额净值	107.755,799.80	
5.期末基金份额净值	0.982	

注:1.上述基金净值指标不包括持有交易基金的基金份额计入费用后实际收益水平低于前项数字。
2.本期利润为基金本期利息收入、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。
3.2.1 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	7.67%	1.42%	8.33%	1.42%	-0.66%	0.00%



注:本基金的建仓期为2012年9月1日至2012年9月28日,建仓期间未将各项资产按比例投资于基金合同约定,截至2013年3月31日止,本基金建仓完毕。

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
梅律 基金经理 2012年7月28日 - 15 硕士研究生毕业于香港科技大学,曾任2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,2007年11月至2010年10月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2012年9月担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2012年9月起担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,753.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,203.97
5	应收申购款	2,772.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,730.03

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 102,160,741.29 94.04
其中:股票 102,160,741.29 94.04
2 固定收益投资 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 6,447,556.04 5.94
其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产 - -
5 其他资产 24,730.03 0.02
7 合计 108,633,027.36 100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,160,741.29	94.04
2	固定收益投资	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	6,447,556.04	5.94
5	其他资产	24,730.03	0.02
7	合计	108,633,027.36	100.00

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

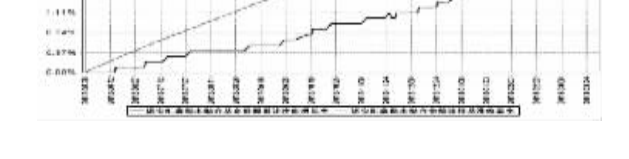
基金简称	诺安汇鑫保本混合型
交易代码	320020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月28日
报告期末基金份额总额	3,069,784,817.44份
投资目标	本基金严格控制风险,在保证投资本金安全的基础上,力争实现长期稳定的增值。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPI-Constant Proportion Portfolio Insurance)策略,在未来一年保本周期中,对资产配置严格按照合同规定的保本策略进行动态调整,确保投资者的投资本金安全,力争实现长期稳定的增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为保本周期期限的三年定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型证券投资基金,在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金销售人	中国银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	20,631,948.84	
2.本期利润	30,342,902.05	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0095	
4.期末基金份额净值	1,319,510,627.18	
5.期末基金份额净值	1.023	

注:1.上述基金净值指标不包括持有交易基金的基金份额计入费用后实际收益水平低于前项数字。
2.本期利润为基金本期利息收入、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。
3.2.1 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	0.99%	0.08%	1.06%	0.07%	-0.07%	0.06%



注:本基金的建仓期为2012年5月28日至2012年5月28日,建仓期间未将各项资产按比例投资于基金合同约定,截至2013年3月31日止,本基金建仓完毕。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	诺安中证创业成长指数分级
交易代码	162309
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月28日
报告期末基金份额总额	109,750,685.88份
投资目标	本基金采用被动式投资,通过严格的跟踪偏离度风险控制管理手段,力争实现跟踪误差最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不得超过4%。
投资策略	本基金完全复制标的指数,跟踪标的资产在沪深创业板指数中的成分基金权重构成,并根据标的指数的变动进行相应调整。当跟踪误差较大时,基金管理人可在不影响跟踪标的指数表现的前提下,对基金投资组合进行适当调整和配置,采取合理措施,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,诺安进取份额具有低风险、收益相对稳定的特征;诺安成长份额具有高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属二级基金名称	诺安进取
下属二级基金代码	162309
下属二级基金报告期末基金份额总额	102,558,254.88份
下属二级基金的风险收益特征	较低风险,较高预期收益。低风险,收益相对稳定。高风险,高预期收益。

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-1936,091.87	
2.本期利润	9,471,182.06	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0748	
4.期末基金份额净值	107.755,799.80	
5.期末基金份额净值	0.982	

注:1.上述基金净值指标不包括持有交易基金的基金份额计入费用后实际收益水平低于前项数字。
2.本期利润为基金本期利息收入、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。
3.2.1 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	7.67%	1.42%	8.33%	1.42%	-0.66%	0.00%



注:本基金的建仓期为2012年9月1日至2012年9月28日,建仓期间未将各项资产按比例投资于基金合同约定,截至2013年3月31日止,本基金建仓完毕。

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
梅律 基金经理 2012年7月28日 - 15 硕士研究生毕业于香港科技大学,曾任2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,2007年11月至2010年10月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2012年9月担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2012年9月起担任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,753.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,203.97
5	应收申购款	2,772.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,730.03

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 102,160,741.29 94.04
其中:股票 102,160,741.29 94.04
2 固定收益投资 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 6,447,556.04 5.94
其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产 - -
5 其他资产 24,730.03 0.02
7 合计 108,633,027.36 100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,160,741.29	94.04
2	固定收益投资	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	6,447,556.04	5.94
5	其他资产	24,730.03	0.02
7	合计	108,633,027.36	100.00

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	诺安中证创业成长指数分级
交易代码	162309
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月28日
报告期末基金份额总额	109,750,685.88份
投资目标	本基金采用被动式投资,通过严格的跟踪偏离度风险控制管理手段,力争实现跟踪误差最小化,在正常市场情况下,本基金日均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不得超过4%。
投资策略	本基金完全复制标的指数,跟踪标的资产在沪深创业板指数中的成分基金权重构成,并根据标的指数的变动进行相应调整。当跟踪误差较大时,基金管理人可在不影响跟踪标的指数表现的前提下,对基金投资组合进行适当调整和配置,采取合理措施,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,诺安进取份额具有低风险、收益相对稳定的特征;诺安成长份额具有高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金销售人	中国银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-1936,091.87	
2.本期利润	9,471,182.06	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0748	
4.期末基金份额净值	107.755,799.80	
5.期末基金份额净值	0.982	

注:1.上述基金净值指标不包括持有交易基金的基金份额计入费用后实际收益水平低于前项数字。
2.本期利润为基金本期利息收入、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。
3.2.1 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	7.67%	1.42%	8.33%	1.42%	-0.66%	0.00%



注:本基金的建仓期为2012年9月1日至2012年9月28日,建仓期间未将各项资产按比例投资于基金合同约定,截至2013年3月31日止,本基金建仓完毕。

诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	诺安新动力混合
交易代码	320018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月31日
报告期末基金份额总额	190,372,451.75份
投资目标	本基金采用灵活主动的分化投资策略,运用多种投资策略灵活配置资产,深入挖掘新形势下中国宏观经济持续发展、加快国内经济增力方式转变、促进经济结构转型升级的契机,在严格控制风险的前提下,追求长期稳定的增值。
投资策略	本基金采取积极投资策略,在严格控制风险的前提下,追求长期稳定的增值。本基金将主要运用价值投资策略和成长投资策略,结合自身资产状况审慎投资,力争获得长期稳定的增值。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中证综合指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	40,969,514.75	
2.本期利润	30,390,514.78	
3.加权平均基金份额本期利润	0.1596	
4.期末基金份额净值	211,919,952.92	
5.期末基金份额净值	1.111	

注:1.上述基金净值指标不包括持有交易基金的基金份额计入费用后实际收益水平低于前项数字。
2.本期利润为基金本期利息收入、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。
3.2.1 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	12.68%	1.22%	0.03%	0.93%	12.65%	0.29%



注:本基金的建仓期为2012年3月15日至2012年9月4日,建仓期间未将各项资产按比例投资于基金合同约定,截至2013年3月31日止,本基金建仓完毕。

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
赵苏 基金经理 2012年3月31日 7 具有基金从业资格,曾任中泰证券资产管理部2010年4月加入诺安基金管理有限公司,任研究员,2012年3月起任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	354,525.66
2	应收证券清算款	8,407,693.35
3	应收股利	-
4	应收利息	110,059.41
5	应收申购款	126,466.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,998,110.46

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 190,372,451.75 94.04
其中:股票 190,372,451.75 94.04
2 固定收益投资 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
5 其他资产 8,998,110.46 4.39
7 合计 199,370,562.21 100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,372,451.75	94.04
2	固定收益投资	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	8,998,110.46	4.39
7	合计	199,370,562.21	100.00

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月19日

诺安汇鑫保本混合型证券投资基金

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期为2013年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

基金简称	诺安汇鑫保本混合型
交易代码	320020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月28日
报告期末基金份额总额	3,069,784,817.44份
投资目标	本基金严格控制风险,在保证投资本金安全的基础上,力争实现长期稳定的增值。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPI-Constant Proportion Portfolio Insurance)策略,在未来一年保本周期中,对资产配置严格按照合同规定的保本策略进行动态调整,确保投资者的投资本金安全,力争实现长期稳定的增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为保本周期期限的三年定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型证券投资基金,在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金销售人	中国银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	20,63	