诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）

2014 第一季度 报告

2014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：2014年4月22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2014年4月18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2014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	120,434,384.47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。 1、资产配置策略 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。 2、"核心"组合投资策略 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。 3、"卫星"组合投资策略 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。 4、债券投资策略 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。 5、现金管理策略 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"。截止本报告期末，本基金尚未上市交易。

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（2014年1月1日－2014年3月31日）
1.本期已实现收益	3,359,992.69
2.本期利润	2,589,537.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0191
4.期末基金资产净值	134,247,990.19
5.期末基金份额净值	1.115

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。

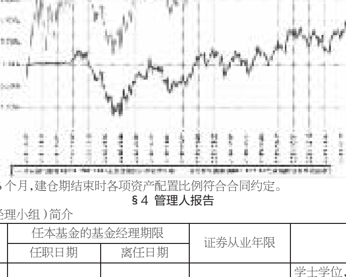
3.2 基金净值表现

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	2.39%	0.83%	1.52%	0.81%	0.87%	0.02%

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



注：本基金的建仓期为6个月，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		
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	－	5	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

油气能源股票在去年获得良好的业绩之后，今年伊始便开始了震荡和调整，但是向上的趋势没有改变。

季度初始，美国的经济数据不尽人意。美国12月份新增非农就业7.4万人，增幅为3年以来最小，远低于市场预期。密歇根大学消费者信心指数初值大幅回落至80.4。12月新屋开工数大幅下滑。数据的不好，市场归结为年末的极寒天气所致。美联储继续削减资产购买计划至650亿美元/月，继续将利率维持在0-0.25%的超低水平，显示出对于美国最近几个季度经济活动升温，就业市场指标喜忧参半，不过总体在改善的看法。欧洲商业活动显示出强劲反弹。欧元区2013年12月份Markit制造业采购经理人指数（PMI）终值为52.7，达2011年5月以来最高水平。欧元区制造业已连续七个月实现增长，增速为2011年来之最。德国的增长依旧强劲，法国的衰退则有所减缓；其他地区的经济形势也开始进一步好转。爱尔兰和西班牙就业已经开始回升。继爱尔兰于十二月退出紧急援助计划后，葡萄牙也可能很快跟随。不过相对而言，欧洲的经济恢复还是没有美国全面。以至于欧洲央行表示，只要有必要，将维持宽松的政策立场，表示利率将在一段时间内维持在纪录低位或更低水平。发达市场的恢复引发新兴市场的资金外流，阿根廷放弃汇率管制，当天货币贬值13%，其他新兴市场货币也出现恐慌抛售的现象，土耳其、南非、俄罗斯、印度等国货币也不同程度地出现贬值。引发一轮全球风险资产的迅速回调。

2月份，美国的数据有所好转。失业率为6.6%，低于市场预期。国会通过再次提高美国政府债务上限的议案。新任美联储主席耶伦讲话鸽派。她表示宽松货币政策在相当长时期内仍适用，美联储将基本延续现行政策，并称迄今全球市场的波动不会导致美联储改变立场。国际原油三大机构上调全球原油需求预期。日本再推宽松政策。日本央行货币会议宣布维持目前货币政策。还宣布将把两项旨在鼓励银行放贷的特别贷款项目规模扩大一倍。乌克兰的局势恶化。

3月份，美联储继续减少资产购买计划100亿美元。美国数据好转，2月工厂耐用品定单高于市场预期。美国库欣原油库存进一步下滑。欧元区在经济在延续复苏的同时，内部需求回升力度相对偏弱。欧央行表示，如果出现中期通胀前景恶化、货币市场状况紧张这两种意外情况，欧洲央行将会采取行动。克里米亚通过公投并入俄罗斯。WTI原油随着俄罗斯受到西方大国制裁，市场对原油供给忧虑加深，同时随着经济回暖，原油需求前景看好，从而原油价格出现反弹。其他风险资产，包括能源股票也随着经济回暖重拾上升通道。

投资操作上我们采取了逢高适当减持，但总体仍然维持高仓位运作的投资策略，取得了较好的效果，基金在本季度超越业绩指标。

一季度，基金上涨2.39%，业绩指标上涨0.6%，基金净值1.115元。

展望二季度油气能源市场，发达市场的经济复苏逐步走向平稳，虽然不同区域复苏步骤不尽相同。美国减少资产购买计划但仍维持宽松，欧洲不排除有新的经济刺激政策出台，日本则想尽办法不断刺激经济。新兴市场在波动过后趋向平稳，资金逐步回流，全球风险资产仍然受到投资人追捧，能源行业随着经济景气的上升，有机会更上一层楼。我们维持油气能源市场维持震荡向上趋势的看法。

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1.115元。本报告期基金份额净值增长率为2.39%，同期业绩比较基准收益率为1.52%。

§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	129,700,331.83	93.39
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	9,108,162.74	6.56
8	其他资产	73,146.84	0.05
9	合计	138,881,641.41	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序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。

5.8 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 OIL EXP	ETF基金	契约型开放式	SSGA Funds Management,Inc.	27,155,083.33	20.23
2	VANGUARD ENERG E	ETF基金	契约型开放式	The Vanguard Group Inc.	25,807,431.25	19.22
3	ISHARES-DJ ENERG	ETF基金	契约型开放式	Black Rock Fund Advisers.	25,779,151.40	19.20
4	SPDR-ENERGY SEL	ETF基金	契约型开放式	SSGA Funds Management	25,456,809.78	18.96
5	ISHARES-GLB ENRG	ETF基金	契约型开放式	Black Rock Fund Advisers.	24,545,713.67	18.28
6	ETFS NATURAL GAS	ETF基金	契约型开放式	ETFS Commodity Securities Ltd.	579,220.22	0.43
7	ETFS BRENT 1MTH	ETF基金	契约型开放式	ETFS Securities. Ltd.	190,738.72	0.14
8	Brent Oil Fund LP	ETF基金	契约型开放式	United States Commodity Funds LLC	118,651.86	0.09
9	UNITED STS OIL FD LP UNITS	ETF基金	契约型开放式	United States Commodities Fund, LLC	67,531.60	0.05

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	913.79
5	应收申购款	72,233.05
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	73,146.84

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

报告期期初基金份额总额	149,876,403.39
报告期期间基金总申购份额	1,563,799.26
减:报告期期间基金总赎回份额	31,005,818.18
报告期期末基金份额总额	120,434,384.47

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§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）2014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。

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
2014年4月22日

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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：2014年4月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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2014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	163209		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年3月29日		
报告期末基金份额总额	26,823,835.08份		
投资目标	本基金实施被动式投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。		
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在中证创业成长指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证创业成长指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证创业成长指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，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%×金融同业存款利率		
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看，诺安稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；诺安进取份额具有高风险、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		
下属三级基金简称	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
下属三级基金交易代码	163209	150073	150075
下属三级基金报告期末基金份额总额	18,566,064.08份	3,303,108.00份	4,954,663.00份
下属三级基金的风险收益特征	较高风险、较高预期收益。	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。

注：本基金上市交易的证券交易所为深圳证券交易所，下属分级基金的基金简称、交易代码均为在深圳证券交易所上市交易的简称及交易代码。

§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（2014年1月1日－2014年3月31日）
1.本期已实现收益	694,234.17
2.本期利润	-2,062,462.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0705
4.期末基金资产净值	26,634,241.88
5.期末基金份额净值	0.993

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。

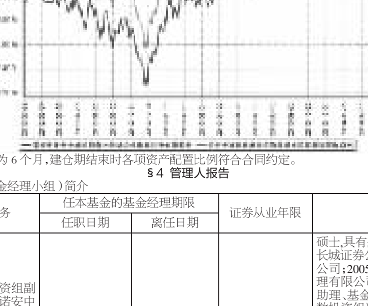
3.2 基金净值表现

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	-7.53%	1.58%	-6.75%	1.55%	-0.78%	0.03%

注：本基金业绩比较基准：中证创业成长指数收益率×95%＋金融同业存款利率×5%。

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6个月，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		
梅律吾	指数投资组副总监、诺安中证100指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2012年7月28日	－	16	硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司；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、研究部副总监、指数投资组副总监。曾于2007年11月至2009年10月担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月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理，2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011年9月至2012年11月任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2014年1月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：①此处梅律吾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 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，诺安中证创业成长指数分级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《诺安中证创业成长指数分级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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年第一季度在经济下行、人民币贬值以及楼市降温等诸多利空冲击之下，A股市场呈现较大幅度下跌。小盘成长股也受到了拖累，但是抗跌性比较强。中证创业成长指数属于小盘成长风格，一季度跌幅低于市场平均水平。

一季度冲击A股市场的利空因素主要有以下几方面。

首先是人民币出现持续大幅度贬值。这是自人民币汇率改革以来罕见的贬值，也是投资者始料不及的。当然这仅是人民币汇率的短期波动，不代表长期趋势。其背后更是中国央行有意而为之，放宽人民币汇率波动幅度，增加人民币汇率弹性。但是人民币贬值给投资者情绪带来的负面影响，由此给A股市场造成的冲击是显著的。

其次是房地产市场明显降温。进入2014年以来，国内房地产市场不再像往年那样热火朝天。房地产行业投资以及楼市销售都在放缓。部分城市地产开发商开始降价促销。这是国内楼市必然的分化，也是房地产市场趋向健康和理性的表现。但是投资者对此有负面预期，担忧房地产行业和中国经济未来。由此形成对A股市场的冲击。

最后是信用风险释放。少数民营企业出现了债务违约。当然信用风险仅限于局部地区和行业，不会大面积爆发。但还是影响了投资者信心，进而冲击A股市场。

以上这些利空因素都是暂时的，在短期内会影响投资者情绪。等到经济企稳以后，这些利空因素都会消失，投资者情绪会逐渐好转。A股市场自然会企稳回升。

本基金完全复制中证创业成长指数，将跟踪误差控制在合理范围内，从而实现对中证创业成长指数的紧密跟踪。

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0.993元。本报告期基金份额净值增长率为-7.53%，同期业绩比较基准收益率为-6.75%。

§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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,147,035.57	93.37
	其中：股票	25,147,035.57	93.37
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
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	银行存款和结算备付金合计	1,280,699.82	4.76
7	其他资产	505,219.04	1.88
8	合计	26,932,954.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	269,945.19	1.01
B	采矿业	－	－
C	制造业	12,640,981.92	47.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,458.06	0.34
E	建筑业	1,662,586.11	6.24
F	批发和零售业	267,763.19	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	－	－
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,467,012.51	16.77
J	金融业	－	－
K	房地产业	1,025,495.68	3.85
L	租赁和商务服务业	1,196,013.32	4.49
M	科学研究和技术服务业	445,236.76	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	1,052,908.07	3.95
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	243,148.80	0.91
R	文化、体育和娱乐业	1,785,485.96	6.70
S	综合	－	－
	合计	25,147,035.57	94.42

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	002415	海康威视	57,035	995,260.75	3.74
2	300070	碧水源	29,614	978,150.42	3.67
3	300027	华谊兄弟	40,470	962,376.60	3.61
4	002241	歌尔声学	35,186	900,761.60	3.38
5	002304	洋河股份	16,269	800,272.11	3.00
6	002236	大华股份	26,728	764,153.52	2.87
7	300104	乐视网	20,417	762,574.95	2.86
8	002065	东华软件	18,280	737,780.80	2.77
9	300058	蓝色光标	14,500	725,000.00	2.72
10	002353	杰瑞股份	11,936	718,547.20	2.70

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,466.65
2	应收证券清算款	493,872.26
3	应收股利	－
4	应收利息	285.83
5	应收申购款	594.30
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	505,219.04

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

项目	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
报告期期初基金份额总额	24,138,891.55	3,988,856.00	5,983,285.00
报告期期间基金总申购份额	333,096.44	－	－
减:报告期期间基金总赎回份额	8,428,784.12	－	－
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	2,522,860.21	-685,748.00	-1,028,622.00
报告期期末基金份额总额	18,566,064.08	3,303,108.00	4,954,663.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算调整份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§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中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。
②《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。
③《诺安中证创业成长指数分级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诺安中证创业成长指数分级证券投资基金2014年第一季度报告正文。
⑥报告期内诺安中证创业成长指数分级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
2014年4月22日

诺安全球黄金证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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：2014年4月22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2014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2014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	1,096,384,421.50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（2014年1月1日－2014年3月31日）
1.本期已实现收益	-8,524,094.47
2.本期利润	58,024,328.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0518
4.期末基金资产净值	858,616,905.67
5.期末基金份额净值	0.783

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。

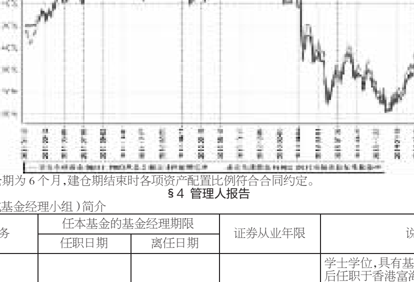
3.2 基金净值表现

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	6.97%	0.91%	8.21%	0.94%	-1.24%	-0.03%

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



注：本基金的建仓期为6个月，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		
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	－	5	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

一季度，黄金在新兴市场货币贬值和美联储减少资产购买计划实施过程中轰轰烈烈反弹，直扑1400美元。至三月中旬，有所回落。

黄金自去年年底最后一天收盘站在了1200美元以上，给市场带来一个暗示，1200美元以下的买盘足够多。黄金在2013年全年下跌近28%并以将近全年最低点

收盘，显示出投资者对于黄金后市的悲观。一月份，黄金市场震荡上行，止跌反弹。一方面是对去年年底过度悲观预期的消化和修复，另一方面今年初美国经济回调和新兴市场的波动刺激了黄金的避险需求。当月上涨约3%。印度商家寻求降低黄金进口关税。2013年印度由于黄金进口规模激增，导致经常帐赤字大幅走宽，印度政府随后将黄金进口关税上调至10%的历史记录，并强制进口商将20%的黄金用作出口用途，令印度国内实物金买盘大幅降温。但由于黄金对于印度民众的重要性，要求放松进口限制的声音一直存在。

二月份，黄金市场继续延续反弹势头，市场修正了前期对美联储的紧缩预期，多头情绪上升。中国公布2013年的实金消费数据。中国2013年黄金消费达到1176.40吨，同比增长41.36%。黄金产量达到428.16吨，再创历史新高，连续七年位居世界第一。

三月份，黄金市延续前期上涨的势头，乌克兰局势继续推高了市场的避险情绪。但是在月中之后，随着地缘政治因素的淡化，黄金上涨动力有限。而美国经济数据回暖以及美联储向市场释放提前进入加息周期的信号，令黄金价格转而回落。印度政府不降反升，上调黄金进口税，进一步降低实金需求。

截止季度末，全球投资者持有的黄金ETF持有量为1759吨，比去年底略减8吨，但二月份开始看到持有量有所增加。

投资操作上我们采取的策略是满仓跟踪。

基金净值为0.783，累计净值0.868，本期上涨6.97%，业绩指标上涨7.24%。

展望二季度，黄金在一季度已经尝试冲击1400美元，回落过程中下探1280美元又迅速重上1300美元。市场陆续披露一些国家在增持黄金，调整外汇储备结构。我们觉得虽然市场的认同方向是继续往下，但是黄金近期的表现有机会重拾升势，再次冲击1400美元。如果不能成功，则会继续测试1250美元的支持位，今年的总体趋势应该是震荡盘整。

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0.783元。本报告期基金份额净值增长率为6.97%，同期业绩比较基准收益率为8.21%。

§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	824,214,128.89	94.93
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	-226,800.00	-0.03
	其中：远期	-226,800.00	-0.03
	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	43,443,832.53	5.00
8	其他资产	833,587.98	0.10
9	合计	868,264,749.40	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序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。

5.8 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	180天远期交易	-226,800.00	-0.03

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	JB-PHY GOLD-A$	ETF基金	契约型开放式	Swiss & Global Asset Management AG	171,266,754.19	19.95
2	ISHARES GOLD TRU	ETF基金	契约型开放式	BlockRock Fund Advisors	169,737,077.34	19.77
3	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	ETF Securities USA LLC	156,223,497.03	18.19
4	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	World Gold Trust Services LLC	127,978,755.78	14.91
5	UBS-GOLD ETF $-A	ETF基金	契约型开放式	UBS Fund Management Switzerland	124,486,346.48	14.50
6	CSETF GOLD	ETF基金	契约型开放式	Credit Suisse Asset Management Funds/Zurich	58,997,735.01	6.87
7	ZKB-GOLD-A USD	ETF基金	契约型开放式	Zuercher Kantonalbank	15,523,963.06	1.81

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	1,930.09
5	应收申购款	831,657.89
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	833,587.98

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

报告期期初基金份额总额	1,138,067,640.93
报告期期间基金总申购份额	44,535,096.30
减:报告期期间基金总赎回份额	86,218,315.73
报告期期末基金份额总额	1,096,384,421.50

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§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诺安全球黄金证券投资基金2014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。

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
2014年4月22日