诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2014年第2期

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

重要提示

（一）诺安多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2011年5月18日证监许可【2011】739号文核准公开募集,本基金的基金合同于2011年8月9日正式生效。

（二）基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

（三）投资有风险,投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场系统性风险、上市公司风险、利率风险、流动性风险、信用风险、管理风险、本基金特有风险、资产配置风险及其他风险等。

本基金属于股票型基金,属于具有高风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

（四）基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)财务数据已经基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年8月9日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

公司名称:诺安基金管理有限公司
住所:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层
办公地址:同住所
法定代表人:秦维舟
设立日期:2003年12月9日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]132号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元人民币
存续期限:持续经营
电话:0755—83026688
传真:0755—83026677
联系人:王嘉
股权结构:

股东单位	出资额(万元)	出资比例
中国对外经济贸易信托投资有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
大恒新纪元科技股份有限公司	3000	20%
合　计	15000	100%

（二）证券投资基金管理情况

截至2014年8月9日,本基金管理人共管理三十四只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金及诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金。

（三）主要人员情况

1. 董事会成员

秦维舟先生,董事长,工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理,香港昌维发展有限公司总经理,香港先锋投资有限公司总经理,中国新纪元有限公司副总裁,诺安基金管理有限公司副董事长。

徐卫晖先生,副董事长,工商管理硕士。历任中国化工进出口总公司财会部副总经理,中化国际贸易股份有限公司副总经理,中化河北进出口公司总经理,中化国际（控股）股份有限公司总经理,中国中化股份有限公司战略规划部、投资发展部总经理,中国对外经济贸易信托有限公司党委书记。

张家林先生,董事,高级工程师,全国人民政治协商会议第9、10、11届委员。曾任中科院自动化研究所工程师、高级工程师,中国自动化技术公司总经理。现任中国大恒(集团)有限公司董事长、大恒新纪元科技股份有限公司董事长。

欧阳文安先生,独立董事,工程师。历任中共北京市委副秘书长兼办公厅主任,中共北京市石景山区委书记,中共北京市委常委、秘书长,北京国际电气工程公司董事长,北京国际电力开发投资公司董事长。

朱秉刚先生,独立董事,教授级高级经济师。历任石油部计划司副司长,中国石油天然气集团公司计划局局长、咨询中心副主任。

陆南屏先生,独立董事。历任新华社香港分社办公厅综合处处长、办公厅副主任、国际问题研究中心办公室主任,国家外汇管理局办公室主任、政策法规司司长、副局长。

2. 监事会成员

李京先生,监事,企业管理硕士。历任中国中化集团总裁办公室部门经理,中化集团香港立丰实业公司总经理助理,中化汇富资产管理公司副总经理,中化欧洲资本公司副总经理兼世盈（厦门）创业投资有限公司副总经理,现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵星明先生,监事,金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长,深圳证券交易所理事会秘书长,君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生,监事。历任浙江证券深圳营业部交易主管,国泰君安证券公司部门主管,诺安基金管理有限公司交易中心总监。

梅律吾先生,监事,硕士。历任长城证券有限责任公司研究员,鹏华基金管理有限公司研究员,诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监。

3. 经理层成员

奥成文先生,总经理,经济学硕士,经济师。曾任中国通用技术（集团）控股有限责任公司资产经营部副经理,中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002年10月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作,任公司督察长,现任公司总经理。

杨文先生,副总经理,企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员,中融基金管理公司市场部经理。2003年8月加入诺安基金管理有限公司,历任市场部总监、发展战略部总监,现任公司副总经理。

杨谷先生,副总经理,经济学硕士,CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员、西北证券公司资产管理部研究员。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、诺安股票证券投资基金基金经理、诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理、诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

陈勇先生,督察长,经济学硕士。曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理,民生证券公司证券投资总部副总经理。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、研究部总监,现任公司督察长。

4. 现任基金经理

杨谷先生,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。

吴博文先生,硕士,曾先后任职于美国雷曼兄弟证券亚洲有限公司、日本野村证券亚洲有限公司,从事港股研究工作。2009年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年6月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

5. 历任基金经理

王永宏先生,曾于2011年8月至2013年4月担任本基金基金经理。

6. 投资决策委员会成员的姓名及职务

本公司投资决策委员会分股票类基金投资决策委员会和固定收益类基金投资决策委员会,具体如下:

股票类基金投资决策委员会:主席由公司总经理奥成文先生担任,委员包括:杨谷先生,副总经理、投资总监、基金经理;夏俊杰先生,权益投资部总监、基金经理;邹翔先生,成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监、基金经理;王创练先生,研究部总监。

固定收益类基金投资决策委员会:主席由公司总经理奥成文先生担任,委员包括:杨谷先生,副总经理、投资总监、基金经理;杨文先生,副总经理;张乐赛先生,固定收益部总监、基金经理;王创练先生,研究部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田　青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年12月31日,中国建设银行资产总额153,632.10亿元,较上年增长9.95%;客户贷款和垫款总额85,900.57亿元,增长14.35%;客户存款总额122,230.37亿元,增长7.76%。营业收入5,086.08亿元,较上年增长10.39%,其中,利息净收入增长10.29%,净利息收益率(NIM)为2.74%;手续费及佣金净收入1,042.83亿元,增长11.52%,占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元,较上年增长11.28%;净利润2,151.22亿元,增长11.12%。资产质量保持稳定,不良贷款率0.99%,拨备覆盖率268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%,保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个,服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外102项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5,较上年上升2位;在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中,位列第2,较上年上升13位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年12月31日,中国建设银行已托管349只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至2012年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

三、相关服务机构

（一）诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、北京、上海、广州、成都开设五个直销网点对投资者办理开户、申购和赎回等业务:

1、深圳直销中心
办公地址:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
邮政编码:518048
电话:0755-83026603
传真:0755-83026677
联系人:张逸凡

2、北京分公司
办公地址:北京市朝阳区光华路甲诺安基金大厦14号8-9层
邮政编码:100020
电话:010-59027811
传真:010-59027890
联系人:孟佳

3、上海分公司
办公地址:上海浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦903室
邮政编码:200120
电话:021-68824617
传真:021-68362099
联系人:温乐珣

4、广州分公司
办公地址:广州市珠江新城华夏路10号富力中心2908
邮政编码:510623
电话:020-38928980
传真:020-38928980
联系人:黄怡珊

5、西部营销中心
办公地址:成都市锦江区下东大街216号喜年广场2407
邮政编码:610021
电话:028-86586052
传真:028-86586055
联系人:裴兰

（二）基金代销机构（排名不分先后）

（1）中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:王洪章
联系人:张静
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
网址:www.ccb.com

（2）中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:010-66107900
传真:010-66107914
联系人:田耕
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

（4）中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

（5）交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
联系人:兰奇
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

（7）平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:孙建一
电话:0755-82088888
传真:0755-82080714
联系人:周勤
客户服务电话:95511-3
网址:www.sdb.com.cn;www.bank.pingan.com

（8）北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:王曦
电话:010-66223584
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn

（9）南京银行股份有限公司
地址:南京市白下区淮海路50号
法定代表人:林复
联系人:贺坚
联系电话:025-84544135
传真:010-84544129
客户服务电话:025-96400、40088-96400
网址:www.njcb.com.cn

（10）杭州银行股份有限公司
注册地址:中国·杭州凤起路432号
办公地址:中国·杭州凤起路432号
法定代表人:吴太普
客户服务电话:0571-96523、400-8888-508
网址:www.hzbank.com.cn

（11）温州银行股份有限公司
住所及办公地址:温州市车站大道华海广场1号楼
法定代表人:夏瑞洲
电话:0577-88990082
传真:0577-88995217
联系人:林波
客户服务电话:0577-96699
网址:www.wzbank.cn

（12）江苏银行股份有限公司
注册地址:南京市洪武北路55号
办公地址:南京市洪武北路55号
法定代表人:黄志伟
联系人:田春慧
电话:025-58588167
传真:025-58588164
客户服务电话:400-86-96098、96098
网址:www.jsbchina.cn

（13）中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com

（14）中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-58351666
传真:010-83914283
联系人:李群
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

（15）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:汤嘉惠、倪苏云
电话:021-61618888
传真:021-63604199
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

（16）中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
电话:010-65546655—108
传真:010-65542373
联系人:秦莉
客户服务电话:95558
网址:www.ecitic.com

（17）烟台银行股份有限公司
注册地址:中国·烟台市芝罘海港路25号
办公地址:山东省烟台市芝罘区海港路25号
法定代表人:叶文君
联系人:王淑华
电话:0535-6699660
传真:0535-6699884
客户服务电话:4008-311-777
网址:www.yantaibank.net

（18）威海市商业银行股份有限公司
注册地址:中国·威海市宝泉路 9 号
法定代表人:谭先国
客户服务电话:96636
网址:www.whccb.com

（19）北京农村商业银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街9号
办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心B座
法定代表人:王金山
电话:010-63229475
传真:010-63229478
联系人:王薇娜
客户服务电话:400-66-96198
网址:www.bjrcb.com

（20）华侨银行（中国）有限公司
注册地址:上海市浦东新区源深路1155号华侨银行大厦
办公地址:上海市浦东新区源深路1155号华侨银行大厦
法定代表人:钱乃骥
客户服务电话:400 670 2888
网址:www.ocbc.com.cn

（21）包商银行股份有限公司
注册地址:包头市青山区钢铁大街6 号
办公地址:包头市青山区钢铁大街6 号
法定代表人:李镇西
客户服务电话:96016（内蒙）967210（宁波、深圳）028-65558555（成都）
网址: www.bsb.com.cn

（22）国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
客户服务电话:4008—888—666
网址:www.gtja.com

（23）申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021—54033888
传真:021—54038844
联系人:孙洪喜
客户服务电话:021—962505
网址:www.sywg.com

（24）中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人:陈有安
电话:010-66568430
传真:010-66568990
联系人:田薇
客户服务电话:400-8888-888
网址:www.chinastock.com.cn

（25）安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
联系电话:0755-82558305
客户服务电话:4008-001-001
网址:www.axzq.com.cn

（26）广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东省广州市天河北路183号大都会广场43、42、41、38、36、19、18楼
法定代表人:林治海
电话:020—87555888
传真:020—87557985
联系人:黄岚
客户服务电话:95575,或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn

（27）国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
电话:0755—82130833
传真:0755—82133952
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

（28）中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人:王东明
电话:010—84683893
传真:010—84865560
联系人:陈忠
客户服务电话:010-84588888
网址:www.cs.ecitic.com

（29）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-68815009
联系人:刘晨
客户服务电话:400-8888-788、10108998
网址:www.ebscn.com

（30）德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人:姚文平
电话:021—68761616
传真:021—68767981
联系人:罗芳
客户服务电话:400—8888—128
网址:www.tebon.com.cn

（31）南京证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人:张华东
电话:025-83364032
传真:025-83320066
联系人:胥春阳
客户服务电话:400-828-5888
网址:www.njzq.com.cn

（32）东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
基金业务对外联系人:李涛
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
客户服务电话:400-888-8588
网址:www.longone.com.cn

（33）湘财证券股份有限公司
注册地址:中国湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:中国湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865938
联系人:陈伟
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

（34）国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常喆
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
联系人:黄静
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

（35）渤海证券股份有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451861
传真:022-28451892
联系人:王兆权
客户服务电话:400-6515-988
网址:www.bhzq.com

（36）平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人:杨宇翔
全国免费业务咨询电话:4008816168
开放式基金业务传真:0755-82400862
联系人:周璐
全国统一总机:4008866338
网址:www.pingan.com

（37）国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务电话:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

（38）中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人:杜航
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
联系人:余雅娜
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

（39）上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
电话:021-63231111
联系人:王伟力
客服服务电话:021-962518
网址:www.962518.com

（40）新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表:刘汝军
联系人:孙恺
电话:010-83561149
传真:010-83561094
客户服务电话:400-698-9898
网址:www.xsdzq.cn

（41）长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516289
联系人:匡婷
客户服务电话:400—6666—888
网址:www.cgws.com

（42）齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
开放式基金咨询电话:0531-81283906
开放式基金业务传真:0531-81283900
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

（43）宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人:冯戎
基金业务对外联系人:李茂俊
基金业务对外联系人电话:010-62294608-6240
基金业务对外联系人传真:010-62296854
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

（44）中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人:龙增来
客户服务电话:400-600-8008
网址:www.china-invs.cn

（45）江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

（46）爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号
法定代表人:郭林
客户服务电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com

（47）中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
客户服务电话:400-889-5618
网址:www.e5618.com

（48）信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

（49）日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:张利军、陈韦杉
联系电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn

（50）华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区月坛北街26号恒华国际商务中心9层
法定代表人:丁之锁
客户服务电话:01058568162
网址:www.hrsec.com.cn

（51）方正证券股份有限公司
注册地址:长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

（52）华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:四川省成都市陕西街239号
法定代表人:杨炯洋
电话:028-86117373
传真:028-86150615
客户服务电话:400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn

（53）首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
办公地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人:吴涛
客户服务电话:400-6200-620
网址:www.sczq.com.cn

（54）西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层
办公地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406132
网址:www.westsecu.com

（55）长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:李良
客户服务电话:4008-888-999或95579
公司网址:www.95579.com

（56）东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

（57）广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
办公地址:广东省广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:刘东
电话: 020-87322668
传真: 020-87325036
联系人:樊刚正
客户服务电话: 020-961303
网址: www.gzs.com.cn

（58）中原证券股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
基金业务对外联系人:程月艳　耿铭
联系电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
客户服务电话:0371-967218;400-813-9666
网址:www.ccnew.com

（59）天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
客户服务电话:010-66045678
传真:010-66045518
天相投顾网-网址:www.txsec.com
天相基金网-网址:www.txjijin.com
联系人:尹伶
联系电话:010-66045529

（60）海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客户服务电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.htsec.com

（61）中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号
办公地址:北京市东城区朝内大街188号中信建投证券公司
法定代表人:张佑君
开放式基金咨询电话:40-08888-108
开放式基金业务传真:010—65182261
联系人:权唐
网址:www.csc108.com

（62）第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
客户服务电话:400-888-1888
网址:www.firstcapital.com.cn

（63）招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45楼
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45楼
法定代表人:宫少林
电话:0755—82943666
传真:0755—82960141
联系人:黄健
客户服务电话:95565或400—8888—111
网址:www.newone.com.cn

（64）华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025—84457777
传真:025—84579763
联系人:李金龙
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

（65）大通证券股份有限公司
注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
法定代表人:张智河
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn

（66）华安证券股份有限公司
注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
客户服务电话:96518
网址:www.hazq.com

（67）华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦第28层A01、B01
法定代表人:洪家新
客户服务电话:400-109-9918（全国）,021-32109999,029-68918888;
网址: www.cfsc.com.cn

（68）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法人代表人:马令海
客户服务电话:400-850-7771
网址: t.jrj.com

（69）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客户服务电话:400-089-1289
网址: www.erichfund.com

（70）上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
客户服务电话:400-1818-188
网址: www.1234567.com.cn

（71）北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
联系人:孙晋峰
电话:010-67000988
传真:010-68086927
客户服务电话:400—001—8811
网址:www.zcvc.com.cn

（72）杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
电话:021-60897869
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

（73）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn;www.jjmmw.com

（74）上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903～906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-58870011
传真:021-68596916
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

（75）和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话:400-920-0022
传真:021-20835879
网址:licaike.hexun.com

（76）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
客户服务电话:0571-88920897,4008-773-772
网址: www.5ifund.com

（77）深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼407室
办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼407室
法定代表人:卓紘畾
客户服务电话:4006-877-899
网址: www.tenyuanfund.com

（78）北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
客户服务电话:400-888-6661
网址: www.myfund.com

（79）一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
法定代表人:吴雪秀
客户服务电话:400-001-1566
网址: www.yilucaifu.com

（80）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net
联系人:魏争
电话:010-57418829

（81）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:400-818-8866
网址: www.shengshiview.com.cn
联系人:徐长征、林凌
电话:010-58170943,010-58170918

（82）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
客户服务电话: 400 6099 200
网址: www.yixinfund.com
联系人:程刚
电话:010-52855713

（三）注册登记机构
名称:诺安基金管理有限公司
住所:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层
法定代表人:秦维舟
电话:0755-83026688
传真:0755-83026677

（四）出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:北京市颐合中鸿律师事务所
住所:北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室
法定代表人/负责人:夏军
电话:010-65178866
传真:010-65180276
经办律师:虞荣方、高平均

（五）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:上海市延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人:卢伯卿
电话:021-61418888
传真:021-63350003
联系人:余志亮
经办注册会计师:胡小骏、王明静

四、基金的名称

诺安多策略股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约性开放式基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具、股指期货和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为5%-40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数×75%+上证国债指数×25%

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:

1、沪深300指数编制合理、透明、运用广泛,具有较强的代表性和权威性。

2、上证国债指数以国债为样本,按照发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。

3、作为股票型基金,选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在管理人与托管人协商一致报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

九、基金的投资策略

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。

1.资产配置策略

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。大类资产的配置由多因子市场择时模型和具体情况决定。模型分为短周期模型和长周期模型,短周期模型每天进行更新,长周期模型在经济数据公布后及时进行更新。同时对于模型本身我们也会定期进行修正和检验。此外,需要指出的是在具备足够多预期收益率良好的投资标的时,将优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

2.股票投资策略

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。

定量投资方面,本基金将依托自主研发的定量投资模型,构建投资组合。其中,核心模型包括诺安行业选择模型、诺安多因素股票模型以及诺安组合优化器。量化投资小组将根据市场变化趋势,定期或不定期地对模型进行复核,并做相应调整,以不断改善模型的适用性。

（1）诺安行业选择模型

诺安行业选择模型,通过定量分析行业赢利能力、分析师的盈利预期、市场认同度等因素,捕捉具有投资吸引力的行业。根据各行业的投资吸引力,决定各行业相对于业绩比较基准中行业权重的相对偏离度。提高投资吸引力高的行业配置,降低投资吸引力低的行业配置。

（2）诺安多因素股票模型

通过诺安行业选择模型筛选的行业进入个股筛选程序。本基金在个股选择层面,采用“诺安多因素股票模型”。

诺安基金根据对中国证券市场运行特征的长期研究,选取估值因子（Valuation）、成长因子（Growth）、盈利趋势（Operating）、分析师情绪（Sentiment）、市场因素（Market）五大类对A股股价波动具有较强解释度的指标,建立“诺安多因素股票模型”,并使该模型成为股票选择的重要依据。

定性投资主要利用基本面研究成果,对模型自动选股的结果进行复核和优选,即在诺安多因素股票模型筛选出的股票名单的基础上,根据分析师定性研究成果,剔除掉某些存在定性缺陷或发生不利变化和事件的上市公司的股票,从而进行定性优选。

需要考虑的定性因素包括:

A)上市公司治理结构、管理和产品;
B)上市公司生产经营;
C)存在对股价有负面影响的潜在事件和政策;
D)存在压制股价的其它非基本面因素。

本基金通过量化技术,对上述定量模型和定性因素筛选的结果进行优化,以确定个股权重,实现风险收益的最佳匹配。定量投资方法以科学性和系统性著称,将在严格的纪律化模型制约下,紧密跟踪策略,使运作风险最小化,并力争取得较高收益。在现阶段,本基金使用“稳健优化”的方法,在所有可能的期望回报的最低条件下,计算最优组合。与其他优化方法相比,使用“稳健优化”方法获得的最优组合,更加稳定,更加分散化,交易成本和换手率更低。

3.债券投资策略

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。

债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,采取以久期管理策略为主,辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等,确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

4.权证投资策略

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。

5.股指期货投资策略

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。股指期货的具体投资策略包括:（1）对冲投资组合的系统性风险;（2）有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

十、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。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2014年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	182,199,692.09	62.66
	其中:股票	182,199,692.09	62.66
2	固定收益投资	56,981,885.40	19.60
	其中:债券	56,981,885.40	19.60
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	买入返售金融资产	–	–
5	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	29,293,859.28	10.07
7	其他资产	22,315,593.97	7.67
	合计	290,791,030.74	100.00

（二）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	10,194,689.07	3.87
C	制造业	105,822,481.71	40.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,165,100.00	3.10
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	12,453,038.40	4.72
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	8,731,868.77	3.31
J	金融业	13,344,504.52	5.06
K	房地产业	8,254,312.34	3.13
L	租赁和商务服务业	2,611,530.90	0.99
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,673,579.78	1.01
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	9,948,586.60	3.77
S	综合	–	–
	合计	182,199,692.09	69.09

（三）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	600511	国药股份	548,592	12,453,038.40	4.72
2	600183	生益科技	1,768,807	10,895,851.12	4.13
3	600329	中新药业	676,876	10,484,809.24	3.98
4	601808	中海油服	579,573	10,194,689.07	3.87
5	601318	中国平安	250,978	9,873,474.52	3.74
6	600886	国投电力	1,601,000	8,165,100.00	3.10
7	600731	湖南海利	1,016,627	7,370,545.75	2.79
8	600351	亚宝药业	700,000	6,440,000.00	2.44
9	000558	莱茵置业	1,068,318	4,946,312.34	1.88
10	600373	中文传媒	350,000	4,900,000.00	1.86

（四）报告期末按券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	56,981,885.40	21.61
8	其他	–	–
9	合计	56,981,885.40	21.61

（五）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	113005	平安转债	350,000	37,387,000.00	14.18
2	110015	石化转债	124,480	13,440,105.60	5.10
3	110011	歌华转债	60,710	6,154,779.80	2.33

（六）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。

（七）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。

（八）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。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易说明

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。

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。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

（十一）投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,除中新药业、中国平安和中国石化外,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。

（1）2013年9月22日,天津中新药业集团股份有限公司收到中国证券监督管理委员会天津证监局出具的《行政监管措施决定书》,主要是因为公司网站提前发布中期业绩数据。天津证监局要求信息披露义务人在公司网站及其他媒体发布信息的时间不得先于指定媒体,不得以新闻发布会或者答记者问等任何形式代替应当履行的报告、公告义务,不得以定期报告形式代替应当履行的临时报告义务,应加强信息披露事务管理等。

截至本报告期末,中新药业（600329）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看,我们认为该公司估值较低,有恢复增长的潜力,上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有中新药业。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

（2）2013年10月15日,中国平安保险（集团）股份有限公司董事会披露公告,中国平安保险（集团）股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司收到了中国证监会关于“万福生科”事件的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48号）。中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

截至本报告期末,平安转债（113005）为本基金前十大重仓证券。我们认为,“万福生科”事件的处理有利于证券市场长远健康发展,但从投资的角度上看,由于平安证券的利润占整个平安保险的比例较低,投行业务在平安证券的利润占比又相对较小,而我们看好的是平安寿险一直以来形成的竞争力,平安证券受处罚不影响中国平安作为保险集团的价值。因此,本基金才继续持有平安转债。当然,后续我们会综合考虑保险市场的竞争、股票市场债券市场的走势以及中国平安的经营状况来及时调整我们对平安转债的持仓,以保护投资者权益。

（3）2014年1月12日,中国石油化工股份有限公司发布公告,国务院对山东省青岛市“ 11·22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议,对中国石化及当地政府的 48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的 15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。本次事故造成直接经济损失人民币 75,172万元,中国石油化工股份有限公司将承担其相应赔偿责任。相关资金主要来自中国石化在以前年度积累的安全生产保险基金（指经国家有关部门批准由中国石油化工集团公司面向公司所属企事业单位设立的企业安全生产保险基金）和公司向商业保险公司投保的商业巨灾保险的保险理赔资金。

截至本报告期末,石化转债（110015）为本基金前十大重仓证券。我们认为,从投资的角度上看,由于事故损失占整个中国石化利润的比例较低,且赔偿资金主要来源于安全生产保险基金和商业保险理赔资金,而我们看好的是中国石化一直以来形成的竞争力,事故处罚不影响中国石化总体生产经营和财务状况的稳定。因此,本基金才继续持有石化转债。当然,后续我们会综合考虑石化市场的竞争、股票市场债券市场的走势以及中国石化的经营状况来及时调整我们对石化转债的持仓,以保护投资者权益。

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。

3、期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	190,732.63
2	应收证券清算款	21,649,036.44
3	应收股利	–
4	应收利息	225,790.72
5	应收申购款	250,034.18
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	22,315,593.97

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	37,387,000.00	14.18
2	110015	石化转债	13,440,105.60	5.10
3	110011	歌华转债	6,154,779.80	2.33

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限的情况。

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,分项之和与合计数可能有尾差。

十二、基金的业绩

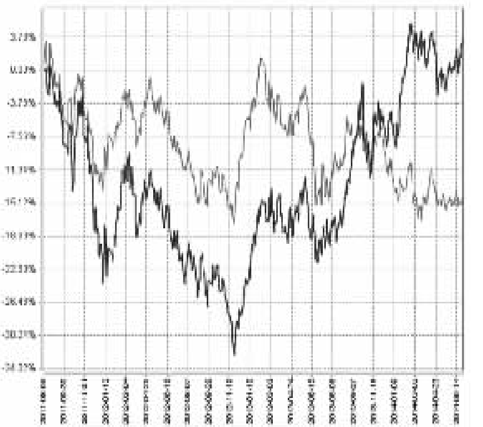
本基金的过往业绩不代表未来表现。

（一）诺安多策略股票型证券投资基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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
2011.8.9~2011.12.31	–19.90%	1.35%	–11.73%	1.04%	–8.17%	0.31%
2012.1.1~2012.12.31	–4.99%	1.31%	6.88%	0.96%	–11.87%	0.35%
2013.1.1~2013.12.31	24.97%	1.21%	–4.73%	1.04%	29.70%	0.17%
2014.1.1~2014.6.30	8.94%	0.95%	–4.82%	0.78%	13.76%	0.17%
2011.8.9~2014.6.30	3.60%	1.23%	–14.45%	0.97%	18.05%	0.26%

注:本基金业绩比较基准: 沪深300指数×75%+上证国债指数×25%

（二） 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。

十三、基金的费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费;
（2）基金托管人的托管费;
（3）基金财产拨划支付的银行费用;
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用;
（5）基金份额持有人大会费用;
（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费;
（7）基金的证券交易费用;
（8）依法可以在基金财产中列支的其他费用。
（9）本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

（3）除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金在申购时收取申购费用,申购费率随申购金额的增加而递减,具体费率如下:

申购金额(M)	申购费率
M<50万元	1.5%
50万元≤M<100万元	1%
100万元≤M<200万元	0.8%
200万元≤M<500万元	0.5%
M ≥500万元	每笔1000元

2、赎回费用

赎回费用由赎回人承担,其中25%的部分归基金资产所有,其余部分可用于注册登记等相关费用。本基金的赎回费率随持有期递减,最高不超过赎回总金额的0.5%。具体费率如下:

持有年限T	赎回费率
T <1年	0.5%
1年≤T<2年	0.2%
T ≥2年	0

3、转换费

（1）、基金转换费用

基金转换费由转出基金的赎回费以及相应的申购费补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定,其中赎回费的百分之二十五计入基金资产。基金转换费用由基金持有人承担。

注:当转入基金的适用申购费率高于转出基金的适用申购费率时,将收取申购费补差,即“申购费补差费率=转入基金的适用申购费率—转出基金的适用申购费率”;当转入基金的适用申购费率等于或低于转出基金的适用申购费率时,不收取申购费补差。

（2）、转换份额计算公式

计算公式如下:A=［B×C×(1—D)/（1+G）+F］/E

其中,A为转入的基金份额;B为转出的基金份额;C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;D为转出基金的对应赎回费率;G为申购费补差费率;E为转换申请当日转入基金的基金份额净值;F为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计未付收益（仅限转出基金为货币市场基金）。具体份额以注册登记机构的记录为准。转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

4、投资者通过网上交易方式办理基金申购或转换,适用网上交易费率,详见基金管理人网站的具体规定。

5、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率、赎回费率和收费方式。如调整费率或收费方式,基金管理人应最迟于新的费率或收费方式实施日前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的费率或收费方式还将在最新的更新的招募说明书中列示。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,根据国家法律法规的规定,履行各自的纳税义务。

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2014年3月22日刊登的《诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书》进行了更新,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施得投资经营活动进行了内容的补充,主要更新的内容如下:

1、在“重要提示”部分,更新了招募说明书内容的截至日期及相关财务数据的截至日期。

2、在“第二部分 释义”中,更新了词语的含义。

3、在“第三部分 基金管理人”中,更新了证券投资基金管理情况、现任基金经理的基本信息。

4、在“第五部分 相关服务机构”中,更新了代销机构和出具法律意见书的律师事务所的信息。

5、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”中,更新了“十三、基金的转换”的相关内容。

6、在“第九部分　基金的投资”中,更新了“十二、基金投资组合报告”的内容。相关数据及内容的截止日期为2014年6月30日。

7、在“第十部分　基金的业绩”中,更新了本基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表以及本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图。

8、在“第二十一部分　对基金份额持有人的服务”中,更新了本基金开通定投业务的相关情况,相关事宜已公告。

9、在“第二十二部分　其他应披露事项”,列举了本基金在本报告期内的相关公告。

十五、签署日期

2014年8月9日

以上内容仅为摘要,须与本招募说明书（更新）正文所载之详细资料一并阅读。

诺安基金管理有限公司
2014年9月20日