# 诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要

2015年第1期

## 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

**重要提示**

（一）诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2011年8月9日证监许可【2011】1258号文核准公开募集，本基金的基金合同于2011年9月27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招募说明书。

（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。

（五）本基金为基金中基金（FOF），主要投资于全球范围内优质的石油、天然气等能源类基金（包括ETF）以及公司股票，基金净值会因为石油、天然气等能源价格波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下三类：一是本基金特有风险，包括投资标的风险、上市交易及外汇额度限制引发的特殊风险等；二是境外投资风险，包括汇率及外汇风险管制、政治管制风险、税务风险、法律风险等；三是基金运作风险，包括操作风险会计核算风险、交易清算风险、技术系统运行风险、通讯风险、不可抗力风险等。在投资本基金前，投资者应全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑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。

（六）基金合同生效六个月后，在相关条件成熟的情况下，本基金将向深圳证券交易所申请上市交易，在本基金上市交易前，投资者仅可通过赎回基金份额进行变现。在上市交易期间，如出现继续接受申购可能导致本基金突破国家外汇局批准的外汇额度的情况，本基金将暂停申购，由此可能导致二级市场价格出现较大波动。当本基金因外汇额度原因暂停申购期间出现了较高的折溢价率，折溢价率可能因国家外汇局批准基金管理人新增外汇额度以及本基金恢复申购业务而大幅缩小，亦可能导致本基金二级市场价格出现较大波动。本基金二级市场收盘价折溢价率可能因石油天然气等能源市场价格波动等市场因素发生较大变动。

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》、《公开募集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。

招募说明书(更新)已经基金托管人复核。招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年3月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日(财务数据未经审计)。

**一、基金名称**

诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）

**二、基金的类别**

基金中基金

**三、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。

**四、投资范围**

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括公募基金（包括ETF）；普通股、优先股、存托凭证等权益类证券；银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券；以及中国证监会许可的其他金融工具。

本基金为基金中基金，投资于基金的比例不低于本基金资产的60%，投资于基金的资产中不低于80%投资于石油天然气等能源行业基金，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

在正常的市场状况下，本基金将会投资于全球范围内优质的石油、天然气等能源行业的基金（包括ETF）及公司股票。本基金投资的基金主要包括（1）石油天然气等能源行业基金，包括能源行业ETF（即跟踪能源行业指数的ETF）及能源行业股票基金（包括跟踪能源行业指数的指数基金和80%以上资产投资于能源行业公司股票的主动型基金）。（2）以跟踪商品指数或商品价格为投资目标的商品类基金。本基金投资的股票主要包括：（1）石油和天然气等能源行业的开采、加工、销售及运输等企业股票；（2）能源设备及服务等企业股票；（3）新能源及替代能源，如风能、太阳能、其他环保能源及可再生能源企业股票。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

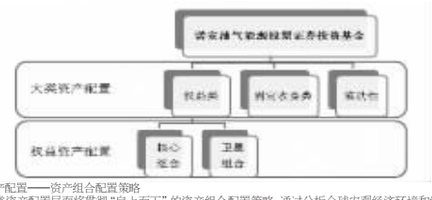
本基金管理人自合同生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

**五、投资策略**

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。本基金的资产配置策略如图1所示：

图1：诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）资产配置策略图




（1）大类资产配置——资产组合配置策略

本基金在大类资产配置层面将贯彻“自上而下”的资产组合配置策略，通过分析全球宏观经济环境和经济政策，借助基金管理人宏观经济量化的研究成果，分析和比较权益类、固定收益类和流动性工具等大类资产的预期风险收益特征，在有效控制风险的前提下，运用定性和定量相结合的方式确定基金资产配置长期比例。

本基金同时关注宏观经济的动态变化和市场趋势，根据盈利增长、流动性、估值水平、投资主体行为、市场情绪等因素进行综合判断，积极地调整各类资产在投资组合中的比例，把握市场时机，力争实现投资组合的收益最大化。

（2）权益类资产配置——“核心-卫星”资产配置策略

本基金在权益类资产投资方面采用“核心—卫星”资产配置策略。“核心—卫星”投资策略将组合资产分成两部分：一部分为“核心”组合，该组合主要投资于石油天然气等能源行业基金，包括能源行业ETF、能源指数基金以及主动型能源基金，以分享能源行业的长期收益；另一部分为“卫星”组合，主要投资于石油、天然气等能源类商品ETF及能源行业个股，通过不同资产类别的优化配置以及优质个股的精选，力争追求超额投资收益。

“核心—卫星”资产配置策略将主动投资策略与被动投资策略相结合，根据宏观经济环境、经济和产业周期、股票市场估值、市场投资主题和风格转换、以及市场整体的波动水平，基金管理人将对“核心—卫星”之间的资产配置进行评估和调整。

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。

（1）实现“核心”投资策略具体步骤：

①考虑到全球各主要资本市场宏观经济环境的不同、经济发展及产业周期的不一致，以及各市场行业板块估值、市场投资主题和风格的转换，基金管理人将初步确定在全球不同地区和市场配置能源行业基金的比例；

② 根据基金管理人对全球各区域经济及能源行业短、中、长期发展走势的分析和预期，调整“核心”组合在各主要资本市场的投资比例；

③ 基金管理人在前述配置比例基础上，从投资品种库中选择代表性强、跟踪质量好、流动性高和费率较低的ETF或指数型基金以简单有效快速准确的获取能源行业投资收益，同时精选业绩突出、评级优秀和流动性强的主动管理型能源基金以获取超额收益。

（2）精选指数型基金（包含ETF）保证“核心”投资策略的实现

1）指数型基金（包含ETF）选择指标

投资于指数型基金（包含ETF）的主要目标是简单、有效、快速、准确的获取能源行业投资收益，基于此，该类基金的选择指标主要包括：

① 基金管理公司：公司管理该类基金的经验、管理历史以及规模；

② 做市商评价指标：包括做市商的基本情况、报价连续性和买卖价差、历史成交量等；

③ 基金管理团队评价指标：投资理念、投资风格、历史业绩和稳定性；

④ 基金投资组合评价指标：基金所跟踪指数和市场的代表性；基金的长期表现和跟踪效率；基金的波动性和风险调整后收益及业绩归因分析等；基金的年内日均成交量及流动性；基金的费率等等。

2）基金筛选：形成指数型基金（包含ETF）的备选基金池

① 定性分析，主要针对基金管理人、基金管理团队和做市商

– 基金管理人：公司历史、管理规模和公司管理层、股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和过往法律纠纷等；

– 基金产品：成立时间、投资理念、费率水平、资产增长、客户分布状况和投资限制等；

– 投资流程：基金决策机制、业绩增长模式（依靠人员还是依靠流程）、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

– 基金管理团队：团队结构和稳定性、成员职责和从业经历、团队的绩效评价体系和备选基金的基金经理管理其它基金的状况；

– 风险控制：公司风险控制体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案；

– 做市商能力评估（主要针对ETF）。

② 定量指标，主要针对基金投资组合

– 基金历史业绩及业绩归因分析，深入了解基金投资流程和分析管理人投资技巧；

– 基金的表现分析：分析并确认基金绝对和相对表现优于同类基金平均水平；

–基金的风险分析：确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的来源以及基金风险调整后的收益；

– 基金的投资风格分析：确认基金的投资风格与其宣称的投资风格相符并长期保持一致；

– 基金规模；

– 基金的历史跟踪误差以及变动，ETF还需要考虑流动性和成交量等；

– 第三方评级机构（如晨星、理柏等）对基金的评级。

3）基金优选：形成指数型基金（包括ETF）核心基金池

① 基金优选

本基金分析研究人员将结合各选基金池中对于每只各选基金定性和定量分析的指标进行分析判断，并结合当前市场实际情况进行微调，最后根据计算结果对各选基金进行评估打分。

② 确定核心基金池

根据评估打分和优选结果确定本基金投资的指数型基金（包含ETF）核心基金池。

（3）精选主动型能源行业基金保证“核心”投资策略的实现：

1）主动型基金选择指标

投资于主动型基金的主要目标是在实现能源行业收益的基础上通过精选业绩突出、评级优秀和流动性强的主动基金实现超额收益，基于此，此类基金的选择指标包括主要包括：

① 基金管理公司：公司管理该类基金的经验、管理历史以及规模；

② 基金管理团队评价指标：投资理念、投资风格、历史业绩和稳定性；

③ 基金投资组合评价指标：基金的长期业绩表现、基金的波动性、风险调整后收益、业绩归因分析及基金的费率等等。

2）基金筛选：形成主动型基金的备选基金池

① 定性分析，主要针对基金管理人、基金管理团队

– 基金管理人：公司历史、管理规模和公司管理层、股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和过往法律纠纷等；

– 基金产品：成立时间、投资理念、费率水平、资产增长、客户分布状况和投资限制等；

– 投资流程：基金决策机制、业绩增长模式（依靠人员还是依靠流程）、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

– 基金管理团队：团队结构和稳定性、成员职责和从业经历、团队的绩效评价体系和备选基金的基金经理管理其它基金的状况；

– 风险控制：公司风险控制体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案；

– 做市商能力评估。

② 定量指标，主要针对基金投资组合

– 基金历史业绩及业绩归因分析，深入了解基金投资流程和分析管理人投资技巧，择时和选股能力；

–基金的表现分析：分析并确认基金绝对和相对表现优于同类基金平均水平；

–基金的风险分析：确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的来源以及基金风险调整后的收益；

– 基金的投资风格分析：确认基金的投资风格与其宣称的投资风格相符并长期保持一致；

– 基金规模；

– 基金的历史跟踪误差及变动；

– 第三方评级机构（如晨星、理柏等）对基金的评级。

3）基金优选：形成主动型基金的核心基金池

① 基金优选

本基金分析研究人员将结合各选基金池中对于每只各选基金定性和定量分析的指标进行分析判断，并结合当前市场实际情况进行微调，最后根据计算结果对各选基金进行评估打分。

② 确定核心基金池

根据评估打分和优选结果确定本基金投资的主动型基金的核心基金池。

（4）构建投资组合

本基金“卫星”组合将在核心股票池和核心基金池的基础上上构建投资组合。

4、债券投资策略

在全球经济的框架下，本基金管理人对全球宏观经济运行趋势及其引致不同国家或地区的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对不同国家及地区未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素。

主要的债券投资策略是：久期调整策略、收益率曲线策略、债券类属配置策略、骑乘策略、相对价值策略、信用利差策略、回购放大策略以及资产支持证券投资策略等。

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。

准确预测未来几个交易日的现金流动是做好现金管理的前提，基金管理人将合理把握因基金的申购赎回、石油、天然气等能源商品价格以及能源行业股票波动加大等因素引起的现金流变化，编制基金现金流量表。

持有一定比例的现金资产是基金保持流动性的必然要求，但现金资产的持有将会影响到本基金的投资收益，形成现金拖累。基金管理人将在保证基金流动性需求的前提下，制定合理的现金资产持有比例。

对于基金持有的现金资产，基金管理人将在保证基金流动性需求的前提下，提高现金资产使用效率，尽可能提高现金资产的收益率。

随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，若今后出现了更合理可行的投资于石油、天然气等能源类行业的投资方法和策略，本基金对投资方法和策略可进行相应的调整或更新。

**六、业绩比较基准**

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））。

标普能源行业指数（净收益）是标普500指数（S&P 500 Index）的子指数，该指数以标普500指数中能源行业的成分股为成分股，各成分股都是世界上非常知名的能源公司，分别是美国石油、天然气、消耗性燃料、能源设备及相关服务领域的领军者，公司的基本面良好、发展稳定。

综合标普能源行业指数（净收益）的编制方法、成分股覆盖特点及领域，标普能源行业指数（净收益）能够有效地反映出国际能源行业的价格趋势。

**七、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。

**八、基金投资组合报告**

基金托管人招商银行保证按照本基金合同规定，于2015年4月17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。

本报告以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

本投资组合报告所载数据截止日为2014年12月31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（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 | 82,831,287.35 | 82.47 |
| 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 | 16,378,924.97 | 16.31 |
| 8 | 其他资产 | 1,224,395.89 | 1.22 |
| 9 | 合计 | 100,434,608.21 | 100.00 |

（二）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。

（三）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。

（四）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。

（五）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。

（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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（七）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。

（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。

（九）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-ENERGY SEL | ETF基金 | 契约型开放式 | SSGA Funds Management | 16,705,783.20 | 18.26 |
| 2 | ISHARES-DJ ENERG | ETF基金 | 契约型开放式 | Black Rock Fund Advisers. | 16,451,269.21 | 17.99 |
| 3 | VANGUARD ENERG E | ETF基金 | 契约型开放式 | The Vanguard Group Inc. | 16,400,945.76 | 17.93 |
| 4 | ISHARES-GLB ENRG | ETF基金 | 契约型开放式 | Black Rock Fund Advisers. | 15,191,142.30 | 16.61 |
| 5 | SPDR OIL EXP | ETF基金 | 契约型开放式 | SGA Funds Management,Inc. | 15,183,670.81 | 16.60 |
| 6 | UNITED STS OIL FD LP UNITS | ETF基金 | 契约型开放式 | United States Commodities Fund,LLC | 2,363,461.06 | 2.58 |
| 7 | ETFS NATURAL GAS | ETF基金 | 契约型开放式 | ETFS Commodity Securities Ltd. | 376,073.74 | 0.41 |
| 8 | ETFS BRENT 1MTH | ETF基金 | 契约型开放式 | ETFS Securities.Ltd. | 96,713.49 | 0.11 |
| 9 | Brent Oil Fnd LP | ETF基金 | 契约型开放式 | United States Commodity Funds LLC | 62,227.78 | 0.07 |

（十）投资组合报告附注

1、本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被证监部门立案调查的，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金本报告期末未持有股票。

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 | 2,361.55 |
| 5 | 应收申购款 | 1,222,034.34 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,224,395.89 |

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、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。

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。

**九、基金的业绩**

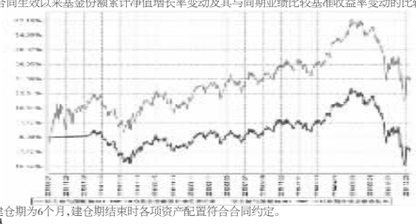
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2011.9.27-2011.12.31 | 0.40% | 0.04% | 13.24% | 2.33% | -12.84% | -2.29% |
| 2012.1.1-2012.12.31 | -5.18% | 0.88% | 3.67% | 1.10% | -8.85% | -0.22% |
| 2013.1.1-2013.12.31 | 14.39% | 0.83% | 20.49% | 0.88% | -6.10% | -0.05% |
| 2014.1.1-2014.12.31 | -14.97% | 1.25% | -8.12% | 1.16% | -6.85% | 0.09% |
| 2011.9.27-2014.12.31 | -7.40% | 0.96% | 29.97% | 1.21% | -37.37% | -0.25% |

注：标普能源行业指数（净收益）（S&P 500 Energy Sector Index（NTR））。

（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符合合同约定。

**十、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

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：王蕾

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2015年3月27日，本基金管理人共管理三十九只开放式基金：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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、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、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鹄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及诺安中证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、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金及诺安裕鑫收益两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。

齐斌先生，董事，硕士。历任中国国资有限责任公司董事会秘书，中国中化集团公司投资部副总经理、战略规划部副总经理。现担任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

李清泉先生，董事，硕士。历任天津电视台总编室副主任，天津广播电视台宣传管理部副主任。现任上海钟表有限公司董事长，上海摩士达钟表进出口有限公司董事长。

奥成文先生，董事，硕士。历任中国通用技术（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有限公司投资银行部副总经理，诺安基金管理有限公司督察长。现任诺安基金管理有限公司总经理。

汤小青先生，独立董事，博士。历任国家计委财政金融司处长，中国农业银行市场开发部副主任，中国人民银行河南省分行副行长，中国人民银行合作司副司长，中国银监会合作金融监管部副主任，内蒙古银监局、山西银监局局长，中国银监会监管一部主任，招商银行副行长。

史其祿先生，独立董事，博士。历任中国工商银行外汇业务管理处处长，中国工商银行伦敦代表处首席代表，中国工商银行新加坡分行总经理，中国工商银行个人金融业务部副总经理，机构业务部副总经理，机构金融业务部资深专家。

赵玲华女士，独立董事，硕士。历任中国人民解放军空军总医院新闻干事，全国妇女联合会宣传部负责人，中国人民银行人事司综合处副处长，国家外汇管理局政策法规司副处长，中国外汇管理杂志社社长兼主编，国家外汇管理局国际收支司巡视员。

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、 基金经理

宋青先生，学士，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、通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，现任国际业务部总监。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。

5、 历任基金经理

梅律吾先生，2011年9月至2012年11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，投资三部执行总监、基金经理；周心鹏先生，投资二部执行总监、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；谢志华先生，固定收益部执行总监、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。

**十一、基金的费用与税收**

（一）基金的费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用）；

4、《基金合同》生效以后的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金收益分配过程中发生的费用；

7、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；

8、《基金合同》生效以后的会计师费和律师费；

9、基金的资金汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；

10、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；

11、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；

12、为了基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用；

13、基金上市初费和上市月费；

14、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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。

（二）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人应在次月首日起5个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付基金管理费给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

在首期支付基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。如需要变更收款帐户，基金管理人应提前10个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.35%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.35%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人应在次月首日起5个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付托管费给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3—15项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）与基金销售有关的费用

1、申购费

申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金在场内和场外的申购费率相同，最高为1.5%，且随申购金额的增加而递减。投资人多次认购时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。具体费率如下：

| | 申购金额（M） | 申购费率 |
|---|---|---|
| 场外、场内申购费 | M<50万元 | 1.5% |
| | 50万元≤M<200万元 | 1.2% |
| | 200万元≤M<500万元 | 0.8% |
| | M≥500万元 | 每笔1000元 |

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购费用=申购金额-净申购金额

（注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用＝固定申购费金额）

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

场内申购时，申购份额的计算保留至整数位，小数点以后的部分舍去，不足1份额对应的申购资金返还至投资人资金账户。

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回费

赎回费用由基金赎回人承担，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。本基金的场内赎回费率为固定赎回费率，不按份额持有时间分段设置赎回费率。本基金的场外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 |
|---|---|---|
| 场外赎回费 | T<1年 | 0.5% |
| | 1年≤T<2年 | 0.3% |
| | T≥2年 | 0 |
| 场内赎回费 | 本基金场内赎回费为固定值0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。 | |

采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回总金额－赎回费用

本基金场内和场外赎回时，赎回金额均为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用后的余额，赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3、转换费

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与其他基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，相关规则与具体费率由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述与销售有关的费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的上述费率还将在最新的更新的招募说明书中列示。

5、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等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（四）其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因故与本基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

（五）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（六）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

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，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份