诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）
2011 年年度报告

2011 年 12 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

送出日期：2012 年 3 月 26 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2012 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2011 年 9 月 27 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
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 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 审计报告 14
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
7.4 报表附注 18
§8 投资组合报告 34
8.1 期末基金资产组合情况 34
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 35
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 35
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 35
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 35
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 35
8.7 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 35
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 35

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.9 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 36
8.10 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 36
8.11 投资组合报告附注 36
§9 基金份额持有人信息 37
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 37
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 37
§10 开放式基金份额变动 37
§11 重大事件揭示 37
11.1 基金份额持有人大会决议 37
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 38
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 38
11.4 基金投资策略的改变 38
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 38
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 38
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 38
11.8 其他重大事件 39
§12 影响投资者决策的其他重要信息 41
§13 备查文件目录 41
13.1 备查文件目录 41
13.2 存放地点 41
13.3 查阅方式 41

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）
基金简称	诺安油气能源(QDII-FOF-LOF)
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	868,253,761.78 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	-

注：本基金的场内交易简称为“诺安油气”，场内交易代码为“163208”。截止本报告期末，本基金尚未上市交易。

2.2 基金产品说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	张燕
	联系电话	0755-83026688	0755-83199084
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95555
传真		0755-83026677	0755-83195201
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		秦维舟	傅育宁

2.4 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
注册地址		-	140 Broadway New York,NY 1005
办公地址		-	140 Broadway New York,NY 1005
邮政编码		-	NY 1005

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	利安达会计师事务所有限责任公司	北京朝阳区八里庄西里 100 号住邦 2000 一号楼东区 2008 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年 9 月 27 日-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,695,140.82
本期利润	3,802,996.24
加权平均基金份额本期利润	0.0041
本期加权平均净值利润率	0.41%
本期基金份额净值增长率	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	3,415,260.23
期末可供分配基金份额利润	0.0039
期末基金资产净值	871,785,016.45
期末基金份额净值	1.004
3.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率	0.40%

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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④本基金基金合同于 2011 年 9 月 27 日生效,截止 2011 年 12 月 31 日,本基金成立未满 1 年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

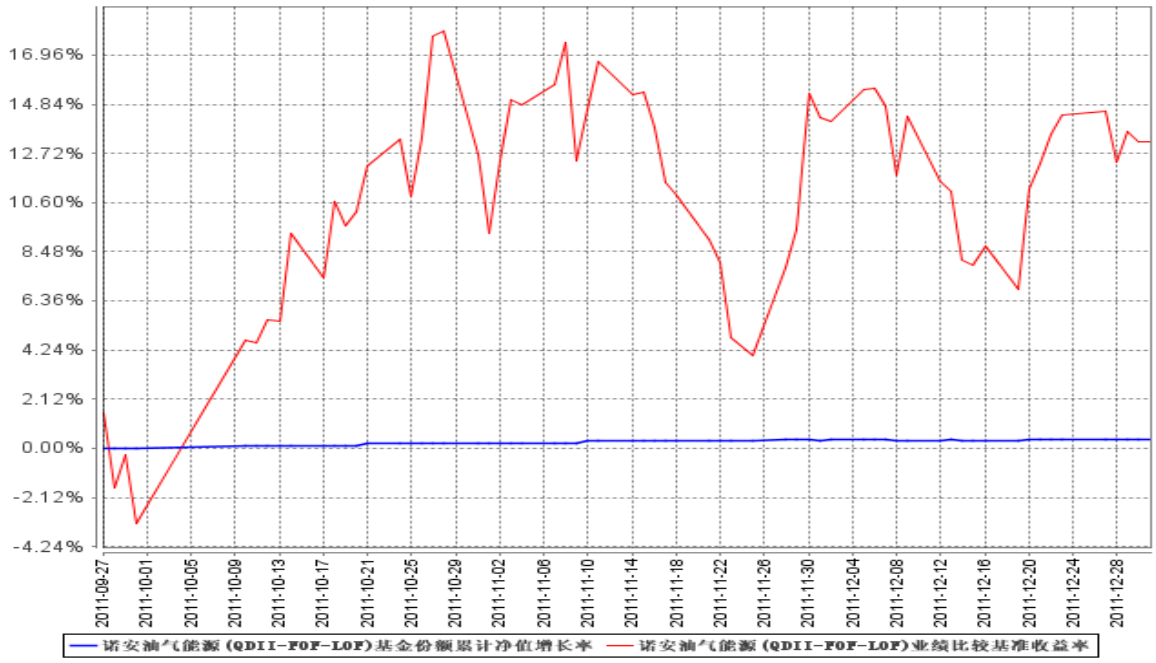
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.40%	0.04%	17.02%	2.32%	-16.62%	-2.28%
自基金合同生	0.40%	0.04%	13.24%	2.33%	-12.84%	-2.29%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

效起至今						

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））。

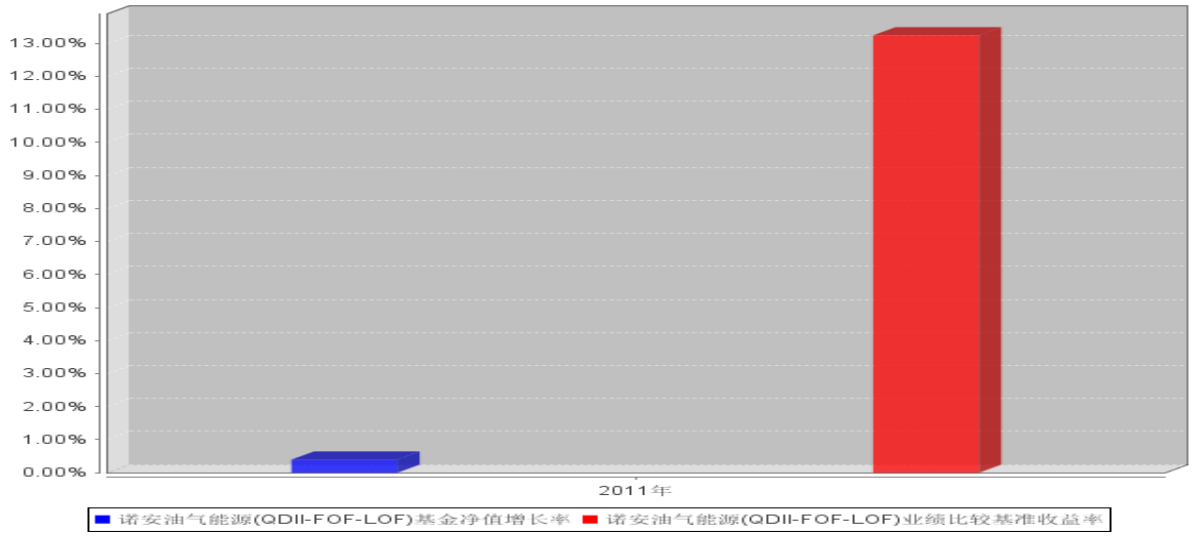
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金的基金合同于 2011 年 9 月 27 日生效，截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金成立未满 1 年。

②本基金的建仓期为 2011 年 9 月 27 日至 2012 年 3 月 26 日，截至 2011 年 12 月 31 日止,本基金建仓期尚未结束。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 2011 年 9 月 27 日生效，2011 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

按本基金实际存续期计算；截至 2011 年 12 月 31 日止,本基金成立未满 1 年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2011 年 9 月 27 日生效,截止 2011 年 12 月 31 日,本基金未进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2011 年 12 月，本基金管理人共管理 18 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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）和诺安全球收益不动产证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梅律吾	研究部副总监、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 9 月 27 日	-	13	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,现任研究部副总监。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 月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月起任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理。

注：①此处梅律吾先生的任职日期为诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年国际原油价格走势强劲，WTI 油价涨幅超过 8%，BRENT 油价涨幅达到 13%。从 2011 年国际原油市场供求关系来看，原油供给偏紧是油价大幅度上涨的主要原因。2011 年度非 OPEC 国家的原油产量低于预期，非 OPEC 原油供给增长几乎停滞。2011 年度中东北非动荡局势也拖累了 OPEC 国家原油供给的增长。尤其是利比亚内战，直接导致利比亚原油减产以及供应量的下降。

2011 年度国际原油市场的需求增长比较平稳。需求增长动力主要来自非 OECD 国家。由于中国和印度等国家的经济基本面依然强劲，带动了国际原油消费需求的增长，而 OECD 国家的原油消费增长乏力，主要是由于欧美债务危机拖累了经济复苏。值得一提的是，2011 年 3 月份日本地震海啸导致了核能源危机。为了替代核能源，日本逐渐扩大从外部进口原油。概而言之，2011 年国际原油消费需求增长平稳，并非油价上涨的主要动力。

2011 年国际原油价格整体走势强劲，但是仍然有大幅度波动。以 WTI 油价为例来说明。由于年初

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

阿拉伯世界爆发伊斯兰革命，中东地区陷入混乱局面，导致国际原油价格持续上涨。5 月初 WTI 油价达到 115 美元的高位，创下 2008 年金融危机以来的新高，离危机前的油价高位已经不远。随后由于欧美债务危机升级，市场开始担忧世界经济“二次探底”，导致国际原油价格持续下行。2011 年 8 月初以及 10 月初，WTI 油价两度跌破 80 美元。2011 年第四季度由于美国经济形势好转，失业率持续下降，因此国际原油价格重拾升势。另外 2011 年底由于伊朗核问题浮出水面，中东局势更加紧张，进一步推动了国际原油价格上涨。WTI 油价重新站上 100 美元。

本基金成立于 2011 年第三季度末。在基金成立的初期，对国际原油市场采取谨慎以及密切关注的策略。本基金在 2011 年第四季度仅有少量的建仓，期待在 2012 年寻求更好和更稳的建仓机会。

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 1.004 元。本报告期基金份额净值增长率为 0.40%,同期业绩比较基准收益率为 13.24%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年度国际原油市场供求局面有望趋向缓和。从国际原油市场的供给来看，非 OPEC 国家的原油供应将明显好转。年美国、加拿大、巴西和哥伦比亚等国家的新油田项目将陆续投产。欧洲北海、澳大利亚以及中国海上油田在 2012 年都会复产。因此非 OPEC 原油供应量上升几成定局。

2012 年度 OPEC 原油供应的增长点，主要在利比亚油田复产，以及伊拉克和安哥拉油田增产。但是 OPEC 原油供应增长存在比较大的不确定性。风险主要在于伊朗核问题以及叙利亚内乱，由此导致中东地区动荡局势甚至可能爆发局部战争。目前美国和欧盟已决定对伊朗实行经济制裁和石油禁运，未来不排除亚洲石油消费大国减少从伊朗的原油进口。这样会导致 2012 年度 OPEC 剩余产能偏紧。

2012 年度国际原油消费需求将继续放慢增长速度。主要原因是非 OECD 国家经济基本面不如 2011 年那样强劲。尤其是中国和印度这两大经济体在 2012 年都将放慢增长速度。OECD 国家的原油消费需求与上年度持平或者略减。整体而言，2012 年度原油消费需求增长仍不是国际原油价格上涨的主要动力。

综上所述，2012 年度国际原油价格上涨的最大动力来源于供应冲击。如果伊朗核问题升级为中东局部战争，国际原油价格将会呈现飞涨局面。WTI 油价会从目前 100 美元平台跃升至 120 甚至 150 美元的平台。

从 2012 年度国际资本市场宽松的流动性环境来看，也支持国际原油价格上涨。2012 年全球货币政策将再度宽松。美联储将零利率政策延长至 2014 年底。欧央行为缓和欧元区债务危机，持续进行 LTRO，甚至会进一步降息。巴西以及亚洲等新兴经济体已经开始降息。中国和印度开始下调银行存款

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

准备金比例。由此可见，2012 年全球流动性环境重新趋向宽松。这将提升国际资本市场的风险偏好，因此会推动全球股市以及国际大宗商品价格上涨。国际原油价格会跟随国际大宗商品上涨。能源行业指数也会跟随全球股市上涨。

本基金将在 2012 年第一季度完成建仓。投资品种包括石油商品类 ETF 以及能源行业 ETF。基于对 2012 年度石油商品价格以及全球股市的看涨，本基金完成建仓以后，会保持比较高的仓位水平。在 2012 年度分享石油商品价格以及全球股市上涨带来的收益，进而为本基金持有人创造满意的投资回报。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内本基金管理人共管理了十八只开放式基金--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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）和诺安全球收益不动产证券投资基金。

在内部监察工作中,本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨,本基金管理人建立并完善了以监察、稽核为主导的工作体系和流程。内部监察稽核人员依照独立、客观、公正的原则,认真履行职责,严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作,确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度公司合法合规运作和内部风险控制的具体情况如下:

1、报告期内,在公司各部门的积极配合下,根据最新颁布的法律法规及公司业务发展的需要,监察稽核部对公司部分管理制度进行修订,推进了公司的制度化建设步伐,完善了公司的制度体系,满足了法律法规及证监会的监管要求,对公司的业务运作也起到了较好的支持、指导作用,有效地推进了相关业务的发展,防范了相关风险。

2、严格进行投资风险的管理和控制,防范相关风险发生。监察稽核部会同公司投资部门根据法律法规及市场环境的变化,及时向公司投资决策委员会提出建议,对公司投资管理制度进行了多次修订。在此基础上,对各类风险控制指标做进一步的细化和完善,通过对各项指标的监控来引导投资部门分散投资、理性投资,起到了良好的效果。

3、根据中国证监会和公司内部控制制度的要求,监察稽核部在报告期内对公司各个部门进行了四次全面的监察稽核和多次临时性监察稽核。内容涉及公司及员工遵纪守法情况,内部控制制度、业务操作流程执行情况;涵盖基金销售、投资运作、后台保障等公司所有业务环节和工作岗位。对于每次监察

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

稽核工作中发现的问题,都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施,切实进行改善,并由监察稽核部跟踪问题的处理情况,确保了公司在各方面规范运作,切实地保障了基金份额持有人的利益。

4、对公司基金销售活动进行监督、指导,确保基金销售活动严格按照《销售管理办法》的规定处理基金代销机构、基金宣传推介材料、基金销售费用等方面的问题,不出现违法违规的情况。同时,督促市场部门利用各种机会,通过多种渠道,以形式多样的方式,做好投资者教育工作。

5、公司所有对外发布的文件、资料及宣传材料,都事先由监察稽核部进行合规性审查,确保其内容真实、准确、合规,符合中国证监会对信息披露的相关要求。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,无内幕交易和不正当关联交易,保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在合规运作、稳健经营的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金期末可供分配利润为 3,415,260.23 元，本期未进行收益分配。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

利安达审字[2012]第 1024 号

诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）全体持有人：

我们审计了后附的诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）（以下简称诺安油气能源基金）财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日期间的利润表、股东权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是诺安油气能源基金管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，诺安油气能源基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了诺安油气能源基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

利安达会计师事务所　　中国注册会计师　韦雪

有限责任公司　　中国注册会计师　赵伟

中国·北京　　二〇一二年三月十五日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：　诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	338,776,815.57
结算备付金		24,636,363.64
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	7,147,425.92
其中：股票投资		-
基金投资		7,147,425.92
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

买入返售金融资产	7.4.7.4	513,201,394.80
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,107,525.35
应收股利		-
应收申购款		60,406.80
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		884,929,932.08
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2011 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		11,620,510.19
应付管理人报酬		1,154,948.67
应付托管费		269,488.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	6,172.96
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	93,795.78
负债合计		13,144,915.63
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	868,253,761.78
未分配利润	7.4.7.10	3,531,254.67
所有者权益合计		871,785,016.45
负债和所有者权益总计		884,929,932.08

注：本期会计报表的实际报告期间为 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日，无对比数据。报告截止日 2011 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.004 元,基金份额总额 868,253,761.78 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）

本报告期：2011 年 9 月 27 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		8,468,158.43

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.利息收入		8,983,035.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,314,020.08
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,669,006.11
其他利息收入		8.95
2.投资收益（损失以“-”填列）		-125,680.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-125,680.47
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	107,855.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-607,045.51
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	109,993.85
减：二、费用		4,665,162.19
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	3,650,086.17
2．托管费	7.4.10.2.2	851,686.75
3．销售服务费		-
4．交易费用	7.4.7.19	32,639.08
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．其他费用	7.4.7.20	130,750.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,802,996.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,802,996.24

注：本期会计报表的实际报告期间为 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日，无对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）

本报告期：2011 年 9 月 27 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净	951,030,683.39	-	951,030,683.39

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,802,996.24	3,802,996.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-82,776,921.61	-271,741.57	-83,048,663.18
其中：1.基金申购款	4,763,775.27	15,475.48	4,779,250.75
2.基金赎回款	-87,540,696.88	-287,217.05	-87,827,913.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	868,253,761.78	3,531,254.67	871,785,016.45

注：本期会计报表的实际报告期间为 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日,无对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

奥成文	薛有为	薛有为
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”）证监许可[2011]1258 号文《关于核准诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）的批复》批准,于 2011 年 8 月 29 日至 2011 年 9 月 20 日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,募集其中净认购额为人民币 950,526,471.15 元,折合 950,526,471.15 份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币 504,212.24 元,折合 504,212.24 份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为 2011 年 9 月 27 日,合同生效日基金份额为 951,030,683.39 份基金单位。

本基金为上市契约型开放式（LOF）,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman &Co.）。《诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金合同》、《诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”）和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》等通知及其他相关规定和基金合同的规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产。本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资按持有意图和持有能力划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;本基金目前持有的其他金融资产划分为应收款项。

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以成本进行后续计量,

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

在摊销时产生的利得或损失,应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产;金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现和未实现两部分。损益平准金(已实现)为在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额;损益平准金(未实现)为在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。 损益平准金(未实现)和损益平准金(已实现)均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金每一基金份额享有同等分配权；

(2)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3)登记在注册登记系统的基金份额，其收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，红利再投资方式免收再投资的费用；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红； 登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额的分红方式为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(4)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5)基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

个工作日；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

(1)基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(2)基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	68,776,815.57
定期存款	270,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	270,000,000.00
其他存款	-
合计：	338,776,815.57

注：本期末银行存款中包含的外币余额为:美元 10,161,188.93 元(汇率为 6.3009，折合人民币 64,024,635.33 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		7,039,570.50	7,147,425.92	107,855.42
其他		-	-	-
合计		7,039,570.50	7,147,425.92	107,855.42

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	170,000,000.00	-
银行间市场	343,201,394.80	-
合计	513,201,394.80	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	13,580.08
应收定期存款利息	807,210.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12,195.04
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	274,540.23
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,107,525.35

7.4.7.6 其他资产

本项其他资产为报表项目,本基金本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,172.96
合计	6,172.96

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43,795.78
预提费用	50,000.00
合计	93,795.78

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	951,030,683.39	951,030,683.39
本期申购	4,763,775.27	4,763,775.27
本期赎回（以“-”号填列）	-87,540,696.88	-87,540,696.88
本期末	868,253,761.78	868,253,761.78

注：① 申购含红利再投份额；

② 本基金在募集期间认购资金本金及利息折份的情况详见“7.4.1 基金基本情况”。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,695,140.82	107,855.42	3,802,996.24
本期基金份额交易产生的变动数	-279,880.59	8,139.02	-271,741.57
其中：基金申购款	15,564.91	-89.43	15,475.48
基金赎回款	-295,445.50	8,228.45	-287,217.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,415,260.23	115,994.44	3,531,254.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	243,897.91
定期存款利息收入	4,024,098.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	46,023.28
其他	-
合计	4,314,020.08

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	45,151,747.77
减：卖出/赎回基金成本总额	45,277,428.24
基金投资收益	-125,680.47

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	107,855.42
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	107,855.42
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	107,855.42

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	109,786.28
其他	207.57
合计	109,993.85

注：“其他”为募集结束日至基金合同生效日收到的利息。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	32,639.08

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

银行间市场交易费用	-
合计	32,639.08

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日至 2011 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	75,000.00
汇划费	5,750.19
合计	130,750.19

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金无需披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

基金管理人于 2012 年 2 月 25 日发布公告，经诺安基金管理有限公司股东会决议通过，中国证券监督管理委员会批准，大恒新纪元科技股份有限公司受让北京中关村科学城建设股份有限公司持有的基金管理人 20%的股权。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
北京中关村科学城建设股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、销售机构
中国中化股份有限公司	管理人股东母公司
中国中化集团公司	管理人股东最终控制方
招商银行股份有限公司	托管人
Brown Brothers Harriman & Co.（布朗兄弟哈里曼银行）	境外资产托管人

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
Brown Brothers Harriman & Co.(布朗兄弟哈里曼银行)	417,285.78	0.43%

7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券权证交易。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年9月27日(基金合同生效日)至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
Brown Brothers Harriman & Co.(布朗兄弟哈里曼银行)	31.65	0.10%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,650,086.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,656,459.07

注：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×1.5%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

基金管理人应于次月首日起 3 个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并做出划付指令；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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	851,686.75

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.35%年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

基金管理人应于次月首日起 3 工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令；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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2011 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招银行股份有限公司	4,752,250.24	3,460,786.80
Brown Brothers Harriman & Co.（布朗兄弟哈里曼银行)	64,024,565.33	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元,无债券作为质押。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险,并设定适当的投资限额,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成:第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

领导;第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部及金融工程部所监控;第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券(不包括境外基金)市值不得超过基金净值的 10%,基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末未持有按长期信用评级列示的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在附注‘7.4.12’中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为一年以内且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本期主要投资于石油、天然气等能源行业类基金（包括 ETF）以及公司股票,所持有的存在到期期限的金融资产和金融负债金额较小。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	338,776,815.57	-	-	-	-	338,776,815.57
结算备付金	24,636,363.64	-	-	-	-	24,636,363.64
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	7,147,425.92	7,147,425.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	513,201,394.80	513,201,394.80
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	1,107,525.35	1,107,525.35
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	60,406.80	60,406.80
资产总计	363,413,179.21	-	-	-	521,516,752.87	884,929,932.08
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	11,620,510.19	11,620,510.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,154,948.67	1,154,948.67
应付托管费	-	-	-	-	269,488.03	269,488.03
应付交易费用	-	-	-	-	6,172.96	6,172.96
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	93,795.78	93,795.78
负债总计	-	-	-	-	13,144,915.63	13,144,915.63
利率敏感度缺口	363,413,179.21	-	-	-	508,371,837.24	871,785,016.45

注：各期限分类的标准:按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债,因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	64,024,635.33	-	-	64,024,635.33
交易性金融资产	7,147,425.92	-	-	7,147,425.92
资产合计	71,172,061.25	-	-	71,172,061.25
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	71,172,061.25	-	-	71,172,061.25

7.4.13.4.2.2 外汇风险敏感性分析

金额单位：人民币元

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2011 年 12 月 31 日）
	1.所有外币相对人民币升值 5%	3,558,603.06
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,558,603.06

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。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（含 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。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资,本基金有效降低了投资组合的其他价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。于 2011 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产－基金投资	7,147,425.92	0.82
交易性金融资产－债券投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	7,147,425.92	0.82

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金额单位：人民币元

假设	1.业绩比较基准的公允价值发生变化	
	2.其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2011 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准的公允价值上升 5%	231,487.23
	2. 业绩比较基准的公允价值下降 5%	-231,487.23

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	7,147,425.92	0.81
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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	513,201,394.80	57.99
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	270,000,000.00	30.51
7	银行存款和结算备付金合计	93,413,179.21	10.56
8	其他各项资产	1,167,932.15	0.13
9	合计	884,929,932.08	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.6 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投资。

8.7 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投资。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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投资。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.9 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。

8.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(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,Inc.	5,662,555.82	0.65
2	ETFS BRENT 1MTH	ETF 基金	契约型开放式	ETFS Oil Securities.Ltd.	764,488.20	0.09
3	UNITED STS OIL FD LP UNITS	ETF 基金	契约型开放式	United States Oil Fund,LP	720,381.90	0.08

注:本基金本报告期末仅持有上述基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本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。

8.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,107,525.35
5	应收申购款	60,406.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,167,932.15

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,704	74,184.36	150,041.00	0.02%	868,103,720.78	99.98%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	88,969.26	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 27 日）基金份额总额	951,030,683.39
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,763,775.27
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	87,540,696.88
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	868,253,761.78

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人、基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

本年度应付未付给所聘任会计师事务所的审计费为 5 万元，其已提供审计服务的连续年限：1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票、基金投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易		基金交易		应支付该券商的佣金		备注
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	39,917,156.76	40.95%	10,712.06	32.81%	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	-	-	6,100,833.90	6.26%	1,590.02	4.87%	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	29,290,425.81	30.05%	14,645.40	44.86%	-
Knight Capital Europe Ltd	-	-	12,349,987.92	12.67%	3,124.74	9.57%	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	9,392,279.86	9.64%	2,541.56	7.79%	-
Brown Brothers Harriman & Co.	-	-	417,285.78	0.43%	31.65	0.10%	-

注：1、本基金本报告期内仅有基金投资交易及因基金投资交易产生的佣金,无股票投资交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2、本基金本报告期内新增 6 家券商：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited、Goldman Sachs (Asia) L.L.C.、中银国际证券有限责任公司、Knight Capital Europe Ltd、Morgan Stanley & Co. International plc、Brown Brothers Harriman & Co.。

3、券商选择标准和程序

选取优秀券商进行境外投资,主要标准有以下几个方面:

(1) 全球眼光。具备优秀的全球投资经验,拥有丰富的地区市场知识和国际运作能力。

(2) 良好的交易执行能力。对投资交易指令能够有效执行以及取得较高质量的成交结果。

(3) 高水平的研究能力。能够为客户提供高水平的综合资本市场研究方案,掌握宏观市场的发展趋势,深入的行业分析,有效地实施方案。

(4) 杰出的服务意识。投资交易中出现的问题能够认真对待,尽可能保证交易的及时性、保证成交价格的确定性以及防范市场风险。

公司国际业务部以及投研部门会定期评价券商的业务水平,并及时与券商沟通,由此确定对券商进行的选择以及成交量的分配,最大程度保证投资交易的执行。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

卷商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
宏源证券股份有限公司	8,117,400,000.00	100%

注：本基金债券回购交易与诺安保本基金共用交易单元。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金份额发售公告	《上海证券报》、深圳证券交易所	2011 年 8 月 24 日
2	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）托管协议	基金管理人网站、深圳证券交易所	2011 年 8 月 24 日
3	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金合同摘要	《上海证券报》、深圳证券交易所	2011 年 8 月 24 日
4	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金合同	基金管理人网站、深圳证券交易所	2011 年 8 月 24 日
5	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）招募说明书	《上海证券报》、深圳证券交易所	2011 年 8 月 24 日
6	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）上网发售提示性公告	《上海证券报》、深圳证券交易所	2011 年 8 月 29 日
7	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）增加场外代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2011 年 8 月 31 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

		深圳证券交易所	
8	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）增加场外代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 9 月 5 日
9	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）增加场外代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 9 月 7 日
10	诺安基金管理有限公司关于增加江苏银行为诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）场外代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 9 月 13 日
11	诺安基金管理有限公司关于增加浦发银行为诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）场外代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 9 月 15 日
12	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 9 月 29 日
13	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回及定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 11 月 8 日
14	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 11 月 9 日
15	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）2011 年 11 月 24 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 11 月 22 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在南京银行开通基金定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 12 月 20 日
17	诺安基金管理有限公司关于诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）2011 年 12 月 26 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所	2011 年 12 月 21 日
18	诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）2012 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2011 年 12 月 30 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

		深圳证券交易所	

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2012 年 2 月 25 日发布公告，经诺安基金管理有限公司股东会决议通过，中国证券监督管理委员会批准，大恒新纪元科技股份有限公司受让北京中关村科学城建设股份有限公司持有的基金管理人 20%的股权。

§13 备查文件目录

13.1 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诺安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照。

⑤《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。

⑥诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）2011 年年度报告正文。

⑦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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 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
2012 年 3 月 26 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站