
诺安货币市场基金 2011 年年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国工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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安货币
基金主代码	320002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 12 月 6 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
报告期末基金份额总额	2,969,811,713.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性, 力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况, 判断短期利率的走势, 进行自上而下的整体资产配置和资产组合配置; 同时, 根据定量和定性方法, 在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金流动性高, 风险低并且收益稳定。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2010 年	2009 年
本期已实现收益	67,412,045.85	21,039,792.16	17,350,409.42
本期利润	67,412,045.85	21,039,792.16	17,350,409.42
本期净值收益率	3.75%	1.83%	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末基金资产净值	2,969,811,713.64	1,427,207,051.47	3,000,062,352.43
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：① 本基金的利润分配是按月结转份额。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

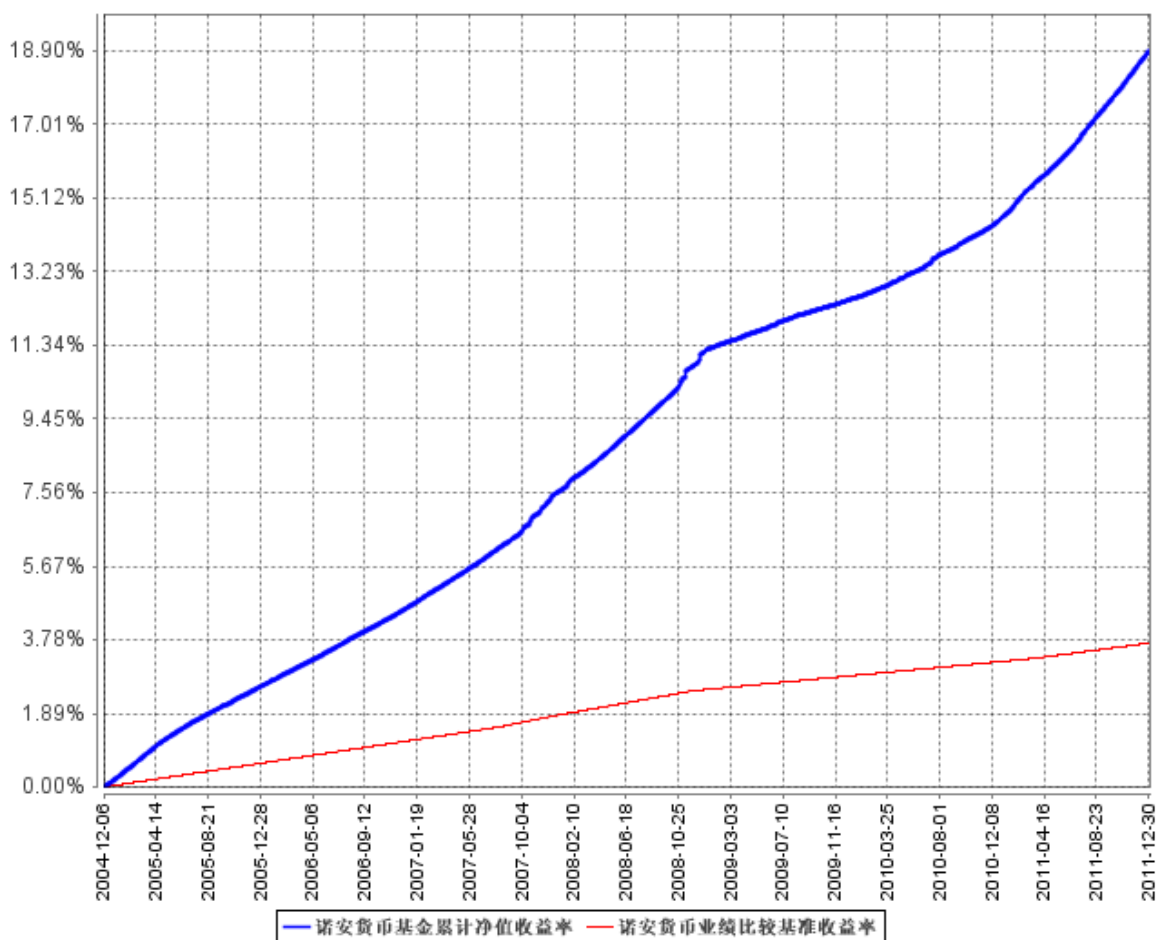
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	1.0506%	0.0022%	0.1278%	0.0000%	0.9228%	0.0022%
过去六个月	2.0796%	0.0039%	0.2556%	0.0000%	1.8240%	0.0039%
过去一年	3.7540%	0.0035%	0.4732%	0.0001%	3.2808%	0.0034%
过去三年	6.9129%	0.0047%	1.1932%	0.0002%	5.7197%	0.0045%
过去五年	13.6303%	0.0058%	2.5049%	0.0004%	11.1254%	0.0054%
自基金合同生效起至今	18.9029%	0.0052%	3.6979%	0.0004%	15.2050%	0.0048%

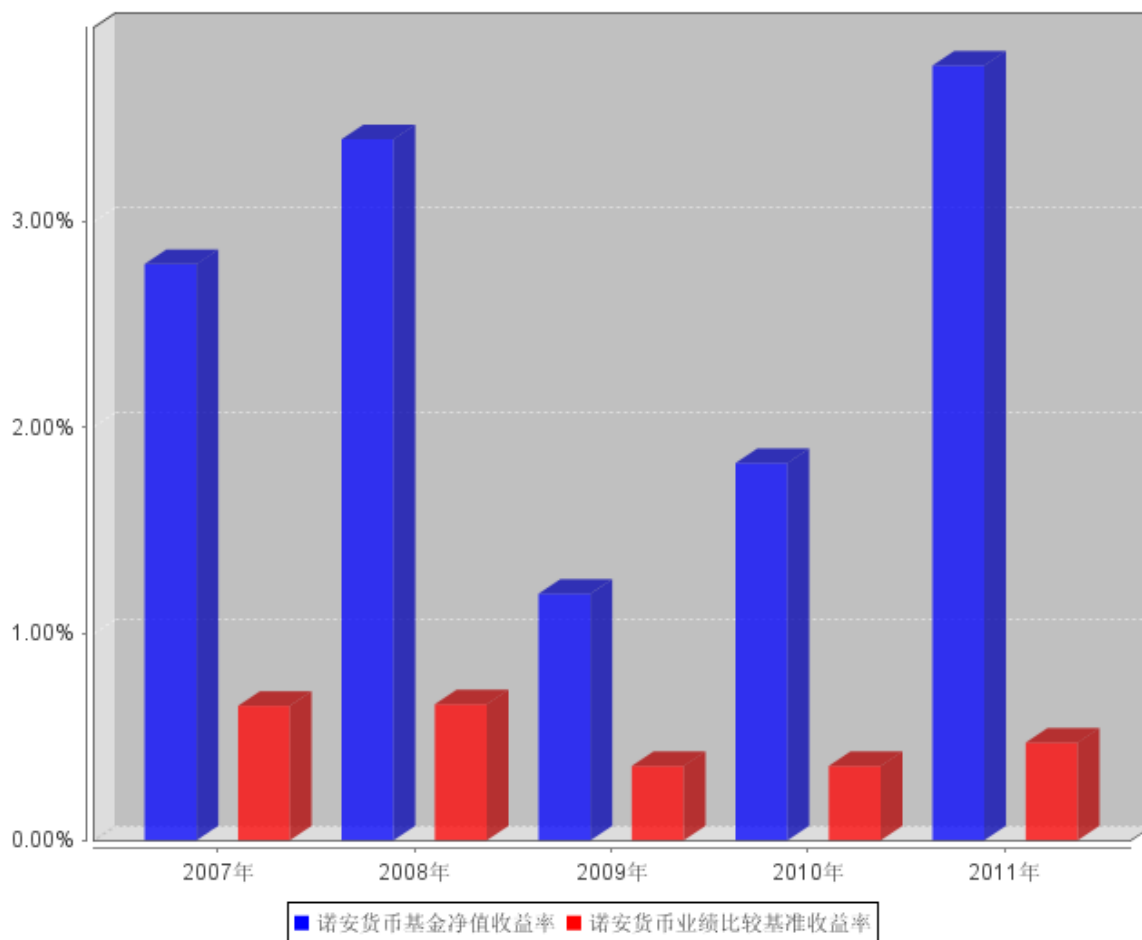
注：①本基金的利润分配是按月结转份额。

② 本基金的业绩比较基准为：当期银行个人活期储蓄利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2011年	58,787,068.96	6,440,203.10	2,184,773.79	67,412,045.85	
2010年	18,036,939.83	2,393,403.24	609,449.09	21,039,792.16	
2009年	14,898,444.35	3,593,021.91	-1,141,056.84	17,350,409.42	
合计	91,722,453.14	12,426,628.25	1,653,166.04	105,802,247.43	

§ 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		
张乐赛	固定收益基金组投资副总监、诺安货币市场基金基金经理、诺安保本混合型证券投资基金的基金经理	2006 年 8 月 19 日	-	7	硕士，具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心；2004 年 12 月加入诺安基金管理有限公司，现任固定收益基金组投资副总监。曾于 2009 年 8 月至 2012 年 1 月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006 年 8 月起担任诺安货币市场基金的基金经理，2011 年 5 月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理。

注：①此处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》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基

金管理暂行规定》及其他有关法律法规,遵守了《诺安货币市场基金基金合同》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

4.4 管理人对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

2011年,受到通胀因素的影响,抗通胀成为宏观经济调控的主要目标。前三个季度,一系列的紧缩货币政策占市场主导,例如:重启三年期央票发行、上调央票利率、连续上调准备金率、上调存贷款利率以及扩大准备金的缴款范围。银行体系的资金被深度锁定,货币市场流动性不断收紧,回购利率中枢不断创新高,资金面几度濒临断裂。在这样的市场情况下,诺安货币市场基金合理安排债券仓位,灵活运用逆回购和定期存款,合理安排资金的到期和债券的兑付,有效地进行流动性管理,满足了广大投资者随时的申购和赎回需求,突出体现了诺安货币市场基金作为现金管理工具的特色。

伴随流动性的收紧和资金成本的不断走高,前三个季度,债券的一级发行利率攀升至历史高位,具备了一定的投资价值,二级市场收益率也水涨船高。面对此环境,诺安市场基金把握住了市场时机,加仓了部分票面利率较高的利率产品和短期融资券。对于短期融资券的投资,诺安货币始终坚持兼顾外部评级和内部评级的选券原则,严格把关发债机构的行业、地域和企业所属性质,精挑细选出资质优良的债券,在确保安全性的基础之上,增强收益性,最大限度地规避信用“黑天鹅事件”,保证基金

本金的安全。诺安货币市场基金取得的投资回报远超出业绩比较基准，为持有人取得了较为满意的收益回报。诺安货币市场基金坚持“确保本金的安全性、资产的流动性，力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益”的投资目标，始终将投资安全性与资产的流动性放在首位，在投资管理过程中严格控制投资与交易风险，注重资产的流动性管理，对基金资产进行了合理配置。在 2011 年的最后一个季度，通胀水平开始回落，宏观调控的重点出现转向，货币政策开始稳中转松，货币市场资金面逐渐宽松，回购利率有所回落，债市收益率也出现明显下行。诺安货币市场基金之前的积极配置在此阶段取得了良好的投资回报。

在投资组合方面，诺安货币市场基金以逆回购、短期定存、央行票据、短期政策性金融债以及资质优良的短期融资券为主要投资标的，并坚持对各投资品种的分散投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金基金投资组合的剩余期限为 94 天，影子定价偏离度为正的 0.03%。本报告期基金份额净值收益率为 3.7540%，同期业绩比较基准收益率为 0.4732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年，通胀水平将进入下行通道，治理通胀不再是宏观调控的主要矛盾。经济增速缓慢下行，基本面利好债市走向。货币政策稳中转松，更具灵活性、针对性和前瞻性。流动性压力较 2011 年将有明显的缓解，回购利率中枢将整体下移。资金成本降低，收益率曲线将整体下移，一级发行利率逐步走低。

在下一阶段，诺安货币市场基金将继续注重跟踪和分析宏观经济的变化和货币政策的走向，根据短期债券市场的形势变化，积极研究投资品种与投资机会，在保证基金投资安全、保障基金资产流动性的前提下，为持有人争取较好的投资回报，实现其现金管理工具的职能。

4.6 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部、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验,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定,本基金收益“每日分配、按月支付”。本基金本期实现收益为 67,412,045.85 元,应分配利润 67,412,045.85 元,已实施利润分配 67,412,045.85 元,符合本基金合同约定。

§ 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

2011 年,本基金托管人在对诺安货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2011 年,诺安货币市场基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安货币市场基金 2011 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

利安达会计师事务所及其经办注册会计师韦雪、赵伟于 2012 年 3 月 15 日出具了利安达审字[2012]第 1008 号“无保留意见的审计报告”。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安货币市场基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,174,268,591.27	27,473,730.66
结算备付金	-	1,789,090.91
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,132,133,098.53	762,291,239.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,132,133,098.53	762,291,239.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	646,687,341.31	629,301,978.95
应收证券清算款	-	-
应收利息	22,193,205.17	8,783,331.58
应收股利	-	-
应收申购款	1,440.00	2,100.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,975,283,676.28	1,429,641,471.82
负债和所有者权益	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	-	-
应付赎回款	380,935.87	-
应付管理人报酬	624,041.30	407,722.53
应付托管费	189,103.41	123,552.26
应付销售服务费	472,758.55	308,880.76
应付交易费用	31,253.95	12,039.99
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	-	-
应付利润	3,244,898.60	1,060,124.81
递延所得税负债	-	-
其他负债	111,370.96	104,500.00
负债合计	5,471,962.64	2,434,420.35
所有者权益：		
实收基金	2,969,811,713.64	1,427,207,051.47
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,969,811,713.64	1,427,207,051.47
负债和所有者权益总计	2,975,283,676.28	1,429,641,471.82

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,969,811,713.64 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安货币市场基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	80,610,025.53	29,874,443.38
1.利息收入	76,462,372.92	27,240,654.98
其中：存款利息收入	18,984,805.51	5,268,597.13
债券利息收入	33,526,923.55	13,848,057.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	23,950,643.86	8,123,999.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,077,652.61	2,633,788.40
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,077,652.61	2,633,788.40
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	-	-

号填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	70,000.00	-
减: 二、费用	13,197,979.68	8,834,651.22
1. 管理人报酬	5,978,828.13	3,915,706.63
2. 托管费	1,811,766.15	1,186,577.88
3. 销售服务费	4,529,415.23	2,966,444.47
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	402,857.37	306,926.05
其中: 卖出回购金融资产支出	402,857.37	306,926.05
6. 其他费用	475,112.80	458,996.19
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	67,412,045.85	21,039,792.16
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	67,412,045.85	21,039,792.16

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 诺安货币市场基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 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 (基金净值)	1,427,207,051.47	-	1,427,207,051.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	67,412,045.85	67,412,045.85
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)	1,542,604,662.17	-	1,542,604,662.17
其中: 1. 基金申购款	10,774,387,279.49	-	10,774,387,279.49
2. 基金赎回款	-9,231,782,617.32	-	-9,231,782,617.32
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)	-	-67,412,045.85	-67,412,045.85
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,969,811,713.64	-	2,969,811,713.64

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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（基金净值）	3,000,062,352.43	-	3,000,062,352.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,039,792.16	21,039,792.16
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）	-1,572,855,300.96	-	-1,572,855,300.96
其中：1. 基金申购款	6,020,715,055.95	-	6,020,715,055.95
2. 基金赎回款	-7,593,570,356.91	-	-7,593,570,356.91
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）	-	-21,039,792.16	-21,039,792.16
五、期末所有者权益（基金净值）	1,427,207,051.47	-	1,427,207,051.47

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.4.3 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、注册登记机构、销售机构
中国工商银行股份有限公司	托管人

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

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,978,828.13	3,915,706.63
其中：支付销售机构的客户维护费	393,247.79	291,616.98

注：A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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

B. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,811,766.15	1,186,577.88

注：A. 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

B. 基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付; 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.4.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	3,283,145.46
中国工商银行股份有限公司(托管人)	530,063.23
合计	3,813,208.69
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,727,041.22
中国工商银行股份有限公司(托管人)	428,046.57
合计	2,155,087.79

注：A. 基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

B. 基金销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付; 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	40,012,934.43	60,879,406.72	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	19,959,800.82	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年12月31日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
深圳市捷隆投资有限公司	203,759,248.56	6.86%	-	-

7.4.4.5 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1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,268,591.27	112,447.36	27,473,730.66	146,673.78

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.5 (2011 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 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。

7.4.5.3.2 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。

§ 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	固定收益投资	1,132,133,098.53	38.05
	其中：债券	1,132,133,098.53	38.05
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	646,687,341.31	21.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	165,685,499.81	5.57
3	银行存款和结算备付金合计	1,174,268,591.27	39.47
4	其他各项资产	22,194,645.17	0.75
5	合计	2,975,283,676.28	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.62	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	139
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
----	--------	---------------------	---------------------

1	30 天以内	26.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.39	-
2	30 天(含)—60 天	26.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.73	-
4	90 天(含)—180 天	5.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	23.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.44	-

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	49,512,693.85	1.67
3	金融债券	350,444,791.73	11.80
	其中：政策性金融债	350,444,791.73	11.80
4	企业债券	102,199,376.38	3.44
5	企业短期融资券	629,976,236.57	21.21
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,132,133,098.53	38.12
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	152,133,413.32	5.12

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	070311	07 进出 11	1,000,000	100,713,196.37	3.39
2	110414	11 农发 14	1,000,000	99,955,671.46	3.37
3	078058	07 华谊债	500,000	51,424,193.75	1.73
4	058017	05 首都机场债	500,000	50,775,182.63	1.71
5	110221	11 国开 21	500,000	49,934,036.94	1.68

6	110249	11 国开 49	500,000	49,926,115.04	1.68
7	110245	11 国开 45	500,000	49,915,771.92	1.68
8	1101022	11 央行票据 22	500,000	49,512,693.85	1.67
9	1181279	11 北营钢 CP01	400,000	40,000,635.40	1.35
10	1181338	11 凤凰 CP01	400,000	39,988,442.98	1.35

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.20%
报告期内偏离度的最低值	-0.21%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

- 8.8.1** 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。
- 8.8.2** 本报告期内不存在“持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券”的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。
- 8.8.3** 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。

8.8.4 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	应收利息	22,193,205.17
4	应收申购款	1,440.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,194,645.17

8.8.5 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
8,562	346,859.58	2,221,522,905.44	74.80%	748,288,808.20	25.20%

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	2,826,680.23	0.10%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年12月6日)基金份额总额	1,573,598,040.62
本报告期期初基金份额总额	1,427,207,051.47
本报告期基金总申购份额	10,774,387,279.49
减：本报告期基金总赎回份额	9,231,782,617.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,969,811,713.64

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。

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 10 万元, 其已提供审计服务的连续年限: 7 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投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量
国信证券	1

注: 1、 本基金租用证券公司交易单元没有进行股票投资。

2、 本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

3、 专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为:

- (1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

- (4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

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

券商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券	930,000,000.00	100.00%

注:本基金租用的证券公司交易单元本期无债券交易和权证交易。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1. 诺安货币市场基金于 2012 年 2 月 21 日进行份额分级,并对基金招募说明书和基金合同进行了修改。分级后本基金将设两级基金份额:A 级基金份额和 B 级基金份额。其中原基金代码 320002 作为 A 级基金代码,新增 320019 为 B 级基金代码,两级基金份额单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

诺安货币市场基金的 A 级、B 级基金份额共同受《诺安货币市场基金基金合同》的约束,享有同等权利,凡基金合同及相关法律文书中对基金份额的提及,其份额的计算皆为 A 级、B 级二类基金份额之总和。

具体情况参见基金管理人于 2012 年 2 月 16 日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安货币市场基金实施基金份额分级并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》

2. 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。

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