

## 诺安主题精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2012 年第 1 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）诺安主题精选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 2010 年 7 月 23 日证监许可【2010】984 号文核准公开募集，本基金的基金合同于 2010 年 9 月 15 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，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、较高收益的品种。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。

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 2012 年 3 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 12 月 31 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

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：陈阳

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 2012 年 3 月底，本基金管理人共管理二十只开放式基金：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及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金。

### （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。

杨自理先生，副董事长，工商管理硕士。历任中国中化集团资产管理部总经理助理，中国对外经济贸易信托有限公司总经理助理、副总经理、总经理。

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。

### 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。

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

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。

### 5. 投资决策委员会成员的姓名及职务

投资决策委员会由五名成员构成。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；邹翔先生，成长基金组投资总监、基金经理；王创练先生，研究部总监；王永宏先生，金融工程部副总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人情况

### （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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，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2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。

手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70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，投资托管服务部副总经理（主持工作），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，投资托管服务部副总经理，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，投资托管服务部副总经理，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。

### （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2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。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。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”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：0755-83026620

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 14 号诺安大厦 8—9 层

邮政编码：100020

电话：010-59027811

传真：010-51309999

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：陈晓瑜

### 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 502

邮政编码：510623

电话：020-38393680

传真：020-38393680

联系人：廖飞

### 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：028-86586055

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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

联系人：张静

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://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](http://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：项俊波

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://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：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### 5. 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

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](http://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：傅育宁

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](http://www.cmbchina.com)

7. 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](http://www.cmbc.com.cn)

8. 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：0755－82088888

传真：0755－82080714

联系人：周勤

客户服务电话：95501

网址：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

9. 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

联系电话：010-66223584

传真：010-60226045

客户服务电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

10. 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](http://www.spdb.com.cn)

#### 11. 上海农村商业银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融·碧玉蓝天大厦 16 至 23 楼

法定代表人：胡平西

联系人：周睿

电话：021-38576985

传真：021-50105124

客户服务电话：021-962999

网址：[www.shrcb.com](http://www.shrcb.com)

#### 12. 宁波银行股份有限公司

住所及办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586189

传真：021-63586215

联系人：钱庚旺

客户服务电话：96528、962528（上海地区）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

#### 13. 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

电话：025-84544135

传真：010-84544129

客户服务电话：025-96400、40088-96400

网址：[www.njcb.com.cn](http://www.njcb.com.cn)

14. 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](http://www.jsbchina.cn)

15. 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：孔丹

联系人：秦莉

电话：010-65546655-108

传真：010-65542373

客户服务热线：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

16. 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

客户服务热线：0577-96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

17. 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：马时雍

客户服务电话：0571-96523、400-8888-508

网址：[www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn)

#### 18. 齐商银行股份有限公司

注册地址：山东省淄博市张店区中心路 105 号

办公地址：山东省淄博市张店区中心路 105 号

法定代表人：杲传勇

客户服务电话：400-8696-588

网址：[www.qsbank.cc](http://www.qsbank.cc)

#### 19. 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客户服务电话：400-888-8811

网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

#### 20. 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

法定代表人：庄永辉

客户服务电话：4008-311-777

网址：[www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

#### 21. 哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

客户服务电话：40060-96358、95537

网址：[www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.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：上海市浦东新区银城中路 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](http://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

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.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

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：顾伟国

电话：010-66568047

传真：010-66568116

联系人：李洋

客户服务电话：400-8888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

25. 中信建投证券有限责任公司

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](http://www.csc108.com)

#### 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：王志伟

电话：020—87555888

传真：020—87557985

联系人：肖中梅

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](http://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](http://www.guosen.com.cn)

#### 28. 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：徐浩明

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

#### 29. 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.htsce.com

#### 30. 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

公司网址：www.95579.com

#### 31. 东海证券有限责任公司

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

联系人：梁旭

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

客户服务电话：400-888-8588



网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

### 32. 湘财证券有限责任公司

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](http://www.xcsc.com)

### 33. 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 99 号

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；上海市浦东新区民生路 1199  
弄证大五道口广场 1 号楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

联系人：杨盛芳

客户服务电话：400-8888-123

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

### 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](http://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：400-651-5988

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裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

联系人：袁月

客户服务电话：95511

网址：www.pingan.com.cn

### 37. 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

### 38. 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：95578

网址：www.gyzq.com.cn

#### 39. 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 层

法定代表人：陆涛

客户服务电话：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

#### 40. 中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号

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

#### 41. 东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

电话：0769-22119426

联系人：张建平

客户服务电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

#### 42. 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

#### 43. 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街大街 1 号 A 座 8 层

办公地址：北京市西城区金融街大街 1 号 A 座 8 层

法人代表：马金声

联络人：戴荻

联系电话：010-68084591

传真：010-68084986

客户服务电话：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

#### 44. 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

#### 45. 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号证券大厦

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：0431-96688-0 或 0431-85096733

网址：www.nesc.cn

46. 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

客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

47. 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](http://www.hysec.com)

48. 山西证券有限责任公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26-30 层

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686709

客户服务电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

49. 广州证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 5 楼、17 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：961303；020-83963933

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

50. 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](http://www.jhzq.com.cn)

51. 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](http://www.ajzq.com)

52. 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](http://www.e5618.com)

53. 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](http://www.cindasc.com)

#### 54. 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](http://www.rxzq.com.cn)

#### 55. 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：北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座三层、五层

法定代表人：丁之锁

客户服务电话：010-58568118

联系人：林长华

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

#### 56. 大通证券股份有限公司

注册地址：大连市中山区人民路 24 号

法定代表人：董永成

联系人：汪晖

电话：0411-39673301

传真：0411-39673219

客户服务电话：4008-169-169

网址：[www.daton.com.cn](http://www.daton.com.cn)

57. 方正证券有限责任公司

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](http://www.foundersc.com)

58. 国海证券有限责任公司

注册地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

联系人：武斌

联系电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

客户服务电话：4008888100（全国）、95563（广西）

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

59. 财达证券有限责任公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 层

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 层

法定代表人：翟建强

客户服务电话：4006128888

网址：[www.s10000.com](http://www.s10000.com)

60. 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：李工

客户服务电话：96518

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

61. 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：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层  
法定代表人：林义相  
电话：010-66045608  
传真：010-66045500  
联系人：林爽  
客户服务电话：010-66045678  
天相投顾问网-网址：<http://www.txsec.com>  
天相基金网-网址：<http://jjin.txsec.com>

62. 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  
客户服务热线：95565、0755-26951111  
网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

63. 南京证券有限责任公司

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  
客户服务热线：400-828-5888  
网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

64. 华福证券有限责任公司（原广发华福证券有限公司）

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

#### 65. 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：025-84457777-950

传真：025-84579763

联系人：李金龙

客户服务热线：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

#### 66. 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦 25 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦第 5 层、17 层、  
18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492062

联系人：盛宗凌

客户服务热线：400-8888-555

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

#### 67. 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市曹杨路 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

客户服务热线：400-8888-128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

#### 68. 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号 6 楼、7 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：袁丽萍

客户服务电话：400-888-5288，0510-82588168

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

#### 69. 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

客户服务热线：010-84588888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

#### 70. 西南证券股份有限公司

注册地址：渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢 22 层

法定代表人：王珠林

客户服务电话：4008096096

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

71. 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：崔海涛

客户服务电话：4008-888-993

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

72. 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 号中原广发金融大厦  
17-20 楼

办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦  
17-20 楼

法定代表人：石保上

客户服务电话：0371-967218

网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

73. 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号成证大厦 16 楼

法定代表人：冉云

联系电话：028-86690021 86690206

传真：028-86695681

客户服务电话：4006-600109

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

74. 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

客户服务电话：400-8888-818

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

75. 中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

76. 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人：况雨林

客户服务电话：0871-3577930

网址：www.hongtazq.com

77. 第一创业证券有限责任公司

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

**（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：付朝晖

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：利安达会计师事务所有限责任公司

住所：北京朝阳区八里庄西里 100 号住邦 2000 一号楼东区 2008 室

法定代表人：黄锦辉

电话：010-85866870

传真：010-85866877

联系人：门熹

经办注册会计师：韦雪、赵伟

#### **四、基金名称**

诺安主题精选股票型证券投资基金

#### **五、基金的类型**

契约型开放式基金

#### **六、基金的投资目标**

本基金通过精选主题，稳健投资，力图在不同的市场环境下均可突破局限，在长期内获得超过比较基准的超额收益。

#### **七、基金的投资范围**

本基金的投资范围为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（含创业板股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%，其中不低于 80%的股票资产投资于与基金管理人构建的备选主题库相关联的个股；债券等固定收益类资产占基金资产的 0%-40%；权证占基金资产净值的 0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

## 八、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、权证投资策略四部分组成。

1. 资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

在具体的大类资产配置过程中，本基金将采用在市场中验证有效的 LEVP 模型，根据市场流动性、经济发展状况、国家政策倾向以及市场整体估值水平的状况，判断类别资产的配置比例和时机，从而动态优化资产组合，以达到建立一个在承受一定风险前提下可获取较高收益的组合的目标。

2. 股票投资策略方面，本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。

### (1) 备选主题库的构建

本基金将从宏观经济、政策制度、行业特征、特殊事件等角度进行深入分析，精选主题，建立备选主题库，并且积极调整主题库，至少每季度更新一次主题库。

#### 1) 主题发掘

我们将从定性和定量的角度，对宏观经济、政策制度、行业特征、特殊事件等角度进行深入分析，从而力求完备地、前瞻性地发掘可应用于市场中的投资主题，构建备选主题库。

#### ① 宏观经济

宏观经济角度主要是从宏观经济发展状况、宏观经济的结构性特征、经济周期以及投资者对宏观经济的预期等角度进行观察和研究。

#### ② 政策制度

中国经济在发展过程中呈现出较明显的政策驱动性特征，受益于财政刺激等利好政策的部门将获得超过社会平均水平的增长速度，我们以政策制度倾向为标准发掘该类主题。

### ③行业特征

行业特征包括行业生命周期、行业竞争强度和行业发展趋势等方面的特征。例如，在产业资本利益的驱动下，并购重组成为某些行业的必然发展趋势，比较突出的是，在争夺资源产品定价权的动机下，资源型产业的并购重组提速的趋势较为明显，而并购重组能给上市公司带来价值重估型投资机会，从而具备了主题性的投资意义。

### ④特殊事件

市场上还有一些主题存在时间相对较短，其驱动因素可能仅仅是某个事件。发掘和研究事件性的主题，有助于把握较为短期的投资机会。

除以上观察角度外，随着时间的推移，可能会出现新的观察投资主题的角度，我们也将经过详细的研究之后，纳入到我们主题挖掘的体系当中。

## 2) 主题库更新

主题研究不是一劳永逸的过程，我们将从上述逻辑出发，持续地跟踪相关要素的趋势性和结构性变化，至少每季度更新一次主题库，以实现备选主题库的动态更新。

### (2) 主题筛选

在建立了备选主题库的基础上，我们将按照前瞻性、标的可投资性以及市场关注度等标准，筛选当前具有投资价值的主题，并按照我们对主题的重要程度的判断赋予备选主题以不同的权重。

1) 前瞻性是指从宏观经济和市场微观环境，以及政策预期的结构性或趋势性变化的角度出发，判断所选主题是否已被市场充分理解。若在市场之前介入前瞻性的主题，便可享受时间上的溢价，而若此主题已被市场充分理解，则介入风险可能会较大。我们将从宏观经济和市场微观环境结构性或趋势性变化的角度出发，关注敏感时间窗口，前瞻性地把握主题。

2) 标的可投资性是指所选主题是否有足够的投资标的与之相对应（具体应看股票数量、市值覆盖是否足够），以及投资标的本身是否具有投资价值。若可



关联股票群足够广泛，则可在一定程度上分散风险，而若可关联股票较少，则存在较大的集中度风险。

3) 市场关注度主要指市场对所选主题的理解和预期程度，我们将从市场情绪、资金流向、卖方研究集中度等角度进行甄别。市场对该主题的投资情绪高涨、资金流向明确、卖方研究集中度较高，则我们认为该主题的市场关注度较高。

在挑选出合适的主题的基础上，我们将从上述三个标准出发，按照我们对主题的重要程度的判断赋予备选主题以不同权重：最具有前瞻性，同时市场关注度良好，标的可投资性强的主题将被赋予最高权重；前瞻性和市场关注度中等，具有合适的标的可投资性的主题将被赋予中等权重；将前瞻性和市场关注度较低，同时具有稍差的标的可投资性的主题将被赋予较低权重。

### (3) 个股精选

本基金将按照最大范围覆盖原则将筛选出来的主题关联到相应股票群中，从而这些不同主题所关联的股票群便组成了对应主题库的备选股票库。最大范围覆盖原则是指在将主题关联到相应股票群的过程中，本基金的研究团队会根据主题筛选的结果，结合第三方研究和市场认知程度，从该主题是否对个股基本面状况产生影响、是否历史上存在联动关系、未来产生关联的可能性等角度出发，在本基金允许投资的基本股票库中，最大可能的筛选出与备选主题相关联的股票群。

本基金将综合考虑个股与既定主题间的关联度以及股票本身的投资价值，精选股票，并根据定量以及定性分析的结果，赋予备选股票以不同的投资价值权重。

#### 1) 构建主题库对应的备选股票库

本基金将按最大范围覆盖原则将所选主题关联到相应股票群中，从而这些不同主题所关联的股票群便组成了对应主题库的备选股票库。

#### 2) 关联度分析

在经由最大范围覆盖原则产生的股票群中，我们需要对其中的个股与相关主题的关联度做出分析。我们主要从盈利影响度、市场认知度和历史联动关系等方面进行考察。

#### 3) 投资价值分析

在个股的投资价值分析的层面，我们将从定性和定量的角度，对股票的基本面情况、估值水平进行分析，并结合基金经理和研究团队的实际调研，对个股赋

予投资价值权重。

在定量方面，本基金主要从两个层次进行分析：一是通过对企业财务指标（包括盈利能力指标、营运能力指标、偿债能力指标和成长能力指标）进行分析，判断企业的基本面情况和成长空间；二是通过对估值指标的分析，判断企业的投资价值。

从财务角度来看，我们主要关注四方面的指标：

①盈利能力指标，如净资产收益率（ROE）、销售毛利率、净利润/营业总收入、每股收益（EPS）等——这是判断企业赚取利润能力的基本指标，我们会结合历史数据、卖方研究以及实地调研对未来数据变化做出研判，从而力图对企业的成长性作出基本的判断；

②营运能力指标，如总资产周转率（ATO）——这是销售额和总资产的比率，其综合考察了长期资产和短期资产，显示了公司总体的投资效率，周转率越快反映公司销售能力越强。

③偿债能力指标，如资产负债率（TDO）——这是负债总额（长期债务加短期债务）与资产总额（债务类资产加权益类资产）的比率。

④成长能力指标，如三年净利润平均增长率——这是企业三年内净利润增长的平均比率，反映企业的利润增长趋势和效益稳定程度，较好地体现了企业的发展状况和成长能力。

从估值角度来看，我们主要关注股票的 P/B，P/E，P/S，PEG 等相对估值指标和自由现金流价值（FCF）等绝对估值指标。

在定性方面，我们主要从上市公司股权结构、信息透明度、公司治理情况、产品创新能力等方面进行考量。

我们将结合个股基本面情况、估值水平分析，以及定性分析的结果赋予个股投资价值权重。基本面情况良好、估值水平合理，同时公司股权结构和治理结构合理，信息透明度高，产品创新能力强的股票赋予较高权重；反之则赋予较低的权重。

#### （4）组合构建

最后，本基金将综合考虑备选个股的主题权重和投资价值权重，并结合其他投资机会的挖掘，遴选在备选主题库之外的具有投资价值的个股，共同构建股票

投资组合。之后结合行业集中度、组合流动性等因素的考量，进行组合的再平衡，得到最终的投资组合。

3. 债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。

4. 权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数与中证全债指数的混合指数，即：

75%沪深 300 指数+25%中证全债指数

沪深 300 指数为中证指数公司于 2005 年 4 月 8 日发布的综合反映沪深证券市场整体状况的指数；同时，中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。从而，沪深 300 指数与中证全债指数的混合指数作为本基金的业绩比较基准具备良好的代表性。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深 300 指数或中证全债指数的编制及发布、或沪深 300 指数或中证全债指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深 300 指数或中证全债指数不宜继续作为基准指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，取得基金托管人同意后，变更本基金的业绩比较基准。

## 十、基金的风险收益特征

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 2011 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（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	992,983,804.75	73.17
	其中：股票	992,983,804.75	73.17
2	固定收益投资	86,966,165.41	6.41
	其中：债券	86,966,165.41	6.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	274,244,484.32	20.21
6	其他资产	2,902,121.44	0.21
7	合计	1,357,096,575.92	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	5,529,000.00	0.41
B	采掘业	81,080,612.84	5.99
C	制造业	454,925,100.91	33.61
C0	食品、饮料	194,639,091.42	14.38
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	33,952,159.32	2.51
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,723,557.48	4.49
C5	电子	4,457,268.24	0.33
C6	金属、非金属	3,388,737.84	0.25
C7	机械、设备、仪表	90,023,379.11	6.65
C8	医药、生物制品	67,740,907.50	5.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,739,194.00	0.28
E	建筑业	11,318,503.20	0.84
F	交通运输、仓储业	11,294,171.32	0.83
G	信息技术业	44,088,813.14	3.26
H	批发和零售贸易	122,589,760.80	9.06
I	金融、保险业	147,050,911.80	10.87
J	房地产业	23,732,674.67	1.75
K	社会服务业	46,002,604.10	3.40
L	传播与文化产业	6,324,000.00	0.47
M	综合类	35,308,457.97	2.61
	合计	992,983,804.75	73.37

(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	600016	民生银行	9,784,620	57,631,411.80	4.26
2	600887	伊利股份	2,606,814	53,257,210.02	3.94

3	600519	贵州茅台	250,000	48,325,000.00	3.57
4	000895	双汇发展	576,440	40,321,978.00	2.98
5	601088	中国神华	1,419,899	35,966,041.67	2.66
6	000069	华侨城 A	4,600,000	32,844,000.00	2.43
7	600143	金发科技	2,253,136	29,133,048.48	2.15
8	601601	中国太保	1,450,000	27,854,500.00	2.06
9	002024	苏宁电器	3,300,000	27,852,000.00	2.06
10	600739	辽宁成大	2,128,500	26,159,265.00	1.93

#### （四）报告期末按债券品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	86,966,165.41	6.43
8	其他	-	-
9	合计	86,966,165.41	6.43

#### （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	113001	中行转债	510,000	48,235,800.00	3.56
2	113002	工行转债	155,000	16,501,300.00	1.22
3	110018	国电转债	105,920	11,226,460.80	0.83
4	110013	国投转债	60,000	5,815,800.00	0.43
5	110015	石化转债	29,580	2,973,085.80	0.22

#### （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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### （八）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，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。
- 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、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	772,493.53
2	应收证券清算款	1,790,978.15
3	应收股利	-
4	应收利息	334,406.59
5	应收申购款	4,243.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,902,121.44

## 4、报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	48,235,800.00	3.56
2	113002	工行转债	16,501,300.00	1.22
3	110013	国投转债	5,815,800.00	0.43
4	110015	石化转债	2,973,085.80	0.22
5	125887	中鼎转债	1,532,463.63	0.11

## 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，分项之和与合计可能有尾差。

## 十二、基金的业绩

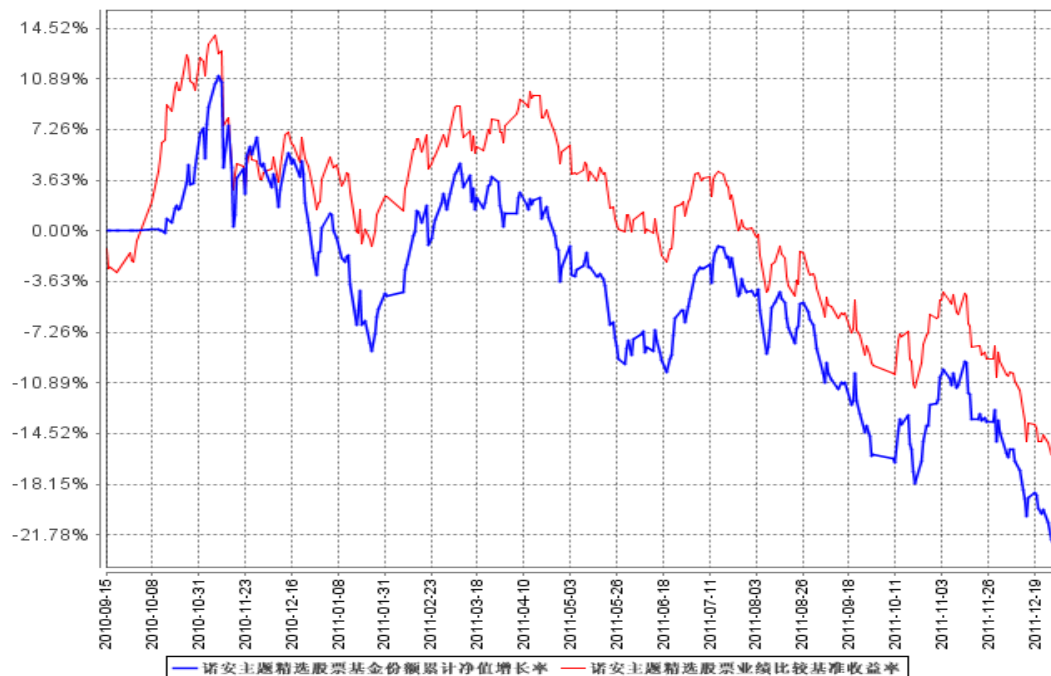
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

## (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
2010.9.15~2010.12.31	0.20%	1.48%	3.71%	1.29%	-3.51%	0.19%
2011.1.1~2011.12.31	-20.96%	1.11%	-17.93%	0.98%	-3.03%	0.13%
2010.9.15~2011.12.31	-20.80%	1.20%	-14.89%	1.05%	-5.91%	0.15%

注：本基金的业绩比较基准为：75%沪深 300 指数+25%中证全债指数。

## （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 2010 年 9 月 15 日至 2011 年 3 月 14 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金建仓期结束未满 1 年。

## 十三、基金的费用概览

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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）基金财产划拨支付的银行费用；
- （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。

#### 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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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 3 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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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 3 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

本基金在申购时收取申购费用。申购费用按单个交易账户单笔分别计算，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	1.0%
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

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 2、赎回费

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

基金赎回金额的计算

$$\text{赎回费} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费}$$

### 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： $A = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + F] / E$

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、特定职业的投资人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）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

#### 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2011年10月29日刊登的《诺主题精选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止日期及相关财务数据的截止日期。

2、在“第二部分 释义”中，更新了“《销售办法》”的含义。

3、在“第三部分 基金管理人”中，更新了基金管理人的股权结构、证券投资基金管理情况的介绍说明、董事会成员的名单以及投资决策委员会成员的介绍说明。

4、更新了基金托管人的基本情况、主要人员情况及基金托管业务经营情况。

5、在“第五部分 相关服务机构”中，更新了直销机构及原有代销机构的信息，更新了本基金的经办注册会计师。

6、在“第六部分 基金份额的申购与赎回”中，对“十三、基金的转换”做了补充说明。

7、在“第七部分 基金的投资”中，更新了“九、基金投资组合报告”的内容。相关数据及内容的截止日期为 2011 年 12 月 31 日。

8、在“第八部分 基金的业绩”内容，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。

9、在“第十七部分 基金合同内容摘要”及“第十八部分 基金托管协议摘要”中，对基金托管人的法定代表人进行了更新。

10、在“第十九部分 对基金份额持有人的服务”中，更新了“四、基金投资的服务”。

11、在“第二十部分 其他应披露事项”中，列举了本基金在本报告期内的相关公告。

## 十五、签署日期

2012 年 3 月 15 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

2012 年 4 月 28 日