

诺安多策略股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

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

送出日期：2012 年 8 月 29 日

§ 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 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	46
7.9 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
§9 开放式基金份额变动	47

§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安多策略股票型证券投资基金
基金简称	诺安多策略股票
基金主代码	320016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 9 日
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
报告期末基金份额总额	585,495,093.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过数量化手段优化投资策略，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略以及股指期货投资策略五部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略 本基金主要投资的大类资产是股票、债券和现金，我们将从宏观面、政策面、资金面和基本面等全面研究、综合分析，发掘择时因子，根据择时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。</p> <p>2. 股票投资策略 本基金以“定量投资”为主，辅以“定性投资”，力争实现稳定超额回报。</p> <p>3. 债券投资策略 本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。</p> <p>4. 权证投资策略 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，进行稳健投资。</p> <p>5. 股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型

	基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的品种。
--	-----------------------------------

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	尹东
	联系电话	0755-83026688	010-67595003
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	010-67595096
传真		0755-83026677	010-66275853
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		秦维舟	王洪章

2.4 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-70,017,767.95
本期利润	15,277,352.85
加权平均基金份额本期利润	0.0226

本期加权平均净值利润率	2.69%
本期基金份额净值增长率	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-114,164,133.48
期末可供分配基金份额利润	-0.1950
期末基金资产净值	471,330,959.68
期末基金份额净值	0.805
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-19.50%

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或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 8 月 9 日生效，截止 2012 年 6 月 30 日，本基金成立未满 1 年。

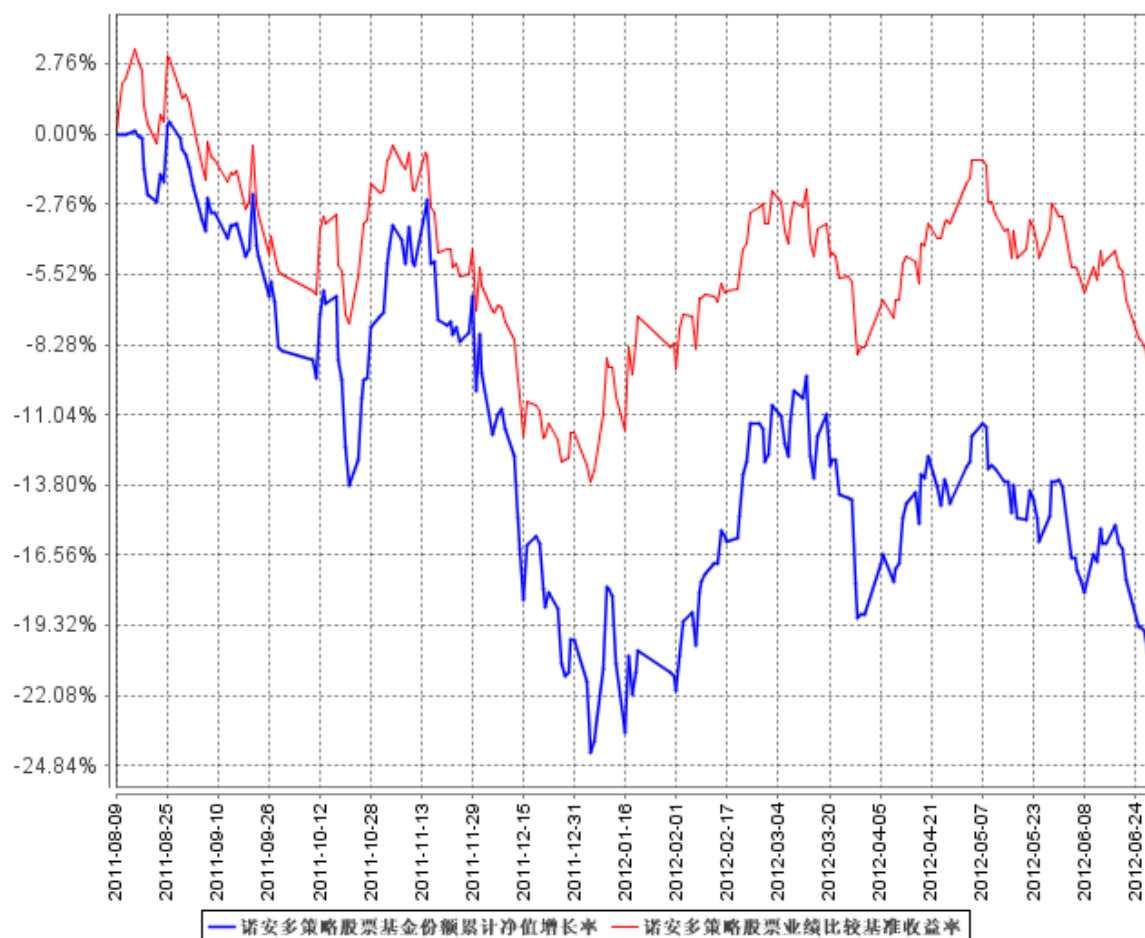
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-6.83%	1.16%	-4.80%	0.82%	-2.03%	0.34%
过去三个月	-0.74%	1.15%	0.51%	0.84%	-1.25%	0.31%
过去六个月	0.50%	1.47%	4.34%	1.00%	-3.84%	0.47%
自基金合同生效起至今	-19.50%	1.42%	-7.90%	1.02%	-11.60%	0.40%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

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 8 月 9 日生效，截至 2012 年 6 月 30 日止，本基金成立未满 1 年。

②本基金的建仓期为 2011 年 8 月 9 日至 2012 年 2 月 8 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至 2012 年 6 月 30 日止，本基金建仓期结束未满 1 年。

§ 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 2012 年 6 月底，本基金管理人共管理二十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、

诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金及诺安汇鑫保本混合型证券投资基金。

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		
王永宏	金融工程部副总监、诺安多策略股票型证券投资基金基金经理	2011 年 8 月 9 日	—	14	经济学博士，具有基金从业资格。曾先后任职于海通证券股份有限公司、大成基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司，2010 年加入诺安基金管理有限公司，现任金融工程部副总监。曾于 2009 年 3 月至 2010 年 9 月担任嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金基金经理。2011 年 8 月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

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。

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，诺安多策略股票型证券投资基金管理人严格遵守了《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《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组

合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，均是由于公司旗下个别基金使用量化投资策略所致。

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

报告期内，本基金按照“定量为主，定性为辅”的原则，积极进行行业轮动和个股精选，在行业和个股精选方面都获得了一些超额收益，但在择时方面并没有获得正的超额收益。

4.4.2 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 0.805 元。本报告期基金份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 4.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截止到报告期末，看多原因在于，一、实体经济下滑，流动性释放出来，资本市场流动性比

2011 年有了较大的改观；二、制度变革给股票市场奠定了长期看好的基础。看空原因在于，一、实体经济下滑导致业绩下滑；二、股票供给增加，大小非解禁和减持压力巨大，形成向下的估值压力；三、“四万亿”导致过剩产能制约了市值占比超过一半的周期股的表现。市场始终在这两种基本力量的对抗中，维持平衡运行状态。结构性机会比较多，把握结构性机会和波段操作是今年制胜的关键。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定, 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金收益每年最多分配 6 次, 每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%; 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

本报告期内, 本基金未进行利润分配。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	37,591,201.48	42,147,571.40
结算备付金		1,439,017.34	4,103,355.35
存出保证金		1,523,249.54	931,823.96
交易性金融资产	6.4.7.2	418,030,990.61	609,640,558.88
其中：股票投资		418,030,990.61	609,640,558.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		15,396,941.80	19,252,687.15
应收利息	6.4.7.5	8,088.56	8,991.57
应收股利		45.04	-
应收申购款		791.85	5,928.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		473,990,326.22	676,090,917.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,390,518.64
应付赎回款		333,531.93	4,331,302.49
应付管理人报酬		607,747.56	930,838.36
应付托管费		101,291.28	155,139.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,166,634.60	2,438,737.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	450,161.17	66,323.99
负债合计		2,659,366.54	9,312,860.34
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	585,495,093.16	832,575,900.84
未分配利润	6.4.7.10	-114,164,133.48	-165,797,844.02
所有者权益合计		471,330,959.68	666,778,056.82
负债和所有者权益总计		473,990,326.22	676,090,917.16

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.805 元，基金份额总额 585,495,093.16 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安多策略股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		25,888,537.97
1.利息收入		209,891.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	209,891.04

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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,882,371.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-63,597,900.28
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	3,715,528.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	85,295,120.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	265,897.67
减：二、费用		10,611,185.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,254,788.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	709,131.45
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,430,367.88
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	216,896.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,277,352.85
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,277,352.85

注：本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，本期会计报表的实际报告期间为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日，无对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安多策略股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	832,575,900.84	-165,797,844.02	666,778,056.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,277,352.85	15,277,352.85

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）	-247,080,807.68	36,356,357.69	-210,724,449.99
其中：1.基金申购款	2,357,470.21	-365,576.43	1,991,893.78
2.基金赎回款	-249,438,277.89	36,721,934.12	-212,716,343.77
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）	585,495,093.16	-114,164,133.48	471,330,959.68

注：本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，本期会计报表的实际报告期间为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日，无对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 奥成文 </u>	<u> 薛有为 </u>	<u> 薛有为 </u>
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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安多策略股票型证券投资基金(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]739 号文《关于核准诺安多策略股票型证券投资基金募集的批复》批准,于 2011 年 7 月 11 日至 2011 年 8 月 5 日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,募集的有效认购金额为人民币 1,255,384,560.62 元,其中净认购额为人民币 1,248,834,629.84 元,折合 1,248,834,629.84 份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币 236,845.34 元,折合 236,845.34 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 8 月 9 日,合同生效日基金份额为 1,249,071,475.18 份基金单位。

本基金为契约型开放式,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。《诺安多策略股票型证券投资基金合同》、《诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

(1) 自 2008 年 9 月 19 日起, 基金管理人运用基金买卖股票, 交易印花税按单边征收方式, 卖出股票按 1%征收, 买入股票不征收。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中因非流通股股东向其支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

(1) 根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东向其支付的股份、现金等对价, 暂免征收企业所得税。

3、个人所得税

(1) 对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入, 由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2005 年 6 月 13 日(含当日)起, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代

缴 10% 的个人所得税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东向其支付的股份、现金等对价, 暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	37,591,201.48
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	37,591,201.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	445,573,724.95	418,030,990.61	-27,542,734.34
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	445,573,724.95	418,030,990.61	-27,542,734.34

注: 本报告期本基金所投资的股票中, 无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有因参与买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,505.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	582.84
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	8,088.56

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,166,634.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,166,634.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	1,257.01
预提费用	198,904.16
合计	450,161.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	832,575,900.84	832,575,900.84
本期申购	2,357,470.21	2,357,470.21
本期赎回(以“-”号填列)	-249,438,277.89	-249,438,277.89
本期末	585,495,093.16	585,495,093.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	-75,539,893.46	-90,257,950.56	-165,797,844.02
本期利润	-70,017,767.95	85,295,120.80	15,277,352.85
本期基金份额交易产生的变动数	37,576,077.69	-1,219,720.00	36,356,357.69
其中：基金申购款	-376,201.46	10,625.03	-365,576.43
基金赎回款	37,952,279.15	-1,230,345.03	36,721,934.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-107,981,583.72	-6,182,549.76	-114,164,133.48

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	183,689.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,201.27
其他	0.56
合计	209,891.04

注：“其他”为认申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,850,218,301.45
减：卖出股票成本总额	1,913,816,201.73
买卖股票差价收入	-63,597,900.28

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,715,528.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,715,528.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	85,295,120.80
——股票投资	85,295,120.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	85,295,120.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	265,878.08
基金转换费收入	19.59
合计	265,897.67

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,430,367.88
银行间市场交易费用	-
合计	5,430,367.88

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
汇划费	8,992.65
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	216,896.81

6.4.7.20 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
中国建设银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期不存在应支付关联方的佣金。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,254,788.98
其中：支付销售机构的客户维护费	1,317,613.40

注：① A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

②本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	709,131.45

注：① A. 基金托管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五个工作日内从基金资产中一次性支取。

②本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.3 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。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.4.2 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。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	37,591,201.48	183,689.21

注：本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.6 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。本期基金合同生效日为 2011 年 8 月 9 日，无对比数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
------	------	------	------	----------------	------	----------------	-------	------------	------------	----

600436	片仔 癭	2012 年 6 月 29 日	重大事 项	87.89	2012 年 7 月 2 日	91.19	13,066	1,142,328.33	1,148,370.74	-
300040	九洲 电气	2012 年 6 月 19 日	出售资 产事项	8.32	2012 年 8 月 7 日	9.15	14,100	121,446.72	117,312.00	-
600499	科达 机电	2012 年 6 月 20 日	重大事 项	10.28	2012 年 7 月 2 日	10.11	100	1,515.00	1,028.00	-
000059	辽通 化工	2012 年 6 月 26 日	重大事 项	7.91	2012 年 7 月 3 日	8.15	100	871.22	791.00	-
002049	晶源 电子	2012 年 6 月 5 日	资产重 组	22.15	2012 年 7 月 12 日	23.00	5	92.11	110.75	-

注：自 2012 年 7 月 23 日起，股票名称“晶源电子”变更为“同方国芯”，股票代码不变。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超

过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 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‘6.4.12’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)的合同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。

6.4.13.3.1 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交易所股票市场, 所持有的存在到期期限的金融资产和金融负债金额较小。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 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	37,591,201.48	-	-	-	-	37,591,201.48
结算备付金	1,439,017.34	-	-	-	-	1,439,017.34
存出保证金	-	-	-	-	1,523,249.54	1,523,249.54
交易性金融资产	-	-	-	-	418,030,990.61	418,030,990.61
应收证券清算款	-	-	-	-	15,396,941.80	15,396,941.80
应收利息	-	-	-	-	8,088.56	8,088.56
应收股利	-	-	-	-	45.04	45.04
应收申购款	496.28	-	-	-	295.57	791.85
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,030,715.10	-	-	-	434,959,611.12	473,990,326.22
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	333,531.93	333,531.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	607,747.56	607,747.56
应付托管费	-	-	-	-	101,291.28	101,291.28
应付交易费用	-	-	-	-	1,166,634.60	1,166,634.60
其他负债	-	-	-	-	450,161.17	450,161.17
负债总计	-	-	-	-	2,659,366.54	2,659,366.54
利率敏感度缺口	39,030,715.10	-	-	-	432,300,244.58	471,330,959.68
上年度末 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	42,147,571.40	-	-	-	-	42,147,571.40
结算备付金	4,103,355.35	-	-	-	-	4,103,355.35
存出保证金	-	-	-	-	931,823.96	931,823.96
交易性金融资产	-	-	-	-	609,640,558.88	609,640,558.88
应收证券清算款	-	-	-	-	19,252,687.15	19,252,687.15
应收利息	-	-	-	-	8,991.57	8,991.57
应收申购款	5,928.85	-	-	-	-	5,928.85
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	46,256,855.60	-	-	-	629,834,061.56	676,090,917.16

负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,390,518.64	1,390,518.64
应付赎回款	-	-	-	-	4,331,302.49	4,331,302.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	930,838.36	930,838.36
应付托管费	-	-	-	-	155,139.74	155,139.74
应付交易费用	-	-	-	-	2,438,737.12	2,438,737.12
其他负债	-	-	-	-	66,323.99	66,323.99
负债总计	-	-	-	-	9,312,860.34	9,312,860.34
利率敏感度缺口	46,256,855.60	-	-	-	-620,521,201.22	666,778,056.82

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具、股指期货和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2012 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

交易性金融资产—股票投资	418,030,990.61	88.69	609,640,558.88	91.43
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	418,030,990.61	88.69	609,640,558.88	91.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准的公允价值发生变化		
	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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	1. 业绩比较基准的公允价值上升 5%	32,622,131.41	33,373,995.62
	2. 业绩比较基准的公允价值下降 5%	-32,622,131.41	-33,373,995.62

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布, 在 95%的置信度下, 使用过去一年的历史数据, 按照 VaR 正态算法, 计算未来一个交易日里, 基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信度: 95%		
	2. 观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末(2012年6月30日)	上年度末(2011年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	10,173,507.03	14,613,720.63
	合计	10,173,507.03	14,613,720.63

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定, 本基金自 2008 年 9 月 16 日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。

本基金所持有的股票中百集团(000759)自 2012 年 3 月 28 日起, 采用指数收益法进行估值, 对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币 51,458.42 元。根据中百集团复牌后的市场表现及基金的实际情况, 经与基金托管人协商一致, 于 2012 年 4 月 24 日起对该股票恢复采用市价估

值方法进行估值。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	418,030,990.61	88.19
	其中：股票	418,030,990.61	88.19
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	39,030,218.82	8.23
6	其他各项资产	16,929,116.79	3.57
7	合计	473,990,326.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,691,641.69	1.21
B	采掘业	32,827,613.78	6.96
C	制造业	211,327,565.14	44.84
C0	食品、饮料	61,259,203.19	13.00
C1	纺织、服装、皮毛	16,975,866.09	3.60
C2	木材、家具	801.66	0.00
C3	造纸、印刷	3,286.72	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,499,606.71	1.59
C5	电子	12,214,152.46	2.59
C6	金属、非金属	10,292,119.33	2.18
C7	机械、设备、仪表	39,839,015.05	8.45
C8	医药、生物制品	59,750,634.70	12.68
C99	其他制造业	3,492,879.23	0.74
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,682,346.05	0.36
E	建筑业	598.54	0.00
F	交通运输、仓储业	20,473,735.24	4.34

G	信息技术业	28,613,342.67	6.07
H	批发和零售贸易	46,820,529.46	9.93
I	金融、保险业	4,404,044.90	0.93
J	房地产业	46,433,309.34	9.85
K	社会服务业	13,075,003.94	2.77
L	传播与文化产业	4,723,275.18	1.00
M	综合类	1,957,984.68	0.42
	合计	418,030,990.61	88.69

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	868,800	17,879,904.00	3.79
2	000516	开元投资	3,529,733	15,742,609.18	3.34
3	600123	兰花科创	760,528	13,735,135.68	2.91
4	000423	东阿阿胶	279,911	11,199,239.11	2.38
5	000666	经纬纺机	864,847	10,568,430.34	2.24
6	002022	科华生物	884,210	9,593,678.50	2.04
7	000726	鲁 泰 A	1,210,100	8,761,124.00	1.86
8	000895	双汇发展	137,062	8,481,396.56	1.80
9	300178	腾邦国际	582,292	8,268,546.40	1.75
10	600157	永泰能源	827,860	7,516,968.80	1.59
11	002422	科伦药业	150,007	6,999,326.62	1.49
12	600570	恒生电子	502,097	6,888,770.84	1.46
13	000900	现代投资	453,900	6,463,536.00	1.37
14	002591	恒大高新	460,882	6,277,212.84	1.33
15	600519	贵州茅台	26,000	6,217,900.00	1.32
16	600686	金龙汽车	939,723	6,164,582.88	1.31
17	000915	山大华特	404,600	6,145,874.00	1.30
18	000402	金 融 街	922,403	6,023,291.59	1.28
19	000568	泸州老窖	139,108	5,885,659.48	1.25
20	600383	金地集团	906,500	5,874,120.00	1.25
21	002285	世联地产	396,500	5,868,200.00	1.25
22	600322	天房发展	1,632,169	5,826,843.33	1.24
23	600354	敦煌种业	968,426	5,684,660.62	1.21
24	600125	铁龙物流	659,283	5,590,719.84	1.19
25	000848	承德露露	313,787	5,506,961.85	1.17
26	600327	大东方	914,000	5,502,280.00	1.17

27	600337	美克股份	909,889	5,459,334.00	1.16
28	002570	贝因美	245,751	4,951,882.65	1.05
29	002557	洽洽食品	230,429	4,631,622.90	0.98
30	600325	华发股份	519,494	4,426,088.88	0.94
31	000651	格力电器	205,829	4,291,534.65	0.91
32	000919	金陵药业	508,895	4,284,895.90	0.91
33	600809	山西汾酒	112,404	4,236,506.76	0.90
34	600348	阳泉煤业	271,400	4,152,420.00	0.88
35	601333	广深铁路	1,399,600	4,114,824.00	0.87
36	000031	中粮地产	896,337	4,069,369.98	0.86
37	600460	士兰微	918,468	4,059,628.56	0.86
38	300015	爱尔眼科	191,403	4,013,720.91	0.85
39	002315	焦点科技	115,410	3,998,956.50	0.85
40	600827	友谊股份	347,088	3,925,565.28	0.83
41	002123	荣信股份	344,584	3,917,920.08	0.83
42	002029	七匹狼	140,000	3,892,000.00	0.83
43	000616	亿城股份	1,019,611	3,731,776.26	0.79
44	000527	美的电器	323,800	3,577,990.00	0.76
45	600748	上实发展	588,800	3,538,688.00	0.75
46	300101	国腾电子	248,901	3,524,438.16	0.75
47	600210	紫江企业	843,802	3,476,464.24	0.74
48	600993	马应龙	199,955	3,449,223.75	0.73
49	000739	普洛股份	399,900	3,367,158.00	0.71
50	600270	外运发展	467,500	3,328,600.00	0.71
51	600177	雅戈尔	384,009	3,260,236.41	0.69
52	600829	三精制药	263,720	3,064,426.40	0.65
53	600740	山西焦化	353,700	3,052,431.00	0.65
54	300171	东富龙	96,197	2,741,614.50	0.58
55	002024	苏宁电器	309,130	2,593,600.70	0.55
56	300089	长城集团	298,450	2,563,685.50	0.54
57	000594	国恒铁路	1,040,000	2,548,000.00	0.54
58	600498	烽火通信	95,955	2,543,767.05	0.54
59	000933	神火股份	270,867	2,470,307.04	0.52
60	600739	辽宁成大	156,642	2,443,615.20	0.52
61	000728	国元证券	221,190	2,413,182.90	0.51
62	600067	冠城大通	430,008	2,395,144.56	0.51
63	600584	长电科技	484,371	2,324,980.80	0.49
64	000623	吉林敖东	131,273	2,276,273.82	0.48
65	002065	东华软件	100,000	2,220,000.00	0.47

66	002463	沪电股份	494,240	2,204,310.40	0.47
67	002099	海翔药业	200,006	2,128,063.84	0.45
68	002153	石基信息	81,905	2,100,863.25	0.45
69	601666	平煤股份	195,810	1,981,597.20	0.42
70	002119	康强电子	256,788	1,920,774.24	0.41
71	601299	中国北车	476,203	1,909,574.03	0.41
72	002230	科大讯飞	96,707	1,905,127.90	0.40
73	600246	万通地产	508,900	1,872,752.00	0.40
74	600755	厦门国贸	367,407	1,837,035.00	0.39
75	600837	海通证券	190,103	1,830,691.89	0.39
76	000729	燕京啤酒	250,698	1,830,095.40	0.39
77	600527	江南高纤	462,500	1,803,750.00	0.38
78	600704	物产中大	195,800	1,744,578.00	0.37
79	000685	中山公用	115,132	1,679,775.88	0.36
80	601699	潞安环能	78,839	1,635,120.86	0.35
81	000917	电广传媒	65,707	1,624,934.11	0.34
82	300078	中瑞思创	116,003	1,614,761.76	0.34
83	600518	康美药业	104,372	1,609,416.24	0.34
84	600723	首商股份	188,537	1,583,710.80	0.34
85	600373	中文传媒	109,800	1,576,728.00	0.33
86	601588	北辰实业	551,500	1,571,775.00	0.33
87	000701	厦门信达	177,904	1,553,101.92	0.33
88	002014	永新股份	92,320	1,428,190.40	0.30
89	600395	盘江股份	48,766	1,310,830.08	0.28
90	000061	农产品	220,979	1,281,678.20	0.27
91	600406	国电南瑞	68,079	1,272,396.51	0.27
92	600529	山东药玻	130,479	1,234,331.34	0.26
93	600742	一汽富维	62,231	1,216,616.05	0.26
94	300170	汉得信息	67,800	1,170,228.00	0.25
95	002262	恩华药业	50,007	1,164,663.03	0.25
96	600436	片仔癀	13,066	1,148,370.74	0.24
97	600376	首开股份	85,400	1,130,696.00	0.24
98	000537	广宇发展	157,100	1,129,549.00	0.24
99	002216	三全食品	42,049	1,057,532.35	0.22
100	000650	仁和药业	114,934	986,133.72	0.21
101	300058	蓝色光标	51,016	851,457.04	0.18
102	600185	格力地产	138,100	829,981.00	0.18
103	600511	国药股份	58,555	819,770.00	0.17
104	300100	双林股份	62,300	803,670.00	0.17

105	600485	中创信测	85,507	752,461.60	0.16
106	600763	通策医疗	32,860	720,291.20	0.15
107	600079	人福医药	29,939	694,285.41	0.15
108	600594	益佰制药	34,479	682,684.20	0.14
109	002028	思源电气	61,309	679,916.81	0.14
110	600222	太龙药业	136,799	642,955.30	0.14
111	601566	九牧王	20,000	557,000.00	0.12
112	600186	莲花味精	186,600	554,202.00	0.12
113	000665	武汉塑料	40,100	539,345.00	0.11
114	600012	皖通高速	125,599	532,539.76	0.11
115	002107	沃华医药	48,100	515,632.00	0.11
116	300066	三川股份	54,738	473,483.70	0.10
117	600675	中华企业	99,010	463,366.80	0.10
118	600386	北巴传媒	60,100	455,558.00	0.10
119	300174	元力股份	39,600	408,276.00	0.09
120	600872	中炬高新	78,910	404,019.20	0.09
121	300079	数码视讯	23,158	384,885.96	0.08
122	000909	数源科技	58,749	383,630.97	0.08
123	002417	三元达	53,090	377,469.90	0.08
124	002566	益盛药业	24,972	375,329.16	0.08
125	300010	立思辰	33,607	284,315.22	0.06
126	002268	卫 士 通	23,760	273,715.20	0.06
127	600798	宁波海运	90,068	271,104.68	0.06
128	000530	大冷股份	40,430	269,263.80	0.06
129	002083	孚日股份	54,500	244,705.00	0.05
130	002181	粤 传 媒	22,226	210,035.70	0.04
131	600370	三房巷	48,333	207,831.90	0.04
132	002275	桂林三金	14,323	202,670.45	0.04
133	002112	三变科技	28,101	197,269.02	0.04
134	002088	鲁阳股份	21,070	195,108.20	0.04
135	600315	上海家化	4,400	171,644.00	0.04
136	300240	飞力达	18,001	170,289.46	0.04
137	000756	新华制药	31,223	163,920.75	0.03
138	300260	新莱应材	11,550	154,077.00	0.03
139	600271	航天信息	7,300	138,043.00	0.03
140	002073	软控股份	16,037	134,390.06	0.03
141	300167	迪威视讯	12,000	130,320.00	0.03
142	000028	国药一致	4,283	127,547.74	0.03
143	300040	九洲电气	14,100	117,312.00	0.02

144	600446	金证股份	16,895	99,680.50	0.02
145	000783	长江证券	10,925	99,417.50	0.02
146	600588	用友软件	5,520	84,235.20	0.02
147	002335	科华恒盛	7,981	83,002.40	0.02
148	600276	恒瑞医药	2,764	79,354.44	0.02
149	600812	华北制药	10,006	63,638.16	0.01
150	600223	鲁商置业	10,900	57,116.00	0.01
151	002293	罗莱家纺	700	52,220.00	0.01
152	002400	省广股份	2,672	51,168.80	0.01
153	600458	时代新材	3,106	38,980.30	0.01
154	601336	新华保险	1,000	34,240.00	0.01
155	002336	人人乐	2,460	32,127.60	0.01
156	002317	众生药业	1,228	29,152.72	0.01
157	002156	通富微电	6,240	28,704.00	0.01
158	300246	宝莱特	1,800	28,404.00	0.01
159	600571	信雅达	3,530	25,945.50	0.01
160	601601	中国太保	1,000	22,180.00	0.00
161	002045	国光电器	4,706	21,459.36	0.00
162	600143	金发科技	3,405	20,327.85	0.00
163	000551	创元科技	3,807	20,215.17	0.00
164	000918	嘉凯城	5,100	19,584.00	0.00
165	000911	南宁糖业	1,710	16,775.10	0.00
166	300086	康芝药业	1,107	13,815.36	0.00
167	600360	华微电子	3,402	13,403.88	0.00
168	601101	昊华能源	704	12,052.48	0.00
169	600874	创业环保	2,200	12,012.00	0.00
170	300168	万达信息	500	11,995.00	0.00
171	002098	浔兴股份	1,507	10,684.63	0.00
172	300273	和佳股份	600	10,656.00	0.00
173	600319	亚星化学	1,746	10,441.08	0.00
174	600422	昆明制药	556	10,358.28	0.00
175	300048	合康变频	1,059	9,668.67	0.00
176	300075	数字政通	400	9,200.00	0.00
177	300081	恒信移动	501	8,917.80	0.00
178	300047	天源迪科	732	8,432.64	0.00
179	300003	乐普医疗	604	7,978.84	0.00
180	600664	哈药股份	1,100	7,249.00	0.00
181	300030	阳普医疗	697	6,656.35	0.00
182	002611	东方精工	655	6,497.60	0.00

183	002032	苏 泊 尔	512	6,420.48	0.00
184	002643	烟台万润	300	6,105.00	0.00
185	600268	国电南自	583	5,206.19	0.00
186	000859	国风塑业	1,205	5,012.80	0.00
187	000428	华天酒店	1,000	4,680.00	0.00
188	300163	先锋新材	300	4,383.00	0.00
189	002546	新联电子	246	4,305.00	0.00
190	000538	云南白药	72	4,268.16	0.00
191	600361	华联综超	717	4,072.56	0.00
192	600549	厦门钨业	91	3,995.81	0.00
193	002508	老板电器	199	3,520.31	0.00
194	002636	金安国纪	400	3,216.00	0.00
195	300036	超图软件	200	2,898.00	0.00
196	600563	法拉电子	186	2,838.36	0.00
197	002585	双星新材	222	2,783.88	0.00
198	600859	王府井	100	2,736.00	0.00
199	000338	潍柴动力	89	2,642.41	0.00
200	300157	恒泰艾普	133	2,621.43	0.00
201	600111	包钢稀土	62	2,446.52	0.00
202	300186	大华农	168	2,399.04	0.00
203	002475	立讯精密	80	2,364.00	0.00
204	300054	鼎龙股份	99	2,222.55	0.00
205	300255	常山药业	98	2,170.70	0.00
206	600489	中金黄金	100	2,152.00	0.00
207	300104	乐视网	90	2,133.00	0.00
208	000776	广发证券	70	2,088.10	0.00
209	000513	丽珠集团	75	2,084.25	0.00
210	000869	张 裕 A	30	2,017.80	0.00
211	000962	东方钨业	149	1,990.64	0.00
212	000937	冀中能源	126	1,924.02	0.00
213	600188	兖州煤业	100	1,898.00	0.00
214	300046	台基股份	155	1,784.05	0.00
215	002436	兴森科技	118	1,782.98	0.00
216	300027	华谊兄弟	109	1,725.47	0.00
217	600582	天地科技	119	1,719.55	0.00
218	002254	泰和新材	150	1,693.50	0.00
219	002006	精功科技	150	1,596.00	0.00
220	002464	金利科技	100	1,593.00	0.00
221	600251	冠农股份	85	1,592.05	0.00

222	002441	众业达	108	1,564.92	0.00
223	600216	浙江医药	60	1,509.00	0.00
224	002479	富春环保	100	1,508.00	0.00
225	600816	安信信托	90	1,495.80	0.00
226	600685	广船国际	100	1,475.00	0.00
227	601126	四方股份	100	1,463.00	0.00
228	002091	江苏国泰	139	1,444.21	0.00
229	600537	亿晶光电	101	1,434.20	0.00
230	600391	成发科技	154	1,426.04	0.00
231	600031	三一重工	100	1,392.00	0.00
232	600482	风帆股份	163	1,390.39	0.00
233	600150	中国船舶	60	1,378.20	0.00
234	300229	拓尔思	99	1,366.20	0.00
235	300039	上海凯宝	61	1,360.30	0.00
236	300102	乾照光电	110	1,328.80	0.00
237	600086	东方金钰	100	1,316.00	0.00
238	600316	洪都航空	100	1,303.00	0.00
239	002086	东方海洋	111	1,285.38	0.00
240	600380	健康元	255	1,246.95	0.00
241	300056	三维丝	100	1,240.00	0.00
242	000598	兴蓉投资	151	1,230.65	0.00
243	002149	西部材料	100	1,197.00	0.00
244	002544	杰赛科技	100	1,194.00	0.00
245	300159	新研股份	98	1,175.02	0.00
246	600893	航空动力	90	1,170.90	0.00
247	300055	万邦达	50	1,155.00	0.00
248	002121	科陆电子	129	1,142.94	0.00
249	600105	永鼎股份	190	1,134.30	0.00
250	600104	上汽集团	79	1,128.91	0.00
251	002187	广百股份	120	1,128.00	0.00
252	600189	吉林森工	164	1,105.36	0.00
253	300179	四方达	90	1,105.20	0.00
254	002484	江海股份	100	1,089.00	0.00
255	300180	华峰超纤	100	1,087.00	0.00
256	000759	中百集团	143	1,063.92	0.00
257	002396	星网锐捷	70	1,048.60	0.00
258	600546	山煤国际	50	1,046.00	0.00
259	000758	中色股份	55	1,043.35	0.00
260	300134	大富科技	90	1,039.50	0.00

261	002008	大族激光	165	1,036.20	0.00
262	600499	科达机电	100	1,028.00	0.00
263	300223	北京君正	64	1,009.28	0.00
264	002434	万里扬	123	1,001.22	0.00
265	002191	劲嘉股份	100	992.00	0.00
266	600595	中孚实业	177	987.66	0.00
267	000858	五 粮 液	30	982.80	0.00
268	002430	杭氧股份	81	979.29	0.00
269	002518	科士达	88	975.92	0.00
270	600085	同仁堂	55	959.75	0.00
271	300094	国联水产	156	932.88	0.00
272	300014	亿纬锂能	72	926.64	0.00
273	600961	株冶集团	93	915.12	0.00
274	300050	世纪鼎利	82	915.12	0.00
275	300123	太阳鸟	64	912.00	0.00
276	002444	巨星科技	104	905.84	0.00
277	002286	保龄宝	70	893.20	0.00
278	600787	中储股份	100	888.00	0.00
279	300024	机器人	40	882.80	0.00
280	300033	同花顺	50	879.00	0.00
281	600183	生益科技	160	824.00	0.00
282	600054	黄山旅游	55	821.15	0.00
283	002561	徐家汇	78	808.08	0.00
284	002255	海陆重工	60	804.00	0.00
285	300154	瑞凌股份	79	797.11	0.00
286	000059	辽通化工	100	791.00	0.00
287	000541	佛山照明	90	776.70	0.00
288	002209	达 意 隆	94	751.06	0.00
289	002513	蓝丰生化	60	744.00	0.00
290	002321	华英农业	104	729.04	0.00
291	600199	金种子酒	28	699.44	0.00
292	600267	海正药业	40	699.20	0.00
293	600475	华光股份	55	687.50	0.00
294	002055	得润电子	100	686.00	0.00
295	600550	天威保变	78	680.94	0.00
296	300247	桑乐金	56	680.40	0.00
297	300057	万顺股份	93	678.90	0.00
298	300218	安利股份	104	662.48	0.00
299	600139	西部资源	72	661.68	0.00

300	300251	光线传媒	28	653.52	0.00
301	000050	深天马 A	100	653.00	0.00
302	002038	双鹭药业	20	644.00	0.00
303	601001	大同煤业	55	602.25	0.00
304	600405	动力源	100	601.00	0.00
305	300052	中青宝	50	593.00	0.00
306	002548	金新农	50	585.00	0.00
307	600572	康恩贝	55	584.65	0.00
308	300164	通源石油	40	584.40	0.00
309	002089	新海宜	78	576.42	0.00
310	000973	佛塑科技	123	571.95	0.00
311	002228	合兴包装	110	566.50	0.00
312	000910	大亚科技	113	554.83	0.00
313	600303	曙光股份	100	550.00	0.00
314	000012	南玻 A	60	540.00	0.00
315	002158	汉钟精机	55	539.55	0.00
316	600832	东方明珠	100	537.00	0.00
317	300214	日科化学	50	536.50	0.00
318	600707	彩虹股份	90	532.80	0.00
319	300118	东方日升	86	514.28	0.00
320	600488	天药股份	90	503.10	0.00
321	000521	美菱电器	109	491.59	0.00
322	000625	长安汽车	100	488.00	0.00
323	000727	华东科技	100	484.00	0.00
324	000680	山推股份	82	479.70	0.00
325	000812	陕西金叶	110	477.40	0.00
326	002210	飞马国际	83	475.59	0.00
327	300295	三六五网	10	468.00	0.00
328	000159	国际实业	59	466.10	0.00
329	600100	同方股份	55	463.10	0.00
330	300172	中电环保	30	453.60	0.00
331	002092	中泰化学	59	451.35	0.00
332	002220	天宝股份	56	444.64	0.00
333	600481	双良节能	62	443.92	0.00
334	002248	华东数控	50	439.50	0.00
335	000560	昆百大 A	55	432.30	0.00
336	600674	川投能源	62	429.04	0.00
337	002184	海得控制	68	427.72	0.00
338	002327	富安娜	9	409.41	0.00

339	600029	南方航空	87	401.07	0.00
340	600966	博汇纸业	78	394.68	0.00
341	002223	鱼跃医疗	26	386.10	0.00
342	002167	东方锆业	20	378.40	0.00
343	600118	中国卫星	30	377.70	0.00
344	002387	黑牛食品	30	373.80	0.00
345	002194	武汉凡谷	55	373.45	0.00
346	000679	大连友谊	60	372.60	0.00
347	000829	天音控股	55	358.60	0.00
348	600875	东方电气	20	358.40	0.00
349	002388	新亚制程	40	354.80	0.00
350	600744	华银电力	101	346.43	0.00
351	600196	复星医药	33	340.23	0.00
352	002261	拓维信息	30	336.60	0.00
353	600219	南山铝业	50	335.00	0.00
354	002587	奥拓电子	30	318.60	0.00
355	002334	英威腾	20	313.60	0.00
356	000885	同力水泥	30	310.50	0.00
357	300232	洲明科技	30	310.20	0.00
358	600243	青海华鼎	55	309.10	0.00
359	600213	亚星客车	44	301.84	0.00
360	002101	广东鸿图	30	292.20	0.00
361	000798	中水渔业	43	291.97	0.00
362	300244	迪安诊断	13	288.99	0.00
363	600211	西藏药业	21	287.70	0.00
364	600986	科达股份	55	283.80	0.00
365	000930	中粮生化	55	267.30	0.00
366	600168	武汉控股	37	257.52	0.00
367	002620	瑞和股份	10	256.90	0.00
368	601866	中海集运	100	253.00	0.00
369	601989	中国重工	48	249.12	0.00
370	600765	中航重机	31	239.01	0.00
371	601328	交通银行	50	227.00	0.00
372	600428	中远航运	55	223.85	0.00
373	600388	龙净环保	9	222.66	0.00
374	002383	合众思壮	12	204.60	0.00
375	600408	安泰集团	55	199.65	0.00
376	000617	石油济柴	20	197.40	0.00
377	002206	海利得	28	187.04	0.00

378	300152	燃控科技	20	184.40	0.00
379	002172	澳洋科技	43	183.61	0.00
380	002106	莱宝高科	9	180.63	0.00
381	002296	辉煌科技	9	180.45	0.00
382	600976	武汉健民	9	176.85	0.00
383	300074	华平股份	9	173.70	0.00
384	002414	高德红外	10	166.40	0.00
385	600690	青岛海尔	14	164.08	0.00
386	000998	隆平高科	9	160.47	0.00
387	002303	美盈森	9	159.39	0.00
388	002385	大北农	8	155.20	0.00
389	300177	中海达	14	152.18	0.00
390	002550	千红制药	7	152.11	0.00
391	601808	中海油服	9	148.59	0.00
392	600298	安琪酵母	6	147.66	0.00
393	600978	宜华木业	30	141.90	0.00
394	000823	超声电子	10	139.50	0.00
395	600688	S 上石化	24	139.20	0.00
396	300156	天立环保	10	137.80	0.00
397	300090	盛运股份	10	135.90	0.00
398	600058	五矿发展	6	133.98	0.00
399	600694	大商股份	4	133.80	0.00
400	300222	科大智能	9	128.25	0.00
401	600616	金枫酒业	9	128.25	0.00
402	002341	新纶科技	14	127.82	0.00
403	002207	准油股份	8	126.64	0.00
404	300158	振东制药	5	125.35	0.00
405	300206	理邦仪器	6	122.94	0.00
406	300130	新国都	8	120.56	0.00
407	300088	长信科技	7	116.76	0.00
408	002129	中环股份	9	115.65	0.00
409	002373	联信永益	9	115.11	0.00
410	000520	长航凤凰	44	113.96	0.00
411	002330	得利斯	10	113.00	0.00
412	002049	晶源电子	5	110.75	0.00
413	002543	万和电气	6	110.58	0.00
414	300002	神州泰岳	6	108.18	0.00
415	002551	尚荣医疗	7	107.94	0.00
416	600432	吉恩镍业	8	106.24	0.00

417	002577	雷柏科技	8	105.20	0.00
418	600770	综艺股份	9	103.32	0.00
419	002279	久其软件	10	102.20	0.00
420	002080	中材科技	10	101.70	0.00
421	300077	国民技术	5	101.55	0.00
422	002481	双塔食品	6	99.30	0.00
423	002320	海峡股份	8	97.44	0.00
424	000989	九 芝 堂	6	97.20	0.00
425	601607	上海医药	9	96.03	0.00
426	000400	许继电气	6	94.02	0.00
427	600888	新疆众和	9	92.97	0.00
428	601166	兴业银行	7	90.86	0.00
429	601088	中国神华	4	89.92	0.00
430	300082	奥克股份	7	89.04	0.00
431	600526	菲达环保	7	86.66	0.00
432	000686	东北证券	5	85.70	0.00
433	002489	浙江永强	8	82.88	0.00
434	000988	华工科技	6	82.62	0.00
435	002404	嘉欣丝绸	12	82.20	0.00
436	000968	煤 气 化	5	76.25	0.00
437	002445	中南重工	7	73.01	0.00
438	300213	佳讯飞鸿	7	70.49	0.00
439	601898	中煤能源	9	69.66	0.00
440	000060	中金岭南	8	68.96	0.00
441	601009	南京银行	8	68.16	0.00
442	600233	大杨创世	6	67.38	0.00
443	600060	海信电器	4	67.24	0.00
444	000153	丰原药业	10	67.20	0.00
445	000929	兰州黄河	9	66.33	0.00
446	600166	福田汽车	9	64.35	0.00
447	600030	中信证券	5	63.15	0.00
448	600879	航天电子	8	63.04	0.00
449	000780	平庄能源	6	62.88	0.00
450	601567	三星电气	7	61.32	0.00
451	300070	碧水源	2	59.80	0.00
452	600522	中天科技	7	59.71	0.00
453	600677	航天通信	7	58.80	0.00
454	600573	惠泉啤酒	8	58.24	0.00
455	000090	深 天 健	8	57.84	0.00

456	000785	武汉中商	9	57.78	0.00
457	600717	天津港	9	56.88	0.00
458	002100	天康生物	6	56.70	0.00
459	600363	联创光电	8	56.32	0.00
460	600456	宝钛股份	3	56.31	0.00
461	000063	中兴通讯	4	55.84	0.00
462	600241	时代万恒	10	55.70	0.00
463	300105	龙源技术	2	54.58	0.00
464	002015	霞客环保	7	54.39	0.00
465	600416	湘电股份	8	53.12	0.00
466	000410	沈阳机床	7	52.99	0.00
467	601688	华泰证券	5	52.50	0.00
468	000503	海虹控股	9	52.29	0.00
469	002061	江山化工	6	51.90	0.00
470	600761	安徽合力	6	51.72	0.00
471	300176	鸿特精密	4	51.52	0.00
472	002480	新筑股份	5	51.35	0.00
473	600649	城投控股	7	50.54	0.00
474	600794	保税科技	4	50.40	0.00
475	600038	哈飞股份	3	50.07	0.00
476	600881	亚泰集团	9	49.50	0.00
477	600226	升华拜克	7	49.28	0.00
478	600410	华胜天成	6	49.20	0.00
479	002059	云南旅游	5	48.75	0.00
480	600999	招商证券	4	46.44	0.00
481	300221	银禧科技	6	45.96	0.00
482	300080	新大新材	7	45.64	0.00
483	600048	保利地产	4	45.36	0.00
484	000019	深深宝 A	5	43.25	0.00
485	000881	大连国际	5	42.40	0.00
486	600312	平高电气	6	42.00	0.00
487	600810	神马股份	5	41.65	0.00
488	300084	海默科技	3	41.55	0.00
489	600682	南京新百	5	40.75	0.00
490	600000	浦发银行	5	40.65	0.00
491	300001	特锐德	3	40.50	0.00
492	600037	歌华有线	5	37.65	0.00
493	600531	豫光金铅	2	37.16	0.00
494	601111	中国国航	6	36.90	0.00

495	601998	中信银行	9	36.00	0.00
496	601007	金陵饭店	5	35.80	0.00
497	300059	东方财富	3	35.34	0.00
498	000612	焦作万方	3	34.83	0.00
499	000597	东北制药	5	34.50	0.00
500	002461	珠江啤酒	3	33.90	0.00
501	600713	南京医药	7	33.18	0.00
502	600097	开创国际	3	32.64	0.00
503	601616	广电电气	7	31.71	0.00
504	002549	凯美特气	2	31.36	0.00
505	600716	凤凰股份	6	29.94	0.00
506	002458	益生股份	2	29.06	0.00
507	002476	宝莫股份	4	29.00	0.00
508	600109	国金证券	2	28.78	0.00
509	300029	天龙光电	3	27.78	0.00
510	600309	烟台万华	2	26.70	0.00
511	002339	积成电子	2	26.08	0.00
512	600869	三普药业	1	23.45	0.00
513	002240	威华股份	5	22.05	0.00
514	600997	开滦股份	2	20.94	0.00
515	002397	梦洁家纺	1	20.90	0.00
516	000926	福星股份	2	18.68	0.00
517	600308	华泰股份	5	17.85	0.00
518	300150	世纪瑞尔	1	16.98	0.00
519	000978	桂林旅游	2	15.30	0.00
520	600396	金山股份	2	14.76	0.00
521	000788	西南合成	2	14.60	0.00
522	600161	天坛生物	1	14.27	0.00
523	600169	太原重工	4	14.04	0.00
524	601766	中国南车	3	13.68	0.00
525	600119	长江投资	2	13.04	0.00
526	300133	华策影视	1	12.69	0.00
527	600714	金瑞矿业	1	12.08	0.00
528	000419	通程控股	2	12.02	0.00
529	600307	酒钢宏兴	3	10.41	0.00
530	000797	中国武夷	2	9.56	0.00
531	600015	华夏银行	1	9.47	0.00
532	600635	大众公用	2	9.32	0.00
533	600122	宏图高科	2	9.08	0.00

534	000600	建投能源	2	8.50	0.00
535	600665	天地源	2	7.96	0.00
536	000663	永安林业	1	7.78	0.00
537	600598	北大荒	1	7.45	0.00
538	600153	建发股份	1	7.16	0.00
539	600438	通威股份	1	6.28	0.00
540	600622	嘉宝集团	1	6.15	0.00
541	000875	吉电股份	2	5.92	0.00
542	000564	西安民生	1	5.79	0.00
543	600586	金晶科技	1	4.45	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	56,993,190.93	8.55
2	601318	中国平安	51,671,455.53	7.75
3	000666	经纬纺机	29,138,684.21	4.37
4	600123	兰花科创	25,529,597.26	3.83
5	600348	阳泉煤业	22,714,730.73	3.41
6	000651	格力电器	21,394,610.09	3.21
7	000527	美的电器	20,367,708.07	3.05
8	000726	鲁 泰 A	20,002,318.87	3.00
9	600887	伊利股份	18,704,082.26	2.81
10	600354	敦煌种业	18,397,317.97	2.76
11	601299	中国北车	18,085,017.47	2.71
12	600325	华发股份	16,808,471.13	2.52
13	002123	荣信股份	15,973,764.50	2.40
14	600036	招商银行	15,888,229.54	2.38
15	000895	双汇发展	15,256,318.85	2.29
16	600809	山西汾酒	13,761,000.39	2.06
17	000900	现代投资	13,706,208.12	2.06
18	600703	三安光电	13,559,285.96	2.03
19	600177	雅戈尔	13,055,275.40	1.96
20	600015	华夏银行	12,449,720.62	1.87

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	60,876,816.63	9.13
2	601601	中国太保	58,520,514.06	8.78
3	600348	阳泉煤业	29,914,534.84	4.49
4	601299	中国北车	23,749,158.36	3.56
5	600139	西部资源	23,017,422.43	3.45
6	002285	世联地产	22,847,375.79	3.43
7	000651	格力电器	21,780,865.25	3.27
8	600109	国金证券	21,352,603.94	3.20
9	000666	经纬纺机	21,014,223.53	3.15
10	600325	华发股份	19,158,227.45	2.87
11	600809	山西汾酒	17,665,489.54	2.65
12	000527	美的电器	16,974,027.62	2.55
13	000998	隆平高科	16,855,452.40	2.53
14	002028	思源电气	16,739,840.11	2.51
15	000726	鲁泰A	16,514,965.37	2.48
16	600036	招商银行	16,365,538.87	2.45
17	000538	云南白药	16,025,394.00	2.40
18	000050	深天马A	15,328,996.25	2.30
19	000623	吉林敖东	15,045,737.80	2.26
20	600123	兰花科创	14,829,056.82	2.22
21	300178	腾邦国际	14,682,421.47	2.20
22	600119	长江投资	14,174,881.65	2.13
23	600703	三安光电	13,817,832.32	2.07

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,636,911,512.66
卖出股票收入（成交）总额	1,850,218,301.45

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1, 523, 249. 54
2	应收证券清算款	15, 396, 941. 80
3	应收股利	45. 04
4	应收利息	8, 088. 56
5	应收申购款	791. 85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16, 929, 116. 79

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
8,752	66,898.43	97,204,464.33	16.60%	488,290,628.83	83.40%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年8月9日）基金份额总额	1,249,071,475.18
本报告期期初基金份额总额	832,575,900.84
本报告期基金总申购份额	2,357,470.21
减：本报告期基金总赎回份额	249,438,277.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	585,495,093.16

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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。

10.2 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金的投资组合策略没有发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	417,668,969.30	11.99%	359,595.96	12.33%	-
首创证券	1	466,720,080.66	13.39%	379,213.71	13.00%	-
浙商证券	1	490,062,795.54	14.06%	416,552.73	14.28%	-
齐鲁证券	1	1,124,225,032.05	32.26%	922,915.45	31.65%	-
江海证券	1	985,698,806.05	28.29%	837,841.83	28.73%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本期新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：江海证券有限责任公司（1 个交易单元）。

2、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单元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, 并能为本基金提供全面的信息服。
- (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》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用证券公司交易单元没有进行其他证券投资。

10.8 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	诺安多策略股票型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 1 月 20 日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券基金网上费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 2 月 13 日
3	诺安基金管理有限公司关于增加烟台银行为诺安多策略股票代销机构及开通定投、转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 2 月 13 日
4	诺安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 2 月 27 日
5	诺安基金管理有限公司关于开通浦发银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 3 月 12 日
6	诺安多策略股票型证券投资基金 2011 年年度报告	基金管理人网站	2012 年 3 月 26 日
7	诺安多策略股票型证券投资基金 2011 年年度报告摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 3 月 26 日
8	诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）——2012 年第 1 期	基金管理人网站	2012 年 3 月 27 日
9	诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要——2012 年第 1 期	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 3 月 27 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中百集团（000759）估值调整的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 3 月 29 日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金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》	2012 年 4 月 5 日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券自助式交易系统申购费率优惠活动的	《中国证券报》、 《上海证券报》、	2012 年 4 月 9 日

	公告	《证券时报》	
13	诺安多策略股票型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 4 月 23 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构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》	2012 年 4 月 28 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 4 月 28 日
16	诺安基金管理有限公司关于增加大通证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 5 月 10 日
17	诺安基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 5 月 23 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在渤海证券开通基金定投业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 5 月 29 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券网上定投业务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》	2012 年 5 月 31 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金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》	2012 年 6 月 28 日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金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》	2012 年 6 月 28 日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银行开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 6 月 28 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购费率优惠活动的补充公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 7 月 4 日
24	诺安多策略股票型证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2012 年 7 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安多策略股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安多策略股票型证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安多策略股票型证券投资基金 2012 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安多策略股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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 8 月 29 日