诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之诺安稳健与诺安进取基金份额上市交易公告书

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2012 年 4 月27 日
公告日期:2012 年 4 月24 日

一、重要声明与提示

“诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之诺安稳健与诺安进取基金份额上市交易公告书”以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“基金法”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号 上市交易公告书的内容与格式》(以下简称“《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》)的规定编制,诺安中证创业成长指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人诺安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告书基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读2012年2月22日刊登在《证券时报》和本公司网站(www.lionfund.com.cn)上的《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

二、基金概览

1、基金名称:诺安中证创业成长指数分级证券投资基金
2、基金简称:诺安中证创业成长指数分级 (基金场内简称:诺安中创)
3、基金代码:163209
4、基金类型:股票型
5、基金运作方式:契约型开放式
6、本基金的基金份额包括诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额(即“诺安创业成长份额”)、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“诺安稳健份额”)与诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“诺安进取份额”)。其中,诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额比例保持4:6的比例不变。
7、本基金的存续期为不定期。
8、本基金通过场外、场内两种方式公开发售诺安创业成长份额。投资人场外认购本基金所获得的全部份额将确认为诺安创业成长份额。投资人通过场内认购本基金所获得的全部份额将按4:6的比例分拆确认为诺安稳健份额与诺安进取份额。
9、诺安创业成长份额的申购与赎回:本基金合同生效后,诺安创业成长份额接受场外与场内申购和赎回;诺安稳健份额、诺安进取份额只上市交易,不接受申购和赎回。
10、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的诺安创业成长份额与诺安稳健份额、诺安进取份额之间的配对转换,包括以下两种方式的配对转换:
(1)分拆。指基金份额持有人将其持有的每十份诺安创业成长份额与诺安稳健份额与诺安进取份额申请转换成四份诺安稳健份额与六份诺安进取份额的行为。
(2)合并。指基金份额持有人将其持有的每四份诺安稳健份额与六份诺安进取份额申请转换成十份诺安创业成长份额的场内份额的行为。
11、基金份额折算:本基金合同生效后,基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。在基金份额折算前与折算后,诺安稳健份额和诺安进取份额的份额配比保持4:6的比例。
12、诺安稳健份额与诺安进取份额的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过,诺安稳健份额与诺安进取份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额比特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3 以上(含2/3)通过方为有效。
13、基金份额总额:截至2012年4月20日,本基金的基金份额总额为1,209,176,634.92份。其中,诺安创业成长份额为1,118,193,253.92份,诺安稳健份额为36,393,352.00份,诺安进取份额为54,590,029.00份。
14、基金份额净值:截至2012年4月20日,诺安创业成长份额的基金份额净值为1.001元,诺安稳健份额的基金份额净值为1.004元,诺安进取份额的基金份额净值为0.999元。
15、本次上市交易的两类基金份额:
(1)诺安稳健份额。场内简称“诺安稳健”,交易代码“150073”
(2)诺安进取份额。场内简称“诺安进取”,交易代码“150075”
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2012年4月27日
18、基金管理人:诺安基金管理有限公司
19、基金托管人:中国银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会,2011年10月25日证监许可【2011】1705号。
2、基金运作方式:契约型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:2012年2月27日至2012年3月23日
5、发售价格:人民币1.00元
6、发售期限:2012年2月27日至2012年3月23日
7、发售方式:投资者可通过场外认购和场内认购两种方式进行认购。
8、发售机构:
(1)场内销售机构
场内销售机构是指具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,其具体名单可在深圳证券交易所网站查询。
本基金募集期结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位证券公司也可代理场内的基金份额发售。本基金管理人将不就此事项进行公告。
尚未取得基金代销资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资人通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。
(2)场外销售机构
1)直销机构
诺安基金管理有限公司。
2)代销机构(排名不分先后)
中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、爱建证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中银证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、信达证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中航证券有限公司、新时代证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中银国际证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司等。
9、验资机构名称:利安达会计师事务所有限责任公司
10、募集资金总额及入账情况:本次募集的净认购金额为1,208,257,982.10元人民币,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计918,652.82元人民币。
上述资金中,3月21日到3月28日的场内、场外利息折份额的金额及利息折份额后产生的余额336,464.57元,以及募集资金有效认购金额在基金募集结束日至基金成立日产生的利息37,600.08元,两项合计344,064.65元,将于募集结束后的下一银行季度结息日(2012年6月20日)后划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户,其余资金已于2012年3月29日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况:2012年3月29日聘请利安达会计师事务所有限责任公司验资,随后向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,2012年3月29日中国证监会予以书面确认,本基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2012年3月29日
13、基金合同生效日的基金份额总额:1,209,176,634.92份
(二)诺安稳健份额与诺安进取基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上【2012】98号
2、上市交易日期:2012年4月27日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、本次上市交易的基金份额:
(1)诺安稳健份额。场内简称“诺安稳健”,交易代码“150073”
(2)诺安进取份额。场内简称“诺安进取”,交易代码“150075”
5、本次上市交易的基金份额总额:诺安稳健份额为36,393,352.00份,诺安进取份额为54,590,029.00份。
6、基金资产净值的披露:在诺安稳健份额和诺安进取份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。
7、本上市交易份额的流通规定:如有本上市交易的份额托管在场外,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)诺安稳健份额
截至2012年4月20日,持有人户数为966户,平均每户持有的基金份额为37,674.28份。
2、持有人结构
截至2012年4月20日,机构投资者持有的基金份额为22,298,942份,占基金总份额的61.2720%;个人投资者持有的基金份额为14,094,410份,占基金总份额的38.7280%。
3、前十名基金份额持有人情况
截至2012年4月20日,前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	中国银河证券股份有限公司	12,000,500	32.97
2	光大水明人寿保险有限公司	8,000,328	21.98
3	东吴证券-工行-东吴财富2号集合资产管理计划	2,000,083	5.50
4	陈丽娜	400,039	1.10
5	陈蔚	400,033	1.10
6	刘涛	400,016	1.10
7	李正元	260,011	0.71
8	翁希平	200,083	0.55
9	李俊甫	200,025	0.55
10	岳威	200,019	0.55
11	苏平	200,019	0.55

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。
(二)诺安进取份额
1、持有人户数
截至2012年4月20日,持有人户数为966户,平均每户持有的基金份额为56,511.42份。
2、持有人结构
截至2012年4月20日,机构投资者持有的基金份额为33,448,411份,占基金总份额的61.2720%;个人投资者持有的基金份额为21,141,618份,占基金总份额的38.7280%。
3、前十名基金份额持有人情况
截至2012年4月20日,前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	中国银河证券股份有限公司	18,000,750	32.97
2	光大水明人寿保险有限公司	12,000,492	21.98
3	东吴证券-工行-东吴财富2号集合资产管理计划	3,000,125	5.50
4	陈丽娜	600,058	1.10
5	陈蔚	600,050	1.10
6	刘涛	600,025	1.10
7	李正元	390,016	0.71
8	翁希平	300,125	0.55
9	李俊甫	300,037	0.55
10	岳威	300,029	0.55
11	苏平	300,029	0.55

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:诺安基金管理有限公司
2、法定代表人:秦维舟
3、总经理:奥成文
4、注册资本:1.5亿元人民币
5、住所及办公地址:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
6、设立批准文号:中国证监会证监基金字【2003】132号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:440301103063235
8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
9、股权结构:中国对外经济贸易信托投资有限公司40%;深圳市捷隆投资有限公司40%;大恒新纪元科技股份有限公司20%。
10、内部组织结构及职能:

委员会名称	职责
投资决策委员会	指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。
风险控制办公会会	研究制定风险管理政策和制度,提出重大风险的解决方案,指导和监督各职能部门开展风险管理工作。
部门名称	职能定位
投资部	负责公募基金产品的投资管理。
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究。
机构理财部	负责专户产品的权益类资产的投资、销售管理。
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作。
产品研发中心	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作。
发展战略部	公司整体战略规划、基金行业研究。
市场部	开展营销宣传和活动策划;负责营销材料制作;开展媒体宣传和公关维护工作;为销售前台提供营销支持。 构建公司渠道营销服务体系;管理和支持区域营销中心的业务开展。 搭建分级客户服务体系;运用多形式服务手段,建立客户沟通平台;编辑服务咨询;为公司营销提供服务支持。
北京分公司	负责所在区域公募基金、一对多专户等产品的销售工作及区域内代销渠道机构的维护和服务。
上海分公司	
广州分公司	
西部营销中心	
监察稽核部	负责公司及基金的合规与运作风险的全面管理。
金融工程部	负责投资策略的量化测算、数量化投资、投资风险监控与业绩归因分析。
中央交易室	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控。
运营保障部	负责信息技术平台建设、注册登记、产品销售的后台清算、保障业务开展。
财务综合部	负责办公管理、财务管理、后勤保障;负责人力资源管理与服务,使公司获取并保持人力资源竞争优势;负责基金估值、投资交易清算及投资运作的定期信息披露。

11、人员情况:
截止到2012年3月底,本公司共有员工188人,其中博士6人,硕士86人,本科77人,其他19人。
12、信息披露负责人:陈勇
咨询电话:400-888-8998或0755-83026688
13、基金管理业务情况简介:
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、上证新兴产业分级型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业分级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。
14、本基金基金经理简介
王坚先生,硕士,CFA,具有基金从业资格。曾任长城证券研究所研究员、太平资产管理公司投资经理。2008年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2009年10月起任诺安中证100指数证券投资基金基金经理,2012年3月起任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国银行股份有限公司 (简称:中国银行)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
变更注册登记日期:2004年8月26日
注册资本:人民币或任策结构拾壹亿肆仟策佰贰拾壹万叁任壹佰玖拾伍元整
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
住所部门信息披露联系人:唐洲敏
电话:010-66594855
传真:010-66594942
发展概况:
1912 年2 月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从1912 年至1949 年,中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行长期作为国家外汇专业银行,成为我国对外开放的重要窗口和对外贸易的主要渠道。1994 年,中国银行改为国有独资商业银行。2003 年,中国银行启动股份制改造。2004 年8 月,中国银行股份有限公司注册成立。2006 年6 月、7 月,先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市,成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。
中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行,在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务,主要经营商业银行业务,包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务,并通过全资子公司中国银际开展投资银行业务,通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务,通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务,通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务,通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。
在近百年的发展历程中,中国银行始终承承追求卓越的精神,稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风,得到了业界和客户的广泛认可和赞誉,树立了卓越的品牌形象。2010年度,中国银行被Global Finance(《环球金融》)评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇类银行,被Euromoney(《欧洲货币》)评为2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”,被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖,被The Asset(《财资》)评为中国最佳贸易融资银行,被Finance Asia(《金融亚洲》)评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行,被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇,中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展,向着国际一流银行的战略目标不断迈进。
2、基金托管部门及主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元,居同业前列。
3、证券投资基金托管情况
截至2011年12月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金麒麟蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或兴混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富天盈指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息优健产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金融四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等137只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。
(三)基金验资机构
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:姜波
电话:010-85866870
传真:010-85866877
联系人:姜波
经办注册会计师:韦雪、李英英

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表 (财务资料未经审计)
本基金2012年4月20日资产负债表如下:

资产	本期末2012年4月20日
资 产:	
银行存款	1,209,292,624.52
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,792,450.25
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	344,064.65
资产总计	1,211,429,139.42
负债和所有者权益	本期末2012年4月20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	-
应付管理人报酬	661,101.78
应付托管费	132,220.35
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	41,431.92
负债合计	834,754.05
所有者权益:	
实收基金	1,209,176,634.92
未分配利润	1,417,750.45
所有者权益合计	1,210,594,385.37
负债和所有者权益总计	1,211,429,139.42

注:报告截止日2012年4月20日,基金份额总额为1,209,176,634.92份。其中,诺安创业成长份额为1,118,193,253.92份,诺安稳健份额为36,393,352.00份,诺安进取份额为54,590,029.00份;诺安创业成长份额的基金份额净值为1.001元,诺安稳健份额的基金份额净值为1.004元,诺安进取份额的基金份额净值为0.999元。

八、基金投资组合

截至2012年4月20日,本基金的投资组合 (财务数据未经审计)如下:
(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
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	1,209,292,624.52	99.82
6	其他各项资产	2,136,514.90	0.18
7	合计	1,211,429,139.42	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
(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
本基金本报告期末未持有股票。
(四)报告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。
(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
本基金本报告期末未持有债券。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前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
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,792,450.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	344,064.65
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,136,514.90

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有流通受限股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能基金份额产生法定终止影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以电话、提示函或者基金合同约定的其他方式通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。
(一)中国证监会核准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件;
(二)《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》
(四)《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件和营业执照
(七)基金托管人业务资格批件和营业执照
风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

诺安基金管理有限公司
二〇一二年四月二十四日

附件:诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同摘要

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
一、基金合同当事人的权利与义务
(一)基金管理人
1、基金管理人基本情况
名称:诺安基金管理有限公司
住所:广东省深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
法定代表人:秦维舟
成立日期:2003年12月9日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字【2003】132 号
经营范围:基金管理业务;发起设立基金;及中国证监会批准的其他业务
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5 亿元人民币
存续期间:持续经营
2、基金管理人的权利
(1)依法募集基金,办理基金备案手续;
(2)依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产;
(3)根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
(4)根据法律法规和基金合同的规定选定本基金的相关费率结构和费费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法律规定的其他费用;
(5)根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;
(6)在本合同的有效期内,在不违反平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
(7)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;
(8)自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;
(9)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;
(10)在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券;
(11)依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益分配方案;
(12)按照法律法规、代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利;
(13)在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;
(14)依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;
(15)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;
(16)法律法规、基金合同规定的其他权利。
3、基金管理人的义务
(1)依法申请并募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账,进行证券投资;
(6)按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(7)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(8)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
(9)依法接受基金托管人的监督。
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销份额的方法符合基金合同等法律文件的规定;
(12)计算并公告基金财产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
(13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(14)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;
(15)按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(16)保存基金财产管理业务活动的记录、账簿、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;
(17)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(18)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(19)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(20)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。
(二)基金托管人
1、基金托管人基本情况
名称:中国银行股份有限公司
住所:北京市复兴门内大街1号
法定代表人:肖 钢
成立日期:1983年10月31日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【998】24号
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币或任策结拾壹亿肆仟策佰贰拾壹万叁任壹佰玖拾伍元整
存续期间:持续经营
经营范围:吸收人民币存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;从事同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱服务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑