

诺安股票证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2013年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司报告期2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺安股票

交易代码:320003

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2005年12月19日

报告期末基金份额总额:14,777,578,763.67份

以中国企业的比较优势和全球化发展为视角，发掘最具投资价值的企业，获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下，本基金的最终目的是取得超额利润，也就是在承担和控制市场风险的情况下，取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。

本基金实施积极的资产配置策略。在资产类别配置层面，本基金关注市场资源在各个资产类别间的流动，动态调整股票资产的配置比例；在基础上，本基金注重中国与比较优势的国际发展基础的行业、行业的研究和投资；在个股选择层面，本基金将对上市公司的基本面进行深入的分析，从而选择具有投资价值的股票，将利用多种投资策略，力求获取高于市场平均水平的稳定投资回报。

4.4 报告期末基金份额净值为0.7614元，本报告期基金份额净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益为6.67%。

§ 3 报告期末基金份额净值

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -641,903,961.53

2.本期利润 111,489,887.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0075

4.期末基金资产净值 11,252,201,429.38

5.期末基金份额净值 0.7614

注:1)上述基金业绩比较指标不包括个人申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示的金额。2)本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入，不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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变动的比较

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.2 基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.3 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.4 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.5 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.6 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.7 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.8 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.9 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.10 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.11 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.12 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.13 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.14 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.15 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.16 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.17 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.18 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.19 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.20 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.21 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.22 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)

过去三个月 0.04% 0.90% 6.77% 1.04% -5.73% -0.14%

注:1)本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债全价指数。

3.2.23 本基金合同生效以来基金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

阶段 净值增长率(净值增长率为正时) /业绩比较基准收益率(业绩比较基准收益为正时) ①(③) ②(④)