

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  
送日期:2013年3月29日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对本报告所载资料不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的准确性、完整性承担责任。本报告经三分之二以上独立董事签字同意，由基金管理人和基金托管人于2013年3月22日复核了本报表中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本报告期基金经理未对本基金进行过定期报告。

本年度报告摘要披露年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

\$ 2 基金简介

**1.1 基金基本情况**

基金简称:诺安多策略股票型证券投资基金

基金主代码:320016

契约型开放式

2011年8月6日

诺安基金管理有限公司

中国建设银行股份有限公司

485,946,024.64份

不定期

**1.2 基金产品说明**

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，力图实现基金资产的长期稳定增值。

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、权证投资策略及股指期货投资策略五部分组成。

**1.3 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。

我们将从宏观经济政策面、行业面、资金面和基本面等全面研究，发掘择时因子，根据择时因子信号和市场情况灵活调整大类资产。

**2.股票投资策略**

本基金以“定量投资”为主，辅以“定性投资”，力争实现稳定的回报率。

**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。

**4.股指期货投资策略**

本基金在股指投资中将根据风险管理的原则，通过期现价差模型和我国证券市场的交易制度估计期现价差，稳健投资。

**5.股权投资策略**

本基金在指定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，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。

**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，风险与收益高于混合型基金，风险收益特征与货币市场基金、货币型基金、债券型基金、货币市场基金、高风险收益的产品。

**2.3 基金管理人和基金托管人**

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

姓名:陈勇

田青

信息披露负责人:联系电话:0755-83026688

电子邮箱:info@lionfund.com.cn

客户服务电话:400-888-8998

传真:0755-83026677

010-66275853

**2.4 信息披露方式**

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址:www.lionfund.com.cn

基金年度报告备置地点:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层

诺安基金管理有限公司

**3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**

金额单位:人民币元

**3.1.1 期间数据和指标**

2012年 | 2011年8月9日至2012年12月31日 | 基金合同生效日(2011年12月31日)-2011年12月31日

本期已实现收益: -129,489,765.77

-82,880,525.97

本期利润: -11,690,792.44

-195,78,381.11

加权平均基金份额本期利润: -0.0191

-0.1889

本期基金份额净值增长率: -4.99%

-19.90%

**3.1.2 期末数据和指标**

2012年末 | 2011年末

本期可供分配基金份额利润: -0.2928

-0.1991

期末基金份额净值: 369,977,880.60

666,778,056.82

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人申购或赎回基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所示的净值。(2)本期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非相关费用后的余额，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入减去必要的费用后的余额，即为本期利润。

3.2 基金合同生效以来基金份额累计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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.4 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.5 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.6 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.7 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.8 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%

过去六个月 | -5.47% | 1.14% | 2.44% | 0.93% | -7.91% | 0.21%

过去一年 | -4.99% | 1.31% | 6.88% | 0.96% | -11.87% | 0.35%

自基金合同生效起至今 | -23.90% | 1.32% | -5.65% | 0.98% | -18.25% | 0.34%

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%。

3.2.9 基金合同生效以来基金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 | 份额净值增长率为① | 份额净值增长率标准差(②) | 业绩比较基准收益率标准差(③) | ①-③ | ②-④ |

过去三个月 | 0.26% | 1.04% | 7.72% | 0.96% | -7.46% | 0.08%