诺安货币市场基金

【2013】半年度报告摘要

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
送出日期:2013年8月27日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安货币	
基金主代码	320002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年12月6日	
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	
报告期末基金份额总额	2,547,039,362.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安货币A	诺安货币B
下属分级基金的交易代码:	320002	320019
报告期末下属分基基金的份额总额	817,086,015.26份	1,729,953,347.38份

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况,判断短期利率的走势,进行自上而下的整体资产策略配置和资产组合配置;同时,根据定量和定性方法,在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金流动性高,风险低并且收益稳定。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

基金级别	诺安货币A	诺安货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	11,150,643.78	52,109,170.13
本期利润	11,150,643.78	52,109,170.13
本期净值收益率	1.7033%	1.8238%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末基金资产净值	817,086,015.26	1,729,953,347.38
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:① 本基金的利润分配方式是"每日分配,按月支付"。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③ 自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额;其中B级基金份额的指标计算自分级实施日(2012年2月21日)算起。

3.2 基金表现

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

诺安货币A

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	0.2477%	0.0015%	0.0292%	0.0000%	0.2185%	0.0015%
过去三个月	0.7772%	0.0031%	0.0885%	0.0000%	0.6887%	0.0031%
过去六个月	1.7033%	0.0044%	0.1760%	0.0000%	1.5273%	0.0044%
过去一年	3.4074%	0.0038%	0.3556%	0.0000%	3.0518%	0.0038%
过去三年	10.6917%	0.0044%	1.2566%	0.0002%	9.4351%	0.0042%
自基金合同生效起至今	25.5187%	0.0052%	4.2999%	0.0004%	21.2188%	0.0048%

诺安货币B

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	0.2674%	0.0015%	0.0292%	0.0000%	0.2382%	0.0015%
过去三个月	0.8371%	0.0031%	0.0885%	0.0000%	0.7486%	0.0031%
过去六个月	1.8238%	0.0044%	0.1760%	0.0000%	1.6478%	0.0044%
过去一年	3.6550%	0.0038%	0.3556%	0.0000%	3.2994%	0.0038%
自基金合同生效起至今	5.2325%	0.0039%	0.5311%	0.0002%	4.7014%	0.0037%

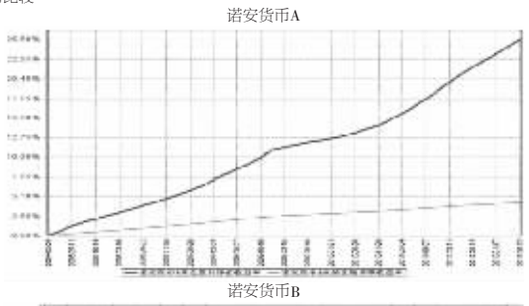
注:①本基金的利润分配方式是"每日分配,按月支付"。

② 本基金的业绩比较基准为:当期银行个人活期储蓄利率(税后)。

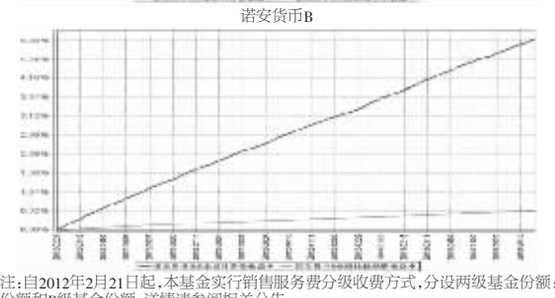
③自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额;其中B级基金份额的指标计算自分级实施日(2012年2月21日)算起。

3.2.2 自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

诺安货币A



诺安货币B



注:自2012年2月21日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

§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2013年8月27日,本基金管理人共管理二十八只开放式基金: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、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安全球收益不动产证券投资基金、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、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金。

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		
张乐赛	固定收益部总监、诺安货币市场基金基金经理、诺安保本混合型证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理	2006年8月19日	-	8	硕士,具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心;2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任固定收益部总监。曾于2009年8月至2012年1月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006年8月起担任诺安货币市场基金的基金经理,2011年5月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年5月起担任诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

报告期间,诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规,遵守了《诺安货币市场基金基金合同》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

本报告期内,公司对不同投资组合不同时间区间(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行了分析,未发现投资组合之间存在违反公平交易原则的异常情况。此外,不存在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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

2013年上半年,国内宏观经济的复苏程度不及预期,仍处于弱势徘徊阶段。除去春节因素和猪瘟事件带来的短期波动,上半年的通胀水平整体在低位运行,未对宏观政策的制定带来约束。货币政策运行基调未变,整体保持中性。央行在公开市场操作中重启了正回购和三月期央票,上半年实现小幅净回笼。在基本面和政策面相对平稳的上半年,债券市场主要受到监管政策、法规以及资金面波动的影响,走势先扬后抑。市场流动性从松到紧,资金价格中枢整体抬升。此外,银监会八号文的发布、债市打黑风暴和银行间市场的钱荒都对债市收益率带来了不小的冲击。

一季度的资金面整体保持平稳宽松,7天利率维持在2.5%-3.5%的区间,节日因素也未带来明显波动。受到外汇占款减少及金融改革等因素的影响,二季度的银行间市场流动性逐步收紧,出现钱荒。7天利率中枢较一季度抬升100Bp以上,大部分期限的利率水平达到了十年来的最高值。六月中旬以来,在资金面最紧张的时刻,市场上的货币基金遭遇了大面积赎回,整体存量缩水50%以上。诺安货币基金合理安排了逆回购和定期存款的到期日,及时地应对了投资者的赎回要求,做好了流动性管理工作,完成了作为"现金管理工具"的职能。

在资金面的支撑下,一季度的债市延续了2012年的小牛行情。一级市场需求旺盛,一、二级利差扩大,二级收益率整体下行。在八号文的刺激下,跨季的收益率还是延续了下行态势。债市打黑风暴、钱荒引发的流动性危机和高资金成本带动了债市的解杠杆抛盘,短端产品成为抛售的主要对象,短端收益率大幅上行,收益率曲线平坦化抬升。一级市场的部分发行推迟或取消,发行密度有所降低。诺安货币基金跟随市场变化,择机参与了一级市场短期融资券的投资。对于信用产品的选择,坚持兼顾外部评级和内部评级,严格把关发债机构的地域和行业,防止信用踩雷事件。针对中低评级的债券,更加注重企业的盈利和所处行业的未来发展,精选出资质较好的债券作为投资标的。

诺安货币基金取得的投资回报远超出业绩比较基准,为持有人取得了较为满意的收益。诺安货币基金始终坚持"确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益"的投资目标,把资产的流动性和投资的安全性摆在首位,在此基础上,追求更好的收益。在投资管理过程中,严格控制投资、交易及操作风险,对基金资产进行合理配置。

在投资组合方面,诺安货币基金以逆回购、定期存款、短期政策性金融债及资质较好的短期融资券为主要投资品种,坚持对各投资品种进行分散投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金投资组合的剩余期限为97天,影子定价偏离度为负的0.1959%。本报告期诺安货币A基金份额净值收益率为1.7033%,诺安货币A的同期业绩比较基准收益率为0.1760%;诺安货币B基金份额净值收益率为1.8238%,诺安货币B的同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,预计经济增速会小幅反弹,通胀水平温和回升,货币政策仍保持中性偏紧,降息和降准的概率较低,公开市场操作仍会发挥对资金面预调微调的重要作用。要注意QE退出预期对全球流动性带来的影响,谨防热钱流出和外汇占款下降带来的资金面紧张局面。货币基金要继续重视流动性管理工作,保证一定比例的现金和流动性较好的短期债券。回购利率中枢易上难下,收益率曲线熊市陡峭化。去杠杆还会持续一段时间,高现金比例、短久期、高评级是比较安全的组合。在经济去产能、金融去杠杆的大趋势下,注意防范个券的信用风险。对于中低评级的债券,跟踪评级,及时调整。在下一阶段,诺安货币基金将继续跟踪宏观基本面的变化,分析货币政策的走向,留意市场流动性。根据债市走势,积极研究投资品种,努力寻找投资机会,在保证基金资产流动性和安全性的基础上,力争为广大基金持有人获取更好的投资回报,完成其"现金管理工具"的职能。

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、监察稽核部和风险控制部,固定收益部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

根据本基金基金合同约定,本基金收益"每日分配、按月支付"。本基金本期实现利润为63,259,813.91元,应分配利润63,259,813.91元,已实施利润分配63,259,813.91元,符合本基金合同约定。

§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

本报告期内,本基金托管人在对诺安货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,诺安货币市场基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安货币市场基金2013年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:诺安货币市场基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	19,777,234.65	18,195,290.80
结算备付金	6,133,181.82	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,089,543,839.14	1,972,456,513.68
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,089,543,839.14	1,972,456,513.68
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,187,444,001.77	279,221,058.83
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,134,003.06	33,640,917.15
应收股利	-	-
应收申购款	230,751,395.71	50,933.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,550,783,656.15	2,303,564,713.46
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31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	40,092.66	2,753.82
应付管理人报酬	956,656.80	805,815.74
应付托管费	289,895.96	244,186.57
应付销售服务费	178,619.96	129,259.33
应付交易费用	80,823.05	39,975.13
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	-	-
应付利润	1,577,731.05	1,626,239.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	202,874.03	209,016.18
负债合计	3,744,293.51	3,474,846.37
所有者权益:		
实收基金	2,547,039,362.64	2,300,089,867.09
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,547,039,362.64	2,300,089,867.09
负债和所有者权益总计	2,550,783,656.15	2,303,564,713.46

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,547,039,362.64份,其中,基金份额净值1.0000元,诺安货币A基金份额总额817,086,015.26份;诺安货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,729,953,347.38份。

6.2 利润表

会计主体:诺安货币市场基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	73,038,354.77	92,848,130.50
1.利息收入	63,682,293.32	87,857,496.17
其中:存款利息收入	5,821,213.83	41,789,352.51
债券利息收入	32,148,587.25	29,971,237.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	25,712,492.24	16,096,905.89
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	9,345,174.74	4,990,634.33
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,345,174.74	4,990,634.33
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	10,886.71	-
减:二、费用	9,778,540.86	11,422,118.67
1.管理人报酬	5,869,408.80	6,371,881.21
2.托管费	1,778,608.61	1,930,873.00
3.销售服务费	965,254.56	1,896,226.89
4.交易费用	-	-
5.利息支出	883,922.28	954,495.04
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	281,346.61	268,642.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	63,259,813.91	81,426,011.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	63,259,813.91	81,426,011.83

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安货币市场基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	2,300,089,867.09	-	2,300,089,867.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,259,813.91	63,259,813.91
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)	246,949,495.55	-	246,949,495.55
其中:1.基金申购款	10,693,077,977.97	-	10,693,077,977.97
2.基金赎回款	-10,446,128,482.42	-	-10,446,128,482.42
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)	-	-63,259,813.91	-63,259,813.91
五、期末所有者权益(基金净值)	2,547,039,362.64	-	2,547,039,362.64
项目	上年度可比期间 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)	2,969,811,713.64	-	2,969,811,713.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	81,426,011.83	81,426,011.83
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)	86,745,889.23	-	86,745,889.23
其中:1.基金申购款	17,143,979,509.95	-	17,143,979,509.95
2.基金赎回款	-17,057,233,620.72	-	-17,057,233,620.72
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)	-	-81,426,011.83	-81,426,011.83
五、期末所有者权益(基金净值)	3,056,557,602.87	-	3,056,557,602.87

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:

奥成文 薛有为 薛有为

基金管理人负责人 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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	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
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	5,869,408.80	6,371,881.21
其中:支付销售机构的客户维护费	201,745.69	375,817.35

注:①基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.33%/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

②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两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	1,778,608.61	1,930,873.00

注:①基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/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

②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两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	451,928.07	135,180.74	587,108.81
中国工商银行股份有限公司(托管人)	211,345.74	1,392.71	212,738.45
合计	663,273.81	136,573.45	799,847.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,137,569.45	103,997.89	1,241,567.34
中国工商银行股份有限公司(托管人)	406,899.11	4,436.71	411,335.82
合计	1,544,468.56	108,434.60	1,652,903.16

注:①基金销售服务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×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

②基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。

③自2012年2月21日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,A级基金份额销售服务费年费率为0.25%,B级基金份额销售服务费年费率为0.01%。详情请参阅相关公告。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	257,977,747.94	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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

诺安货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市捷隆投资有限公司	-	-	214,861,045.20	9.34%

6.4.4.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	19,777,234.65	87,996.21	10,427,707.22	53,876.17

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发而形成的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013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,无债券作为抵押。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013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和/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。

§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	固定收益投资	1,089,543,839.14	42.71
	其中:债券	1,089,543,839.14	42.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,187,444,001.77	46.55
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	39,840,829.86	1.56
3	银行存款和结算备付金合计	25,910,416.47	1.02
4	其他各项资产	247,885,398.77	9.72
5	合计	2,550,783,656.15	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.93	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	160
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	51.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.96	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	9.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	3.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	26.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		90.41	-

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	499,880,226.75	19.63
	其中:政策性金融债	499,880,226.75	19.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	589,663,612.39	23.15
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,089,543,839.14	42.78
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,949,577.95	1.96

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比