诺安多策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2013年第2期

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

重要提示

（一）诺安多策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2011年5月18日证监许可［2011］739号文核准公开募集，本基金的基金合同于2011年8月9日正式生效。

（二）基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

（三）投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，须承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场系统性风险、上市公司风险、利率风险、流动性风险、信用风险、管理风险、本基金特有风险、资产配置风险及其他风险等。

本基金属于股票型基金，属于具有高风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金以一元初始面值募集基金份额，在市场波动等因素的影响下，基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

（四）基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）财务数据已经基金托管人复核。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年8月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

公司名称：诺安基金管理有限公司
住所：深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层
办公地址：同住所
法定代表人：秦维舟
设立日期：2003年12月9日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字［2003］132号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.5亿元人民币
存续期限：持续经营
电话：0755-83026688
传真：0755-83026677
联系人：陈阳
股权结构：

股东单位	出资额（万元）	出资比例
中国对外经济贸易信托投资有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
大恒新纪元科技股份有限公司	3000	20%
合　计	15000	100%

（二）证券投资基金管理情况

截至2013年8月9日，本基金管理人共管理二十七只开放式基金：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、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及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。

（三）主要人员情况

1.董事会成员

秦维舟先生，董事长、工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理，香港昌维发展有限公司总经理，香港先锋投资有限公司总经理，中国新纪元有限公司副总裁，诺安基金管理有限公司副董事长。

徐卫晖先生，副董事长、工商管理硕士。历任中国化工进出口总公司财会部副总经理，中化国际贸易股份有限公司副总经理，中化河北进出口公司总经理，中化国际（控股）股份有限公司总经理，中国中化股份有限公司战略规划部、投资发展部总经理，中国对外经济贸易信托有限公司党委书记。

张家林先生，董事，高级工程师，全国人民政治协商会议第9、10、11届委员。曾任中科院自动化研究所工程师、高级工程师，中国自动化技术公司总经理。现任中国大恒（集团）有限公司董事长、大恒新纪元科技股份有限公司董事长。

欧阳文安先生，独立董事，工程师。历任中共北京市委副秘书长兼办公厅主任，中共北京市石景山区委书记，中共北京市委常委、秘书长，北京国际电气工程公司董事长，北京国际电力开发投资公司董事长。

朱渊刚先生，独立董事，教授级高级经济师。历任石油部计划司副司长，中国石油天然气集团公司计划局局长、资源中心副主任。

陆刚屏先生，独立董事，历任新华社香港分社办公厅综合处处长、办公厅副主任、国际问题研究中心办公室主任，国家外汇管理局办公室主任、政策法规司司长、副局长。

2.监事会成员

李京先生，监事，企业管理硕士。历任中国中化集团总裁办公室部门经理，中化集团香港立丰实业公司总经理助理，中化汇富资产管理公司副总经理，中化欧洲资本公司副总经理兼世盈（厦门）创业投资有限公司副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵星明先生，监事，金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长，深圳证券交易所理事会秘书长，君安证券香港公司副总经理等。

戴宏明先生，监事，历任浙江证券深圳营业部交易主管，国泰君安证券公司部门主管，诺安基金管理有限公司交易中心总监。

梅律吾先生，监事，硕士。历任长城证券有限责任公司研究员，鹏华基金管理有限公司研究员，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监。

3.经理层成员

奥成文先生，总经理，经济学硕士，经济师。曾任中国通用技术（集团）控股有限责任公司资产经营部副经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002年10月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作，任公司督察长，现任公司总经理。

杨文先生，副总经理，企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员，中融基金管理公司市场部经理。2003年8月加入诺安基金管理有限公司，历任市场部总监、发展战略部总监，现任公司副总经理。

杨谷先生，副总经理，经济学硕士，CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员、西北证券公司资产管理部研究员。2003年10月加入诺安基金管理有限公司，现任公司副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理、诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理、诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

陈勇先生，督察长，经济学硕士。曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理、民生证券公司证券投资总部副总经理。2003年10月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、研究部总监，现任公司督察长。

4.基金经理

王水平先生，经济学博士，具有基金从业资格。曾先后就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。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月至2013年4月任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

杨谷先生，经济学硕士，CFA，具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部；2003年10月加入诺安基金管理有限公司，现任公司副总经理、投资总监。曾于2006年11月至2007年11月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2006年2月起任诺安股票证券投资基金基金经理，2010年9月起任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理，2013年4月起任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员的姓名及职务

本公司投资决策委员会分股票类基金投资决策委员会和固定收益类基金投资决策委员会，具体如下：

股票类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、投资总监、基金经理；张宇光先生，总经理助理兼配置基金组投资总监；邹翔先生，成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监、基金经理；王创练先生，研究部总监。

固定收益类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、投资总监，基金经理；杨文先生，副总经理；张乐赛先生，固定收益部总监、基金经理；王创练先生，研究部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号
联系人：田青
联系电话：010-67595096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司普身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2013年6月30日，中国建设银行资产总额148,592.14亿元，较上年末增长6.34%。2013年上半年，中国建设银行实现净利润1,199.64亿元，较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%，年化股权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元，较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%，较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元，较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司，海外机构已覆盖到全球14个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5，较上年上升1位；在美国《财富》世界500强排名第50位，较上年上升27位；在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2，较上年提升11位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工225人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行，中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年6月30日，中国建设银行已托管311只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖，和媒内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

三、相关服务机构

（一）诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、北京、上海、广州、成都开设五个直销网点对投资者办理开户、申购和赎回等业务：

1.深圳直销中心
办公地址：深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
邮政编码：518048
电话：0755-83026620
传真：0755-83026677
联系人：张逸凤
2.北京分公司
办公地址：北京市朝阳区光华路甲14号8-9层
邮政编码：100020
电话：010-59027811
传真：010-59027890
联系人：孟佳
3.上海分公司
办公地址：上海浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦903室
邮政编码：200120
电话：021-68824617
传真：021-68362099
联系人：陈晓瑜
4.广州分公司
办公地址：广州市珠江新城华夏路10号富力中心2908
邮政编码：510623
电话：020-38393680
传真：020-38393680
联系人：廖飞
5.西部营销中心
办公地址：成都市锦江区下东大街216号喜年广场2407
邮政编码：610021
电话：028-86586055
传真：028-86586055
联系人：裴兰

（二）基金代销机构（排名不分先后）

①中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：王洪章
联系人：张静
客户服务电话：95533
传真：010-66275654
网址：www.ccb.com

②中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
电话：010-66107900
传真：010-66107914
联系人：田耕
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

③中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

④中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

⑤交通银行股份有限公司
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：021-58781234
传真：021-58408842
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

⑥招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195109
联系人：兰奇
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

⑦平安银行股份有限公司（原深圳发展银行股份有限公司以吸收合并原平安银行股份有限公司的方式完成两行整合并更名后的银行）
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：孙建一
电话：0755-82088888
传真：0755-82080714
联系人：周勤
客户服务电话：95511-3
网址：www.sdb.com.cn；www.bank.pingan.com

⑧北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
电话：010-66223584
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
网址：www.bankofbeijing.com.cn

⑨南京银行股份有限公司
地址：南京市白下区淮海路50号
法定代表人：林复
联系人：贺坚
联系电话：025-84544135
传真：010-84544129
客户服务电话：025-96400、40088-96400
网址：www.njcb.com.cn

⑩杭州银行股份有限公司
注册地址：中国·杭州凤起路432号
办公地址：中国·杭州凤起路432号
法定代表人：马时雍
客户服务电话：0571-96523、400-8888-508
网址：www.hzbank.com.cn

⑪温州银行股份有限公司
住所及办公地址：温州市车站大道华海广场1号楼
法定代表人：夏瑞洲
电话：0577-88990082
传真：0577-88995217
联系人：林波
客户服务电话：0577-96699
网址：www.wzbank.cn

⑫江苏银行股份有限公司
注册地址：南京市洪武北路55号
办公地址：南京市洪武北路55号
法定代表人：黄志伟
联系人：田春慧
电话：025-58588167
传真：025-58588164
客户服务电话：400-86-96098、96098
网址：www.jsbchina.cn

⑬中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
客户服务电话：95595
网址：www.cebbank.com

⑭中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-58351666
传真：010-83914283
联系人：李胖
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

⑮上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：汤慈惠、倪苏云
电话：021-61618888
传真：021-63604199
客户服务电话：95528
网址：www.spdb.com.cn

⑯中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：常振明
电话：010-65546655-108
传真：010-65542373
联系人：秦莉
客户服务电话：95558
网址：www.ecitic.com

⑰招商证券股份有限公司
注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道2012号招商证券大厦
办公地址：中国广东省深圳市福田区深南大道2012号招商证券大厦
法定代表人：宫少林
电话：0755-83076988
传真：0755-82926067
联系人：黄婵君
客户服务电话：400-888-1108
网址：www.newone.com.cn

⑱中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
电话：010-84683893
传真：010-84865560
联系人：陈忠
客户服务电话：010-84588888
网址：www.cs.ecitic.com

⑲光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-68815009
联系人：刘晨
客户服务电话：400-8888-788、10108998
网址：www.ehscn.com

⑳德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区武宁路618号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人：姚文平
电话：021-68761616
传真：021-68767981
联系人：罗芳
客户服务电话：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn

㉑财富证券有限责任公司
注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：张华东
电话：025-83364032
传真：025-83320066
联系人：胥春阳
客户服务电话：400-828-5888
网址：www.njzq.com.cn

㉒东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
基金业务对外联系人：李涛
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
客户服务电话：400-888-8588
网址：www.longzhong.com.cn

㉓湘财证券有限责任公司
注册地址：中国湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：中国湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634518
传真：021-68865938
联系人：陈伟
客户服务电话：400-888-1551
网址：www.xcsc.com

㉔国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：常喆
电话：010-84183333
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

㉕渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市河西区宾水道3号
法定代表人：杜庆平
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
客户服务电话：400-6515-988
网址：www.bhzq.com

㉖平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人：杨宇翔
全国免费业务咨询电话：4008816168
开放式基金业务传真：0755-82400862
联系人：周璐
全国统一总机：4008866338
网址：www.pingan.com

㉗国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
客户服务电话：400-8888-777
网址：www.gyzq.com.cn

㉘中航证券有限公司
注册地址：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
联系人：余雅薇
客户服务电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com

㉙上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
电话：021-63231111
联系人：王伟力
客服服务电话：021-962518
网址：www.962518.com

㉚财富证券有限责任公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表：刘汝军
联系人：孙恺
电话：010-83561149
传真：010-83561094
客户服务电话：400-698-9898
网址：www.xsdzq.cn

㉛长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14/16/17层
法定代表人：黄耀华
电话：0755-83516289
联系人：匡婷
客户服务电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com

㉜长信证券有限公司
注册地址：山东省济南市经十路20518号
办公地址：山东省济南市经十路20518号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
开放式基金咨询电话：0531-81283906
开放式基金业务传真：0531-81283900
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

㉝宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人：冯戎
基金业务对外联系人：李茂俊
基金业务对外联系人电话：010-62294608-6240
基金业务对外联系人传真：010-62296854
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

㉞中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人：杨明辉
客户服务电话：400-600-8008
网址：www.cjis.cn

㉟长江证券有限责任公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务电话：4008-888-999或95579
公司网址：www.95579.com

㊱陈方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客户服务电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn

㊲广州证券有限责任公司
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
办公地址：广东省广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：刘东
电话：020-87322668
传真：020-87325036
联系人：樊刚正
客户服务电话：020-961303
网址：www.gzs.com.cn

㊳平原证券股份有限公司
注册地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：曾明军
基金业务对外联系人：程月艳　耿铭
联系电话：0371-65585670
传真：0371-65585665
客户服务电话：0371-967218；400-813-9666
网址：www.ccnew.com

㊴天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
客户服务电话：010-66045678
传真：010-66045500
天相投顾网-网址：www.txsec.com
天相基金网-网址：www.txjijin.com
联系人：潘鸿
联系电话：010-66045446

㊵海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸、李笑鸣
客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

㊶中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号
办公地址：北京市东城区朝内大街188号中信建投证券公司
法定代表人：张佑君
开放式基金咨询电话：40-08888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc108.com

㊷第一创业证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
客户服务电话：400-888-1888
网址：www.firstcapital.com.cn

㊸招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82960141
联系人：黄健
客户服务电话：95565或400-8888-111
网址：www.newone.com.cn

㊹华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777
传真：025-84579763
联系人：李金龙
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

㊺大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
法定代表人：张智河
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169
网址：www.daton.com.cn

㊻华安证券有限责任公司
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市草南路166号润安大厦A座
法定代表人：李工
客户服务电话：96518
网址：www.hazq.com

㊼鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦第28层A01、B01
法定代表人：洪家新
客户服务电话：400-109-9918（全国）、021-32109999、029-68918888；
网址：www.cfsc.com.cn

（三）注册登记机构

名称：诺安基金管理有限公司
住所：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
电话：0755-83026688
传真：0755-83026677

（四）律师事务所和经办律师

名称：北京市丽合律师事务所
住所：北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室
法定代表人/负责人：付朝晖
电话：010-65178866
传真：010-65180276
经办律师：虞荣芳、高平均

（五）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人：卢伯卿
电话：021-61418888
传真：021-63350003
联系人：余志亮
经办注册会计师：胡小骏、王明静

四、基金的名称

诺安多策略股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约性开放式基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：

1、沪深300指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性。

2、上证国债指数以国债为样本，按照发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性。

3、作为股票型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在管理人与托管人协商一致报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

九、基金的投资策略

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。

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，发掘探时因子，根据探时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。大类资产的配置由多因子市场探时模型和具体情况决定。模型分为短周期模型和长周期模型，短周期模型每天进行更新，长周期模型在经济数据公布后及时进行更新。同时对于模型本身我们也会定期进行修正和检验。此外，需要指出的是在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，将优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

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。

定量投资方面，本基金将依托自主研发的定量投资模型，构建投资组合。其中，核心模型包括诺安行业选择模型、诺安多因素股票模型以及诺安组合优化器。量化投资小组将根据市场变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做相应调整，以不断改善模型的适用性。

①诺安行业选择模型

诺安行业选择模型，通过定量分析行业赢利能力、分析师的盈利预期、市场认同度等因素，捕捉具有投资吸引力的行业。根据各行业的投资吸引力，决定各行业相对于业绩比较基准中行业权重的相对偏离度。提高投资吸引力高的行业配置，降低投资吸引力低的行业配置。

②诺安多因素股票模型

通过诺安行业选择模型筛选的行业进入个股筛选程序。本基金在个股选择层面，采用“诺安多因素股票模型”。

诺安基金根据对中国证券市场运行特征的长期研究，选取估值因子（Valuation）、成长因子（Growth）、盈利趋势（Operating）、分析师情绪（Sentiment）、市场因素（Market）五大类对A股股价波动具有较强解释度的指标，建立“诺安多因素股票模型”，并使该模型成为股票选择的重要依据。

定性投资主要利用基本面研究成果，对模型自动选股的结果进行复核和优选，即在诺安多因素股票模型筛选出的股票名单的基础上，根据分析师定性研究成果，剔除掉某些存在定性缺陷或发生不利变化和事件的上市公司的股票，从而进行定性优选。

需要考虑的定性因素包括：

A）上市公司治理结构、管理和产品；

B）上市公司生产经营；

C）存在对股价有负面影响的潜在事件和政策；

D）存在压制股价的其它非基本面因素。

本基金通过量化技术，对上述定量模型和定性因素筛选的结果进行优化，以确定个股权重，实现风险收益的最佳匹配。定量投资方法以科学性和系统性著称，将在严格的纪律化模型制约下，紧密跟踪策略，使运作风险最小化，并力争取得较高收益。在现阶段，本基金使用“稳健优化”的方法，在所有可能的期望回报的最坏条件下，计算最优组合。与其他优化方法相比，使用“稳健优化”方法获得的最优组合，更加稳定，更加分散化，交易成本和换手率更低。

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。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

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。

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。股指期货的具体投资策略包括：①对冲投资组合的系统性风险；②有效管理现金流量，降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资申批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

十、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。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2013年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	223,867,304.13	62.51
	其中：股票	223,867,304.13	62.51
2	固定收益投资	10,846,506.70	3.03
	其中：债券	10,846,506.70	3.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	40,000,000.00	11.17
	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	83,139,469.59	23.21
6	其他资产	303,729.93	0.08
7	合计	358,157,010.35	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业