

诺安成长股票型证券投资基金

[2011] 第一季度报告

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:2011年4月22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责任。

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2011年4月20日复核了本报告中

的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容的真实性、准确性和完整性,保证复核内

容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 诺安成长股票

交易代码 320007

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2009年3月19日

报告期末基金份额总额 2,058,729,325.35份

基金目标 本基金主要投资于具有良好成长性的企业,同时兼顾企业成长能力的持续性,并以其投资价值做出定性及定量分析,力图在享受企业成长溢价的同时获得长期稳定的回报。

本基金具体的选股策略由资产配置、股票投资、债券投资和权证投资四部分组成。

(1)在资产配置方面,本基金采用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TA)相结合的方式进行。

(2)在股票投资方面,本基金投资于成长企业的比例不低于本基金

所持基金资产的80%。

(3)在债券投资方面,本基金实行利率预期策略,收益率由曲线拟策略、收益率曲线策略、一个信用利差策略以及风险暴露策略等策略构成,力求获取高于债券市场平均水平的回报。

(4)在权证投资方面,本基金主要通过价值发现和价差策略,作为辅助

投资工具,本基金将结合自身资产状况审慎使用,力图获得最佳风险管理效果。

投资策略 本基金的业绩比较基准为:80%×中证中小板指数

+20%×上证国债指数。

风险收益特征 本基金属于高风险、高收益的股票型投资基金品种。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 46,624,511.71

2.本期利润 5,864,434.19

3.期初平均基金份额净值 2,418,336.739

4.期末基金份额净值 2,418,336.059

5.期末基金份额净值 1.175

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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数字。

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。

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的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去三个月 1.91% 1.26% 2.24% 0.08% -0.33% 0.18%

注:本基金的业绩比较基准为:80%×中证中小板指数+20%×上证国债指数。

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

图示:基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

图示:基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较