

## 诺安全球黄金证券投资基金

## [2011] 第二季度报告

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7月20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7月18日复核了本报告中

的财务指标、净值表现、收益分配政策等重要内容，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。

本报以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至2011年3月30日止。

本基金基金合同于2011年1月18日生效，至报告期末未满半年。

## § 2 基金产品概况

基金简称:诺安全球黄金(QDII-FOF)

基金主代码:320013

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年1月18日

报告期末基金份额总额:1,572,513,621.17份

投资目标:本基金主要通过投资于境外有实物支持的黄金ETF，紧密跟踪金价走势，为投资者提供一类可有效分散投资风险的黄金类金融工具。

本基金主要通过投资于有实物支持的黄金ETF的方式达成跟踪金价的投资目标。本基金通过在全全球发达市场上购买有实物

黄金支持的实物黄金ETF，之后本基金通过买入持有的黄金ETF的赎回权，再将赎回所得资金投资于黄金类资产。

本基金只买卖黄金ETF的赎回权，流动性等因数在定期进行调整和平衡。

本基金的总体投资策略包括长期投资策略以及风险管理策略

策略等部分组成。

本基金的业绩比较基准为伦敦金价折合成人民币后的汇率率，伦敦金价每日价格采用伦敦金价“下午定价”(London Gold Price PM Fix)。

人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

本基金为混合型基金，主要投资于实物黄金支持的黄金ETF。投资

目标为紧密跟踪黄金价格，预期风险收益水平与黄金价格相拟，在

证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。

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

境外投资顾问:无

英文名称:Brown Brothers Harriman &amp; Co.

中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 54,586,320.40

2.本期利润 73,609,277.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 1,651,695,944.24

5.期末基金份额净值 1.050

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价折合成人民币后的收益率,伦敦金价每日价格采用伦敦金价下午定价率(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.2.3 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价折合成人民币后的收益率,伦敦金价每日价格采用伦敦金价下午定价率(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.2.5 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价折合成人民币后的收益率,伦敦金价每日价格采用伦敦金价下午定价率(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

3.3 主要财务指标

3.3.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.2 基金净值表现

3.3.2.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.3 基金资产净值

3.3.3.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.4 基金资产净值

3.3.4.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.5 基金资产净值

3.3.5.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.6 基金资产净值

3.3.6.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.7 基金资产净值

3.3.7.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.8 基金资产净值

3.3.8.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.9 基金资产净值

3.3.9.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.10 基金资产净值

3.3.10.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.11 基金资产净值

3.3.11.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.12 基金资产净值

3.3.12.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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。

3.3.13 基金资产净值

3.3.13.1 本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

序号 净值增长率(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

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,