

信息披露 Disclosure

诺安增利债券型证券投资基金

[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、完整性和及时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、投资组合报告等内容，保证复核内容的真实性、准确性、完整性和及时性，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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺安增利债券

基金代码:320008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年5月27日

报告期末基金份额总额:114,004,362.01份

本基金通过不断核心固定收益类资产上进行增强配置，力图在获得稳定的收益的同时降低风险。

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下，力争在中长期投资中获得超越业绩比较基准的收益。

本基金的投资策略分为核心类资产配置策略和增强类资产配置策略两大部分。

1.核心类资产配置策略

国债、金融债、短期融资券、企业债、公司债、可转债、央行票据、回购协议等较固定收益类资产为本基金的核心资产。

2.增强类资产配置策略

股票(包括权证)、权证等非固定收益类金融工具为本基金的增强资产。

本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置和投资组合的优化，力争在中长期投资中获得超越业绩比较基准的收益。

投资策略:本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置和投资组合的优化，力争在中长期投资中获得超越业绩比较基准的收益。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标:诺安增利债券A报告期:2011年4月1日至2011年6月30日 诺安增利债券B报告期:2011年4月1日至2011年6月30日

1.本期已实现收益 -1,180,914.43 -478,027.70

2.本期利润 -1,250,402.81 -462,035.01

3.期初平均基金份额本期利润 -0.0139 -0.0131

4.期末基金份额净值 89,476,029.76 30,057,229.93

5.期末基金份额净值 1.0551 1.0401

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要低于所列数据。

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为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.31% 0.10% 0.53% 0.04% -1.84% 0.06%

诺安增利债券B

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

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

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

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要低于所列数据。

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。

3.2.3 本基金净值表现

3.2.3.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.31% 0.10% 0.53% 0.04% -1.84% 0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.4 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

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.5 本基金净值表现

3.2.5.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.6 本基金净值表现

3.2.6.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.7 本基金净值表现

3.2.7.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.8 本基金净值表现

3.2.8.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.9 本基金净值表现

3.2.9.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.10 本基金净值表现

3.2.10.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.11 本基金净值表现

3.2.11.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.12 本基金净值表现

3.2.12.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.13 本基金净值表现

3.2.13.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.14 本基金净值表现

3.2.14.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.15 本基金净值表现

3.2.15.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.16 本基金净值表现

3.2.16.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.17 本基金净值表现

3.2.17.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.18 本基金净值表现

3.2.18.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.19 本基金净值表现

3.2.19.1 本报告期基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

诺安增利债券A

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①