

# 诺安股票证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 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

送出日期：2012 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安股票证券投资基金
基金简称	诺安股票
基金主代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 19 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	15,181,480,876.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角,发掘最具投资价值的企业,获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担和控制市场风险的情况下,取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产的配置比例;在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资;在个股选择层面,本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析,挖掘具有中长期投资价值的股票;在债券投资方面,本基金将运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×富时 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效地规避风险并相应地获得较高的投资收益。

### 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
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴	北京市西城区复兴门内大街 55

	业银行大厦 19-20 层	号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	秦维舟	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-791,052,055.00
本期利润	175,066,890.48
加权平均基金份额本期利润	0.0114
本期加权平均净值利润率	1.37%
本期基金份额净值增长率	1.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,633,153,573.47
期末可供分配基金份额利润	-0.2393
期末基金资产净值	12,133,969,670.16
期末基金份额净值	0.7993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	201.63%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人申购或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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。

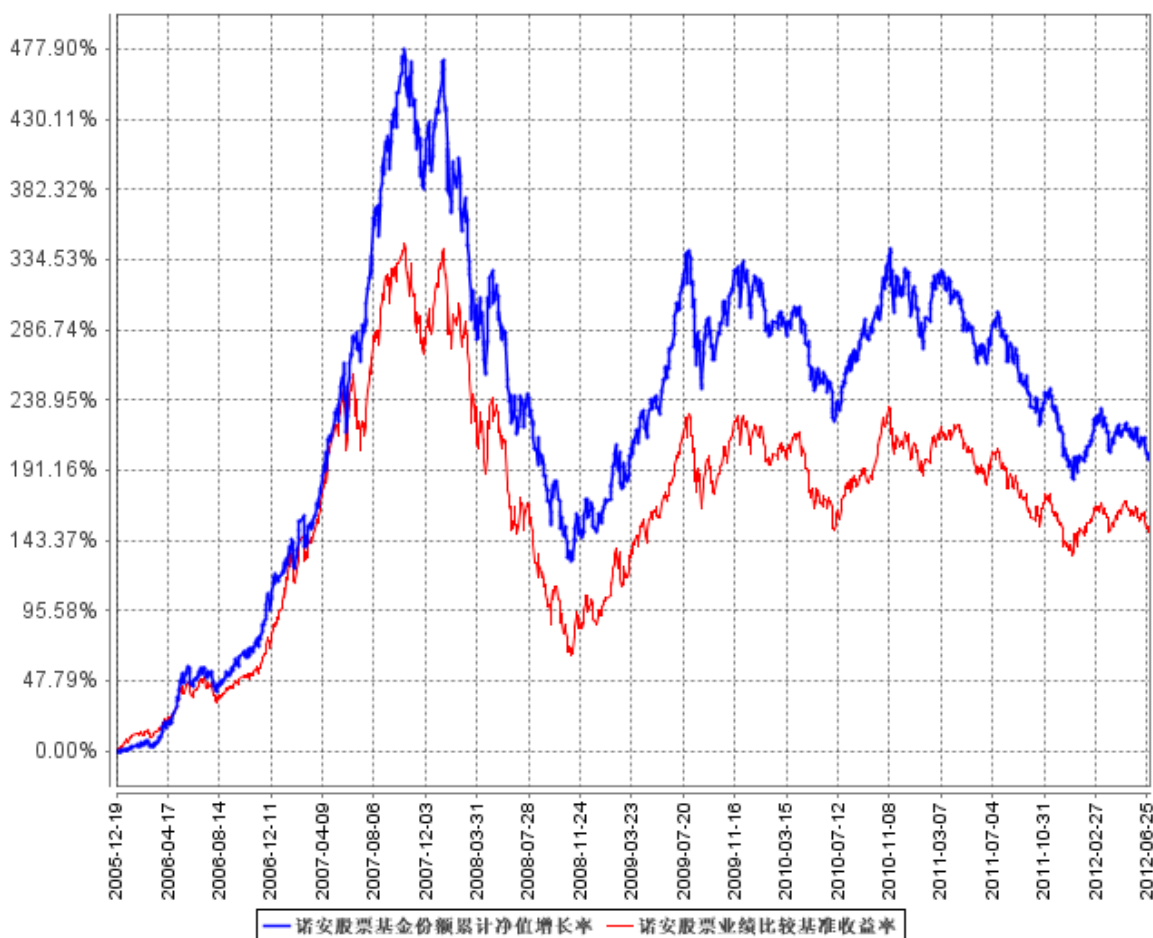
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	-5.70%	0.84%	-4.82%	0.88%	-0.88%	-0.04%
过去三个月	-0.81%	0.85%	1.06%	0.89%	-1.87%	-0.04%
过去六个月	1.32%	1.06%	5.18%	1.08%	-3.86%	-0.02%
过去一年	-20.69%	1.03%	-14.82%	1.09%	-5.87%	-0.06%
过去三年	-21.35%	1.27%	-12.01%	1.25%	-9.34%	0.02%
自基金合同生效起至今	201.63%	1.59%	152.63%	1.60%	49.00%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



## § 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

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字【2003】132 号文批准, 公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、大恒新纪元科技股份有限公司, 公司注册资本为 1.5 亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、紧急应变制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。本基金管理人共管理二十一开放式基金: 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及诺安汇鑫保本混合型证券投资基金。

#### 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		
杨谷	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	2006 年 6 月 22 日	-	14	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。
邹翔	成长基金组	2010 年 10 月	-	19	经济学硕士, 具有基金从业资格。



	投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理	14 日		曾先后任职于中信实业银行、华夏证券有限公司、华夏基金管理有限公司、大通证券有限公司、中国国际金融有限公司、诺德基金管理有限公司、申万巴黎基金管理有限公司。邹翔先生曾于 1999 年 7 月至 2000 年 6 月任兴和证券投资基金基金经理、2000 年 7 月至 2001 年 11 月任兴安证券投资基金基金经理、2007 年 4 月至 2008 年 5 月任诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理。2010 年 3 月加入诺安基金管理有限公司, 现任公司成长基金组投资总监。于 2010 年 10 月起任诺安股票证券投资基金基金经理。
--	---------------------	------	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

报告期间, 诺安股票证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规, 遵守了《诺安股票证券投资基金基金合同》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**

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，均是由于公司旗下个别基金使用量化投资策略所致。

### **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**

2012 年上半年是市场弱势震荡的半年。基本面的下滑以及对冲下滑的政策共同演绎，通胀形势的反复、放松预期的摆动、海外经济的时好时坏始终制约着市场，向下无法突破，向上也无法抬升，A 股总体陷入纠结状态。估值角度看，全市场估值在历史的低位，但没有到历史最低，向上弹升也缺乏动力。在此情况下，我们围绕低估值的、业绩能够持续超预期增长的品种进行了布局，实现了一定的收益。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至报告期末，本基金份额净值为 0.7993 元。本报告期基金份额净值增长率为 1.32%，同期业绩比较基准收益率为 5.18%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

外围市场上半年危机难解，希腊选举问题行将结束，西班牙、塞浦路斯各自步入危机状态，德国的 PMI 继续疲软，欧洲峰会无果而终，欧债危机第二季继续上演，美国的消费数据、工业生产数据继续下滑，全球经济在炎炎夏天却处处感觉冷意，龙年过半，油价、金价双双暴跌，美元和美债高位盘整，美联储对是否推 QE3 的犹豫不决，着实让金融市场忧心忡忡。

国内经济加速下行，PPI 连创新低，作为工业血液的煤炭 6 月份连续暴跌，工业需求加速下滑局面彰显无遗。尽管上半年央行屡次降准降息，但从事后经济和市场的反应看，这些政策是远远不够的，除了房地产的信贷能够环比快速增长之外，其他中长期信贷需求远远没有得到激发，而即便是前者出现了较为积极的信号，媒体对于房价报复性反弹担忧的宣传也再度表明，经济基本结构性矛盾并非是可一日化解的小疾。鉴于经济基本面的加速下滑，我们认为，更多对冲性的政策将在下半年出台，特别是中国一年一度的北戴河经济工作会议以及五年一度的全国党代会行将召开，政策面持续出招可以期待。

估值方面看，截止 6 月 30 日，沪深 300 的 PE 估值 (TTM) 为 11.70 倍 (PE 历史最低估值 9.9 倍)，PB 估值为 2.13 倍 (PB 历史最低估值为 1.75 倍)，剔除银行股的估值为 19.99 倍左右，相比较历史估值，全市场估值仍处在底部的位置。

综合国内外形势，我们认为：下半年的市场将延续上半年的震荡调整趋势，市场将继续寻找新的上升理由，流动性仍将整体保持宽松，局部的热点有望导致结构性的机会持续存在，中长期的主流热点品种或将出现，但需要密切观察。

#### 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同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、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员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

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最少一次,最多为六次;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

### § 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

2012 年上半年,本基金托管人在对诺安股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他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

2012 年上半年,诺安股票证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安股票证券投资基金未进行利润分配。

#### 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股票证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、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：诺安股票证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	3,279,257,863.78	4,682,897,085.80
结算备付金		7,909,329.70	7,974,921.02
存出保证金		3,824,004.90	4,531,144.94
交易性金融资产	6.4.7.2	7,990,923,336.37	7,643,121,958.20
其中：股票投资		7,990,923,336.37	7,643,121,958.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		878,913,748.92	-
应收利息	6.4.7.5	744,870.27	964,050.59
应收股利		5,822,356.06	-
应收申购款		269,182.87	171,890.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,167,664,692.87	12,339,661,051.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,086,083.07	53,519,959.77
应付赎回款		4,376,305.09	3,937,454.91
应付管理人报酬		15,371,334.58	16,275,797.13
应付托管费		2,561,889.11	2,712,632.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,324,442.88	4,958,955.47
应交税费		25,000.00	25,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,949,967.98	1,851,855.66
负债合计		33,695,022.71	83,281,655.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	15,181,480,876.41	15,536,222,884.21
未分配利润	6.4.7.10	-3,047,511,206.25	-3,279,843,488.61
所有者权益合计		12,133,969,670.16	12,256,379,395.60
负债和所有者权益总计		12,167,664,692.87	12,339,661,051.40

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7993 元，基金份额总 15,181,480,876.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安股票证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		301,943,148.66	-1,145,665,269.98
1.利息收入		23,555,741.06	41,943,668.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,695,246.61	12,893,482.10
债券利息收入		-	7,000.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,860,494.45	29,043,185.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-687,881,324.47	1,149,359,846.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-742,153,484.75	1,114,028,046.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	54,272,160.28	35,331,799.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	966,118,945.48	-2,337,400,032.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	149,786.59	431,248.11
<b>减：二、费用</b>		126,876,258.18	196,758,310.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	94,973,333.44	130,702,535.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,828,888.94	21,783,755.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	15,863,979.52	44,054,271.23
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	210,056.28	217,747.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		175,066,890.48	-1,342,423,580.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		175,066,890.48	-1,342,423,580.84

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安股票证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	15,536,222,884.21	-3,279,843,488.61	12,256,379,395.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	175,066,890.48	175,066,890.48
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)	-354,742,007.80	57,265,391.88	-297,476,615.92
其中：1.基金申购款	87,492,732.67	-15,445,424.22	72,047,308.45
2.基金赎回款	-442,234,740.47	72,710,816.10	-369,523,924.37
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	15,181,480,876.41	-3,047,511,206.25	12,133,969,670.16
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	17,381,898,614.18	1,589,633,221.36	18,971,531,835.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,342,423,580.84	-1,342,423,580.84
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)	-1,368,550,549.22	-121,608,772.65	-1,490,159,321.87
其中：1.基金申购款	156,500,444.86	7,561,650.91	164,062,095.77
2.基金赎回款	-1,525,050,994.08	-129,170,423.56	-1,654,221,417.64
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	16,013,348,064.96	125,600,867.87	16,138,948,932.83

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：

<u>          奥成文          </u>	<u>          薛有为          </u>	<u>          薛有为          </u>
基金管理公司负责人	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 基金基本情况

诺安股票证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监基金字[2005]154号文《关于同意诺安股票证券投资基金设立的批复》批准,于2005年11月3日至2005年12月13日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,共募集资金人民币379,115,510.80元,折合379,115,510.80份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币85,441.25元,其中在基金设立募集期产生的利息为人民币61,905.56元,折合61,905.56份基金份额,其余利息为人民币23,535.69元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2005年12月19日,合同生效日基金份额为379,177,416.36份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安股票证券投资基金基金合同》、《诺安股票证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》等通知及其他相关规定和基金合同的规定而编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012年6月30日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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。



### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1、 印花税

(1) 自 2008 年 9 月 19 日起, 基金管理人运用基金买卖股票, 交易印花税按单边征收方式, 卖出股票按 1%征收, 买入股票不征收。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中因非流通股股东向其支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

#### 2 、 营业税、企业所得税

(1) 根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东向其支付的股份、现金等对价, 暂免征收企业所得税。

#### 3 、 个人所得税

(1) 对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入, 由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2005 年 6 月 13 日(含当日)起, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 10%的个人所得税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东向其支付的股份、现金等对价, 暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	3, 279, 257, 863. 78

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3, 279, 257, 863. 78

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9, 265, 611, 196. 35	7, 990, 923, 336. 37	-1, 274, 687, 859. 98
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9, 265, 611, 196. 35	7, 990, 923, 336. 37	-1, 274, 687, 859. 98

注：本基金本期所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	741, 666. 99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3, 203. 28
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

其他	-
合计	744,870.27

#### 6.4.7.6 其他资产

本项其他资产为报表项目,本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,324,442.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,324,442.88

#### 6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	1,062.00
预提费用	198,905.98
合计	1,949,967.98

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,536,222,884.21	15,536,222,884.21
本期申购	87,492,732.67	87,492,732.67
本期赎回(以“-”号填列)	-442,234,740.47	-442,234,740.47
本期末	15,181,480,876.41	15,181,480,876.41

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,922,091,988.61	-357,751,500.00	-3,279,843,488.61
本期利润	-791,052,055.00	966,118,945.48	175,066,890.48
本期基金份额交易产生的变动数	79,990,470.14	-22,725,078.26	57,265,391.88
其中:基金申购款	-18,783,907.58	3,338,483.36	-15,445,424.22

基金赎回款	98,774,377.72	-26,063,561.62	72,710,816.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,633,153,573.47	585,642,367.22	-3,047,511,206.25

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	13,575,936.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	119,307.66
其他	2.84
合计	13,695,246.61

注：“其他”为认申购款利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	5,186,989,450.86
减：卖出股票成本总额	5,929,142,935.61
买卖股票差价收入	-742,153,484.75

### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	54,272,160.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	54,272,160.28

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	966,118,945.48
——股票投资	966,118,945.48
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	966,118,945.48

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	39,796.11
印花税手续费返还	109,793.72
基金转换费收入	196.76
合计	149,786.59

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	15,863,979.52
银行间市场交易费用	-
合计	15,863,979.52

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
汇划费	2,150.30
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	210,056.28

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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

基金管理人于 2012 年 2 月 25 日发布公告，经诺安基金管理有限公司股东会决议通过，中国证券监督管理委员会批准，大恒新纪元科技股份有限公司受让北京中关村科学城建设股份有限公司持有的基金管理人 20% 的股权。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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。

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	94,973,333.44	130,702,535.72
其中：支付销售机构的客户维护费	16,477,980.09	22,360,500.40

注：A. 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

B. 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,828,888.94	21,783,755.97

注:A. 基金托管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:

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

B. 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间与基金托管人无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末基金管理人主要股东及其控制机构未持有本基金的基金份额。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011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	3,279,257,863.78	13,575,936.11	4,817,395,722.29	12,713,984.17

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300315	掌趣科技	2012年5月4日	2012年8月13日	新股流通受限	16.00	20.86	1,020,000	16,320,000.00	21,277,200.00	-

注：①可流通日以公告为准。

②本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限债券和权证。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	晶源电子	2012年6月5日	重大资产重组	22.15	2012年7月12日	23.00	1,865,095	37,429,651.38	41,311,854.25	-
600565	迪马股份	2012年5月31日	重大资产重组	4.88	2012年7月23日	4.39	688,600	2,783,134.14	3,360,368.00	-

注：自2012年7月23日起，股票名称“晶源电子”变更为“同方国芯”，股票代码不变。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012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,无债券作为质押。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2012 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。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险,并设定适当的投资限额,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成:第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导;第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部及金融工程部所监控;第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在附注‘6.4.12’中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金主要投资于交易所股票市场,所持有的存在到期期限的金融资产和金融负债金额较小。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。除银行存款、结算备付金外,本基金所持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	3,279,257,863.78	-	-	-	-	3,279,257,863.78
结算备付金	7,909,329.70	-	-	-	-	7,909,329.70

存出保证金	-	-	-	-	3,824,004.90	3,824,004.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-7,990,923,336.37	7,990,923,336.37
应收证券清算款	-	-	-	-	878,913,748.92	878,913,748.92
应收利息	-	-	-	-	744,870.27	744,870.27
应收股利	-	-	-	-	5,822,356.06	5,822,356.06
应收申购款	397.32	-	-	-	268,785.55	269,182.87
资产总计	3,287,167,590.80	-	-	-	-8,880,497,102.07	12,167,664,692.87
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	6,086,083.07	6,086,083.07
应付赎回款	-	-	-	-	4,376,305.09	4,376,305.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	15,371,334.58	15,371,334.58
应付托管费	-	-	-	-	2,561,889.11	2,561,889.11
应付交易费用	-	-	-	-	3,324,442.88	3,324,442.88
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	1,949,967.98	1,949,967.98
负债总计	-	-	-	-	33,695,022.71	33,695,022.71
利率敏感度缺口	3,287,167,590.80	-	-	-	-8,846,802,079.36	12,133,969,670.16
上年度末 2011 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	4,682,897,085.80	-	-	-	-	4,682,897,085.80
结算备付金	7,974,921.02	-	-	-	-	7,974,921.02
存出保证金	-	-	-	-	4,531,144.94	4,531,144.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-7,643,121,958.20	7,643,121,958.20
应收利息	-	-	-	-	964,050.59	964,050.59
应收申购款	-	-	-	-	171,890.85	171,890.85
资产总计	4,690,872,006.82	-	-	-	-7,648,789,044.58	12,339,661,051.40
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	53,519,959.77	53,519,959.77
应付赎回款	-	-	-	-	3,937,454.91	3,937,454.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	16,275,797.13	16,275,797.13
应付托管费	-	-	-	-	2,712,632.86	2,712,632.86
应付交易费用	-	-	-	-	4,958,955.47	4,958,955.47
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	1,851,855.66	1,851,855.66
负债总计	-	-	-	-	83,281,655.80	83,281,655.80
利率敏感度缺口	4,690,872,006.82	-	-	-	-7,565,507,388.78	12,256,379,395.60

注：各期限分类的标准：按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大

影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金的投资方向界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的,具有良好流动性的 A 股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债券。现金资产主要投资于各类银行存款。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资,本基金有效降低了投资组合的其他价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%,债券投资比例为基金资产净值的 0%-35%,现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2012 年 6 月 30 日,本基金面临的整体其他价格风险列示如下:

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	7,990,923,336.37	65.86	7,643,121,958.20	62.36
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,990,923,336.37	65.86	7,643,121,958.20	62.36

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准的公允价值发生变化。	
	其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末(2012年6月30日)

1. 业绩比较基准的公允价值上升 5%	560, 579, 133. 18	555, 556, 857. 28
2. 业绩比较基准的公允价值下降 5%	-560, 579, 133. 18	-555, 556, 857. 28

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布, 在 95%的置信度下, 使用过去一年的历史数据, 按照 VaR 正态算法, 计算未来一个交易日里, 基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	置信度: 95%		
	观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	基金投资组合的风险价值	191, 943, 163. 74	183, 187, 728. 18
	合计	191, 943, 163. 74	183, 187, 728. 18

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定, 本基金自 2008 年 9 月 16 日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。

本基金所持有的股票中百集团(000759)自 2012 年 3 月 28 日起, 采用指数收益法进行估值, 对本基金当日净利润和资产净值的影响为减少人民币 5, 667, 896. 38 元, 根据中百集团复牌后的市场表现及基金的实际状况, 于 2012 年 4 月 24 日起对该股票恢复采用市价估值方法进行估值。

## § 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	权益投资	7, 990, 923, 336. 37	65. 67
	其中: 股票	7, 990, 923, 336. 37	65. 67
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	3,287,167,193.48	27.02
6	其他各项资产	889,574,163.02	7.31
7	合计	12,167,664,692.87	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	69,944,758.51	0.58
B	采掘业	471,025,709.66	3.88
C	制造业	4,740,064,706.87	39.06
C0	食品、饮料	625,724,606.56	5.16
C1	纺织、服装、皮毛	38,349,006.26	0.32
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	44,820,471.85	0.37
C4	石油、化学、塑胶、塑料	391,855,843.83	3.23
C5	电子	1,290,941,391.05	10.64
C6	金属、非金属	149,697,631.84	1.23
C7	机械、设备、仪表	1,459,827,267.81	12.03
C8	医药、生物制品	684,732,421.87	5.64
C99	其他制造业	54,116,065.80	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	344,248,250.44	2.84
E	建筑业	43,512,093.82	0.36
F	交通运输、仓储业	32,447,892.96	0.27
G	信息技术业	498,051,368.81	4.10
H	批发和零售贸易	319,289,628.38	2.63
I	金融、保险业	112,391,558.98	0.93
J	房地产业	530,727,964.79	4.37
K	社会服务业	284,234,612.45	2.34
L	传播与文化产业	312,120,343.89	2.57
M	综合类	232,864,446.81	1.92
	合计	7,990,923,336.37	65.86

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600060	海信电器	29,476,011	495,491,744.91	4.08

2	601857	中国石油	33,201,496	300,473,538.80	2.48
3	600812	华北制药	43,803,499	278,590,253.64	2.30
4	600031	三一重工	19,538,912	271,981,655.04	2.24
5	600519	贵州茅台	1,099,919	263,045,628.85	2.17
6	600007	中国国贸	25,013,549	260,140,909.60	2.14
7	000988	华工科技	18,773,310	258,508,478.70	2.13
8	600143	金发科技	42,644,963	254,590,429.11	2.10
9	000566	海南海药	12,079,589	233,136,067.70	1.92
10	600268	国电南自	23,035,575	205,707,684.75	1.70
11	002429	兆驰股份	16,641,589	188,049,955.70	1.55
12	000917	电广传媒	7,176,727	177,480,458.71	1.46
13	000930	中粮生化	35,969,137	174,810,005.82	1.44
14	600879	航天电子	21,897,827	172,554,876.76	1.42
15	600776	东方通信	30,613,574	159,190,584.80	1.31
16	600881	亚泰集团	27,340,904	150,374,972.00	1.24
17	600048	保利地产	12,839,018	145,594,464.12	1.20
18	601929	吉视传媒	13,781,200	116,588,952.00	0.96
19	000837	秦川发展	15,699,083	108,009,691.04	0.89
20	600011	华能国际	16,314,809	105,230,518.05	0.87
21	600376	首开股份	7,946,344	105,209,594.56	0.87
22	002052	同洲电子	10,203,579	99,484,895.25	0.82
23	600310	桂东电力	7,981,826	98,655,369.36	0.81
24	002025	航天电器	6,629,078	96,453,084.90	0.79
25	600456	宝钛股份	4,839,891	90,844,754.07	0.75
26	002311	海大集团	5,020,054	89,658,164.44	0.74
27	600804	鹏博士	14,252,415	84,659,345.10	0.70
28	000968	煤气化	5,510,224	84,030,916.00	0.69
29	600416	湘电股份	12,585,468	83,567,507.52	0.69
30	002385	大北农	3,965,268	76,926,199.20	0.63
31	000887	中鼎股份	8,992,477	76,346,129.73	0.63
32	002153	石基信息	2,773,563	71,141,890.95	0.59
33	600704	物产中大	7,952,414	70,856,008.74	0.58
34	600770	综艺股份	5,951,252	68,320,372.96	0.56
35	600361	华联综超	11,154,582	63,358,025.76	0.52
36	300139	福星晓程	2,269,988	62,924,067.36	0.52
37	600577	精达股份	11,083,794	62,512,598.16	0.52
38	600488	天药股份	10,799,300	60,368,087.00	0.50
39	601989	中国重工	10,800,000	56,052,000.00	0.46
40	000651	格力电器	2,562,443	53,426,936.55	0.44

41	002338	奥普光电	2,613,139	51,740,152.20	0.43
42	000998	隆平高科	2,899,907	51,705,341.81	0.43
43	002017	东信和平	4,543,288	51,111,990.00	0.42
44	600755	厦门国贸	10,145,081	50,725,405.00	0.42
45	601788	光大证券	3,733,176	49,165,927.92	0.41
46	600583	海油工程	7,999,942	48,719,646.78	0.40
47	600128	弘业股份	4,457,630	47,429,183.20	0.39
48	000402	金融街	6,999,817	45,708,805.01	0.38
49	002123	荣信股份	3,949,872	44,910,044.64	0.37
50	600079	人福医药	1,902,606	44,121,433.14	0.36
51	601668	中国建筑	13,027,573	43,512,093.82	0.36
52	000759	中百集团	5,795,632	43,119,502.08	0.36
53	002011	盾安环境	3,999,853	42,598,434.45	0.35
54	002049	晶源电子	1,865,095	41,311,854.25	0.34
55	600795	国电电力	15,099,049	40,767,432.30	0.34
56	600503	华丽家族	8,603,331	39,575,322.60	0.33
57	600104	上汽集团	2,749,872	39,295,670.88	0.32
58	300257	开山股份	1,243,809	35,448,556.50	0.29
59	600422	昆明制药	1,855,953	34,576,404.39	0.28
60	600525	长园集团	4,883,404	34,476,832.24	0.28
61	300156	天立环保	2,419,603	33,342,129.34	0.27
62	002430	杭氧股份	2,728,492	32,987,468.28	0.27
63	002023	海特高新	3,654,042	32,447,892.96	0.27
64	600969	郴电国际	2,101,541	31,670,222.87	0.26
65	002179	中航光电	2,266,960	31,102,691.20	0.26
66	600886	国投电力	6,938,813	30,114,448.42	0.25
67	600168	武汉控股	4,234,089	29,469,259.44	0.24
68	600511	国药股份	1,999,938	27,999,132.00	0.23
69	600663	陆家嘴	2,269,212	27,843,231.24	0.23
70	600157	永泰能源	2,961,034	26,886,188.72	0.22
71	600665	天地源	6,446,825	25,658,363.50	0.21
72	600850	华东电脑	999,943	25,188,564.17	0.21
73	600716	凤凰股份	5,000,000	24,950,000.00	0.21
74	000024	招商地产	1,000,000	24,530,000.00	0.20
75	600765	中航重机	2,999,665	23,127,417.15	0.19
76	600888	新疆众和	2,146,946	22,177,952.18	0.18
77	300315	掌趣科技	1,020,000	21,277,200.00	0.18
78	601328	交通银行	4,500,000	20,430,000.00	0.17
79	000727	华东科技	4,096,875	19,828,875.00	0.16



80	300017	网宿科技	1,215,677	19,815,535.10	0.16
81	002235	安妮股份	2,271,891	19,424,668.05	0.16
82	000635	英力特	1,960,000	19,325,600.00	0.16
83	600141	XD 兴发集	914,000	18,910,660.00	0.16
84	600016	民生银行	3,050,000	18,269,500.00	0.15
85	600639	浦东金桥	2,483,471	17,607,809.39	0.15
86	600657	信达地产	3,871,494	17,150,718.42	0.14
87	002045	国光电器	3,700,586	16,874,672.16	0.14
88	600383	金地集团	2,600,000	16,848,000.00	0.14
89	000598	兴蓉投资	2,003,200	16,326,080.00	0.13
90	600637	百视通	1,221,275	15,998,702.50	0.13
91	002156	通富微电	3,413,570	15,702,422.00	0.13
92	002036	宜科科技	991,657	15,420,266.35	0.13
93	000338	潍柴动力	509,903	15,139,020.07	0.12
94	000039	中集集团	1,100,000	14,630,000.00	0.12
95	600135	乐凯胶片	1,705,650	14,463,912.00	0.12
96	600622	嘉宝集团	2,303,919	14,169,101.85	0.12
97	300057	万顺股份	1,926,148	14,060,880.40	0.12
98	000006	深振业 A	2,439,695	13,930,658.45	0.11
99	601166	兴业银行	1,050,000	13,629,000.00	0.11
100	000901	航天科技	1,191,627	13,513,050.18	0.11
101	000537	广宇发展	1,689,908	12,150,438.52	0.10
102	000860	顺鑫农业	742,835	11,900,216.70	0.10
103	002005	德豪润达	1,525,614	11,869,276.92	0.10
104	600690	青岛海尔	989,906	11,601,698.32	0.10
105	000739	普洛股份	1,355,550	11,413,731.00	0.09
106	002228	合兴包装	2,200,956	11,334,923.40	0.09
107	600823	世茂股份	1,027,601	11,283,058.98	0.09
108	600741	华域汽车	1,248,118	11,195,618.46	0.09
109	600107	美尔雅	1,339,735	10,543,714.45	0.09
110	600869	三普药业	429,002	10,060,096.90	0.08
111	600335	国机汽车	757,842	9,154,731.36	0.08
112	000690	宝新能源	1,900,000	8,341,000.00	0.07
113	000157	中联重科	800,000	8,024,000.00	0.07
114	600432	吉恩镍业	599,914	7,966,857.92	0.07
115	000848	承德露露	442,010	7,757,275.50	0.06
116	300079	数码视讯	449,940	7,478,002.80	0.06
117	002328	新朋股份	1,172,578	7,199,628.92	0.06
118	300077	国民技术	350,000	7,108,500.00	0.06

119	600495	晋西车轴	653,361	6,958,294.65	0.06
120	002111	威海广泰	797,400	6,777,900.00	0.06
121	600839	四川长虹	3,000,000	6,330,000.00	0.05
122	000919	金陵药业	724,000	6,096,080.00	0.05
123	002106	莱宝高科	301,769	6,056,503.83	0.05
124	002611	东方精工	584,962	5,802,823.04	0.05
125	600626	申达股份	1,499,940	5,474,781.00	0.05
126	600859	王府井	199,985	5,471,589.60	0.05
127	002485	希努尔	479,898	5,422,847.40	0.04
128	600814	杭州解百	880,000	5,253,600.00	0.04
129	300182	捷成股份	220,747	5,187,554.50	0.04
130	000721	西安饮食	770,503	5,139,255.01	0.04
131	002570	贝因美	252,039	5,078,585.85	0.04
132	300195	长荣股份	202,479	4,987,057.77	0.04
133	002249	大洋电机	531,455	4,942,531.50	0.04
134	600837	海通证券	500,000	4,815,000.00	0.04
135	002554	惠博普	449,865	4,768,569.00	0.04
136	300038	梅泰诺	506,878	4,627,796.14	0.04
137	300236	上海新阳	344,943	4,460,112.99	0.04
138	600590	泰豪科技	625,000	4,268,750.00	0.04
139	601268	二重重装	686,860	4,210,451.80	0.03
140	600707	彩虹股份	687,790	4,071,716.80	0.03
141	000100	TCL 集团	2,000,000	4,060,000.00	0.03
142	600582	天地科技	270,000	3,901,500.00	0.03
143	600354	敦煌种业	660,000	3,874,200.00	0.03
144	600815	厦工股份	418,042	3,866,888.50	0.03
145	000589	黔轮胎 A	700,000	3,759,000.00	0.03
146	002332	仙琚制药	300,000	3,750,000.00	0.03
147	600199	金种子酒	150,000	3,747,000.00	0.03
148	000501	鄂武商 A	250,300	3,724,464.00	0.03
149	600565	迪马股份	688,600	3,360,368.00	0.03
150	600552	方兴科技	155,503	3,304,438.75	0.03
151	300164	通源石油	220,000	3,214,200.00	0.03
152	002003	伟星股份	303,442	3,004,075.80	0.02
153	300309	吉艾科技	99,954	2,932,650.36	0.02
154	002073	软控股份	348,722	2,922,290.36	0.02
155	601318	中国平安	60,000	2,744,400.00	0.02
156	002271	东方雨虹	200,000	2,720,000.00	0.02
157	000656	金科股份	250,000	2,687,500.00	0.02

158	000597	东北制药	379,749	2,620,268.10	0.02
159	600258	首旅股份	210,000	2,559,900.00	0.02
160	300023	宝德股份	200,000	2,528,000.00	0.02
161	601106	中国一重	800,000	2,528,000.00	0.02
162	600108	亚盛集团	500,000	2,465,000.00	0.02
163	601628	中国人寿	130,699	2,391,791.70	0.02
164	300173	松德股份	253,674	2,206,963.80	0.02
165	600373	中文传媒	142,913	2,052,230.68	0.02
166	600300	维维股份	210,000	1,990,800.00	0.02
167	300100	双林股份	141,999	1,831,787.10	0.02
168	600207	ST 安彩	458,600	1,705,992.00	0.01
169	600177	雅戈尔	175,194	1,487,397.06	0.01
170	000995	ST 皇台	112,690	1,402,990.50	0.01
171	600998	九州通	101,100	1,352,718.00	0.01
172	000799	酒 鬼 酒	24,961	1,307,956.40	0.01
173	600015	华夏银行	99,888	945,939.36	0.01
174	600460	士兰微	200,000	884,000.00	0.01
175	600516	方大炭素	100,000	854,000.00	0.01
176	600290	华仪电气	101,000	658,520.00	0.01
177	002006	精功科技	29,598	314,922.72	0.00
178	600138	中青旅	3,808	68,467.84	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600060	海信电器	249,766,673.09	2.04
2	601857	中国石油	234,844,609.46	1.92
3	600268	国电南自	214,254,685.91	1.75
4	600028	中国石化	208,515,684.32	1.70
5	002429	兆驰股份	182,042,764.73	1.49
6	000988	华工科技	159,742,902.77	1.30
7	601929	吉视传媒	147,000,000.00	1.20
8	600694	大商股份	132,671,029.48	1.08
9	601788	光大证券	130,494,359.25	1.06
10	600770	综艺股份	120,542,935.89	0.98
11	600031	三一重工	111,603,660.33	0.91

12	600736	苏州高新	109,128,130.18	0.89
13	601601	中国太保	107,379,177.22	0.88
14	600776	东方通信	106,201,837.89	0.87
15	600011	华能国际	102,793,584.87	0.84
16	600456	宝钛股份	100,959,033.86	0.82
17	000917	电广传媒	99,291,767.46	0.81
18	600837	海通证券	83,066,123.69	0.68
19	600704	物产中大	82,922,490.96	0.68
20	600787	中储股份	79,057,355.59	0.65

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600787	中储股份	284,544,801.10	2.32
2	600143	金发科技	282,496,461.01	2.30
3	600770	综艺股份	275,892,301.59	2.25
4	601628	中国人寿	257,791,619.14	2.10
5	600028	中国石化	246,280,598.06	2.01
6	000968	煤气化	229,450,032.80	1.87
7	000528	柳工	207,151,633.76	1.69
8	000009	中国宝安	200,838,000.66	1.64
9	600815	厦工股份	148,843,647.02	1.21
10	600694	大商股份	143,131,896.30	1.17
11	600888	新疆众和	123,885,551.01	1.01
12	600736	苏州高新	117,820,789.84	0.96
13	600031	三一重工	103,804,657.21	0.85
14	601601	中国太保	102,083,026.19	0.83
15	002052	同洲电子	89,448,238.22	0.73
16	601989	中国重工	87,583,754.71	0.71
17	600837	海通证券	87,356,674.08	0.71
18	601788	光大证券	87,323,209.63	0.71
19	000727	华东科技	78,613,221.33	0.64
20	300102	乾照光电	74,795,915.27	0.61

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,310,825,368.30
卖出股票收入（成交）总额	5,186,989,450.86

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1** 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体, 本期没有出现被监管部门立案调查的情形, 也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.9.2** 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,824,004.90
2	应收证券清算款	878,913,748.92
3	应收股利	5,822,356.06
4	应收利息	744,870.27
5	应收申购款	269,182.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	889,574,163.02

**7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
814,333	18,642.84	40,027,892.56	0.26%	15,141,452,983.85	99.74%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	691,112.85	0.00%

注：①本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

②本基金基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年12月19日）基金份额总额	379,177,416.36
本报告期期初基金份额总额	15,536,222,884.21
本报告期基金总申购份额	87,492,732.67
减：本报告期基金总赎回份额	442,234,740.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,181,480,876.41

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会, 没有基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金的投资组合策略没有发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	1,682,234,232.78	16.30%	1,366,827.88	15.75%	-
中信建投	1	1,410,073,051.83	13.66%	1,198,557.49	13.81%	-
中信证券	1	2,979,418,145.52	28.86%	2,539,303.42	29.27%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

国都证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	819,496,907.03	7.94%	665,846.89	7.67%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	127,466,776.97	1.23%	108,028.46	1.25%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	464,435,898.99	4.50%	394,767.08	4.55%	-
渤海证券	1	870,574,036.07	8.43%	748,977.59	8.63%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	665,541,743.43	6.45%	565,707.46	6.52%	-
东吴证券	1	490,553,684.68	4.75%	416,971.05	4.81%	-
宏源证券	1	420,845,612.90	4.08%	341,941.15	3.94%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	392,121,407.36	3.80%	328,852.27	3.79%	-

注：本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本期新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：国海证券股份有限公司（1 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需, 并能为本基金提供全面的信息服。
- (6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券回购交易
------	--------



	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
申银万国	-	-
招商证券	-	-
中信建投	-	-
中信证券	4,200,400,000.00	80.77%
国泰君安	-	-
德邦证券	-	-
国都证券	-	-
银河证券	-	-
安信证券	-	-
华泰证券	-	-
山西证券	-	-
长城证券	-	-
海通证券	-	-
渤海证券	1,000,000,000.00	19.23%
中投证券	-	-
广发证券	-	-
瑞银证券	-	-
中航证券	-	-
东吴证券	-	-
宏源证券	-	-
长江证券	-	-
国海证券	-	-

注：本基金租用证券公司交易单元未进行债券和权证投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年1月11日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年1月20日
3	诺安股票证券投资基金 2011 年第四季度报告	《中国证券报》	2012年1月20日

		《上海证券报》 《证券时报》	
4	诺安股票证券投资基金招募说明书更新(2011年第2期)摘要	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年2月3日
5	诺安股票证券投资基金招募说明书更新(2011年第2期)	基金管理人网站	2012年2月3日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年2月6日
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券基金网上费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年2月13日
8	诺安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年2月25日
9	诺安基金管理有限公司关于开通浦发银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年3月12日
10	诺安股票证券投资基金 2011 年年度报告	基金管理人网站	2012年3月26日
11	诺安股票证券投资基金 2011 年年度报告摘要	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年3月26日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中百集团(000759)估值调整的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012年3月29日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率	《中国证券报》 《上海证券报》	2012年4月5日

	优惠活动的公告	《证券时报》	
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券自助式交易系统申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 4 月 9 日
15	诺安股票证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 4 月 23 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 4 月 28 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 4 月 28 日
18	诺安基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 5 月 23 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在渤海证券开通基金定投业务的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 5 月 29 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券网上定投业务申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 5 月 31 日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 6 月 28 日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2012 年 6 月 28 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参	《中国证券报》	2012 年 6 月 28 日

	加中国银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》 《证券时报》	
--	--------------------	-------------------	--

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安股票证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安股票证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安股票证券投资基金托管协议》。
- ④诺安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照。
- ⑤《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。
- ⑥诺安股票证券投资基金 2012 年半年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安股票证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2012 年 8 月 29 日