

值(元)占基金资产净值比例(%)\r\n 1 国家债券 191,211,000.00 29.65\r\n 3 金融债券 -\r\n 其中:政策性金融债 -\r\n 4 企业债券 228,917,000.00 35.50\r\n 5 企业短期融资券 80,090,000.00 12.42\r\n 6 可转债 23,626,304.00 3.66\r\n 7 其他 -\r\n 8 合计 523,844,304.00 81.24\r\n 5.5 报告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\r\n 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元)占基金资产净值比例(%) \r\n 1 1001042 10央行票据42 1,000,000 100,000,000.00 15.51\r\n 2 0801014 08央行票据14 500,000 50,655,000.00 7.86\r\n 3 0801017 08央行票据17 400,000 40,556,000.00 6.29\r\n 4 113001 中行转债 233,600 23,626,304.00 3.66\r\n 5 0980155 09新海连债 200,000 21,324,000.00 3.31\r\n 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细\r\n 序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元)占基金资产净值比例(%) \r\n 1 119004 澜电 03 200,000 20,133,853.15 3.12\r\n 5.7 报告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\r\n 本基金本报告期末未持有权证。 \r\n 5.8 投资组合报告附注\r\n 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。 \r\n 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的股票。 \r\n 其他资产构成\r\n 序号 名称 金额(元) \r\n 1 存出保证金 250,000.00\r\n 2 应收证券清算款 29,000,000.00\r\n 3 应收股利 -\r\n 4 应收利息 8,134,670.90\r\n 5 应收申购款 56,858,973.02\r\n 6 其他应收款 -\r\n 7 待摊费用 -\r\n 8 其他 -\r\n 9 合计 94,243,643.92\r\n 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细\r\n 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 \r\n 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明\r\n 序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元)占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明\r\n 1 002422 科伦药业 2,553,517.40 0.40 新发流通受限\r\n 2 002434 万里扬 2,359,206.06 0.37 新发流通受限\r\n 3 300070 碧水源 1,420,834.00 0.22 新发流通受限\r\n 4 002410 广联达 1,060,365.95 0.16 新发流通受限\r\n 5 002407 多氟多 972,860.70 0.15 新发流通受限\r\n 6 002428 云南锗业 818,005.68 0.13 新发流通受限\r\n §6 开放式基金份额变动\r\n 单位:份\r\n 本报告期初基金份额总额 376,835,967.02\r\n 本报告期基金总申购份额 350,114,994.19\r\n 减:本报告期基金总赎回份额 151,505,252.09\r\n 本报告期基金拆分变动份额 -\r\n 本报告期末基金份额总额 575,445,709.12\r\n §7 备查文件目录\r\n 7.1 备查文件目录\r\n ①中国证券监督管理委员会批准原诺安中短期债券投资基金募集的文件。②中国证券监督管理委员会核准原诺安中短期债券投资基金转型为诺安优化收益债券型证券投资基金的批复。③《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》。④《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》。⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。⑥诺安优化收益债券型证券投资基金2010年第二季度报告正文。⑦报告期内诺安优化收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。 \r\n 7.2 存放地点\r\n 基金管理人、基金托管人住所。 \r\n 7.3 查阅方式\r\n 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 \r\n 投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人客户服务中心电话:0755-83026888,或全国统一客户服务热线:400-888-8998,亦可登陆基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。 \r\n 诺安基金管理有限公司\r\n {"noticeType": "1"}, {"noticeDate": "2010-07-13"}, {"noticeTitle": "诺安基金管理有限公司关于增加农行申购(780288)为旗下部分基金代销机构并同时开通基金定投业务的公告", "noticeContent": "诺安基金管理有限公司关于增加中国农业银行为旗下部分基金代销机构并同时开通基金定投业务的公告\r\n 诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司")与中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")签署的基金销售代理协议,本公司新增中国农业银行为旗下诺安股票证券投资基金(基金简称:诺安股票,基金代码:320003)、诺安优化收益债券型证券投资基金(基金简称:诺安优化收益债券,基金代码:320004)及诺安灵活配置混合型证券投资基金(基金简称:诺安灵活配置混合,基金代码:320006)的代销机构。 \r\n 自2010年7月15日起,投资者可在中国农业银行的各营业网点办理上述基金的开户、申购、赎回等业务。 \r\n 同时,本公司将在中国农业银行开通诺安股票、诺安优化收益债券及诺安灵活配置混合的定期定额投资业务,每期最低申购金额为人民币200元(含200元),具体办理规则请遵守中国农业银行的相关规定。 \r\n 提示:因技术原因,本公司上述基金在中国农业银行暂不开办转托管业务,敬请投资者留意。 \r\n 投资者可以通过以下途径咨询有关情况: \r\n 1、中国农业银行股份有限公司\r\n 客户服务热线:95599,或前往各营业网点咨询\r\n 网站:www.abchina.com\r\n 2、诺安基金管理有限公司\r\n 客户服务热线:400-888-8998(免长途费)、0755-83026888,网站:www.lionfund.com.cn\r\n 特此公告。 \r\n 诺安基金管理有限公司\r\n 二〇一〇年七月十三日", "noticeType": "3"}, {"noticeDate": "2010-06-05"}, {"noticeTitle": "诺安基金管理有限公司关于旗下基金在申银万国证券开通定期定额投资业务的公告", "noticeContent": "诺安基金管理有限公司关于旗下基金在申银万国证券开通定期定额投资业务的公告\r\n 为满足广大投资者的理财需求,经与申银万国证券股份有限公司(以下简称"申银万国证券")协商,诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定,自2010年6月7日起,在申银万国证券开通本公司旗下基金的定期定额投资业务(以下简称:"基金定投")。 \r\n 基金定投指投资者可通过本公司指定的基金销售机构提交申请,约定每期扣款时间和扣款金额,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。 \r\n 现将有关事项公告如下: \r\n 一、适用投资者范围\r\n 中华人民共和国境内合格的个人投资者。 \r\n 二、适用基金\r\n 诺安平衡证券投资基金(基金代码:320001)、诺安货币市场基金(基金代码:320002)、诺安股票证券投资基金(基金代码:320003)、诺安优化收益债券型证券投资基金(基金代码:320004)、诺安价值增长股票证券投资基金(基金代码:320005)、诺安灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:320006)、诺安成长股票型证券投资基金(基金代码:320007)、诺安增利债券型证券投资基金(基金代码:A级320008、B级320009)、诺安中证100指数证券投资基金(基金代码:320010)以及诺安中小盘精选股票型证券投资基金(基金代码:320011)。 \r\n 三、办理时间及规则\r\n 自2010年6月7日起,投资者可到申银万国证券各指定营业网点办理上述基金的定投业务申请,基金定投的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购业务受理时间相同。具体办理规则请遵循申银万国证券的相关规定。 \r\n 四、申购费率的说明\r\n 基金定投申购费率同普通申购费率。 \r\n 五、投资金额\r\n 投资者可到申银万国证券各指定营业网点申请开办基金定投业务并约定每期扣款时间及固定的投资金额,该投资金额即为申购金额,每期申购金额不低于人民币500元(含500元)。 \r\n 六、交易确认\r\n 每期实际扣款日即为基金申购申请日,并以该日(T日)的基金份额净值为基准计算申购份额,申购份额将在T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户内。基金份额确认查询和赎回起始日为T+2工作日。 \r\n 为使您及时掌握定投申请的确认结果,请投资者在T+2工作日起到本公司或申银万国证券各指定营业网点查询确认结果。 \r\n 投资者办理本业务后,可在本基金交易时间内随时办理基金的赎回。如无另行公告,本业务已申购份额的赎回及赎回费率等同于正常的赎回业务。赎回时遵循"先进先出"规则。 \r\n 七、咨询方式\r\n 1、申银万国证券股份有限公司\r\n 客服电话:021-962505;或前往申银万国证券各营业网点进行咨询。 \r\n 网站:www.sywg.com\r\n 2、诺安基金管理有限公司\r\n 客服电话:400-888-8998(免长途费),0755-83026888\r\n 网站:www.lionfund.com.cn\r\n 八、风险提示\r\n 本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。 \r\n 特此公告。 \r\n 诺安基金管理有限公司\r\n 二〇一〇年六月五日", "noticeType": "3"}, {"noticeDate": "2010-05-11"}, {"noticeTitle": "诺安优化(320004)第十次分红公告", "noticeContent": "诺安优化收益债券型证券投资基金第十次分红公告\r\n 诺安优化收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")自基金合同生效以来取得了良好的投资业绩,本着及时回报投资者的原则,诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定对本基金进行第十次分红。根据《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,经基金管理人计算并由本基金的基金托管人华夏银行股份有限公司复核,截至2010年5月10日本基金的可分配收益为45,639,473.83元,本公司决定以2010年5月10日的可分配收益为基准,向本基金的基金持有人进行收益分配。收益分配方案公告如下: \r\n 一、收益分配方案\r\n 以本基金2010年5月10日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发红利0.15元。 \r\n 二、收益分配时间\r\n 1、权益登记日:2010年5月13日\r\n 2、现金红利发放日:2009年5月17日\r\n 3、选择红利再投资的投资者其现金红利转为基金份额的份额资产净值(NAV)确定日:2009年5月13日\r\n 4、红利再投资的基金份额可赎回起始日:2010年5月17日\r\n 三、收益分配对象\r\n 权益登记日在诺安基金管理有限公司登记在册的本基金的全体基金份额持有人。 \r\n 四、收益发放办法\r\n 1、选择现金红利方式的投资者的红利款将于2010年5月17日自基金托管账户划出。 \r\n 2、选择红利再投资方式的投资者由红利转得的基金份额将以2010年5月13日除权后的基金份额净值为计算基准确定再投资份额,本公司对红利再投资所产生的基金份额进行确认并通知各销售机构。2010年5月17日起投资者可以查询、赎回。 \r\n 五、有关税收和费用的说明\r\n 1、根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金向投资者分配的基金收益,暂免征收所得税。 \r\n 2、本次分红免收分红手续费。 \r\n 六、提示\r\n 1、权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红权益,权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红权益。 \r\n 2、权益登记日申请申购的金额以2010年5月13日除权后的基金份额净值为计算基准确定申购份额,权益登记日申请赎回的份额以2010年5月13日除权后的基金份额净值为计算基准确定赎回金额。 \r\n 3、对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金方式。 \r\n 4、本次分红确认的方式将按照投资者在权益登记日之前(不含2010年5月13日)最后一次选择的分红方式为准。 \r\n 5、若投资者选择红利再投资方式并在2010年5月13日申请赎回基金份额的,其账户余额(包括红利再投资份额)低于100份时,本基金将自动计算其分红收益,并与赎回款一起以现金形式支付。 \r\n 七、咨询办法\r\n 1、华夏银行、中国工商银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、中国光大银行、中国民生银行、浦发银行、深圳发展银行、北京银行、广东发展银行、平安银行、宁波银行、上海农商银行、杭州银行、南京银行、温州银行、江苏银行、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、中国银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、中信金通证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、上海证券、新时代证券、国联证券、浙商证券、平安证券、东莞证券、国都证券、宏源证券、齐鲁证券、金元证券、江南证券、德邦证券、广发华福证券、华龙证券、财通证券、中投证券、日信证券、江海证券、民族证券、华宝证券、爱建证券、华融证券、大通证券、方正证券、天相投顾等机构的代销网点。 \r\n 2、诺安基金管理有限公司全国统一客户服务热线:400-888-8998,客户服务中心咨询电话:0755-83026888\r\n 3、诺安基金管理有限公司网

站: www.lionfund.com.cn 特此公告。 诺安基金管理有限公司 二〇一〇年五月十一日, "noticeType": "2", {"noticeDate": "2010-04-20", "noticeTitle": "诺安优化(320004)2010年第一季度报告", "noticeContent": " 诺安优化收益债券型证券投资基金2010年第一季度报告 \r\n\r\n §1 重要提示 \r\n 本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。 \r\n 本基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月16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、误导性陈述或者重大遗漏。 \r\n 本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。 \r\n 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。 \r\n 本报告财务资料未经审计。 \r\n 本报告期自2010年1月1日起至3月31日止。 \r\n §2 基金产品概况 \r\n 基金简称 诺安优化收益债券 \r\n 基金主代码 320004 \r\n 基金运作方式 契约型开放式 \r\n 基金合同生效日 2007年8月29日 \r\n 报告期末基金份额总额 376,835,967.02 份 \r\n 投资目标 确保本金的稳妥和价值的稳定,力争为投资者提供高于投资基准的回报。 \r\n 投资策略 本基金的投资策略分为固定收益类品种投资策略和新股投资策略两部分: \r\n (1)固定收益类品种投资策略包括总体资产配置、类属资产配置、期限结构 \r\n 配置、具体个券选择策略和资产支持证券投资策略。 \r\n (2)新股申购策略:在我国证券市场中,由于一、二级市场价差的存在,参 \r\n 与新股申购常常能够取得较低风险的稳定收益。本基金将在充分研究新发 \r\n 股票基本面的前提下,参与新股申购,并且将所得新股在其可交易之日起 \r\n 得 60 个工作日内全部卖出。 \r\n 业绩比较基准 本基金的业绩比较基准是中信标普全债指数。 \r\n 风险收益特征 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益低于混合型基金、股票 \r\n 型基金,高于货币市场基金。 \r\n 基金管理人 诺安基金管理有限公司 \r\n 基金托管人 华夏银行股份有限公司 \r\n §3 主要财务指标和基金净值表现 \r\n 3.1 主要财务指标 \r\n 单位:人民币元 \r\n 主要财务指标报告期末(2010年1月1日至2010年3月31日) \r\n 1.本期已实现收益 12,733,028.27 \r\n 2.本期利润 17,301,110.04 \r\n 3.加权平均基金份额本期利润 0.0426 \r\n 4.期末基金资产净值 425,419,026.68 \r\n 5.期末基金份额净值 1.1289 \r\n 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。 \r\n 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。 \r\n 3.2 基金净值表现 \r\n 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 \r\n 业绩比较基 \r\n 净值增长率 净值增长率 业绩比较基 \r\n 阶段 准收益率标 ①-③ ②-④ \r\n ① 标准差 ② 准收益率 ③ \r\n ④ \r\n 过去三个月 4.14% 0.19% 1.70% 0.05% 2.44% 0.14% \r\n 注:2007年8月29日(含当日)后,本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”,业绩比较基准是中信标普全债指数。 \r\n 3.2.2 自基金转型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 \r\n 18.00% \r\n 16.00% \r\n 14.00% \r\n 12.00% \r\n 10.00% \r\n 8.00% \r\n 6.00% \r\n 4.00% \r\n 2.00% \r\n 0.00% \r\n -2.00% \r\n 2007-8-29 2008-6-29 2009-4-29 2010-2-28 \r\n 诺安优化收益债券 业绩比较基准收益率 \r\n 注:2007年8月29日(含当日)后,本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”,业绩比较基准是中信标普全债指数。 \r\n §4 管理人报告 \r\n 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 \r\n 任本基金的基金经理期限 证券从 \r\n 业年限 姓名 职务 说明 \r\n 任职日期 离任日期 业年限 \r\n 毕业于南京财经大学金融学院,具有基金 \r\n 本基金的 \r\n 从业经历。曾就职于南京商业银行业务资金运 \r\n 基金经理, \r\n 营销中心; 2004年12月加入诺安基金管理 \r\n 诺安货 币 2009年8月4 \r\n 张乐赛 - 5 有限公司,2006年8月起担任诺安货币市 场 基金 日 \r\n 场基金的基金 经理,2009年8月起担任诺 \r\n 的 基金 经 \r\n 安优化收益债券型证券投资基金的基金 \r\n 理。 \r\n 经理。 \r\n 注:①此处任职日期为公司作出决定并对外公告之日; \r\n ②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》等相关规定。 \r\n 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 \r\n 报告期间,诺安优化收益债券型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《诺安优化收益债券型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。 \r\n 4.3 公平交易专项说明 \r\n 4.3.1 公平交易制度的执行情况 \r\n 本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期未出现任何违反公平交易制度的行为。 \r\n 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 \r\n 本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。 \r\n 4.3.3 异常交易行为的专项说明 \r\n 报告期内,本基金不存在异常交易情况。 \r\n 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 \r\n 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 \r\n 2010年1季度在投资组合方面,本基金以中央银行票据、金融债和国债,以及高评级短期融资券、公司债、有银行的担保的资产证券化产品为主要投资对象,并坚持对各投资品种进行分散投资,使资产保持了较强的流动性,保障了投资者随时申购、赎回的需求,突出体现了诺安优化收益债券型证券投资基金“收益稳定,流动性强”的本色。 \r\n 1季度新股的持续发行以及其上市后优异的表现,给债券基金带来了很好的机会,我们积极参与新股的申购,同时加大信用债的配置比例,压缩利率产品的组合久期,取得了很好的回报。 \r\n 2010年2季度,经济将继续复苏,信贷增量将保持平稳,通胀的压力将会增大,国家有可能继续出台量化的紧缩政策,其中不排除择机加息的可能。这对债券市场将会产生一定的压力,目前的中长期利率产品有可能出现调整。资金面的趋紧、回购利率的提高和打新股收益的变化都会对债券收益率产生影响。 \r\n 本基金将压缩组合久期,采取哑铃型配置,保证组合良好的流动性,在此基础上获取更高的收益;同时积极地有选择性的参与新股申购,以获取更高的收益。 \r\n 4.4.2 报告期末基金的投资表现 \r\n 截至报告期末,本基金份额净值为1.1289,本报告期基金份额净值增长率为4.14%,同期业绩比较基准收益率为1.70%。 \r\n §5 投资组合报告 \r\n 5.1 报告期末基金资产组合情况 \r\n 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%) \r\n 1 权益投资 58,177,821.21 8.86 \r\n 其中: 股票 58,177,821.21 8.86 \r\n 2 固定收益投资 481,571,553.25 73.31 \r\n 其中: 债券 437,838,180.00 66.65 \r\n 资产支持证券 43,733,373.25 6.66 \r\n 3 金融衍生品投资 - - \r\n 4 买入返售金融资产 - - \r\n 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 - - \r\n 5 银行存款和结算备付金合计 22,830,684.48 3.48 \r\n 6 其他资产 94,334,769.16 14.36 \r\n 7 合计 656,914,828.10 100.00 \r\n 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 \r\n 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) \r\n A 农、林、牧、渔业 1,940,359.38 0.46 \r\n B 采掘业 3,901,248.16 0.92 \r\n C 制造业 26,646,862.87 6.26 \r\n C0 食品、饮料 5,052,870.68 1.19 \r\n C1 纺织、服装、皮毛 1,108,259.90 0.26 \r\n C2 木材、家具 0.00 0.00 \r\n C3 造纸、印刷 0.00 0.00 \r\n C4 石油、化学、塑胶、塑料 5,158,266.30 1.21 \r\n C5 电子 0.00 0.00 \r\n C6 金属、非金属 4,826,523.70 1.13 \r\n C7 机械、设备、仪表 6,534,591.48 1.54 \r\n C8 医药、生物制品 2,138,904.24 0.50 \r\n C9 其他制造业 1,827,446.57 0.43 \r\n D 电力、煤气及水的生产和供应业 584,652.48 0.14 \r\n E 建筑业 4,658,966.14 1.10 \r\n F 交通运输、仓储业 3,405,028.88 0.80 \r\n G 信息技术业 7,622,902.25 1.79 \r\n H 批发和零售贸易 981,117.56 0.23 \r\n I 金融、保险业 5,971,658.72 1.40 \r\n J 房地产业 0.00 0.00 \r\n K 社会服务业 2,238,167.95 0.53 \r\n L 传播与文化产业 0.00 0.00 \r\n M 综合类 226,856.82 0.05 \r\n 合计 58,177,821.21 13.68 \r\n 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 \r\n 占基金资产净 \r\n 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 值比例(%) \r\n 1 600999 招商证券 177,524 5,020,378.72 1.18 \r\n 2 300059 东方财富 37,054 3,213,322.88 0.76 \r\n 3 002320 海峡股份 49,869 3,159,699.84 0.74 \r\n 4 002311 海大集团 78,119 2,806,034.48 0.66 \r\n 5 002340 格林美 26,443 2,139,767.56 0.50 \r\n 6 002310 东方园林 16,871 2,107,187.90 0.50 \r\n 7 002321 华英农业 82,149 1,940,359.38 0.46 \r\n 8 002375 亚厦股份 40,504 1,833,211.04 0.43 \r\n 9 002353 杰瑞股份 18,530 1,745,896.60 0.41 \r\n 10 601888 中国国旅 89,359 1,669,226.12 0.39 \r\n 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 \r\n 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) \r\n 1 国家债券 40,656,000.00 9.56 \r\n 2 央行票据 160,845,000.00 37.81 \r\n 3 金融债券 - - \r\n 其中: 政策性金融债 - - \r\n 4 企业债券 215,339,000.00 50.62 \r\n 5 企业短期融资券 20,122,000.00 4.73 \r\n 6 可转债 876,180.00 0.21 \r\n 7 其他 - - \r\n 8 合计 437,838,180.00 102.92 \r\n 5.5 报告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 \r\n 占基金资产净值 \r\n 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 比例(%) \r\n 1 0901044 09 央行票据44 700,000 68,838,000.00 16.18 \r\n 2 0801014 08 央行票据14 500,000 51,095,000.00 12.01 \r\n 3 0801017 08 央行票据17 400,000 40,912,000.00 9.62 \r\n 4 010704 07 国债 04 400,000 40,656,000.00 9.56 \r\n 5 122033 09 富力债 200,000 21,080,000.00 4.96 \r\n 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 \r\n 占基金资产净 \r\n 序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 值比例(%) \r\n 1 119004 澜电 03 200,000 20,133,853.15 4.73 \r\n 2 119009 宁建 04 195,000 19,506,450.00 4.59 \r\n 3 119005 浦建收益 400,000 4,093,070.10 0.96 \r\n 5.7 报告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 \r\n 本基金本报告期末未持有权证。 \r\n 5.8 投资组合报告附注 \r\n 5.8.1 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。 \r\n 5.8.2 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的股票。 \r\n 5.8.3 其他资产构成 \r\n 序号 名称 金额(元) \r\n 1 存出保证金 250,000.00 \r\n 2 应收证券清算款 87,273,186.12 \r\n 3 应收股利 - \r\n 4 应收利息 6,176,186.04 \r\n 5 应收申购款 635,397.00 \r\n 6 其他应收款 - \r\n 7 待摊费用 - \r\n 8 其他 - \r\n 9 合计 94,334,769.16 \r\n 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 \r\n 序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) \r\n 1 110006 龙盛转债 876,180.00 0.21 \r\n 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 \r\n 流通受限部分的公允 占基金资产净 \r\n 序号 股票代码 股票名称 流通受限情况说明 \r\n 值(元) 值比例(%) \r\n 1 300059 东方财富 3,213,322.88 0.76 新发流通受限 \r\n 2 002340 格林美 2,139,767.56 0.50 新发流通受限 \r\n 3 002375 亚厦股份 1,833,211.04 0.43 新发流通受限 \r\n 4 002353 杰瑞股份 1,745,896.60 0.41 新发流通受限 \r\n §6 开放式基金份额变动 \r\n 单位:份 \r\n 本报告期期初基金份额总额 466,869,612.51 \r\n 本报告期基金总申购份额 11,993,722.82 \r\n 减:本报告期基金总赎回份额 102,027,368.31 \r\n 本报告期基金拆分变动

份额 本报告期末基金份额总额 376,835,967.02 7.1 备查文件目录 ①中国证券监督管理委员会批准原诺安中短期债券投资基金募集的文件。 ②中国证券监督管理委员会核准原诺安中短期债券投资基金转型为诺安优化收益债券型证券投资基金的批复。 ③《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》。 ④《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》。 ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。 ⑥诺安优化收益债券型证券投资基金 2010 年第一季度报告正文。 ⑦报告期内诺安优化收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。 7.2 存放地点 基金管理人、基金托管人住所。 7.3 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客户服务中心电话：0755-83026888，或全国统一客户服务热线：400-888-8998，亦可登陆基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。 诺安基金管理有限公司 2010 年 4 月 20 日 {"noticeType": "1"}, {"noticeDate": "2010-04-14", "noticeTitle": "诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书 (更新)", "noticeContent": "诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书 (更新)", "noticeType": "4"}, {"noticeDate": "2010-04-13", "noticeTitle": "诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要", "noticeContent": "诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要", "noticeType": "4"}, {"noticeDate": "2010-03-31", "noticeTitle": "诺安优化(320004)2009 年年度报告摘要", "noticeContent": "诺安优化收益债券型证券投资基金 2009 年年度报告摘要"} §1 重要提示 1.1 重要提示 诺安优化收益债券型证券投资基金由诺安中短期债券投资基金转型而来。依据中国证监会 2007 年 8 月 23 日证监基金字[2007]239 号文核准的诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议，诺安中短期债券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略和费率结构，修订基金合同，并更名为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。自 2007 年 8 月 29 日起，由《诺安中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》生效，原《诺安中短期债券投资基金基金合同》自同一起失效。 因此，本次信息披露的相关内容将以转型后的“诺安优化收益债券型证券投资基金”的信息为主，涉及到原“诺安中短期债券投资基金”的财务数据等信息将会做特别的说明，敬请广大投资者留意。 基金管理人、基金托管人及基金销售机构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。 本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。 诺安优化收益债券型证券投资基金根据基金合同规定，于 2010 年 3 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。 诺安优化收益债券型证券投资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。 诺安优化收益债券型证券投资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。 本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。 本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。 §2 基金简介 2.1 基金基本情况 基金简称 诺安优化收益债券 基金主代码 320004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2007 年 8 月 29 日 基金管理人 诺安基金管理有限公司 基金托管人 华夏银行股份有限公司 报告期末基金份额总额 466,869,612.51 份 基金合同存续期 不定期 注：原“诺安中短期债券投资基金”的基金合同生效日为 2006 年 7 月 17 日，2007 年 8 月 29 日《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》生效，“诺安中短期债券投资基金”转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。 2.2 基金产品说明 基金的投资目标和价值的稳定，力争为投资者提供高于投资目标的投资回报。 诺安优化收益债券型证券投资基金的投资策略为固定收益类品种投资策略和新股投资 投资策略 策略两部分。(1) 固定收益类品种投资策略包括总体资产配置、类别资产配置、期限结构配置、具体个券选择策略和资产支持证券投资策略。(2) 新股申购策略：在我国证券市场，由于一、二级市场价差的存在，参与新股申购常常能够取得较低风险的稳定收益。 本基金将在充分研究新发股票基 本面的前提下，参与新股申购，并且将所得新股在其可交易之日起的 60 个交易日内全部卖出。 业绩比较基准 本基金的业绩比较基准是中信标普全债指数。 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益低于混合 风险收益特征 型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 2.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构 基金管理人 诺安基金管理有限公司 基金托管人 华夏银行股份有限公司 姓名 陈勇 郑鹏 信息披露负责人 联系电话 0755-83026688 010-85238418 电子邮箱 info@lionfund.com.cn zhijtg@hxb.com.cn 客户服务热线 400-888-8998 95577 传真 0755-83026677 010-85238680 2.4 信息披露方式 基金年度报告正文的管理人互联网网站 www.lionfund.com.cn 基金年度报告备置地点 诺安基金管理有限公司 基金年度报告备置地点 诺安基金管理有限公司 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 3.1 主要会计数据和财务指标 基金单位：人民币元 2007 年 08 月 29 日至 2007 年 12 月 31 日 期间数据和指标 2009 年 2008 年 2007 年 12 月 31 日 本期已实现收益 10,357,711.86 29,606,982.54 3,759,669.92 本期利润 16,729,910.08 12,444,913.27 35,158,987.21 加权平均基金份额本期利润 0.0370 0.0150 0.0637 本期基金份额净值增长率(%) 2.95 2.57 6.05 3.1.2 期末数据和指标 2009 年末 2008 年末 2007 年末 可供分配基金份额利润 0.0301 0.0152 0.0018 期末基金资产净值 506,099,979.77 495,246,967.45 1,696,530,689.47 期末基金份额净值 1.0840 1.0631 1.0565 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。 ③2007 年 8 月 29 日(含当日)前本基金的名称为“诺安中短期债券投资基金”，2007 年 8 月 29 日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。 转型生效后，基金份额累计净值增长率列示自基金成立日起至转型生效前一日止的数据，含转型生效后，此指标列示的是自基金转型生效日起的数据。 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 业绩比较基准 份额净值 份额净值增长 业绩比较基准 阶段 准收益率① - ③ ② - ④ 增长率① 率标准差② 准收益率③ 准差④ 过去三个月 3.44% 0.16% 0.36% 0.04% 3.08% 0.12% 过去六个月 3.81% 0.15% -0.15% 0.05% 3.96% 0.10% 过去一年 2.95% 0.13% 0.27% 0.06% 2.68% 0.07% 自基金转型 11.98% 0.15% 10.01% 0.08% 1.97% 0.07% 起至今 注：2007 年 8 月 29 日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，业绩比较基准是中信标普全债指数。 3.2.2 自基金转型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 注：2007 年 8 月 29 日(含当日)后，本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”，业绩比较基准是中信标普全债指数。 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 提示：本基金于 2007 年 8 月 29 日转型，2007 年本基金净值增长率按转型后实际存续期计算。 2007 年 8 月 29 日(基金转型生效日)至 2007 年 12 月 31 日基金业绩比较基准收益率为 0.02%，由于比例太小，在比较图中无法显示。 3.3 过去三年基金的利润分配情况 基金单位：人民币元 每 10 份基金 现金形式发放 再投资形式发 年度利润分配 年度 备注 基金份额分红数 总额 放总额 合计 本期分 2009 年 0.100 2,978,643.65 1,085,441.46 4,064,085.11 红一次 本期分 2008 年 0.200 9,950,719.01 8,356,102.59 18,306,821.60 红二次 2007 年 8 月 29 日(基 本期分 金转型生效日)至 0.150 7,452,246.67 6,449,187.03 13,901,433.70 红一次 2007 年 12 月 31 日 本期分 0.071 543,205.30 1,310,024.25 1,853,229.55 2007 年 8 月 28 日 红二次 合计 0.521 20,924,814.63 17,200,755.33 38,125,569.96 提示：本基金于 2007 年 8 月 29 日转型，2007 年本基金利润分配按转型前和转型后分别列示。 §4 基金管理人、基金托管人、基金销售机构 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、北京中关村科学城建设股份有限公司，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。 截至 2009 年 12 月 31 日，公司共管理九只开放式基金：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。 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 说明 任职日期 离任日期 限 毕业于南京财经大学 融学院，具有基金从业资格。 曾就职于南京商 本基金的基 业银行资金运营中 金经理，诺 心：2004 年 12 月加入诺 安货币市场 2009 年 8 月 4 日 - 5 安基金管理有限公 基金的基金 司，2006 年 8 月起担任诺 理，2009 年 8 月起担任诺 安优化收益债券型证券 投资基金基金 经理。 诺安优化收益债券型证券投资基金 2007 年 8 月 29 日 2009 年 8 月 4 日 9 毕业于中南财经政法大 金经理，诺 日 学金融专业，具有基金 安增利债券 从业资格。 曾任职于深 型证券投资 圳平安人寿保险公 司、 诺安基金 理人有限公司，曾任诺安 货币市场基金 基金经 理、诺安中短期债券投 资基金(现诺安优化收 益债券型证券投资基 金)基金经 理、诺安增利 债券型证券投资基 金基金经 理。 注：①此处钟志伟先生的任职日期为本基金转型后基金合同生效之日，钟志伟先生的离任日期以及张乐赛先生的任职日期均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《证券从业人员资格管理办法》等相关规定。 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 报告期间，诺安优化收益债券型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》其他有关法律法规，遵守了《诺安优化收益债券型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。 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 本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程，并通过系统和人工等方式在各环节严格控制，保证了公平交易的严格执行，本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合 4.3.3 异常交易行为的专项说明 报告期内，本基金不存在异常交易

情况。\\n 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 \\n 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 \\n 本基金继续坚持“确保本金的稳妥和价值的稳定，力争为投资者提供高于投资基准的回报”的投资目标，始终将确保本金的稳妥和价值的稳定放在首位，在投资管理过程中严格控制投资与交易风险，注重资产的流动性管理，对基金资产进行了合理配置。\\n 2009年本基金单位净值累计增长2.95%。自2008年四季度债市大涨之后，债券市场出现了较深幅度的回调，下半年IPO重启后，打新股为债券基金带来了超额的收益。本基金采取稳健的投资策略，适度进行波段操作，使资产保持了较强的流动性，保障了投资者随时申购、赎回的需求，突出体现了诺安优化收益债券型证券投资基金“收益稳定，流动性强”的本色。\\n 在投资组合方面，诺安优化收益债券型证券投资基金以中央银行票据、金融债和国债，以及高评级短期融资券、企业债为主要投资对象，并坚持对各投资品种进行分散投资。同时积极参与新股网下申购，为投资者获取了一定的回报。\\n 4.4.2 报告期内基金业绩的表现 \\n 截至报告期末，本基金份额净值为1.0840，本报告期份额净值增长率为2.95%，同期业绩比较基准收益率为0.27%。\\n 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 \\n 2010年全球经济环境扑朔迷离，经济复苏的过程不会一帆风顺，其间的波折是肯定的。国内适度宽松的货币政策和积极的财政政策的基调虽然已经确定，但对信贷增量的控制、经济结构的调整将是必然，流动性也不会再现2009年那种过度宽松的局面。历经调整之后的债券市场有可能出现机会，但新股定价过高，部分新股上市破发的现象将影响到打新股的收益。\\n 下一阶段，诺安优化收益债券型证券投资基金将压缩组合久期，采取子弹型配置，保证组合良好的流动性，同时有选择地参与新股申购，以力争为投资者获取较好的收益。\\n 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 \\n 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与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。\\n 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部、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验，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。\\n 报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。\\n 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 \\n 根据本基金基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，如当期出现净亏损，则不进行收益分配。\\n 本基金本期进行利润分配一次，共分配利润4,064,085.11元，每10份基金份额分红数为0.100元，符合本基金合同约定。\\n 截至2009年12月31日，本基金未分配而可供分配利润为14,056,780.90元。\\n §5 托管人报告 \\n 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 \\n 报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。\\n 5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 \\n 基金管理人应在报告期内的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面，严格遵守了有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。\\n 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 \\n 托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2009年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。\\n §6 审计报告 \\n 利安达会计师事务所及其经办注册会计师门焘、陈静于2010年3月15日出具了利安达审字[2010]第1008号“无保留意见的审计报告”。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。\\n §7 年度财务报表 \\n 7.1 资产负债表 \\n 会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金 \\n 报告截止日：2009年12月31日 \\n 单位：人民币元 \\n 本期末 上年度末 \\n 资产 \\n 2009年12月31日 2008年12月31日 \\n 资产： \\n 银行存款 145,381,277.46 4,602,504.31 \\n 结算备付金 1,190,801.49 2,551,142.05 \\n 存出保证金 250,000.00 250,000.00 \\n 交易性金融资产 565,893,122.15 529,788,637.20 \\n 其中：股票投资 58,720,851.90 \\n 债券投资 463,438,897.00 456,114,000.00 \\n 资产支持证券投资 43,733,373.25 73,674,637.20 \\n 衍生金融资产 - \\n 买入返售金融资产 - \\n 应收证券清算款 4,931,821.20 \\n 应收利息 7,382,948.80 9,290,191.26 \\n 应收股利 - \\n 应收申购款 10,072,900.00 457,929.74 \\n 其他资产 - \\n 资产总计 735,102,871.10 546,940,404.56 \\n 本期末 上年度末 \\n 负债和所有者权益 \\n 2009年12月31日 2008年12月31日 \\n 负债： \\n 短期借款 - \\n 交易性金融负债 - \\n 衍生金融负债 - \\n 卖出回购金融资产款 227,039,453.42 50,000,000.00 \\n 应付证券清算款 - \\n 应付赎回款 - \\n 应付管理人报酬 344,071.36 320,711.56 \\n 应付托管费 88,475.50 82,468.70 \\n 应付销售服务费 137,628.56 128,284.64 \\n 应付交易费用 22,043.37 7,855.53 \\n 应交税费 1,000,198.37 743,285.97 \\n 应付利息 14,560.75 1,285.71 \\n 应付利润 - \\n 其他负债 356,460.00 409,545.00 \\n 负债合计 229,002,891.33 51,693,437.11 \\n 所有者权益： \\n 实收基金 466,869,612.51 465,830,873.80 \\n 未分配利润 39,230,367.26 29,416,093.65 \\n 所有者权益合计 506,099,979.77 495,246,967.45 \\n 负债和所有者权益总计 735,102,871.10 546,940,404.56 \\n 注：报告截止日2009年12月31日，基金份额净值1.0840元，基金份额总额466,869,612.51份。\\n 7.2 利润表 \\n 会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金 \\n 本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日 \\n 单位：人民币元 \\n 本期 上年度可比期间 \\n 项目 2009年1月1日至2009年12月31日 2008年1月1日至2008年12月31日 \\n 一、收入 23,993,431.28 32,431,102.90 \\n 1.利息收入 15,609,015.95 28,923,282.71 \\n 其中：存款利息收入 425,305.58 1,458,856.83 \\n 债券利息收入 13,460,943.00 24,695,223.60 \\n 资产支持证券利息收入 1,626,270.77 2,731,508.99 \\n 买入返售金融资产收入 96,496.60 37,693.29 \\n 其他利息收入 - \\n 2.投资收益（损失以“-”填列） 1,996,381.53 20,508,979.19 \\n 其中：股票投资收益 1,843,159.77 14,676,485.54 \\n 债券投资收益 -158,496.54 5,245,906.25 \\n 资产支持证券投资收益 -138,233.43 - \\n 衍生工具收益 449,951.73 450,099.31 \\n 股利收益 -136,488.09 \\n 3.公允价值变动收益（损失以“-”填列） 6,372,198.22 -17,162,069.27 \\n 4.其他收入（损失以“-”填列） 15,835.58 160,910.27 \\n 减：二、费用 7,263,521.20 19,986,189.63 \\n 1. 管理人报酬 3,336,339.77 6,125,606.46 \\n 2. 托管费 857,915.92 1,575,155.90 \\n 3. 销售服务费 1,334,535.85 2,450,242.61 \\n 4. 交易费用 49,528.21 277,769.59 \\n 5. 利息支出 1,512,632.45 9,334,195.07 \\n 其中：卖出回购金融资产支出 1,512,632.45 9,334,195.07 \\n 6. 其他费用 172,569.00 223,220.00 \\n 三、利润总额（亏损总额以“-”填列） 16,729,910.08 12,444,913.27 \\n 四、净利润（净亏损以“-”填列） 16,729,910.08 12,444,913.27 \\n 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 \\n 会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金 \\n 本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日 \\n 单位：人民币元 \\n 本期 项目 2009年1月1日至2009年12月31日 \\n 实收基金 未分配利润 所有者权益合计 \\n 一、期初所有者权益（基 \\n 465,830,873.80 29,416,093.65 495,246,967.45 \\n 二、本期经营活动产生的 \\n 基金净值变动数（本期利 \\n 16,729,910.08 \\n 润） \\n 三、本期基金份额交易产 \\n 生的基金净值变动数 1,038,738.71 -2,851,551.36 -1,812,812.65 \\n （净值减少以“-”号填 \\n 列） \\n 其中：1.基金申购款 391,320,841.69 20,745,109.20 412,065,950.89 \\n 2.基金赎回款 -390,282,102.98 -23,596,660.56 -413,878,763.54 \\n 四、本期向基金份额持有 \\n 人分配利润产生的基金净 \\n -4,064,085.11 -4,064,085.11 值变动（净值减少以“-” \\n 号填列） \\n 五、期末所有者权益（基 \\n 466,869,612.51 39,230,367.26 506,099,979.77 \\n 净值） \\n 六、上年度可比期间 \\n 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 \\n 实收基金 未分配利润 所有者权益合计 \\n 一、期初所有者权益（基 \\n 465,830,873.80 29,416,093.65 495,246,967.45 \\n 净值） \\n 二、本期经营活动产生的 \\n 基金净值变动数（本期利 \\n 12,444,913.27 12,444,913.27 \\n 润） \\n 三、本期基金份额交易产 \\n 生的基金净值变动数 -1,139,987,927.43 -55,433,886.26 -1,195,421,813.69 \\n （净值减少以“-”号填 \\n 列） \\n 其中：1.基金申购款 437,960,840.08 24,086,801.36 462,047,641.44 \\n 2.基金赎回款 -1,577,948,767.51 -79,520,687.62 -1,657,469,455.13 \\n 四、本期向基金份额持有 \\n 人分配利润产生的基金净 \\n -18,306,821.60 -18,306,821.60 值变动（净值减少以“-” \\n 号填列） \\n 五、期末所有者权益（基 \\n 465,830,873.80 29,416,093.65 \\n 净值） \\n 七、报表附注为财务报表的组成部分。\\n 本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：\\n 薛有为 薛有为 \\n 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人 \\n 7.4 报表附注 \\n 7.4.1 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相一致的说明 \\n 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相一致。\\n 7.4.2 差错更正的说明 \\n 本基金本报告期无差错更正。\\n 7.4.3 关联方关系 \\n 关联方名称 与本基金的关系 \\n 中国对外经济贸易信托有限公司 管理人 深圳捷隆投资有限公司 管理人 北京中关村科技城市建设股份有限公司 管理人 诺安基金管理有限公司 发起人、管理人 华夏银行股份有限公司 托管人 中国中化集团公司 管理人 股东 \\n 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 \\n 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易 \\n 7.4.4.1.1 股票交易 \\n 本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。\\n 7.4.4.1.2 权证交易 \\n 本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。\\n 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金 \\n 本基金本报告期及其上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。\\n 7.4.4.2 关联方报酬 \\n 7.4.4.2.1 基金管理费 \\n 单位：人民币元 \\n 本期 上年度可比期间 \\n 项目 2009年1月1日至2009年12月 2008年1月1日至2008年12月 31日 31日 \\n 当期发生的基金应支付的管理费 3,336,339.77 6,125,606.46 \\n 其中：支付给销售机构的客户维护费 313,480.07 1,075,196.33 \\n 注：A.基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率计提，计算方法如下：\\n $H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$ \\n H为每日应支付的基金管理费 \\n E为前一日的基金资产净值 \\n 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。\\n 7.4.4.2.2 基金托管费 \\n 单位：人民币元 \\n 本期 上年度可比期间 \\n 项目 2009年1月1日至2009年12月 2008年1月1日至2008年12月 31日 31日 \\n 当期发生的基金应支付的托管费

857,915.92 1,575,155.90 注：A.基金托管费按前一日的基金资产净值的0.18%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.18\% / \text{当年天数}$ 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。

7.4.4.2.3 销售服务费 单位：人民币元 本期 获得销售服务费的各关联方名称 2009年1月1日至2009年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 诺安基金管理有限公司(管理人) 703,807.53 华夏银行股份有限公司 (托管人) 322,206.81 合计 1,026,014.34 上年度可比期间 获得销售服务费的各关联方名称 2008年1月1日至2008年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 诺安基金管理有限公司(管理人) 811,570.87 华夏银行股份有限公司 (托管人) 895,548.10 合计 1,707,118.97 注：A.基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.28%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.28\% / \text{当年天数}$ H为每日应计提的基金销售服务费 E为前一日的基金资产净值 B.基金销售服务费每日计算，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销售机构。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 单位：人民币元 本期 2009年 1月1日至2009年 12月 31日 与关联方进行银行间市场 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 交易的各关 基金买入 基金卖出 交易金额 利息收入 交易金额 利息支出 名称 华夏银行股份 有限公司 上年度可比期间 2008年 1月1日至2008年 12月 31日 银行间市场 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 交易的各关 基金买入 基金卖出 交易金额 利息收入 交易金额 利息支出 关联方名称 华夏银行股 份有限公司 注：本基金本报告期不存在与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 报告期内基金管理人无投资本基金的情况。 7.4.4.4.2 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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。 7.4.4.5 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 本期 上年度可比期间 关联方 2009年 1月1日至2009年 12月 31日 2008年 1月1日至2008年 12月 31日 名称 31日 期末余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入 华夏银行股份有限 145,381,277.46 411,131.79 4,602,504.31 1,329,196.08 公司 7.4.4.6 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。 7.4.4.7 其它关联交易事项的说明 本基金无其他关联交易事项。 7.4.5 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 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 7.4.5.1.1 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 期末成本总额 期末估值总额 代码 类型 价格 值单单位：股) 注 新发流 600999 招商证券 2009-11-12 2010-02-17 31.00 29.39 177,524 5,503,244.00 5,217,430.36 受限 新发流 601117 中国化学 2009-12-29 2010-01-07 5.43 5.43 12,000 65,160.00 65,160.00 受限 新发流 601139 深圳燃气 2009-12-15 2010-03-25 6.95 16.78 43,696 303,687.20 733,218.88 受限 新发流 601299 中国北车 2009-12-23 2010-03-29 5.56 6.13 386,225 2,147,411.00 2,367,559.25 受限 新发流 601888 中国国旅 2009-09-25 2010-01-15 11.78 20.94 89,359 1,052,649.02 1,871,177.46 受限 新发流 002302 西部建设 2009-10-22 2010-02-03 15.00 31.79 51,233 768,495.00 1,628,697.07 受限 新发流 002303 美盈森 2009-10-22 2010-02-03 25.36 31.50 51,415 1,303,884.40 1,619,572.50 受限 新发流 002304 洋河股份 2009-10-29 2010-02-08 60.00 113.99 13,734 824,040.00 1,565,538.66 受限 新发流 002305 南国置业 2009-10-29 2010-02-08 12.30 19.57 59,221 728,418.30 1,158,954.97 受限 新发流 002306 湘鄂情 2009-11-05 2010-02-11 18.90 33.36 46,639 881,477.10 1,555,877.04 受限 新发流 002310 东方园林 2009-11-20 2010-03-01 58.60 110.88 13,914 815,360.40 1,542,784.32 受限 新发流 002311 海大集团 2009-11-20 2010-03-01 28.00 37.54 78,969 2,211,132.00 2,964,496.26 受限 新发流 002313 日海通讯 2009-11-26 2010-03-03 24.80 40.82 17,281 428,568.80 705,410.42 受限 新发流 002317 众生药业 2009-12-03 2010-03-11 55.00 70.77 26,782 1,473,010.00 1,895,362.14 受限 新发流 002318 久立特材 2009-12-03 2010-03-11 23.00 33.13 22,581 519,363.00 748,108.53 受限 新发流 002319 乐通股份 2009-12-03 2010-03-11 13.70 31.28 34,019 466,060.30 1,064,114.32 受限 新发流 002320 海峡股份 2009-12-09 2010-03-16 33.60 51.18 49,869 1,675,598.40 2,552,295.42 受限 新发流 002321 华英农业 2009-12-09 2010-03-16 16.98 26.61 82,149 1,394,890.02 2,185,984.89 受限 新发流 002322 理工监测 2009-12-11 2010-03-18 40.00 61.88 5,453 218,120.00 337,431.64 受限 新发流 002325 洪涛股份 2009-12-15 2010-03-22 27.00 33.18 40,472 1,092,744.00 1,342,860.96 受限 新发流 002326 永太科技 2009-12-15 2010-03-22 20.00 31.27 37,849 756,980.00 1,183,538.23 受限 新发流 002327 富安娜 2009-12-22 2010-03-30 30.00 39.66 27,665 829,950.00 1,097,193.90 受限 新发流 002331 皖通科技 2009-12-25 2010-01-06 27.00 27.00 500 13,500.00 13,500.00 受限 新发流 300015 爱尔眼科 2009-10-15 2010-01-30 28.00 48.80 38,568 1,079,904.00 1,882,118.40 受限 新发流 300017 网宿科技 2009-10-15 2010-01-30 24.00 42.71 16,323 391,752.00 697,155.33 受限 新发流 300018 中元华电 2009-10-15 2010-01-30 32.18 48.57 44,226 1,423,192.68 2,148,056.82 受限 新发流 300019 硅宝科技 2009-10-15 2010-01-30 23.00 43.74 16,059 369,357.00 702,420.66 受限 新发流 300030 阳普医疗 2009-12-18 2010-03-25 25.00 35.10 25,052 626,300.00 879,325.20 受限 新发流 300036 超图软件 2009-12-18 2010-03-25 19.60 38.31 24,330 476,868.00 932,082.30 受限 新发流 300041 回天胶业 2009-12-28 2010-01-08 36.40 36.40 500 18,200.00 18,200.00 受限 7.4.5.1.2 受限证券类别：债券 证券代码 证券名称 成功认购日 可流通日 期末成本总额 期末估值总额 代码 类型 格 值单单位：张) 注 未上市流 122040 09新黄浦 2009-12-18 100.00 100.00 200,000 20,000,000.00 20,000,000.00 受限 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权证。 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金期末未持有暂时停牌股票。 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2009年12月31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168,039,453.42元，是以以上债券作为质押： 人民币元 期末估值单 债券代码 债券名称 回购到期日 数量(张) 期末估值总额 价 0701026 07 央行票据 26 2010-01-04 100.42 260,000 26,109,200.00 0981131 09 鲁商 CP01 2010-01-06 100.21 200,000 20,042,000.00 0981145 09 华侨城 CP01 2010-01-06 100.27 200,000 20,054,000.00 0980145 09 邕水务 2010-01-06 100.66 100,000 10,066,000.00 0701026 07 央行票据 26 2010-01-06 100.42 40,000 4,016,800.00 0901044 09 央行票据 44 2010-01-06 98.25 900,000 88,425,000.00 合计 1,700,000 168,713,000.00 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2009年12月31日止，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59,000,000.00元，于2009年1月4日到期。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或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。 8 投资组合报告 8.1 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 58,720,851.90 7.99 其中：股票 58,720,851.90 7.99 2 固定收益投资 507,172,270.25 68.99 其中：债券 463,438,897.00 63.04 资产支持证券 43,733,373.25 5.95 3 金融衍生品投资 4 买入返售金融资产 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 146,572,078.95 19.94 6 其他各项资产 22,637,670.00 3.08 7 合计 735,102,871.10 100.00 8.2 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 2,185,984.89 0.43 B 采掘业 C 制造业 27,091,756.96 3.53 C0 食品、饮料 5,507,749.92 0.73 C1 纺织、服装、皮毛 1,097,193.90 0.15 C2 木材、家具 2,586,304.98 0.34 C3 造纸、印刷 2,586,304.98 0.34 C4 石油、化学、塑胶、塑料 2,968,273.21 0.39 C5 电子 893,333.18 0.12 C6 金属、非金属 3,139,045.60 0.41 C7 机械、设备、仪表 6,894,643.65 0.91 C8 医药、生物制品 4,005,212.52 0.53 C9 其他制造业 2,970,118.70 0.39 D 电力、煤气及水的生产和供应业 733,218.88 0.10 E 建筑业 10,136,367.66 1.34 F 交通运输、仓储业 2,552,295.42 0.34 G 信息技术业 2,970,118.70 0.39 H 批发和零售贸易 I 金融、保险业 5,217,430.36 0.70 J 房地产业 2,459,346.13 0.33 K 社会服务业 5,374,332.90 0.72 L 传播与文化业 M 综合类 合计 58,720,851.90 7.99 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 金额单位：人民币元 占基金资产净值比例 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(%) 1 601668 中国建筑 6,534,627.44 1.32 2 600999 招商证券 5,503,244.00 1.11 3 601618 中国中冶 4,801,908.62 0.97 4 002311 海大集团 2,211,132.00 0.45 5

601299 中国北车 2,147,411.00 0.43\r\n 6 002320 海峡股份 1,675,598.40 0.34\r\n 7 002317 众生药业 1,473,010.00 0.30\r\n 8 300018 中元华电 1,423,192.68 0.29\r\n 9 002321 华英农业 1,394,890.02 0.28\r\n 10 002303 美盈森 1,303,884.40 0.26\r\n 11 002325 洪涛股份 1,092,744.00 0.22\r\n 12 300015 爱尔眼科 1,079,904.00 0.22\r\n 13 601888 中国国旅 1,052,649.02 0.21\r\n 14 002306 湘鄂情 881,477.10 0.18\r\n 15 002327 富安娜 829,950.00 0.17\r\n 16 002304 洋河股份 824,040.00 0.17\r\n 17 002310 东方园林 815,360.40 0.16\r\n 18 002282 博深工具 787,566.00 0.16\r\n 19 002302 西部建设 768,495.00 0.16\r\n 20 002326 永太科技 756,980.00 0.15\r\n 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。累计买入股票均为申购中签的股票。 \r\n 8.4.2 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\r\n 金额单位：人民币元\r\n 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(%) \r\n 1 601668 中国建筑 3,307,000.00 0.67\r\n 2 601618 中国中冶 1,631,000.00 0.33\r\n 3 002282 博深工具 1,159,228.00 0.23\r\n 4 002281 光迅科技 784,254.25 0.16\r\n 5 002289 宇顺电子 468,990.00 0.09\r\n 6 002283 天润曲轴 440,000.00 0.09\r\n 7 002284 亚太股份 357,252.00 0.07\r\n 8 300002 神州泰岳 45,950.00 0.01\r\n 9 300024 机器人 35,000.00 0.01\r\n 10 300005 探路者 21,890.00 0.00\r\n 11 300004 南风股份 17,500.00 0.00\r\n 12 002324 普利特 16,150.00 0.00\r\n 13 300010 立思辰 14,000.00 0.00\r\n 14 601107 四川成渝 8,430.00 0.00\r\n 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。 \r\n 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额\r\n 单位：人民币元\r\n 买入股票成本（成交）总额 47,218,373.06\r\n 卖出股票收入（成交）总额 8,306,644.25\r\n 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合\r\n 金额单位：人民币元\r\n 序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%) \r\n 1 国家债券 40,656,000.00 8.03\r\n 2 央行票据 240,386,000.00 47.50\r\n 3 金融债券 --\r\n 其中：政策性金融债 --\r\n 4 企业债券 141,027,000.00 27.87\r\n 5 企业短期融资券 40,096,000.00 7.92\r\n 6 可转债 1,273,897.00 0.25\r\n 7 其他 --\r\n 8 合计 463,438,897.00 91.57\r\n 8.6 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\r\n 金额单位：人民币元\r\n 占基金资产净值比\r\n 序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值\r\n 例(%) \r\n 1 0901044 09 央行票据44 1,200,000 117,900,000.00 23.30\r\n 2 0801014 08 央行票据14 500,000 51,300,000.00 10.14\r\n 3 0801017 08 央行票据17 400,000 41,060,000.00 8.11\r\n 4 010704 07 国债 04 400,000 40,656,000.00 8.03\r\n 5 0701026 07 央行票据26 300,000 30,126,000.00 5.95\r\n 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细\r\n 金额单位：人民币元\r\n 证券代\r\n 占基金资产净值比\r\n 序号 证券名称 数量（份） 公允价值\r\n 码 例(%) \r\n 1 119004 澜电 03 200,000 20,133,853.15 3.98\r\n 2 119009 宁建 04 195,000 19,506,450.00 3.85\r\n 3 119005 浦建收益 400,000 4,093,070.10 0.81\r\n 8.8 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\r\n 明细本基金本报告期末未持有权证。 \r\n 8.9 投资组合报告附注\r\n 8.9.1 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。 \r\n 8.9.2 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的股票。 \r\n 8.9.3 期末其他各项资产构成\r\n 金额单位：人民币元\r\n 序号 名称 金额\r\n 1 存出保证金 250,000.00\r\n 2 应收证券清算款 4,931,821.20\r\n 3 应收股利 -\r\n 4 应收利息 7,382,948.80\r\n 5 应收申购款 10,072,900.00\r\n 6 其他应收款 -\r\n 7 待摊费用 -\r\n 8 其他 -\r\n 9 合计 22,637,670.00\r\n 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细\r\n 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 \r\n 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明\r\n 金额单位：人民币元\r\n 占基金资产净\r\n 序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 流通受限情况说明\r\n 值比例(%) \r\n 1 600999 招商证券 5,217,430.36 1.03 新发流通受限\r\n 2 002311 海大集团 2,964,496.26 0.59 新发流通受限\r\n 3 002320 海峡股份 2,552,295.42 0.50 新发\r\n 流通受限\r\n 4 601299 中国北车 2,367,559.25 0.47 新发流通受限\r\n 5 002321 华英农业 2,185,984.89 0.43 新发流通受限\r\n 6 300018 中元华电 2,148,056.82 0.42 新发流通受限\r\n 7 002317 众生药业 1,895,362.14 0.37 新发流通受限\r\n 8 300015 爱尔眼科 1,882,118.40 0.37 新发流通受限\r\n 9 9 基金份额持有人信息\r\n 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构\r\n 份额单位：份\r\n 持有人结构\r\n 持有人户\r\n 均持有的 机构投资者 个人\r\n 投资者\r\n 数(户) 基金份额 占总份额\r\n 持有份额 持有份额\r\n 持有份额\r\n 比例(%) 比例(%) \r\n 101,758.85 341,285,437.32 73.10\r\n 125,584,175.19 26.90\r\n 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况\r\n 本基金项目 持有份额总数(份) 占基金总份额比例(%) \r\n 基金管理人公司\r\n 所有从业人员持有本\r\n 42,060.56 0.01\r\n 9.3 开放式基金\r\n 10 开放式基金份额变动\r\n 单位：份\r\n 基金转型日(2007年8月29日)基金份额总额\r\n 205,321,350.98\r\n 本报告期初基金份额总额 465,830,873.80\r\n 本报告期基金总申购份额 391,320,841.69\r\n 减：本报告期基金总赎回份额\r\n 390,282,102.98\r\n 本报告期基金拆分变动份额 -\r\n 本报告期末基金份额总额 466,869,612.51\r\n 注：① 总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回\r\n 份额含转换出份额。 \r\n ② 原基金合同生效日(2006年7月17日)基金份额总额 1,405,401,965.36份。 \r\n 11 重大事件揭示\r\n 11.1 基金份额持有人大会决议\r\n 本年度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\r\n 11.2 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\r\n 本基金管理人于2009年4月通过董事会决议，张小康先生不再担任公司董事职务，增补杨自理先生担任公司董事职务。 \r\n 2009年4月20日，本\r\n 基金托管人华夏银行股份有限公司发布了关于基金托管部负责人孙家春同志离任的公告。 \r\n 2009年7月15日，本基金托管人华夏银行股份有限公司发布了\r\n 关于基金托管部许明基金行业高管任职资格获得中国证监会核准的公告。 \r\n 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼\r\n 本报告期内无涉及\r\n 本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。 \r\n 11.4 基金投资策略的改变\r\n 本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。 \r\n 11.5 为基金进\r\n 行审计的会计师事务所情况\r\n 本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。本年度应付未付给所聘任会计师事务所的审计费为10万元，其已提供\r\n 审计服务的连续年限：4年。 \r\n 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况\r\n 本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到\r\n 监管部门稽查或处罚的任何情形。 \r\n 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况\r\n 11.7.1 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\r\n 金额单位：人民币元\r\n 股票交易 应支付该券商的佣金\r\n 交易单元 占当期股票 占当期佣 备\r\n 券商名称\r\n 数量 成交金额 成交总额的 佣金 金总量的\r\n 注\r\n 比例(%) 比例(%) \r\n 湘财证券有限责任公司 1 3,360,214.25 40.45 2,730.22 39.37 -\r\n 安信证券股份有限公司 1 4,946,430.00 59.55 4,204.37\r\n 60.63 -\r\n 注1、本报告期租用证券公司的交易单元无变更。 \r\n 2、专用交易单元的选择标准和程序\r\n 基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经\r\n 营机构的选择标准为：\r\n (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。 \r\n (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定。 \r\n (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。 \r\n (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\r\n 高度保密的要求。 \r\n (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要，并能为本基金提供全面的信息服务。 \r\n (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。 \r\n 基金管理人根据以上标准进行评估后确定\r\n 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》。 \r\n 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况\r\n 金额单位：\r\n 人民币元\r\n 债券交易 债券回购交易 权证交易\r\n 占当期债 占当期回 占当期权\r\n 券商名称\r\n 成交金额 券总额的 成交金额 购总额的 成交金额 证总额的\r\n 的\r\n 比例(%) 比例(%) 比例(%) \r\n 湘财证券有\r\n 限公司 100,254,299.18 81.07 - - -\r\n 限责任公司\r\n 安信证券股\r\n 份\r\n 23,408,849.12 18.93\r\n 1,131,400,000.00 100.00 1,548,166.13 100.00\r\n 份有限公司\r\n 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热线：400-888-8998或客户服务中心电话：0755-83026888，亦可登陆基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。 \r\n 诺安基金管理有限公司\r\n 2010年3月31\r\n 日"，"noticeType": "1"}，{"noticeDate": "2010-03-26"}，"noticeTitle": "诺安基金管理有限公司关于增加方正证券为旗下基金代销机构并同时开通定投及转换业务的\r\n 公告"，"noticeContent": "诺安基金管理有限公司关于增加方正证券为旗下基金代销机构并同时开通定投及转换业务的公告\r\n 根据诺安基金管理有限\r\n 公司（以下简称“本公司”）与方正证券有限责任公司（以下简称“方正证券”）签署的基金销售代理协议，本公司新增方正证券为旗下诺安平衡证券投资基\r\n 金（基金代码：320001）、诺安货币市场基金（基金代码：320002）、诺安股票证券投资基金（基金代码：320003）、诺安优化收益债券型证券投资基金\r\n （基金代码：320004）、诺安价值增长股票证券投资基金（基金代码：320005）、诺安灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：320006）、诺安成长股\r\n 票型证券投资基金（基金代码：320007）、诺安增利债券型证券投资基金（基金代码：A级320008、B级320009）及诺安中证100指数证券投资基金（基金\r\n 代码：320010）的代销机构。 \r\n 自2010年3月29日起，投资者可在方正证券的各营业网点办理上述基金的开户、申购、赎回等业务，进行相关信息查\r\n 询并享受相应的服务。 \r\n 为更好地满足广大投资者的需求，本公司自2010年3月29日起在方正证券同时开通上述各基金的定期定额投资业务及转换\r\n 业务。 \r\n 重要提示：\r\n 1、基金定期定额投资业务的申购费率同普通申购费率，投资者在方正证券办理上述基金的定期定额投资业务，每期最低\r\n 申购金额为人民币200元(含)。具体办理的业务规则和程序请遵循方正证券的规定。 \r\n 2、基金转换费用的收取方法及业务规则请参见各基金最新的招募\r\n 说明书及本公司已刊登的上述基金间办理转换业务的相关公告。本公司对基金转换的最低份额起点不设限制，如方正证券有其他规定的，遵循方正证券的\r\n 规定。 \r\n 3、诺安增利债券型证券投资基金的A级基金份额与B级基金份额之间不能直接进行转换。 \r\n 投资者可以通过以下途径咨询有关情况：\r\n 1、方正证券有限责任公司\r\n 客户服务热线：95571；或前往各营业网点咨询\r\n 公司网址：www.foundersc.com\r\n 2、诺安基金管理有\r\n 限公司\r\n 客服电话：400-888-8998（免长话费），0755-83026888\r\n 网站：www.lionfund.com.cn\r\n 特此公告。 \r\n 诺安基金管理\r\n 有限公司\r\n 二〇一〇年三月二十六日"，"noticeType": "3"}，"currencyDetail":\r\n {"fundCode": null, "purchaseFundCode": null, "fundName": null, "shareType": null, "riskLevel": null, "fundType": null, "fundGroup": null, "fundGroupName": null, "decimal\r\n []", "fundInfos": [], "rightPwd": true}