

11.51\ 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\ 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(\ 119004 澜电03 400,000.00 40,267,706.30 9.51\ 119009 宁建04 195,000.00 19,557,764.80 4.62\ 119005 浦建收益 400,000.00 13,849,166.10 3.27\ 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\ 本基金本报告期末未持有权证。 5.8 投资组合报告附注 5.8.1 本基金本报告期投资的前十名证券中没有被监管部门立案调查的发行主体,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。 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。 5.8.3 其他资产构成\ 序号 名称 金额(元) \ 1 存出保证金 250,000.00\ 2 应收证券清算款 0.00\ 3 应收股利 0.00\ 4 应收利息 7,317,478.39\ 5 应收申购款 84,800.00\ 6 其他应收款 0.00\ 7 其他 0.00\ 8 合计 7,652,278.39\ 5.8.4 报告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。 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明\ 本基金本报告期末未持有股票,无流通受限情况。 \ 6 开放式基金份额变动\ 单位:份 \ 报告期初基金份额总额 465,830,873.80\ 报告期间基金总申购份额 7,740,070.02\ 报告期间基金总赎回份额 66,522,435.05\ 报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) 0.00\ 报告期末基金份额总额 (H\ 000F\ 0001价值(\ 7 备查文件目录\ 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2009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\ 2009年4月21日\ 1\ 1\ 2009-04-13\ 诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要\ 2009-04-13\ 诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)\ 2009-04-03\ 诺安基金管理有限公司关于开通中国农业银行金穗卡网上直销定投业务并同时开展申购费率优惠活动的公告\ 诺安基金管理有限公司关于开通中国农业银行金穗卡网上直销定投业务并同时开展申购费率优惠活动的公告\ 为满足广大投资者的理财需求,诺安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2009年4月7日起在本公司直销网上交易平台对持有中国农业银行金穗卡的个人投资者开通基金定期定额投资业务(以下简称“网上直销定投”)。 同时,本公司决定自上述业务开通之日起开展网上直销定投申购费率优惠活动。 现将有关事项公告如下: 一、业务开通时间\ 自2009年4月7日起。 二、适用投资者\ 持有中国农业银行金穗卡的合格个人投资者。 三、开通方式\ 投资者登录本公司网站(www.lionfund.com.cn)后,点击“网上交易”菜单,新开通基金网上直销或登录网上交易,点击“定期定额申购开通”,按步骤完成定期定额投资协议签订,进行银行交易确认并签订定期三方扣款协议,即可开通网上直销定投。 四、适用基金\ 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)以及诺安成长股票型证券投资基金(基金代码:320007)。 除特别声明外,本公司今后发行和管理的开放式基金也将在适用范围之内。 五、适用费率\ 通过中国农业银行金穗卡在本公司网上交易系统定期定额申购本公司旗下所有(前端)非零申购费率基金的,其申购费率享有7折优惠。具体如下: 原申购费率(含分级费率)高于0.6%的,申购费率按7折优惠(即实收申购费率=原申购费率×0.7),但折扣后的实际执行费率不得低于0.6%,优惠后申购费率低于(或等于)0.6%的,一律按0.6%计算;原申购费率(含分级费率)低于0.6%(含0.6%)的,则按原费率执行。 各基金原费率详见各基金相关法律文件。 六、投资金额\ 投资者在办理网上直销定投时应约定每期固定的投资金额,该投资金额即为申购金额,每期申购金额的最高限额为人民币200元(含200元),最高限额为人民币10万元(含10万元)。本公司可根据有关规定对上述限额进行调整,并进行公告。 七、重要提示\ 1、本公告有关基金网上交易业务的解释权归本公司所有,其他规则详见本公司网站发布的《诺安基金管理有限公司直销网上交易定期定额申购业务规则》。 2、诺安成长股票型证券投资基金目前尚处于封闭期内,何时打开日常的申购、赎回等业务,敬请投资者留意本公司相关公告。 八、咨询方式\ 投资者可以通过拨打本公司客户服务热线400-888-8998(免长途费)或0755-83026888进行咨询;也可登陆本公司网站www.lionfund.com.cn了解相关情况。 风险提示: 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。 投资者申请使用网上交易业务前,应认真阅读有关网上交易协议、相关规则,了解网上交易的固有风险,投资者应慎重选择,并在使用时妥善保管好网上交易信息,特别是账号和密码。 \ 特此公告。 \ 诺安基金管理有限公司\ 2009年4月3日\ 3\ 2009-03-28\ 诺安优化(320004)2008年年度报告\ 诺安优化收益债券型证券投资基金2008年年度报告\ 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》自同日起失效。 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。 \ 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2009年3月20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。 \ 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。 \ 本基金本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。 \ 本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。 \ 1.2 目录\ 1 重要提示及目录\ 2\ 1.1 重要提示\ 2\ 1.2 目录\ 3\ 2 基金简介\ 5\ 2.1 基金基本情况\ 5\ 2.2 基金产品说明\ 5\ 2.3 基金管理人及基金托管人\ 5\ 2.4 信息披露方式\ 6\ 2.5 其他相关资料\ 6\ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况\ 6\ 3.1 主要会计数据和财务指标\ 6\ 3.2 基金净值表现\ 7\ 3.3 过去三年基金的利润分配情况\ 8\ 4 管理人报告\ 8\ 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遵规守信情况的说明\ 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\ 9\ 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况\ 10\ 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明\ 11\ 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明\ 11\ 5 托管人报告\ 11\ 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明\ 11\ 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\ 11\ 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\ 11\ 5.6 审计报告\ 12\ 5.7 年度财务报表\ 12\ 7.1 资产负债表\ 12\ 7.2 利润表\ 14\ 7.3 所有者权益(基金净值)变动表\ 14\ 7.4 报表附注\ 15\ 8 投资组合报告\ 33\ 8.1 期末基金资产组合情况\ 33\ 8.2 期末按行业分类的股票投资组合\ 34\ 8.3 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\ 34\ 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动\ 34\ 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合\ 35\ 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\ 36\ 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细\ 36\ 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明细\ 36\ 8.9 投资组合报告附注\ 36\ 9 基金份额持有人信息\ 37\ 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构\ 37\ 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\ 37\ 9.3 10 开放式基金变动\ 37\ 9.4 11 重大事件揭示\ 37\ 11.1 基金份额持有人大会决议\ 37\ 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\ 37\ 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金

基金的监察稽核工作情况
报告期内本基金管理人共管理了六只开放式基金——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及诺安灵活配置混合型证券投资基金。
在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以监察、稽核为主导的工作体系和流程。内部监察稽核人员依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。其中公司合法合规运作和内部风险控制的具体情况主要有：
1、报告期内，在公司各部门的积极配合下，监察稽核部对公司部分管理制度进行修订；同时，根据最新颁布的法律法规及公司业务发展的需要，制定了一系列新的规章制度。大力推进了公司的制度化建设步伐，完善了公司的制度体系，满足了法律法规及证监会的监管要求，对公司的业务运作也起到了较好的支持、指导作用，有效地推进了相关业务的发展，防范了相关风险。
2、严格进行投资风险的管理和控制，防范相关风险发生。监察稽核部会同公司投资部门根据法律法规及市场环境的变化，及时向公司投资决策委员会提出建议，对公司投资管理制度的修订进行了多次修订。在此基础上，加强了对投资风险尤其是流动性风险的控制，对各类风险控制指标进行了逐步细化和完善。通过对各项指标的监控来引导投资部门分散投资、理性投资，起到了良好的效果。
3、根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，监察稽核部在报告期内对公司各个部门进行了四次全面的监察稽核和多次临时性监察稽核。内容涉及公司及员工遵纪守法情况，内部控制制度、业务操作流程执行情况；涵盖基金销售、投资运作、后台保障等公司所有业务环节和工作岗位。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由监察稽核部跟踪问题的处理情况，确保了公司在各方面规范运作，切实地保障了基金份额持有人的利益。
4、对公司基金销售活动进行监督、指导，确保基金销售活动严格按照《销售管理办法》的规定处理基金代销机构、基金宣传推介材料、基金销售费用等方面的问题，不出现违法违规的情况。
同时，督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。
5、公司所有对外发布的文件、资料及宣传材料，都事先由监察稽核部进行合规性审查，确保其内容真实、准确、合规，符合中国证监会对信息披露的相关要求。
本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。
本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。
4.7 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。
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，并有权表决有关估值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，本基金未签订与估值相关的定价服务协议。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
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。
本基金本期进行利润分配两次，共分配利润18,306,821.60元，每10份基金份额分红数为0.200元，符合本基金合同约定。
截至2008年12月31日，本基金未分配而可供分配利润为7,091,053.64元。
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
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。
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
基金管理人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。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2008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。
5.6 审计报告
利安达审计[2009]第1062号
诺安优化收益债券型证券投资基金全体持有人：我们审计了后附的诺安优化收益债券型证券投资基金（以下简称诺安优化基金）财务报表，包括2008年12月31日的资产负债表，2008年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
一、管理层对财务报表的责任
按照企业会计准则、《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是诺安优化基金管理层的责任。这种责任包括：
（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
（2）选择和运用恰当的会计政策；
（3）作出合理的会计估计。
二、注册会计师的责任
我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。
审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。
我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
三、审计意见
我们认为，诺安优化基金财务报表已经按照企业会计准则、《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了诺安优化基金2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和基金净值变动情况。
利安达会计师事务所 中国注册会计师 门 熹
利安达会计师事务所 中国注册会计师 陈 静
中国北京二〇〇九年二月二十八日
7 年度财务报表
7.1 资产负债表
会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金
报告截止日：2008年12月31日
单位：人民币元
资产
附注号 本期末 上年度末
2008年12月31日 2007年12月31日
资产：
银行存款 7.4.7.1 4,602,504.31
198,429,570.57
结算备付金 2,551,142.05 2,226,177.88
存出保证金 250,000.00 250,000.00
交易性金融资产 7.4.7.2 529,788,637.20
1,475,005,826.05
其中：股票投资 0.00 61,563,146.15
债券投资 456,114,000.00 1,327,085,114.70
资产支持证券投资 73,674,637.20
86,357,565.20
衍生金融资产 7.4.7.3 0.00 0.00
买入返售金融资产 7.4.7.4 0.00 0.00
应收证券清算款 0.00 0.00
应收利息 7.4.7.5 9,290,191.26 17,677,715.06
应收股利 0.00 0.00
应收申购款 457,929.74 4,659,525.46
其他资产 7.4.7.6 0.00 0.00
资产总计 546,940,404.56 1,698,248,815.02
负债和所有者权益 附注号 本期末 上年度末
2008年12月31日 2007年12月31日
负债：
短期借款 0.00 0.00
交易性金融负债 0.00 0.00
衍生金融负债 7.4.7.3 0.00 0.00
卖出回购金融资产款 50,000,000.00 0.00
应付证券清算款 0.00 0.00
应付赎回款 0.00 0.00
应付管理人报酬 7.4.10.2.1 320,711.56 761,776.45
应付托管费 7.4.10.2.2 82,468.70 195,885.36
应付销售服务费 128,284.64 304,710.59
应付交易费用 7.4.7.7 7,855.53 45,008.15
应交税费 743,285.97 0.00
应付利息 1,285.71 0.00
应付利润 0.00 0.00
其他负债 409,545.00 410,745.00
负债合计 7.4.7.8 51,693,437.11 1,718,125.55
所有者权益：
实收基金 7.4.7.9 465,830,873.80 1,605,818,801.23
未分配利润 7.4.7.10 29,416,093.65 90,711,888.24
所有者权益合计 495,246,967.45 1,696,530,689.47
负债和所有者权益总计 546,940,404.56 1,698,248,815.02
注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值1.0631元，基金份额总额465,830,873.80份。
7.2 利润表
会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金
本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日
单位：人民币元
本期 上年度可比期间
项目 附注号 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入 32,431,102.90 47,524,605.98
1.利息收入 28,923,282.71 9,855,238.15
其中：存款利息收入 7.4.7.11 1,458,856.83 598,344.18
债券利息收入 24,695,223.60 7,836,001.20
资产支持证券利息收入 2,731,508.99 1,412,710.71
买入返售金融资产收入 37,693.29 8,182.06
其他利息收入 0.00 0.00
2.投资收益（损失以“-”填列） 20,508,979.19 5,806,781.84
其中：股票投资收益 7.4.7.12 14,676,485.54 4,501,755.82
债券投资收益 7.4.7.13 5,245,906.25 245,444.22
资产支持证券投资收益 0.00 422,380.11
衍生工具收益 7.4.7.14 450,099.31 637,201.69
股利收益 7.4.7.15 136,488.09 0.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列） 7.4.7.16 -17,162,069.27 31,494,485.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列） — —
5.其他收入（损失以“-”号填列） 7.4.7.17 160,910.27 368,100.42
二、费用（以“-”号填列） -19,986,189.63 -8,764,086.43
1. 管理人报酬 7.4.10.2.1 -6,125,606.46 -2,095,442.26
2. 托管费 7.4.10.2.2 -1,575,155.90 -594,530.73
3. 销售服务费 -2,450,242.61 -1,000,643.19
4. 交易费用 7.4.7.18 -277,769.59 -138,242.58
5. 利息支出 -9,334,195.07 -4,646,371.15
其中：卖出回购金融资产支出 -9,334,195.07 -4,646,371.15
6. 其他费用 7.4.7.19 -223,220.00 -288,856.52
三、利润总额（亏损总额以“-”填列） 38,760,519.55
7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金
本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日
单位：人民币元
本期 项目
2008年1月1日至2008年12月31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） 1,605,818,801.23 90,711,888.24 1,696,530,689.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 -12,444,913.27 12,444,913.27
（本期利润）
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动 -1,139,987,927.43 -55,433,886.26 -1,195,421,813.69
（净值减少以“-”号填列）
其中：1.基金申购款 437,960,840.08 24,086,801.36 462,047,641.44
2.基金赎回款（以“-”号填列） -1,577,948,767.51 -79,520,687.62 -1,657,469,455.13
四、本期向基金份额持有人

分配利润产生的 -18,306,821.60 -18,306,821.60

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) 465,830,873.80

29,416,093.65 495,246,967.45

上年度可比期间

项目 2007年1月1日至2007年12月31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) 215,469,023.45 612,255.79 216,081,279.24

二、本期经营活动产生的基金净值变动数 - 38,760,519.55 38,760,519.55

(本期利润)

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动 1,390,349,777.78 67,093,776.15 1,457,443,553.93

数 (净值减少以“-”号填列)

其中：1.基金申购款 2,099,392,885.89 88,980,839.94 2,188,373,725.83

2.基金赎回款 (以“-”号填列) -709,043,108.11 -21,887,063.79 -730,930,171.90

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 -15,754,663.25 -15,754,663.25

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) 1,605,818,801.23 90,711,888.24 1,696,530,689.47

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安优化收益债券型证券投资基金 (以下简称“本基金”) 系由诺安中短期债券投资基金转型而来。2007年7月11日至2007年8月9日, 本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会, 审议通过了《关于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有关事项的议案》, 经中国证券监督管理委员会 (简称“中国证监会”) 证监基金字[2007]239号文《关于核准诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》批准, 2007年8月29日原诺安中短期债券投资基金正式转型为诺安优化收益债券型证券投资基金。

原诺安中短期债券投资基金系经中国证监会证监基金字[2006]115号文《关于同意诺安中短期债券投资基金设立的批复》批准, 于2006年7月1日至2006年7月13日面向社会公开募集, 经利安达会计师事务所验资, 共募集资金人民币1,405,149,318.00元, 折合1,405,149,318.00份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币252,647.36元, 折合252,647.36份基金份额。以上实收基金共计人民币1,405,401,965.36元, 折合1,405,401,965.36份基金份额, 投资者户数共计6144户。

基金合同生效日为2006年7月17日, 合同生效日基金份额为1,405,401,965.36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, 基金托管人为华夏银行股份有限公司。基金管理人已将《诺安中短期债券投资基金基金合同》、《诺安中短期债券投资基金托管协议》修订为《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》、《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》, 并已经中国证监会核准备案。《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》、《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》自2007年8月29日起生效, 原《诺安中短期债券投资基金基金合同》、《诺安中短期债券投资基金托管协议》自同日起失效。

7.4.2 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2号《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 (试行)>》等问题的通知及其他相关规定和基金合同的规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

自公历1月1日至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产。本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资按持有意图和持有能力划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；本基金目前持有的其他金融资产划分为应收款项。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次付息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量, 期间取得的利息或现金股利, 应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法, 以成本进行后续计量, 在摊销时产生的利得或损失, 应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时, 终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时, 其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益, 同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价, 于股权分置改革方案实施后的股票复牌日, 冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益, 出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本, 按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账, 其中所包含的债券应收利息单独核算, 不构成债券投资成本；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券, 于成交日确认为债券投资。债券投资成本, 按成交总额扣除交易费用入账, 其中所包含的债券应收利息单独核算, 不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券, 根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后, 按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益；

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 资产支持证券投资

资产支持证券投资比照上述(2)中相关原则进行计算。

(4) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证, 在确认日记录所获分配的权证数量, 该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益, 出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日, 按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本, 按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后, 上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(4)中相关原则进行计算。

(6) 回购协议

基金持有的回购协议 (封闭式回购) 以成本列示, 按实际利率 (当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金根据上述原则确定的公允价值进行估值, 本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 股票投资

A. 上市流通的股票的估值

上市流通的股票2008年9月16日前, 按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券, 以最近一个交易日的收盘价计算；2008年9月16日起, 按如下方式估值：

(a) 对存在活跃市场的投资品种, 按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 应采用最近交易市价确定公允价值。

(b) 对存在活跃市场的投资品种, 如估值日无市价, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的, 应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价, 确定公允价值进行估值；

(c) 当投资品种不再存在活跃市场, 且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的, 应采用市场参与者普遍认同, 且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术, 确定投资品种的公允价值进行估值；

B. 未上市的股票的估值

(a) 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票, 以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值, 该日无交易的, 以最近一个交易日的收盘价计算；

(b) 首次公开发行的股票, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值, 该日无交易的, 以最近一个交易日的收盘价计算；

(c) 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

若非公开发行股票初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价 (收盘价), 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价 (收盘价) 估值；若非公开发行股票初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价 (收盘价), 按估值日内已发生交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 债券投资

A. 证券交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 以确定公允价格；

B. 证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值, 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 以确定公允价格；

C. 银行间同业市场交易的债券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值；

D. 同一债券同时在两个或两格以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值；

E. 未上市流通的债券采用估值技术确定的公允价值估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(3) 资产支持证券投资

资产支持证券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(4) 权证投资

A. 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格；

B. 未上市流通的权证采用估值技术确定

公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

(5)分离交易可转债上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(4)中的相关原则进行估值。

(6)其他A.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，本基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。B.相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销 当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金 实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金 损益平准金包括已实现和未实现两部分。(已实现)为在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益(损失)占基金净值比例计算的金额；(未实现)为在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。损益平准金(未实现)和损益平准金(已实现)均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量 (1)利息收入 A.存款利息收入、结算备付金利息收入和权证保证金利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；B.债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额入账。若票面利率与实际利率出现重大差异，则按实际利率计算利息收入；C.资产支持证券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额入账；D.买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小的，可按合同利率计算利息收入。(2)投资收益 A.股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本和相关费用的差额入账；B.债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额入账；C.资产支持证券投资收益/(损失)于卖出证券成交日按卖出证券成交金额与其成本和应收利息的差额入账；D.衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本和相关费用的差额入账；E.股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。(3)公允价值变动收益/(损失)于估值日按公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。(4)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量 (1)基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提；(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率逐日计提；(3)销售服务费按前一日基金资产净值的0.28%的年费率逐日计提；(4)卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小的，可按合同利率计算利息支出；(5)交易费用于金融资产交易实际发生时确认费用；(6)信息披露费、审计费用和债券托管账户维护费按期合理预估数额逐日计提；(7)其他费用于实际发生时确认费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策 (1)每一基金份额享有同等收益分配权；(2)投资者可以选择现金分红或红利再投资。若基金份额持有人未做选择，则默认对其收益的分配方式为现金分红；(3)如果基金份额持有人所获现金红利不足支付银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利转为基金份额；(4)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；(5)基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；(6)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，但若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；(7)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；(8)以不损害基金份额持有人利益为前提，基金管理人可以无需基金份额持有人大会审议通过酌情调整基金收益分配方案；(9)法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计 根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：(1)对于特殊事项停牌股票，2008年9月16日之前按停牌前最后交易日的收盘价格估值；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》，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重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。(2)按照中国证券登记结算有限责任公司发布《证券结算风险基金管理办法》的有关规定，自2008年1月1日起，暂停提取证券结算风险基金。(3)根据上海证券交易所《关于调整权证相关收费的通知》规定，自2008年8月22日起，权证交易经手费标准调整为成交金额(双向)的0.0045%，权证相关流量费恢复收取。(4)按照中国证券业协会《关于调整债券应收利息计算方式等问题的通知》的有关规定，自2008年3月17日起，银行间债券及交易所贴现债改用实际天数计算。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 7.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明 本基金本报告期无差错更正。

7.4.6 税项 7.4.6.1 印花税 (1)基金管理人运用基金买卖股票自2008年4月24日前，按照3‰的税率征收股票交易印花税。自2008年4月24日起至2008年9月18日止，股票交易印花税率由3‰调整为1‰。自2008年9月19日起，调整股票交易印花税为单边征收方式，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。

7.4.6.2 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。(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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明 7.4.7.1 银行存款 单位：人民币元 项目 本期末 上年度末 2008年12月31日 2007年12月31日 活期存款 4,602,504.31 198,429,570.57 定期存款 0.00 0.00 其他存款 0.00 0.00 合计 4,602,504.31 198,429,570.57

7.4.7.2 交易性金融资产 单位：人民币元 项目 本期末 公允价值 估值增值 股票 0.00 0.00 交易所市场 236,040,430.00 244,428,000.00 8,387,570.00 债券 银行间市场 205,741,153.70 211,686,000.00 5,944,846.30 合计 441,781,583.70 456,114,000.00 14,332,416.30 资产支持证券 73,674,637.20 73,674,637.20 0.00 其他 0.00 0.00 0.00 合计 515,456,220.90 529,788,637.20 14,332,416.30 上年度末 项目 2007年12月31日 成本 公允价值 估值增值 股票 30,728,143.55 61,563,146.15 30,835,002.60 交易所市场 738,058,371.30 738,623,114.70 564,743.40 债券 银行间市场 588,367,260.43 588,462,000.00 94,739.57 合计 1,326,425,631.73 1,327,085,114.70 659,482.97 资产支持证券 86,357,565.20 86,357,565.20 0.00 其他 0.00 0.00 0.00 合计 1,443,511,340.48 1,475,005,826.05 31,494,485.57 注：本年度及上年度本基金所投资的股票中，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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债 本基金本期末及上年度末不存在衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额 本基金本期末及上年度末不存在买入返售金融资产。 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券 本基金本期末及上年度末不存在买断式逆回购。

7.4.7.5 应收利息 单位：人民币元 项目 本期末 上年度末 2008年12月31日 2007年12月31日 应收活期存款利息 2,046.11 62,274.91 应收定期存款利息 0.00 0.00 应收其他存款利息 0.00 0.00 应收结算备付金利息 1,148.00 1,001.80 应收债券利息 8,573.896.70 16,684,346.16 应收买入返售证券利息 0.00 0.00 应收申购款利息 5.80 0.00 应收资产支持证券利息 713,094.65 930,092.19 其他 0.00 0.00 合计 9,290,191.26 17,677,715.06

7.4.7.6 其他资产 本基金本期末及上年度末无其他资产项目。

7.4.7.7 应付交易费用 单位：人民币元 项目 本期末 上年度末 2008年12月31日 2007年12月31日 交易所市场应付交易费用 4,017.01 355.00 银行间市场应付交易费用 3,838.52 44,653.15 合计 7,855.53 45,008.15

7.4.7.8 其他负债 单位：人民币元 项目 本期末 上年度末 2008年12月31日 2007年12月31日 应付券商交易单元保证金 250,000.00 250,000.00 应付赎回费 0.00 0.00 预提费用 159,500.00 159,500.00 其中：审计费用 100,000.00 100,000.00 信息披露费用 55,000.00 55,000.00 债券账户维护费 4,500.00 4,500.00 汇划费 45.00 1,245.00 合计 409,545.00 410,745.00

7.4.7.9 实收基金 金额单位：人民币元 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 基金份额(份) 账面金额 上年度末 1,605,818,801.23 1,605,818,801.23 本期申购 437,960,840.08 437,960,840.08 本期赎回 -1,577,948,767.51 -1,577,948,767.51 本期期末 465,830,873.80 465,830,873.80 注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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 2,873,375.14 87,838,513.10 90,711,888.24 本期利润 29,606,982.54 -17,162,069.27 12,444,913.27 本期基金份额交易产生 -7,082,482.44 -48,351,403.82 -55,433,886.26 产生的变动数 其中：基金申购款 3,465,782.33 20,621,019.03 24,086,801.36 基金赎回款 -10,548,264.77 -68,972,422.85 -79,520,687.62 本期已分配利润 -

18,306,821.60 0.00 -18,306,821.60 本期末 7,091,053.64 22,325,040.01 29,416,093.65 注: 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

7.4.7.11 存款利息收入 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 活期存款利息收入 1,329,196.08 567,442.63 定期存款利息收入 0.00 0.00 其他存款利息收入 4,339.20 24,832.50 结算备付金利息收入 125,321.55 6,069.05 其他 0.00 0.00 合计 1,458,856.83 598,344.18 注: 其他存款利息收入为认购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 卖出股票成交总额 87,554,121.36 9,279,330.82 卖出股票成本总额 -72,877,635.82 -4,777,575.00 买卖股票差价收入 14,676,485.54 4,501,755.82

7.4.7.13 债券投资收益 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 卖出债券(、债转股及债券到期) 1,960,563,262.91 1,508,610,375.62 成交金额 13,979,199.19 1,916,340,631.94 -1,500,072,098.21 成本总额 13,979,199.19 1,916,340,631.94 债券投资收益 5,245,906.25 245,444.22

7.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入 单位: 人民币元 项目 本期 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 卖出权证成交金额 4,197,844.88 962,944.11 卖出权证成本总额 -3,747,745.57 -325,742.42 买卖权证差价收入 450,099.31 637,201.69

7.4.7.15 股利收益 单位: 人民币元 项目 本期 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 股票投资产生的股利收益 136,488.09 0.00 基金投资产生的股利收益 - 合计 136,488.09 0.00

7.4.7.16 公允价值变动收益 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目名称 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 1.交易性金融资产 -17,162,069.27 31,494,485.57 ——股票投资 -30,835,002.60 30,835,002.60 ——债券投资 13,672,933.33 659,482.97 ——资产支持证券投资 0.00 0.00 2.衍生工具 0.00 0.00 ——权证投资 0.00 0.00 3.其他 0.00 0.00 合计 -17,162,069.27 31,494,485.57

7.4.7.17 其他收入 单位: 人民币元 项目 本期 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 基金赎回费收入 140,841.43 348,152.61 基金转换费收入 19,738.60 19,947.81 印花税费返还 30.24 - 其他 300.00 - 合计 160,910.27 368,100.42

注: “其他”为交易所逆回购手续费返还。

7.4.7.18 交易费用 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 交易所市场交易费用 240,497.52 55,921.26 银行间市场交易费用 37,272.07 82,321.32 合计 277,769.59 138,242.58

7.4.7.19 其他费用 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 审计费用 100,000.00 100,000.00 信息披露费 100,000.00 100,000.00 债券托管账户维护费 18,000.00 18,000.00 汇划费 5,220.00 27,068.52 持有人大会费用 - 43,288.00 其他 - 500.00 合计 223,220.00 288,856.52

注: “其他”为证券账户开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明 7.4.8.1 或有事项 无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项 无。

7.4.9 关联方关系 企业名称 与本企业的关系 中国对外经济贸易信托有限公司 管理人股东 深圳捷隆投资有限公司 管理人股东 中关村科学城建设股份有限公司 管理人股东 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 母公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易 7.4.10.1.1 股票交易 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。

7.4.10.1.2 权证交易 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金 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。

7.4.10.2 关联方报酬 7.4.10.2.1 基金管理费 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 当期应支付的管理费 6,125,606.46 2,095,442.26 其中: 当期已支付 5,804,894.90 1,333,665.81 期末未支付 320,711.56 761,776.45 注: A.2007年8月29日(含8月29日)转型前基金管理费按前一日基金资产净值的0.45%的年费率计提, 2007年8月29日转型后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: $H = E \cdot 4.5\% / \text{当年天数}$ 转型后: $H = E \cdot 7.0\% / \text{当年天数}$ H 为每日应支付的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 B. 基金管理人的管理费每日计提, 按月支付, 由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费 单位: 人民币元 本期 上年度可比期间 项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 当期应支付的托管费 1,575,155.90 594,530.73 其中: 当期已支付 1,492,687.20 398,645.37 期末未支付 82,468.70 195,885.36 注: A.2007年8月29日(含8月29日)转型前基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提, 2007年8月29日转型后基金托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提, 计算方法如下: $H = E \cdot 1.5\% / \text{当年天数}$ 转型后: $H = E \cdot 1.8\% / \text{当年天数}$ H 为每日应支付的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 B. 基金托管人的托管费每日计算, 每日计提, 按月支付, 由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.2.3 销售服务费 单位: 人民币元 本期 获得销售服务费的 2008年1月1日至2008年12月31日 各关联方名称 当期应支付的销售服务费 当期已支付 期末未支付 合计 诺安基金管理有限公司(管理人) 762,067.19 49,503.68 811,570.87 华夏银行股份有限公司(托管人) 854,381.92 41,166.18 895,548.10 合计 1,616,449.11 90,669.86 1,707,118.97 注: 上年度可比期间 获得销售服务费的 2007年1月1日至2007年12月31日 各关联方名称 当期应支付的销售服务费 当期已支付 期末未支付 合计 诺安基金管理有限公司(管理人) 498,941.86 25,937.40 524,879.26 华夏银行股份有限公司(托管人) 179,091.34 142,771.05 321,862.39 合计 678,033.20 168,708.45 846,741.65 注: A. 基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.28%的年费率计提。计算方法如下: $H = E \cdot 0.28\% / \text{当年天数}$ 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首两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。

7.4.10.3 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 2008年1月1日至2008年12月31日 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 银行间市场交易的基金 基金交易金 利息收 交易金额 利息支出 各关联方名称 买入 卖出 额 入 华夏银行股份有限公司 0.00 0.00 0.00 193,999,469.00 95,404.97 注: 2007年1月1日至2007年12月31日 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购 银行间市场交易的基金 基金交易金 利息收 交易金额 利息支出 各关联方名称 买入 卖出 额 入 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 注: 2007年与基金托管人无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 报告期内基金管理人无投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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 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。

7.4.10.5 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 本期 上年度可比期间 关联方 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日 名称 日 31日 期末余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入 华夏银行股份有限公司 4,602,504.31 1,329,196.08 198,429,570.57 567,442.63

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况 单位: 人民币元 序号 权益 除息日 每10份基金 现金形式 再投资形式 利润分配 备注 登记日 份额 分红数 发放总额 合计 2008-3-24 2008-3-24 0.100 4,947,950.88 5,647,349.56 10,595,300.44 - 2008-7-2 2008-7-2 0.100 5,002,768.13 2,708,753.03 7,711,521.16 - 合计 - 0.200 9,950,719.01 8,356,102.59 18,306,821.60 - 7.4.12 期末 (2008年12月31日) 本基金持有的流通受限证券 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金期末不存在流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票 本基金期末未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2008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0.00元, 无债券作为抵押。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2008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50,000,000.00元, 于2009年1月6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。

7.4.13 金融工具风险及管理 7.4.13.1 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、风险控制委员会、监察稽核部及研究部风险管理组所监控; 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。

7.4.13.2 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, 且通过分散化投资以降低信用风险。本基金持有的除国债、政策性金融债以外的同一信用主体发行的证券产品的比例, 不得超过本基金资产净值的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。

7.4.13.3 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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债均计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上受市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

项目	2007年12月31日	2008年12月31日	2009年12月31日	2010年12月31日
金融资产	4,602,504.31	4,602,504.31	2,551,142.05	2,551,142.05
金融负债	250,000.00	250,000.00	532,716,000.00	86,357,565.20
金融资产公允价值	4,602,504.31	4,602,504.31	2,551,142.05	2,551,142.05
金融负债公允价值	250,000.00	250,000.00	532,716,000.00	86,357,565.20
金融资产公允价值减去金融负债公允价值	4,352,504.31	4,352,504.31	2,018,426.05	2,018,426.05

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

1. 市场利率发生变化。

2. 其他市场变量保持不变。

分析对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：元)：

假设	2008年12月31日	2009年12月31日	2010年12月31日
利率上升27个基点	-2,056,242.15	-2,181,190.62	-2,181,190.62
利率下降27个基点	2,056,242.15	2,181,190.62	2,181,190.62

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、资产支持证券、银行存款、回购等，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购，持有因可转债转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产，但非固定收益类金融工具投资比例合计不超过基金资产的20%。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。本基金不通过二级市场买入股票或权证。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大价格风险。于2008年12月31日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	2007年12月31日	2008年12月31日	2009年12月31日	2010年12月31日
金融资产	4,602,504.31	4,602,504.31	2,551,142.05	2,551,142.05
金融负债	250,000.00	250,000.00	532,716,000.00	86,357,565.20
金融资产公允价值	4,602,504.31	4,602,504.31	2,551,142.05	2,551,142.05
金融负债公允价值	250,000.00	250,000.00	532,716,000.00	86,357,565.20
金融资产公允价值减去金融负债公允价值	4,352,504.31	4,352,504.31	2,018,426.05	2,018,426.05

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	0.00	0.00
2	固定收益投资	529,788,637.20	96.86
3	资产支持证券	73,674,637.20	13.47
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	7,153,646.36	1.31
6	其他资产	9,998,121.00	1.83
7	合计	546,940,404.56	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601898	中煤能源	11,229,817.50	0.66
2	601186	中国铁建	7,571,267.20	0.45
3	601958	金铂股份	3,952,856.35	0.23
4	601899	紫金矿业	2,110,480.00	0.12
5	601766	中国南车	1,829,074.50	0.11
6	002242	九阳股份	1,070,379.52	0.06
7	002240	威华股份	1,042,982.40	0.06
8	002204	华锐铸钢	622,092.24	0.04
9	002203	海亮股份	596,020.03	0.04
10	002212	南洋股份	570,432.24	0.03
11	002237	恒邦股份	568,702.20	0.03
12	002249	大洋电机	560,793.60	0.03
13	002244	滨江集团	548,857.44	0.03
14	002211	宏达新材	537,455.15	0.03
15	002269	美邦服饰	474,240.00	0.03
16	002241	歌尔声学	462,645.30	0.03
17	002206	海利得	395,440.11	0.02
18	002208	合肥城建	358,956.00	0.02
19	002227	奥特迅	346,805.58	0.02
20	002214	大立科技	319,389.20	0.02

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。

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

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	601898	中煤能源	9,279,931.81	0.55
2	601186	中国铁建	7,779,581.00	0.46
3	601939	建设银行	6,905,077.37	0.41
4	601866	中海集运	5,967,382.94	0.35
5	601601	中国太保	5,170,749.93	0.30
6	601857	中国石油	4,150,884.78	0.24
7	601766	中国南车	4,093,771.25	0.24
8	601088	中国神华	3,575,815.04	0.21
9	601958	金铂股份	3,339,423.67	0.20
10	002202	金风科技	2,970,003.38	0.18
11	601899	紫金矿业	2,945,940.00	0.17
12	601808	中海油服	2,000,958.40	0.12
13	002204	华锐铸钢	1,436,706.06	0.08
14	002242	九阳股份	1,359,302.36	0.08
15	002194	武汉凡谷	1,273,838.60	0.08
16	002203	海亮股份	1,091,764.20	0.06
17	002186	全聚德	1,086,410.50	0.06
18	002180	万里达	914,452.13	0.05
19	002215	诺普信	837,002.35	0.05
20	002212	南洋股份	779,698.10	0.05

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。

8.4.3 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

项目	金额
买入股票成本(成交)总额	42,149,492.27
卖出股票收入(成交)总额	87,554,121.36

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	244,428,000.00	49.35
2	央行票据	176,088,000.00	35.56
3	金融债券	0.00	0.00
4	企业债券	35,598,000.00	7.19
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	可转债	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	456,114,000.00	92.10

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010704	07国债04	1,400,000	142,758,000.00	28.83
2	0701026	07央行票据26	1,000,000	102,480,000.00	20.69
3	010301	03国债(1)	1,000,000	101,670,000.00	20.53
4	0801101	08央行票据101	500,000	49,000,000.00	9.89
5	088068	08西城投	200,000	20,332,000.00	4.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119004	澜创03	400,000	40,267,706.30	8.13
2	119009	宁建04	195,000	19,557,764.80	3.95
3	119005	浦建收益	400,000	13,849,166.10	2.80

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金本报告期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	9,290,191.26
5	应收申购款	457,929.74
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	9,998,121.00

8.9.4 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。

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例	
持有人户数(户)	51,433.24	203,973,977.35	43.79%
机构投资者	261,856,896.45	56.21%	
个人投资者	203,973,977.35	43.79%	

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

项目：持有份额总数(份) 占基金总份额比例

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	447,026.94	0.10%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	基金转型日(2007年8月29日)	基金份总额	2007年8月29日	基金份总额
基金转型日	205,321,350.98	205,321,350.98	基金转型日	205,321,350.98

1,605,818,801.23 报告期期间基金总申购份额 437,960,840.08 报告期期间基金总赎回份额 1,577,948,767.51 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) 0.00 报告期期末基金份额总额 465,830,873.80 注: 1、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。
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。
§11 重大事件揭示
11.1 基金份额持有人大会决议
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。
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
本基金管理人于2008年6月28日发布了变更董事长和董事的公告, 刘德树先生不再担任本公司董事长、董事职务, 选举秦维舟先生担任本公司董事长, 增补张小康先生担任本公司董事。
2008年5月15日, 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的任职公告。该项任职经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]576号文件核准。
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
11.4 基金投资策略的改变
本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
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, 其已提供审计服务的连续年限: 3年。
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
本基金的基金管理人、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。
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
(1) 证券公司名称及交易单元数量、股票交易及支付佣金情况
金额单位: 人民币元
股票交易 应支付该券商的佣金
交易 占当期股 占当期佣
券商名称 单元 票 备注
成交金额 佣金 数量 成交总额 总量的比
例
例
湘财证券有限责任公司 1 32,344,605.17 36.94% 26,280.33 35.90%
安信证券股份有限公司 1 55,209,516.19 63.06% 46,927.24 64.10%
合计 2 87,554,121.36 100.00% 73,207.57 100.00%
(2) 债券、权证交易情况
券商名称 债券成交金额 占成交总 权证成交金额 占成交总
额的比例 额的比例
安信证券股份有限公司 113,716,619.80 100.00% 4,197,844.88 100.00%
合计 113,716,619.80 100.00% 4,197,844.88 100.00%
(3) 交易所债券回购交易
券商名称 回购成交金额 占成交总额的 比例
安信证券股份有限公司 9,131,800,000.00 100.00%
合计 9,131,800,000.00 100.00%
注1、本报告期租用证券公司的交易单元无变更。
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要, 并能为本基金提供全面的信息服务。
(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》。
11.8 其他重大事件
序号 公告事项 法定披露方式 法定披露日期
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加海通证券为诺安优化债券基金、诺
1 《上海证券报》、 2008-01-04
安价值增长基金代销机构的公告
《证券时报》
2 诺安优化收益债券型证券投资基金2007年第四季度报告 《中国证券报》 2008-01-19
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构进一步开通
3 《上海证券报》、 2008-01-22
换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于在中国建设银行推出基金定期定额投资
4 《上海证券报》、 2008-01-30
业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加中国建设银行为旗下基金代销机构
5 《上海证券报》、 2008-01-30
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于在华夏银行推出基金定期定额投资业务
6 《上海证券报》、 2008-02-01
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加民生银行为旗下基金代销机构并同
7 《上海证券报》、 2008-02-20
时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加交通银
行为旗下基金代销机构的公
8 《上海证券报》、 2008-02-27
告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于在交通金
行推出基金定期定额投资业务
9 《上海证券报》、 2008-02-27
并开展优惠活动的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安优化收益债券型证券投资基金
招募说明书(更新) 摘要
《中国证券报》 2008-03-12
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于在中国工商银行推出诺安优化债券基金
11 《上海证券报》、 2008-03-19
定期定额投资业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安优化收益债券型证券投资基金第七次分红公告
《中国证券报》
2008-03-21
13 诺安优化收益债券型证券投资基金2007年年度报告摘要 《中国证券报》 2008-03-29
14 诺安基金管理有限公司关于在深圳平安银行
推出基金定期定额投资 《中国证券报》、 2008-04-07
业务的公告 《上海证券报》、
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金有限
公司关于增加深圳平安银行为旗下基金代销机构
15 《上海证券报》、 2008-04-07
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加广东发展银行为旗下基金代销机构
16 《上海证券报》、 2008-04-08
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于参加北京银行网上银行基金申购费率优
17 《上海证券报》、 2008-04-10
惠活动的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于在北京银行推出基金定期定额投资业务
18 《上海证券报》、
2008-04-10
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加中信证券为旗下部分基金代销机构
19 《上海证券报》、
2008-04-15
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加信泰证券为旗下部分
基金代销机构
20 《上海证券报》、 2008-04-15
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金有限
公司关于增加渤海证券为旗下部分基金代销机构
21 《上海证券报》、 2008-04-18
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安优化收益债券型证券投资基金2008年第一季度报告 《中国证券报》 2008-04-22
22 诺安优化收益债券型证券投资基金2008年第一
季度报告 《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加国元证券为旗下
基金代销机构的公
23 《上海证券报》、 2008-04-25
告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于通过中国光大银
行网上银行申购旗下部
24 《上海证券报》、 2008-05-05
分基金实行费率优惠的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在中国光大银行开通基金定期定额投资
25 《上海证券报》、 2008-05-05
业务并开展优惠活动的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加中国光大银行为旗下部分基金代
销机构并开通转换业务的公告
《证券时报》
27 诺安优化收益债券型证券投资基金第八次分红公告 《中国证券报》 2008-06-30
28 诺安基金管理有限公司关于在民生银行推出基金定期定额投资业务
28 《上海证券报》、 2008-07-10
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在中信建投证券推出基金定期定额投资
29 《上海证券报》、 2008-07-14
业务并开展申购费率优惠活动的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安优化收益债券型证券投资基金2008年第二季度报告 《中国证券报》、 2008-07-19
30 诺安优化收益债券型证券投资基金2008年第二
季度报告 《中国证券报》、
诺安基金管理有限公司关于增加上海证
券为旗下基金代销机构的公
31 《上海证券报》、 2008-07-22
告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加新
时代证券为旗下基金代销机构并
32 《上海证券报》、 2008-08-08
并同时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于基金直销专户账户变更的公告
《上海证券报》、 2008-08-19
34 诺安优化收益债券型证券投资基金2008
半年度报告摘要 《中国证券报》 2008-08-27
35 诺安基金管理有限公司关于在广东发展银行推出基金定期定额投资
35 《上海证券报》、 2008-10-07
业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》 2008-10-
07
37 诺安基金管理有限公司关于在长城证券开通基金转换业务的公告 《上海证券报》、 2008-10-10
38 诺安基金管理有限公司关于增加长城证券为旗下基金代销机构的公
38 《上海证券报》、 2008-10-10
告
《证券时
报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在长城证券推出基金定期定额投资业务
39 《上海证券报》、 2008-10-10
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加东北证券为旗下基金代销机构的公
40 《上海证券报》、 2008-10-17
告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在东北证券开通基金转换业务的公告
《上海证券报》、 2008-10-17
41 诺安基金管理有限公司关于在东北证券推出基金定期定额投资业务
42 《上海证券报》、 2008-10-17
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加齐鲁证券为旗下基金定期定额投资业务
44 《上海证券报》、 2008-10-27
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加齐鲁证券为旗下基金代销机构并同
45 《上海证券报》、 2008-10-27
时开通基金转换业务的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加宏源证券为旗下基金代销机构并同
46 《上海证券报》、 2008-10-27
时开通基金转换业务的
公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加中国建银投资证券有限责任公司为
《中国证券报》、 2008-10-31
旗下开放式基金代销机
构的公告
《上海证券报》、
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在宁波银行开通基金转换业务的公告
《上海证
券报》、 2008-11-26
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加宁波银行为旗下基金代销机构的公
49 《上海证
券报》、 2008-11-26
告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在宁波银行推出基金定期定额投资业务
50 《上海
证券报》、 2008-11-26
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于增加山西证券为旗下部分基金代销机构
51 《上海证
券报》、 2008-12-05
的公告
《证券时报》
《中国证券报》、
诺安基金管
理有限公司关于在广州证券推出基金定期定额投资业务

52 《上海证券报》、2008-12-19 的公告 《证券时报》 《中国证券报》、 诺安基金管理有限公司关于增加广州证券为旗下基金代销机构并同 53 《上海证券报》、2008-12-19 时开通基金转换业务的公告 《证券时报》 §12 备查文件目录 12.1 备查文件目录 1、 中国证券监督管理委员会批准设立诺安中短期债券投资基金的文件。 2、 《诺安中短期债券投资基金基金合同》。 3、 《诺安中短期债券投资基金托管协议》。 4、 诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议。 5、 诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会计票结果。 6、 中国证监会《关于核准诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》(证监基金字[2007]239号)。 7、 《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》。 8、 《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》。 9、 基金管理人业务资格批件、营业执照。 10、 《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。 11、 报告期内诺安中短期债券投资基金、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。 12.2 存放地点 基金管理人、基金托管人住所 12.3 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。 诺安基金管理有限公司 二零零九年三月二十八日, "noticeType": "1", {"noticeDate": "2009-03-27", "noticeTitle": "诺安优化(320004)第九次分红公告", "noticeContent": "诺安优化收益债券型证券投资基金第九次分红公告 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九次分红。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,本公司决定以2009年3月26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: 一、收益分配方案 本基金每10份基金份额派发红利0.10元 二、收益分配时间 1、权益登记日、除息日:2009年3月30日 2、现金红利发放日:2009年4月1日 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3月30日 4、红利再投资的基金份额可赎回起始日:2009年4月1日 三、收益分配对象 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。 四、收益发放办法 1、选择现金红利方式的投资者的红利款将于2009年4月1日自基金托管账户划出。 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2009年3月30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。2009年4月1日起投资者可以查询、赎回。 五、有关税收和费用的说明 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。 2、本次分红免收分红手续费。 六、提示 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。 2、权益登记日申请申购的金额以2009年3月30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2009年3月30日除权后的基金份额净值为计算基准确定赎回金额。 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。 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2009年3月30日)最后一次选择的分红方式为准。 5、若投资者选择红利再投资方式并在2009年3月30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1000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。 七、咨询办法 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、北京银行、浦发银行、平安银行、广东发展银行、宁波银行、国泰君安证券、中国银河证券、中信建投证券、联合证券、安信证券、广发证券、国信证券、招商证券、中信证券、光大证券、海通证券、德邦证券、长江证券、南京证券、华泰证券、湘财证券、国都证券、渤海证券、中信金通证券、平安证券、东方证券、国元证券、江南证券、东莞证券、上海证券、新时代证券、长城证券、东北证券、齐鲁证券、宏源证券、中投证券、山西证券、广州证券、国联证券、浙商证券、金元证券、兴业证券、信泰证券、天相投顾等机构的代销网点。 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 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 2009年3月27日, "noticeType": "1", {"noticeDate": "2009-03-27", "noticeTitle": "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九次分红。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,本公司决定以2009年3月26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: 一、收益分配方案 本基金每10份基金份额派发红利0.10元 二、收益分配时间 1、权益登记日、除息日:2009年3月30日 2、现金红利发放日:2009年4月1日 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3月30日 4、红利再投资的基金份额可赎回起始日:2009年4月1日 三、收益分配对象 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。 四、收益发放办法 1、选择现金红利方式的投资者的红利款将于2009年4月1日自基金托管账户划出。 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2009年3月30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。2009年4月1日起投资者可以查询、赎回。 五、有关税收和费用的说明 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。 2、本次分红免收分红手续费。 3、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。 4、权益登记日申请申购的金额以2009年3月30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2009年3月30日除权后的基金份额净值为计算基准确定赎回金额。 5、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。 6、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2009年3月30日)最后一次选择的分红方式为准。 7、若投资者选择红利再投资方式并在2009年3月30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1000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。 七、咨询办法 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、北京银行、浦发银行、平安银行、广东发展银行、宁波银行、国泰君安证券、中国银河证券、中信建投证券、联合证券、安信证券、广发证券、国信证券、招商证券、中信证券、光大证券、海通证券、德邦证券、长江证券、南京证券、华泰证券、湘财证券、国都证券、渤海证券、中信金通证券、平安证券、东方证券、国元证券、江南证券、东莞证券、上海证券、新时代证券、长城证券、东北证券、齐鲁证券、宏源证券、中投证券、山西证券、广州证券、国联证券、浙商证券、金元证券、兴业证券、信泰证券、天相投顾等机构的代销网点。 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 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 2009年3月27日, "noticeType": "2", {"noticeDate": "2009-02-25", "noticeTitle": "诺安基金管理有限公司关于参加工商银行(601398)基智定投业务及进行业务费率优惠活动的公告", "noticeContent": "诺安基金管理有限公司关于参加中国工商银行基智定投业务及进行业务费率优惠活动的公告 为满足广大投资者的理财需求,鼓励基金投资者树立长期投资理念,诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司")将参加中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")推出的基智定投业务,并参与该业务的基金申购费率优惠活动。 基智定投业务是基金定期定额投资业务的一种升级业务。基金管理公司接受投资者的基智定投申购业务申请后,中国工商银行将根据投资者的要求在某一固定期限(以月为最小单位)从投资人指定的资金账户内扣划一定的申购款项。通常它的投资额比普通申购额低。基智定投分为定时不定额和定时定额两种投资方式。 现将有关事项公告如下: 一、时间安排 自2009年2月26日起开始办理基智定投业务; 自2009年2月26日起的2009年全部法定基金交易日的交易时间内,投资人通过中国工商银行基智定投业务进行的基智定投申购均享有申购费率八折优惠。 二、适用基金 诺安平衡证券投资基金(基金代码:320001) 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) 三、基智定投业务申购费率优惠方式 自2009年2月26日起的2009年全部法定基金交易日的交易时间内,投资人通过中国工商银行基智定投业务进行的基智定投申购均享有申购费率八折优惠。原申购费率(含分级费率)高于0.6%的,基智定投申购费率按8折优惠(即实收申购费率=原申购费率x0.8),但优惠后费率不低于0.6%;原申购费率(含分级费率)等于和低于0.6%的,则按原费率执行。 四、各基金原申购费率请参见各基金最新的招募说明书及相关公告。 四、注意事项 1、中国工商银行基智定投业务投资人特指个人投资人。 2、基智定投业务是基金定期定额投资的一种升级业务,其业务办理的具体程序与中国工商银行的有关规定为准。中国工商银行保留对基智定投业务及优惠活动的最终解释权。有关基智定投业务及优惠活动的具体规定如有变化,敬请投资者留意中国工商银行的相关公告。 3、投资人对基智定投业务如有任何疑问,或希望得到更多相关资料,可登录中国工商银行及各基金公司网站或直接致电客服电话进行咨询。中国工商银行已于2009年2月24日在其网站发布了《中国工商银行关于开展基智定投业务的通告》。 五、投资者可通过以下途径咨询有关情况 1、中国工商银行股份有限公司 网站:www.icbc.com.cn 客服电话:95588,或前往中国工商银行各营业网点进行咨询 2、诺安基金管理有限公司 网站:www.lionfund.com.cn 客服电话:400-888-8998(免长话费),0755-83026888 特此公告。 诺安基金管理有限公司 2009年2月25日, "noticeType": "3", {"noticeDate": "2009-02-06", "noticeTitle": "诺安基金管理有限公司关于增加浙商证券为旗下部分基金代销机构的公告", "noticeContent": "诺安基金管理有限公司关于增加浙商证券为旗下部分基金代销机构的公告 根据诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司")与浙商证券有限责任公司(以下简称"浙商证券")签署的基金销售代理协议,本公司新增浙商证券为旗下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)及诺安灵活

配置混合型证券投资基金（基金代码：320006）的代销机构。自2009年2月9日起，浙商证券各指定营业网点开始为投资者办理上述基金的开户、申购、赎回等业务。具体办理程序请遵循浙商证券的规定。投资者可以通过以下途径咨询有关情况：1、浙商证券有限责任公司 客户服务热线：0571-87901963,或前往各营业网点咨询 浙商证券有限责任公司网站：www.stocke.com 2、诺安基金管理有限公司 客户服务中心电话：0755-83026888 全国统一客户服务热线：400-888-8998 诺安基金管理有限公司网站：www.lionfund.com.cn 风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。

特此公告。诺安基金管理有限公司 2009年2月6日

诺安基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的通知

诺安基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的通知

根据自2007年8月1日起施行的《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》第二章第十九条规定：在与客户的业务关系存续期间，金融机构应当采取持续的客户身份识别措施，关注客户及其日常经营活动、金融交易情况，及时提示客户更新资料信息。客户先前提交的身份证件或者身份证明文件已过有效期的，客户没有在合理期限内更新且没有提出合理理由的，金融机构应中止为客户办理业务。

根据此项规定，诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）提醒广大客户，如果您的身份证件或者身份证明文件已过有效期，请及时到开立基金账户的机构办理身份证件或者身份证明文件更新手续，以免影响交易。

如有疑问，请拨打本公司客户服务热线400-888-8998（免长话费）、0755-83026888，或登陆本公司网站www.lionfund.com.cn了解相关情况。特此通知。

诺安基金管理有限公司 2009年2月3日

备注：《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》系根据《中华人民共和国反洗钱法》等法律规定，由中国人民银行、中国银行业监督管理委员会、中国证券监督管理委员会和中国保险监督管理委员会制定并发布（中国人民银行、中国银行业监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、中国保险监督管理委员会令[2007]第2号）

currencyDetail":

fundCode":null,"purchaseFundCode":null,"fundName":null,"shareType":null,"riskLevel":null,"fundType":null,"fundGroup":null,"fundGroupName":null,"decimal":null,"fundInfos":[],"rightPwd":true}