

诺安灵活配置混合型证券投资基金

2012 年 度 报 告 摘 要

截至报告期末,本基金份额净值为0.965元。本报告期基金份额净值增长率为7.10%,同期业绩比较基准收益率为6.36%。

4.5 管理人

对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年投资要解决好两组矛盾:一是中国经济长期潜在增长率下滑的大方向与新领导上台后提振经济之间的矛盾;另一个是经济增长方式转型的迫切性与中小公司估值偏高的必然性之间的矛盾。预计市场将会在两难矛盾的过程中出现大幅震荡,但计点应客观看,应随着整个市场的参与主体越来越机构化、长期化、国际化,价值型公司的估值有回升的需求,而成长性公司必将趋于分化,“以价值为例”,用更严格的标准“辅以成长”这将是本基金在2013年的核心策略。最后,和往年一样,本基金仍会坚守“谨慎勤勉”的原则,“优化结构”,“精选个股”,力争创造更好的投资业绩,最后感谢各位持有人对本基金的信任。

4.6 管理人

对报告期内本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及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、年中和本年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、监察稽核部和风险控制部、固定收益部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。由估值小组负责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,并有表决权决议有关基金估值有一票表决权,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

对报告期内本基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%。本基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益弥补上一年度亏损后,方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循诚信原则,严格按照《证券投资基金的托管协议》、《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,诺安灵活配置混合型证券投资基金管理人——诺安基金管理有限公司在诺安灵活配置混合型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、基金费用开支等方面,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,诺安灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制的诺安灵活配置混合型证券投资基金2012年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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 审计报告

国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师李英、胡立新于2013年3月15日出具了国浩华审字[2013]227A013号《2012年度审计报告》,投资者可登陆会计师事务所网站查看审计报告全文。

7 年度财务报表

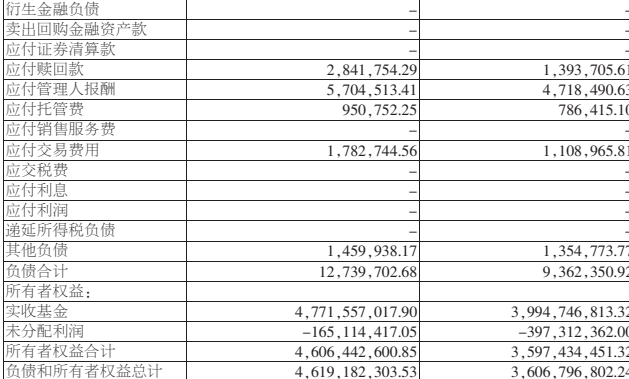
7.1 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
银行存款	275,661,591.28	336,196,932.01
结算备付金	59,063,824.64	3,313,505.70
存出保证金	1,389,650.80	2,009,046.37
交易性金融资产	3,620,390,602.56	2,597,734,863.70
其中:股票投资	3,508,644,492.16	2,586,194,672.50
债券投资	111,746,110.40	11,540,191.20
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	593,500,000.00	628,901,463.35
应收证券清算款	66,776,035.52	36,798,460.15
应收利息	476,784.77	445,271.88
应收股利	-	-
应收申购款	1,923,813.96	1,397,259.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,619,182,303.53	3,606,796,802.24
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,841,754.29	1,393,705.61
应付赎回款	5,704,513.44	4,718,490.63
应付管理人报酬	5,904,532.41	786,415.03
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费	1,782,744.56	1,108,965.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,459,938.17	1,354,773.37
负债合计	12,739,702.68	9,362,350.92
所有者权益:		
实收基金	4,771,557,017.90	3,994,746,813.32
未分配利润	-165,114,417.05	-397,312,362.00
所有者权益合计	4,606,442,600.85	3,597,434,451.32
负债和所有者权益总计	4,619,182,303.53	3,606,796,802.24

注:1. 本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。
2.2 自基金合同生效以来基金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



3.2.3 自基金合同生效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

资产	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	337,361,324.33	-632,021,470.02
1.利息收入	19,012,015.71	7,330,395.53
其中:存款利息收入	7,349,381.03	5,327,795.91
债券利息收入	389,545.24	336,651.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,273,089.44	1,665,947.94
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-249,268,097.39	-12,059,813.47
其中:股票投资收益	-287,940,463.38	-26,873,928.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,355,817.70	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	38,672,365.99	19,169,987.02
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	566,465,192.89	-628,274,100.50
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,152,213.12	982,048.42
减:一、费用	84,587,258.81	70,738,929.72
1.管理人报酬	64,062,193.17	47,310,249.18
2.托管费	10,677,032.30	7,885,041.46
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,428,092.92	15,122,466.79
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	419,940.42	421,172.29
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	252,774,065.52	-702,760,399.74
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	252,774,065.52	-702,760,399.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上期 2011年1月1日至2011年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	3,994,746,813.32	-397,312,362.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	252,774,065.52
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)	776,810,204.58	-20,576,120.57
其中:1.基金申购款	1,853,592,713.75	-94,837,129.48
2.基金赎回款	-1,076,782,509.17	74,261,008.91
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)	4,771,557,017.90	-165,114,417.05

7.4 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上期 2011年1月1日至2011年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	3,994,746,813.32	-397,312,362.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	252,774,065.52
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)	776,810,204.58	-20,576,120.57
其中:1.基金申购款	1,853,592,713.75	-94,837,129.48
2.基金赎回款	-1,076,782,509.17	74,261,008.91
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)	4,771,557,017.90	-165,114,417.05

7.5 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上期 2011年1月1日至2011年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	3,994,746,813.32	-397,312,362.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	252,774,065.52
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)	776,810,204.58	-20,576,120.57
其中:1.基金申购款	1,853,592,713.75	-94,837,129.48
2.基金赎回款	-1,076,782,509.17	74,261,008.91
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)	4,771,557,017.90	-165,114,417.05

7.6 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.7 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.8 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.9 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.10 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.11 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.12 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.13 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.14 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.15 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.16 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.17 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.18 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.19 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.20 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.21 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.22 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.23 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.24 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.25 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.26 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.27 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.28 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.29 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.30 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.31 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.32 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.33 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.34 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.35 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.36 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.37 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.38 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.39 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.40 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.41 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.42 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.43 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.44 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.45 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.46 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.47 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.48 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.49 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.50 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.51 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.52 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.53 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.54 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.55 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.56 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.57 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.58 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.59 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.60 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.61 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.62 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.63 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.64 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.65 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.66 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.67 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.68 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.69 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.70 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.71 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.72 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.73 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.74 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.75 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.76 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.77 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.78 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.79 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.80 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.81 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.82 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.83 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.84 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.85 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.86 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.87 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

7.88 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期末:2012年12月31日

<