

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事、董事会、监事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、完整性承担责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要简要半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:诺安灵活配置混合

基金代码:320006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年5月20日

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额:3,337,451,451.05份

基金合同存续期:不定期

2.2 基金产品说明

投资目标:积极调整，稳健投资，力图在将风险控制在一定水平的基础上获得超过比较基准的投资收益。

本基金实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略和风险管理策略四部分组成。

(1)在资产配置方面，本基金自上而下进行，具体由类别资产配置和行业资产配置组成。

(2)在股票投资方面，本基金综合运用行业策略、企业增长策略、内在价值策略、景气回归上升策略这三种策略构建股票组合。

(3)在债券投资方面，本基金将实施利率预测策略、久期策略、收益率曲线策略、个券估值策略以及风险免疫策略等投资策略，力求获取于市场平均水平的投资回报。

(4)在权证投资方面，本基金主要运用的策略包括：价值发现策略、差价策略、对被投资股票具有担保的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。作为辅助性投资工具，本基金将结合自身资产状况慎重投资，力求获得最佳的风险调整回报。

本基金在运作过程中，将根据市场情况，适时调整投资策略。

5.1 报告期内本基金托管人遵循诚信原则的情况

本基金报告期内，本基金托管人在遵守诺安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其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 托管人报告报告期内本基金投资运作遵循诚信、净值计算、利润分配等原则的情况的说明

本基金报告期内，诺安灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人——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、基金资产估值、基金份额申购价格计算、基金费用开支等方面上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各项重要的运作严格按照基金合同的的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

托管人依据对诺安基金管理有限公司编制的报告和诺安灵活配置混合型证券投资基金2013半年度报告中财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6. 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

7.6 利润表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

金额单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益:122,681,601.74

本期利润:-43,040,488.55

加权平均基金份额本期利润:-0.0098

本期基金份额净值增长率:-2.59%

3.1.2 主要会计数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:(1)本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

(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)和本期相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5.5 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金份额表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值 增幅净值 增幅净值 增幅净值 增幅净值 增幅净值
增长率(1) 准备(2) 准备(3) 准备(4)

过去一个月 -7.21% 0.90% -9.44% 1.12% 2.23% -0.22%

过去三个月 -6.00% 0.80% -6.81% 0.87% 0.81% -0.07%

过去一年 -2.59% 0.89% -6.96% 0.90% 4.37% -0.01%

过去三年 -4.28% 0.81% -4.77% 0.82% 0.49% -0.01%

过去五年 7.98% 0.97% -3.65% 0.82% 11.63% 0.15%

自基金合同生效日起至今 57.10% 1.04% -19.38% 1.10% 76.48% -0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。

3.2.2 基金管理人同生以来基金份额净值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

单位:人民币元

3.3.1 期间数据和指标

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益:122,681,601.74

本期利润:-43,040,488.55

加权平均基金份额本期利润:-0.0098

本期基金份额净值增长率:-2.59%

3.3.2 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.3 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.4 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.5 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.6 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.7 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.8 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.9 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.10 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.11 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.12 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.13 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润:-0.0597

期末基金份额净值:3,138,307,575.81

期末基金份额净值增长率:0.940

注:本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用、计划费用、计划费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3.14 期间数据和指标

报告期末(2013年6月30日)