

诺安汇鑫保本混合型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

未托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计会计师事务所名称及地址
普华永道会计师事务所(特殊普通合伙) 地址: 于2016年3月29日出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道) 会计师事务所名称及地址: 普华永道会计师事务所(特殊普通合伙) 地址: 于2016年3月29日出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道) 会计师事务所名称及地址: 普华永道会计师事务所(特殊普通合伙) 地址: 于2016年3月29日出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道)

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
资产负债表: 2015年12月31日

单位: 人民币元

资产	2015年12月31日	上年度末2014年12月31日
货币资金	641,261,536.62	89,172,386.49
结算备付金	1,524,081.28	4,886,114.79
存出保证金	186,729.16	160,164.68
交易保证金	2,172,960,734.58	1,810,912,491.00
其中: 股票投资	219,564,902.98	379,071,423.38
基金投资	-	-
债券投资	1,953,395,831.60	1,432,841,067.22
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	449,501,914.25	40,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	32,422,831.96	26,982,308.23
应收股利	-	-
应收申购款	238,525.42	288.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,296,066,352.27	1,972,124,376.00

负债和所有者权益

2015年12月31日 2014年12月31日

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 -

应付利息 -

应付股利 -

应付管理人报酬 -

应付托管费 -

应付销售服务费 -

应付交易费用 -

应收资产支持证券利息 -

应付利息 -

递延所得税负债 -

其他负债 -

负债合计 -

所有者权益:

实收基金 -

未分配利润 -

所有者权益合计 -

负债和所有者权益总计 -

注: 报告期末2015年12月31日, 基金份额净值为1.029元, 基金份额总额为2,614,422,214.15份。

7.2 利润表

单位: 人民币元

资产	2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	368,022,277.60	389,509,785.79
1. 利息收入	67,752,317.49	85,576,433.68
其中: 存款利息收入	1,572,304.47	842,000.00
债券利息收入	51,678,414.65	84,617,192.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,301,601.37	117,041.36
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	269,709,618.17	126,967,056.04
其中: 股票投资收益	188,224,591.19	127,466,686.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	80,093,700.08	-1,738,957.01
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列)	28,322,474.85	162,801,567.13
4. 汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”填列)	2,227,887.09	4,184,318.14
减: 二、费用	39,667,420.56	50,917,138.20
1. 管理人报酬	24,560,173.32	22,042,204.89
2. 托管费	4,098,362.25	3,673,700.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,772,063.21	3,189,798.17
5. 利息支出	6,695,477.93	21,568,508.70
其中: 卖出回购金融资产支出	6,695,477.93	21,568,508.70
6. 其他费用	511,343.85	453,405.57
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	328,354,857.04	338,592,627.59
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	328,354,857.04	338,592,627.59

7.3 所有者权益变动表

单位: 人民币元

项目	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
一、所有者权益(基金净值)	1,324,341,144.36	285,002,736.69
1. 本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	328,354,857.04
2. 本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)	-	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)	469,319,850.50	273,332,466.12
其中: 1. 基金申购款	1,695,530,137.25	794,444,548.91
2. 基金赎回款	-1,216,210,306.75	-521,112,082.79
四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,793,660,994.86	2,690,351,044.71

7.4 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

7.5 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

7.6 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

7.7 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

7.8 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

7.9 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

8. 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

338,592,627.59 338,592,627.59

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期净申购/赎回及转入/转出)

-720,807,418.30 -81,997,189.92 -802,804,608.22

其中: 1. 基金申购款

31,589,103.60 4,657,221.42 36,246,325.02

2. 基金赎回款

-752,398,521.90 -96,654,408.34 -849,052,930.24

四、本期基金份额持有人分配利润(净收益分配以“-”填列)

-

五、期末所有者权益(基金净值)

1,324,341,144.36 285,002,736.69 1,619,343,871.05

9. 资产负债表

单位: 人民币元

2015年1月1日至2015年12月31日

项目 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)

2,046,148,562.66 38,407,286.02 2,084,555,848.68