诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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。

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。

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。

本报告财务资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2015年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安稳健回报混合	
基金主代码	000714	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月15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	2,352,751,813.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安稳健回报混合A	诺安稳健回报混合C
下属分级基金的交易代码:	000714	002052
报告期末下属分级基金的份额总额	420,759,541.76份	1,931,992,272.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置,把握投资市场的变化趋势,力求在有效分散风险的同时获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策策略,结合定性分析和定量分析进行大类资产的配置。具体而言,首先利用经济周期理论,对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,以规避或分散市场风险,为基金带来稳健回报。 1.大类资产配置策略方面,本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。 2.股票投资策略方面,本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量,将好公司与好股票有机结合,前瞻性地把握A股市场中存在的具有综合趋势机会的个股,进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。 3.债券投资策略方面,本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。 4.权证投资策略方面,本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具,我们将结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。 5.股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎的原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中证全债指数
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	洪渊
	联系电话	0755-83026688	(010)66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§3 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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年		2014年9月15日(基金合同生效日)-2014年12月31日	
	诺安稳健回报混合A	诺安稳健回报混合C	诺安稳健回报混合A	诺安稳健回报混合C
本期已实现收益	99,174,355.21	588,670.56	20,221,176.36	-
本期利润	99,025,911.53	8,346,632.74	44,992,185.97	-
加权平均基金份额本期利润	0.0977	0.0077	0.0764	-
本期基金份额净值增长率	20.95%	0.93%	7.40%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2610	0.2604	0.0375	-
期末基金资产净值	546,503,469.13	2,508,344,632.74	395,748,412.82	-
期末基金份额净值	1.299	1.298	1.074	-

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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。

③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。

④自2015年11月18日起,本基金分设两级基金份额:A类基金份额和C类基金份额,详情请参阅相关公告。

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

诺安稳健回报混合A

3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.85%	0.25%	11.02%	1.00%	-8.17%	-0.75%
过去六个月	2.44%	0.30%	-7.39%	1.60%	9.83%	-1.30%
过去一年	20.95%	0.48%	8.82%	1.49%	12.13%	-1.01%
自基金合同生效起至今	29.90%	0.48%	38.46%	1.39%	-8.56%	-0.91%

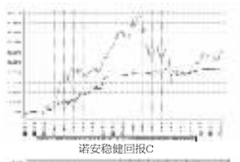
诺安稳健回报混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.93%	0.22%	1.11%	1.00%	-0.18%	-0.78%

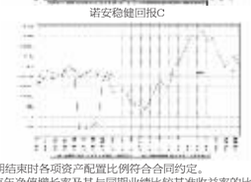
注:本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中证全债指数。

3.2.2 自基金合同生效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

诺安稳健回报A



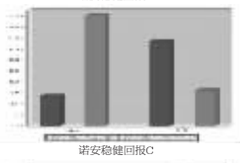
诺安稳健回报C



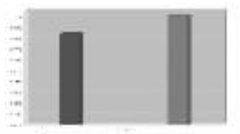
注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

诺安稳健回报A



诺安稳健回报C



注:本基金基金合同于2014年9月15日生效,2014年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2014年9月15日生效,截止2015年12月31日,本基金未进行利润分配。

§4 管理人报告

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

截至2015年12月,本基金管理人共管理45只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、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、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安金味黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金。

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	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周心鹏	投资二部执行总监、诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年9月15日	-	15	金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于南方证券投资银行部、中投证券金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于南方证券投资银行部、中投证券投资银行部、长盛基金研究部和华夏基金机构投资部。2010年1月加入诺安基金管理有限公司,任基金经理助理,现任投资二部执行总监。2011年3月至2015年4月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2014年3月至2015年4月任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2010年10月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,2014年9月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
吴博俊	诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月4日	-	8	硕士,2008年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2014年6月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年6月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处周心鹏先生的任职日期为基金合同生效之日,吴博俊先生的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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,诺安稳健回报灵活配置混合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《诺安稳健回报灵活配置混合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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。此外,公司对连续四个季度期间内,公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析,未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年我国宏观经济运行仍旧呈现疲弱态势。2015年四季度GDP同比增长6.8%,环比增长1.6%,均低于三季度的6.9%和1.8%,也低于政府年初设定的7%的目标,这也是中国经济连续第二年增长未达标。

房地产投资放缓,制造业去产能加快,基建减速,带动投资增速再次下行。12月末投资同比增长10%,增速比前三季度回落0.3个百分点,是为2015年新低。从拉动固定资产投资的三驾马车来看,房地产投资增速累计同比1%,12月份当月继续负增长,是拖累固定资产投资增速下滑的主要动力;制造业投资增速比上月回落0.33个百分点,表明行业投资去产能阶段仍在继续。同时,基础设施投资年底也有所减速,为17.3%,增速比1-11月份回落0.7个百分点。与房地产相关消费增长较快,汽车、通讯类商品增速明显回落。12月份社会零售总额名义增长11.1%,四季度较三季度有所回升。从商品分类看,对房地产消费相关的建材、家具、家电类商品销售增长较快,增速均超过去年同期。去年一枝独秀的通讯器材类商品销售增速下降34个百分点;由于油价下跌,汽车、石油类商品销售尽显疲态,由于其权重较大,因此拖累整体消费增长较去年回落1个百分点。同时,消费函数的领先指标居民收入受经济下行而有所放缓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,诺安稳健回报混合A的基金份额净值为1.299元。本报告期基金份额净值增长率为20.95%,同期业绩比较基准收益率为8.82%。

截至报告期末,诺安稳健回报混合C的基金份额净值为1.298元。本报告期基金份额净值增长率为0.93%,同期业绩比较基准收益率为1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,稳增长、调结构的方向应该延续,经济增长仍在中枢下移之中,人民币是否会进一步贬值、十三五规划以及新股注册制等多重因素都会是对宏观以及股市影响的重要变量,因此在现阶段大类资产类别的配置上,我们继续维持稳健+成长的组合。

股票投资方面,优质蓝筹股以及低估值业绩增长的小市值成长股都会是我们投资的方向,如国企改革、十三五规划等政策相关的主题投资也会不断挖掘。但在震荡市场中,我们会更注重个股的业绩增长以及转型的实际落地效果选股。同时,静待注册制推出的契机。

债券与现金组合投资方面,在震动市中我们会加大债券的配置比例,但考虑到中长期利率中枢还将下行,且经济还面临一些长期隐忧,部分信用等级低的企业债存在违约风险。因此债券配置上,继续以高等级、短期限的债券作为本产品投资部分。

4.6 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、合规与风险控制部、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。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。

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4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内,本基金托管人在对诺安稳健回报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

本报告期内,诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安稳健回报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、基金费用开支等问题上,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,诺安稳健回报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和披露的诺诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师王明静、吴迪于2016年3月25日出具了德师报(审)字(16)第P0677号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	44,480,801.04	49,907,099.40
结算备付金	285,550.45	22,853,774.47
存出保证金	52,649.74	118,117.08
交易性金融资产	526,598,138.01	230,537,496.68
其中:股票投资	64,140,138.01	187,286,422.68
基金投资	-	-
债券投资	462,458,000.00	43,251,074.00
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	2,283,001,844.50	99,000,268.50
应收证券清算款	200,039,899.89	-
应收利息	4,968,812.14	571,407.75
应收股利	-	-
应收申购款	-	87,713.93
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,059,427,695.77	403,075,877.81
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 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	-	-
应付赎回款	297,561.87	5,462,514.23
应付管理人报酬	3,164,044.61	652,846.62
应付托管费	527,340.80	108,807.78
应付销售服务费	164,537.85	-
应付交易费用	305,550.00	1,074,571.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	120,558.77	28,724.99
负债合计	4,579,593.90	7,327,464.99
所有者权益:		
实收基金	2,352,751,813.78	368,449,702.82
未分配利润	702,096,288.09	27,298,710.00
所有者权益合计	3,054,848,101.87	395,748,412.82
负债和所有者权益总计	3,059,427,695.77	403,075,877.81

注:①报告截止日2015年12月31日,基金份额总额2,352,751,813.78份,其中,诺安稳健回报混合A基金份额净值1.299元,基金份额总额420,759,541.76份;诺安稳健回报混合C基金份额净值1.298元,基金份额总额1,931,992,272.02份。

②上年度会计期间为2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	135,448,380.22	49,973,512.15
1.利息收入	18,994,863.09	3,103,344.87
其中:存款利息收入	3,647,906.05	1,316,487.01
债券利息收入	5,102,327.63	164,055.58
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,244,629.41	1,622,802.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	96,400,958.47	21,236,208.49
其中:股票投资收益	90,535,607.17	19,431,123.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,400,998.90	1,805,085.29
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	464,352.40	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7,609,518.50	24,771,009.61
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	12,443,040.16	862,949.18
减:二、费用	28,075,835.95	4,981,326.18
1. 管理人报酬	21,241,798.84	2,663,152.06
2. 托管费	3,540,299.87	443,858.69
3. 销售服务费	164,537.85	-
4. 交易费用	2,523,281.23	1,816,831.43
5. 利息支出	387,506.33	-
其中:卖出回购金融资产支出	387,506.33	-
6. 其他费用	218,411.83	57,484.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	107,372,544.27	44,992,185.97
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	107,372,544.27	44,992,185.97

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	368,449,702.82	27,298,710.00	395,748,412.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	107,372,544.27	107,372,544.27
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)	1,984,302,110.96	567,425,033.82	2,551,727,144.78
其中:1.基金申购款	5,264,279,553.79	1,408,527,093.22	6,672,806,647.01
2.基金赎回款	-3,279,977,442.83	-841,102,059.40	-4,121,079,502.23
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)	2,352,751,813.78	702,096,288.09	3,054,848,101.87
项目	上年度可比期间 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014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)	637,203,715.37	-	637,203,715.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,992,185.97	44,992,185.97
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)	-268,754,012.55	-17,693,475.97	-286,447,488.52
其中:1.基金申购款	6,153,861.97	423,328.98	6,577,190.95
2.基金赎回款	-274,907,874.52	-18,116,804.95	-293,024,679.47
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)	368,449,702.82	27,298,710.00	395,748,412.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____奥成文_____ _____薛有为_____ _____薛有为_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2014]626号文《关于核准诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准,于2014年8月13日至2014年9月10日向社会进行公开募集,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,募集的有效认购金额为人民币637,203,715.37元,其中净认购额为人民币637,040,651.08元,折合637,040,651.08份基金份额,有效认购金额产生的利息为人民币163,064.29元,折合163,064.29份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2014年9月15日,合同生效日基金份额为637,203,715.37份基金单位。

根据《诺安基金管理有限公司关于诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金新增基金份额类别并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》,自2015年11月18日起,本基金设两级基金份额:A类基金份额和C类基金份额,A类基金份额的基金代码为000714(与分级前基金代码相同)。新设C类基金份额代码为002052。

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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于2016年3月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致,会计估计变更详见7.4.4.2的说明。

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定受益品种的估值处理标准》,本基金自2015年3月26日起,对所持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月26日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.5 关联方关系

项目	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

7.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.6.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内不存在应支付关联方的佣金。

7.4.6.2 关联方报酬

7.4.6.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,241,798.84	2,663,152.06
其中:支付销售机构的客户维护费	826,186.96	1,337,902.51

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.6.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,540,299.87	443,858.69

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.6.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.6.5 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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	44,480,801.04	3,022,190.94	49,907,099.40	466,806.88

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

7.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

7.4.7 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.7.1 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

7.4.12.1.1 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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300463	迈克生物	2015年5月21日	2016年5月28日	新发流通受限	27.96	117.39	233,333	6,523,990.68	27,390,960.87	-
002781	奇信股份	2015年12月16日	2016年12月22日	新发流通受限	13.31	37.37	204,545	2,722,493.95	7,643,846.65	-
300477	合纵科技	2015年6月4日	2016年6月10日	新发流通受限	10.61	53.00	32,153	341,143.33	1,704,109.00	-
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新发流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600