

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的名称、住所及办公地址、基本情况、基金名称、基金类型、基金合同的当事人及其权利义务、并对其他内容的真实性、准确性和完整性承担个别和连带的法律责任。本报告经本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司复核，并由基金管理人签署。本报告于2015年3月23日由基金管理人根据法律法规的规定公开披露。

基金销售代理人、投资顾问机构的名称、地址、联系方式等信息不包含在定期报告中，敬请投资者注意查阅。

基金的过往业绩并不预示未来表现，投资者在做出投资决策前应认真阅读本基金的招募说明书及其他资料。

基金年度报告摘要自年度报告正式披露之日起六个月内有效，投资者欲了解详细内容，应当阅读年度报告全文。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应当阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

基金简称	诺安双利债券型发起式证券投资基金
基金代码	320021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月29日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	370,330,594.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

本基金力图在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力，使基金资产在风险可控的基础上得到最大化的增值。

1. 资产配置策略

本基金80%以上的基金资产投资于债券等固定收益类金融工具，本基金股票投资比例上限不超过20%，以便控制市场波动的风险。

2. 债券投资策略

本基金将在保持组合低波动性的前提下，运用多种积极投资增殖策略，追求绝对回报，相对回报投资组合的目标在于资金保值增值、持续性地为绝对回报的方式实现增值。

3. 投资策略

(1) 精选个股策略
本基金将主要采取自下而上的个股精选策略，投资于具备稳定内生增长、能给股东创造经济价值(EVA)的股票。

(2) 综合动态调整策略

本基金将根据市场波动性及其走向趋势，采用平均法评估建仓节奏，控制建仓成本，同时设置止损止损点，在保证获利达到既定目标时及时兑现，以实现基金每年的绝对收益目标。

4. 权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其理论定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求风险可控的前提下方实现稳健的超额收益。

5. 指期货投资策略

股指期货投资用于对股市系统性风险管理，根据股指期货的投资分析模型和投资决策委员会的稳定性结论，选择适当的期货合约对冲大盘指数短期内下跌的风险；具体品种比例由历史对冲方法决定的Beta值直接择时模型共同决定。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的不断更新，本基金将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富投资策略。

6. 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为“债综合指数(全价)”。

本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

7. 风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
姓名	陈勇	张燕
信息披露负责人	0755-83026688	0755-83199984
联系电话	040-888-8998	95555
电子邮箱	info@ionfund.com.cn	yan_zhang@cmchina.com
客户服务电话	400-888-8998	
传真	0755-83026677	0755-83195210

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.ionfund.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

金额单位:人民币元

项目	2014年	2013年	2012年11月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	52,380,740.48	20,170,230.65	2,619,952.06
本期利润	78,776,030.67	21,994,850.42	1,705,334.03
加权平均基金份额本期利润	0.1918	0.0239	0.0012
本期基金份额净值增长率	18.04%	3.00%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额总额	0.1503	0.0250	0.0012
期末基金资产净值	450,752,165.51	473,375,482.18	1,397,606,705.34
期末基金份额净值	1.217	1.031	1.001

注:1. 上述基金的申购赎回费用由申购人承担,赎回人实际收取的赎回金额低于所列示金额。
2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减基金费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上年初至本期未实现的利润。
3. 本期可供分配利润是采用资产负债表日可供分配的利润与未分配利润之和确定的。

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的孰低数。

3.3 基金份额净值增长率及其与同行业相比基准收益率的比较

3.4 主要数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年11月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	52,380,740.48	20,170,230.65	2,619,952.06
本期利润	78,776,030.67	21,994,850.42	1,705,334.03
加权平均基金份额本期利润	0.1918	0.0239	0.0012
本期基金份额净值增长率	18.04%	3.00%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额总额	0.1503	0.0250	0.0012
期末基金资产净值	450,752,165.51	473,375,482.18	1,397,606,705.34
期末基金份额净值	1.217	1.031	1.001

注:本基金管理人对申购赎回费用由申购人承担,赎回人实际收取的赎回金额低于所列示金额。

2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减基金费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上年初至本期未实现的利润。

3. 本期可供分配利润是采用资产负债表日可供分配的利润与未分配利润之和确定的。

3.2 基金份额净值增长率及其与同行业相比基准收益率的比较

3.3 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

3.4 主要数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年11月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
份额净值增长率	1.217	1.031	1.001
业绩比较基准收益率	1.217	1.031	1.001
差额	0.000	0.000	0.000

注:本基金管理人对申购赎回费用由申购人承担,赎回人实际收取的赎回金额低于所列示金额。

2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减基金费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上年初至本期未实现的利润。

3. 本期可供分配利润是采用资产负债表日可供分配的利润与未分配利润之和确定的。

3.2 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

3.3 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

3.4 主要数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年11月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
份额净值增长率	1.217	1.031	1.001
业绩比较基准收益率	1.217	1.031	1.001
差额	0.000	0.000	0.000

注:本基金管理人对申购赎回费用由申购人承担,赎回人实际收取的赎回金额低于所列示金额。

2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减基金费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上年初至本期未实现的利润。

3. 本期可供分配利润是采用资产负债表日可供分配的利润与未分配利润之和确定的。

3.2 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

3.3 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

3.4 主要数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年11月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
份额净值增长率	1.217	1.031	1.001
业绩比较基准收益率	1.217	1.031	1.001
差额	0.000	0.000	0.000

注:本基金管理人对申购赎回费用由申购人承担,赎回人实际收取的赎回金额低于所列示金额。

2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减基金费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上年初至本期未实现的利润。

3. 本期可供分配利润是采用资产负债表日可供分配的利润与未分配利润之和确定的。

3.2 基金