诺安优化收益债券型证券投资基金

2014 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:华夏银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月23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2014年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014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	诺安优化收益债券
基金主代码	320004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月29日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	817,266,182.78份
基金合同存续期	不定期

注:原“诺安中短期债券投资基金”的基金合同生效日为2006年7月17日,2007年8月29日《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》生效,“诺安中短期债券投资基金”转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的稳妥和价值的稳定,力争为投资者提供高于投资基准的回报。
投资策略	本基金的投资策略分为固定收益类品种投资策略和新股投资策略两部分: (1)固定收益类品种投资策略包括总体资产配置、类属资产配置、期限结构配置、具体个券选择策略和资产支持证券投资策略。 (2)新股申购策略:在我国证券市场中,由于一、二级市场价差的存在,参与新股申购常常能够取得较低风险的稳定收益。本基金将在充分研究新发股票基本面的前提下,参与新股申购,并且将所得新股在其可交易之日起的60个交易日内全部卖出。
业绩比较基准	中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	郑鹏
	联系电话	0755-83026688	010-85238667
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95577
传真		0755-83026677	010-85238680

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	99,403,503.95	20,379,574.95	31,224,447.23
本期利润	181,213,216.90	13,894,796.78	51,256,977.14
加权平均基金份额本期利润	0.3479	0.0201	0.0833
本期基金份额净值增长率	23.75%	2.21%	7.71%
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利润	0.0735	0.0343	0.0191
期末基金资产净值	1,012,675,266.90	274,815,232.57	1,233,460,038.42
期末基金份额净值	1.2391	1.0853	1.0716

注:①上述基金业绩指标不包括持有人申购或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。

④2007年8月29日(不含当日)前本基金的名称为“诺安中短期债券投资基金”,2007年8月29日(含当日)后,本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。转型生效前,基金份额累计净值增长率列示自基金成立日起至转型生效前一日止的数据,基金转型生效后,此指标列示的是自基金转型生效日起的数据。

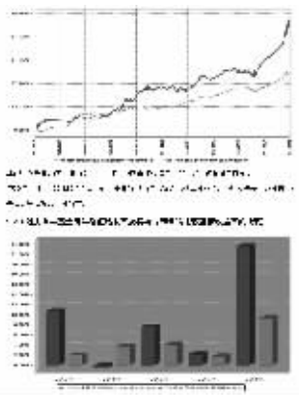
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	12.02%	0.54%	3.62%	0.17%	8.40%	0.37%
过去六个月	16.10%	0.38%	5.33%	0.21%	10.77%	0.17%
过去一年	23.75%	0.33%	9.41%	0.16%	14.34%	0.17%
过去三年	36.25%	0.24%	15.84%	0.10%	20.41%	0.14%
过去五年	50.08%	0.24%	22.64%	0.09%	27.44%	0.15%
自基金合同生效起至今	68.06%	0.21%	34.91%	0.09%	33.15%	0.12%

注:2007年8月29日(含当日)后,本基金转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”,业绩比较基准是中信标普全债指数。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	1.0000	123,144,308.62	15,446,972.86	138,591,281.48	本报告期分红一次
2013	0.1000	1,994,567.17	537,681.18	2,532,248.35	本报告期分红一次
2012	1.7000	251,551,734.43	18,515,679.21	270,067,413.64	本报告期分红两次
合计	2.8000	376,690,610.22	34,500,333.25	411,190,943.47	

§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2014年12月,本基金管理人共管理37只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、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、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、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、诺安多策略股票型证券投资基金、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、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。

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		
谢志华	固定收益部执行总监,诺安纯债定期开放债券基金经理,诺安鸿鑫保本混合基金经理,诺安信用债券一年定期开放债券基金经理,诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理,诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理,诺安优化收益债券基金经理,诺安永鑫一年定期开放债券基金经理,诺安保本混合基金经理,诺安汇鑫保本混合基金经理及诺安聚利债券基金经理	2013年12月18日	-	9	理学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,现任固定收益部执行总监。2013年5月起任诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起任诺安稳固收益一年定期定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理,2014年6月起任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年11月起任诺安保本混合型证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金及诺安聚利债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定;

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,诺安优化收益债券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》其他有关法律法规,遵守了《诺安优化收益债券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,同时涵盖投资授权、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

14年中国宏观经济总体温和向下,通胀压力不大,基本面对债券市场形成支撑。央行货币政策也趋于宽松,前期采取定向降准,以及SLF等新型货币工具缓和资金面,后期通过下调正回购利率、降息等措施引导无风险利率降低。全年货币政策进程持续推动债市行情。银行收缩非标业务,债券配置需求增加。在多种因素推动下,14年债券市场走出了难得的大行情。下半年受益于股票市场走强,转债市场也全面普涨。

投资运作上,诺安优化收益在规模大幅增加的情况下,努力保持了债券杠杆比例,四季度加大了转债的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.2391元。本报告期基金份额净值增长率为23.75%,同期业绩比较基准收益率为9.41%。

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15年债券市场,宏观基本面和货币政策仍有望对债市形成支撑,但趋势性行情空间可能小于14年。我们将持续关注央行货币政策进程、短端利率定位,同时对信用风险暴露的可能性保持警惕。

诺安优化将积极寻找潜在的交易性机会,同时将继续加强对持仓债券信用资质的跟踪管理,严控信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,如当期出现净亏损,则不进行收益分配。

本基金本报告期共进行利润分配一次。2014年12月3日(权益登记日)进行第一次利润分配,共分配利润138,591,281.48元,每10份基金份额分红数为1.000元。符合本基金合同约定。

截至2014年12月31日,本基金可供分配利润为60,108,148.24元。

4.7 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

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期共进行利润分配一次。2014年12月3日(权益登记日)进行了一次利润分配,共分配利润138,591,281.48元。

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

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2014年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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、洪锐明于2015年3月23日出具了德师报(审)字(15)第P0517号“无保留意见的审计报告”。投资者可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:诺安优化收益债券型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	17,123,054.34	8,928,330.47
结算备付金	34,508,997.20	14,252,883.24
存出保证金	116,373.56	142,001.56
交易性金融资产	1,609,646,994.55	509,331,433.80
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,609,646,994.55	509,331,433.80
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	-	-
应收证券清算款	-	1,128,669.83
应收利息	28,600,375.19	9,051,279.24
应收股利	-	-
应收申购款	36,259,607.62	124,100.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,726,255,402.46	542,958,698.14
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	699,128,999.80	258,599,556.00
应付证券清算款	11,223,382.68	5,026,300.39
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	905,147.04	194,270.88
应付托管费	232,752.11	49,955.34
应付销售服务费	362,058.80	77,708.32
应付交易费用	8,289.46	12,648.88
应交税费	1,593,322.57	1,593,322.57
应付利息	97,183.10	8,454.84
应付利润	-	2,532,248.35
递延所得税负债	-	-
其他负债	29,000.00	49,000.00
负债合计	713,580,135.56	268,143,465.57
所有者权益:		
实收基金	817,266,182.78	253,224,845.21
未分配利润	195,409,084.12	21,590,387.36
所有者权益合计	1,012,675,266.90	274,815,232.57
负债和所有者权益总计	1,726,255,402.46	542,958,698.14

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.2391元,基金份额总额817,266,182.78份。

7.2 利润表

会计主体:诺安优化收益债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	201,494,284.28	30,640,956.84
1.利息收入	50,399,511.78	40,333,981.63
其中:存款利息收入	429,728.60	295,889.50
债券利息收入	49,742,332.74	39,853,033.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	227,450.44	185,058.86
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	68,936,582.55	-3,472,225.40
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	68,936,582.55	-3,472,225.40
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	81,809,712.95	-6,484,778.17
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	348,477.00	263,978.78
减:二、费用	20,281,067.38	16,746,160.06
1.管理人报酬	4,287,597.94	5,307,763.09
2.托管费	1,102,525.17	1,364,853.41
3.销售服务费	1,715,039.17	2,123,105.23
4.交易费用	10,623.53	26,889.54
5.利息支出	12,988,765.83	7,706,522.29
其中:卖出回购金融资产支出	12,988,765.83	7,706,522.29
6.其他费用	176,515.74	217,026.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	181,213,216.90	13,894,796.78
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	181,213,216.90	13,894,796.78

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安优化收益债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1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)	253,224,845.21	21,590,387.36	274,815,232.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	181,213,216.90	181,213,216.90
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)	564,041,337.57	131,196,761.34	695,238,098.91
其中:1.基金申购款	1,920,452,904.17	407,314,820.86	2,327,767,725.03
2.基金赎回款	-1,356,411,566.60	-276,118,059.52	-1,632,529,626.12
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)	-	-138,591,281.48	-138,591,281.48
五、期末所有者权益(基金净值)	817,266,182.78	195,409,084.12	1,012,675,266.90
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	1,151,005,482.86	82,454,555.56	1,233,460,038.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,894,796.78	13,894,796.78
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)	-897,780,637.65	-72,226,716.63	-970,007,354.28
其中:1.基金申购款	904,601,831.16	78,209,544.16	982,811,375.32
2.基金赎回款	-1,802,382,468.81	-150,436,260.79	-1,952,818,729.60
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)	-	-2,532,248.35	-2,532,248.35
五、期末所有者权益(基金净值)	253,224,845.21	21,590,387.36	274,815,232.57

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 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

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》,同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

除上述会计政策外,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。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	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
华夏银行股份有限公司	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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,287,597.94	5,307,763.09
其中:支付销售机构的客户维护费	294,797.90	199,019.85

注:本基金的管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.70%÷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

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,102,525.17	1,364,853.41

注:本基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.18%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.18%÷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

基金托管人的托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,170,050.36
华夏银行股份有限公司(托管人)	77,661.92
合计	1,247,712.28
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,725,334.02
华夏银行股份有限公司(托管人)	90,620.01
合计	1,815,954.03

注:本基金的销售服务费按前一日的基金资产净值的0.28%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.28%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
华夏银行股份有限公司	17,123,054.34	177,382.97	8,928,330.47	188,578.09

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

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币240,128,999.80元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
0980155	09新海连债	2015年1月5日	102.29	400,000	40,916,000.00
1080033	10常德经投债	2015年1月5日	104.35	200,000	20,870,000.00
1080039	10临沂城投债	2015年1月5日	103.07	60,000	6,184,200.00
1480369	14莘高创债01	2015年1月5日	104.21	200,000	20,842,000.00
1480381	14南宁绿港债	2015年1月5日	103.31	200,000	20,662,000.00
101361008	13苏电器MTN001	2015年1月6日	100.10	200,000	20,020,000.00
101364012	13泰交通MTN001	2015年1月6日	104.34	300,000	31,302,000.00
101453026	14宏图MTN001	2015年1月6日	99.44	200,000	19,888,000.00
101459047	14常州投资MTN002	2015年1月6日	101.17	350,000	35,409,500.00
0980145	09邕水务	2015年1月13日	103.12	100,000	10,312,000.00
101355004	13闽交运MTN001	2015年1月13日	100.84	290,000	29,243,600.00
合计				2,500,000	255,649,300.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额459,000,000.00元,分别于2015年1月5日及2015年1月7日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

②各层级金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 281,991,055.48 元,属于第二层级的余额为1,327,655,939.07元,无属于第三层级的余额(2013年12月31日:第一层级227,670,812.28元,第二层级 281,660,621.52 元,无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,609,646,994.55	93.25
	其中:债券	1,609,646,994.55	93.25
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	51,632,051.54	2.99
7	其他各项资产	64,976,356.37	3.76
8	合计	1,726,255,402.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未进行股票交易。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未进行股票交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未进行股票交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,100,000.00	4.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,086,000.00	5.93
	其中:政策性金融债	60,086,000.00	5.93
4	企业债券	747,453,828.47	73.81
5	企业短期融资券	135,228,500.00	13.35
6	中期票据	358,349,000.00	35.39
7	可转债	259,429,666.08	25.62
8	其他	-	-
9	合计	1,609,646,994.55	158.95

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	360,000	56,372,400.00	5.57
2	019203	12国债03	500,000	49,100,000.00	4.85
3	113005	平安转债	240,830	43,450,548.60	4.29
4	0980155	09新海连债	400,000	40,916,000.00	4.04
5	101352007	13福公用MTN001	400,000	40,884,000.00	4.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8