

诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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

报告送出日期:2016年1月21日

§ 1.重要提示

基金管理人的董事局及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责任。

基金托管人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，并对基金定期报告的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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。

本报告期内财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺安优势行业混合

交易代码:000638

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年3月13日

报告期末基金份额总额:2,329,705,769.90份

投资目标:本基金通过积极资产配置及全面深入的研究,发掘优势行业,精选行业个股,力争在行业中获得超越市场的收益。

本基金将通过深入研究优势行业的基本面,具体从大类资产配置角度,权衡投资策略,力争投资收益,从而实现投资回报。

投资策略: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,在长期中获得超越市场的收益。

1. 大类资产配置策略:本基金将结合宏观经济形势、市场环境变化,长期中获得超越市场的收益的前提下,积极调整资产配置比例,根据市场变化,为投资者创造一定风险前提下获取较高的投资回报。

2. 股票投资策略:本基金将根据股票投资策略,个股选择两个部分。

3. 债券投资策略:本基金将根据债券投资策略,债券组合构建两个部分。

4. 权证投资策略:本基金将主要运用权证投资策略和权证套利策略。作为辅助性投资工具,我们结合自身特点积极探索,并利用权证的风险敞口。

业比较基准:60%×沪深300指数+40%×中证全债指数

风险收益特征:本基金属偏股型基金,定期向投资人分配股息的混合基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

基金管理人:诺安基金管理有限公司

下属分级基金的基金简称:诺安优势行业混合A

下属分级基金的交易代码:000638

报告期末下属分级基金的份额总额:1,249,039,018.47份

1,080,666,747.43份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

诺安优势行业混合A 诺安优势行业混合C

1.本期已实现收益 11,212,671.31 -408,785.04

2.本期利润 74,470,744.01 12,774,326.48

3.加权平均基金份额利润率 0.0480 0.0128

4.期末基金资产净值 1,023,032,804.11 1,404,742,968.48

5.期末基金份额净值 1.000 1.000

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价费用和交易费用水平将低于所列数字。

②本期的利润已进行分配,投资人收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

③自2015年11月18日起,本基金分设为两级基金份额: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 本报告期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

诺安优势行业混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.23% 1.10% 1.00% -7.7% -0.7%

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资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 职务

诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理

吴博波 2014年6月14日 - B

硕士,2008年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、行业研究员,2014年6月起担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月起担任诺安行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金本期未发生基金经理变更。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

投资研究方面,公司设立专门的公平交易小组,建立公平交易制度,并定期对公平交易制度的执行情况进行评估。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

4.2.3 相关人员公平交易制度的执行情况

本基金本期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人所有的投资组合参与的交易所公开竞价原则符合基金合同的规定。

4.3 报告期内基金组合投资的关联交易的情况

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场交易、二级市场交易等投资经营活动。

投资交易方面,对于场外交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易机制,交易中心按时间优先、价格优先的原则,根据多个投资组合同一时段下达的不同买卖申报,自动综合平衡,确保各投资组合获得公平的交易机会。

4.4 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内没有出现影响基金资产净值的重大事件。

4.5 投资组合报告

基金管理人报告本期基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况

1.报告期末基金资产总额:76,616,229.55

2.报告期末基金净值:1.001

3.加权平均基金份额利润率:0.0311

4.期末基金资产净值:80,402,222.04

5.期末基金份额净值:1.001

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价费用和交易费用水平将低于所列数字。

②本期的利润已进行分配,投资人收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安优势行业混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.24% 0.12% 0.40% 0.01% 2.64% -0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的当年定期存款基准利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 职务

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

谢忠华 2014年6月24日 -

硕士,2008年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、行业研究员,2014年6月起担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,2015年6月起担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。

本基金本期未发生基金经理变更。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

投资研究方面,公司设立专门的公平交易小组,建立公平交易制度,并定期对公平交易制度的执行情况进行评估。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

4.2.3 相关人员公平交易制度的执行情况

本基金本期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人所有的投资组合参与的交易所公开竞价原则符合基金合同的规定。

4.3 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内没有出现影响基金资产净值的重大事件。

4.4 报告期内基金的交易价格偏离日常交易价格的程度

本基金在报告期间内不存在异常交易行为。本报期间内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所在

4.5 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况

1.报告期末基金资产总额:1,199,694.22

2.本期利润:2,389,810.22

3.加权平均基金份额利润率:0.0311

4.期末基金资产净值:80,402,222.04

5.期末基金份额净值:1.001

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价费用和交易费用水平将低于所列数字。

②本期的利润已进行分配,投资人收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安永鑫收益一年定期开放C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.24% 0.12% 0.40% 0.01% 2.64% -0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的当年定期存款基准利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 职务

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

谢忠华 2014年6月24日 -

硕士,2008年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、行业研究员,2014年6月起担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,2015年6月起担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。

本基金本期未发生基金经理变更。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

投资研究方面,公司设立专门的公平交易小组,建立公平交易制度,并定期对公平交易制度的执行情况进行评估。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

根据相关法律法规、公司内部制度以及公司公平交易制度,本公司不存在内幕交易行为。

4.2.3 相关人员公平交易制度的执行情况

本基金本期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人所有的投资组合参与的交易所公开竞价原则符合基金合同的规定。

4.3 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内没有出现影响基金资产净值的重大事件。

4.4 报告期内基金的交易价格偏离日常交易价格的程度

本基金在报告期间内不存在异常交易行为。本报期间内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所在

4.5 报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况

1.报告期末基金资产总额:1,199,694.22

2.本期利润:2,389,810.22

3.加权平均基金份额利润率:0.0311

4.期末基金资产净值:80,402,222.04

5.期末基金份额净值:1.001

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计价费用和交易费用水平将低于所列数字。

②本期的利润已进行分配,投资人收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安永鑫收益一年定期开放C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.24% 0.12% 0.40% 0.01% 2.64% -0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的当年定期存款基准利率(税后)。

3.