

诺安主题精选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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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：中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内页，对本基金运作情况、净值表现、风险收益特征等重大遗漏。

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。

本报告中财务数据未经审计。

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：诺安主题精选混合型证券投资基金

交易代码：320012

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年9月16日

报告期末基金份额总额：22,464,309.61份

投资目标：本基金主要投资于证券市场中的股票资产，通过股票资产的配置和精选，力争在风险调整后收益超越业绩基准。

投资策略：本基金将主要投资于证券市场中的股票资产，通过股票资产的配置和精选，力争在风险调整后收益超越业绩基准。

业绩比较基准：75%×沪深300指数+25%×中证全债指数

风险收益特征：本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注：2015年6月6日起，原“诺安主题精选股票型证券投资基金”变更为“诺安主题精选混合型证券投资基金”。

§ 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)

1.本期已实现收益 10,768,477.24

2.本期利润 86,080,470.10

3.加权平均基金份额本期利润 0.3655

4.期末基金资产净值 410,872,221.97

5.期末基金份额净值 1.767

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示。

(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扣除本期费用后的余额。

3.21 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④
过去三个月 28.50% 11.4% 13.07% 1.26% 12.43% 0.29%

注：本基金的业比较基准为：75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。

3.22 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(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

罗春雷 诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理 2010年9月26日 - 硕士，曾先后就职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银河基金管理有限公司，从2012年1月起至2015年6月就职于诺安基金管理有限公司，任基金经理。2016年1月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理。

刘鹏 诺安全球经济股票型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理 2016年1月17日 2015年11月21日 10 博士，曾在光大证券股份有限公司、诺安基金管理有限公司、银河基金管理有限公司、从2012年1月起至2015年6月就职于诺安基金管理有限公司，任基金经理。2016年1月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理。

注：(1)此处基金经理的任职日期和离任日期均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。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

报告期间，诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理严格遵守了《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《诺安主题精选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。本公司投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.4 投资组合的重大关联交易行为的专项说明

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，在此基础上，不将投资组合根据其投资目标、投资风格和投资策略的不同，建立不同投资组合的公平交易规则，将投资组合自动划分为一级市场申购、非公开发行股票申购等集中竞价交易的交易分配，在申购与参与申购之前，各投资组合经独立地确定申购价格和交易时机，公司在此获得额度确定后，按比例分配给各投资组合。

4.5 管理人对宏观经济、行业及市场情况的专项说明

报告期间，本公司未对宏观经济、行业及市场情况发表任何观点。

4.6 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.7 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.8 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.9 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.10 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.11 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.12 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期间内不存在异常交易行为。

4.13 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.14 投资组合的重大关联交易行为的专项说明

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.15 管理人对宏观经济、行业及市场情况的专项说明

报告期间，本公司未对宏观经济、行业及市场情况发表任何观点。

4.16 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.17 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.18 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.19 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.20 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.21 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.22 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.23 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.24 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.25 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.26 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.27 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.28 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.29 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.30 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.31 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.32 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.33 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.34 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.35 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.36 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.37 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.38 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.39 公平交易制度执行的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理办法》，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。制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和债券管理，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相关的各个环节。

4.40 公平交易制度执行的执行情况