

诺安价值增长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

基金管理人的董事会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。

基金托管人和基金管理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、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。

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12月31日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称	诺安价值增长混合
交易代码	320006
基金合同生效方式	定期开放式
基金合同生效日	2006年11月1日
报告期末基金份额总额	2,010,623,286.00份

投资目标 依托于中国经济持续增长带来的长期增长，发挥价值挖掘和长期持股的优秀投资策略。

投资策略 在资产配置方面，根据国内外经济形势、资金和市场的变化，采取自上而下的方法，结合行业估值、货币市场利率等因素，通过恰当的债券投资和股票投资，在股票投资方面，采用自下而上的方法选股，在债券投资方面，通过研究宏观经济、国家政策变化、利率、资金面、行业景气度、估值、成长性等指标，为投资者寻找高收益且风险平均的优质投资品种。

业绩比较基准 100%×同期中国人民银行一年期定期存款利率+20%×同期中国国债指数

风险收益特征 本基金属于混合型基金，高风险收益基金与货币市场基金

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

注:自2015年8月6日起,原“诺安价值增长股票证券投资基金”变更为“诺安价值增长混合型证券投资基金”。

\$ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 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.本期实现收益	141,102,771.43
2.本期利润	331,101,010.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0169
4.期末基金资产净值	2,379,538,066.00

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的数字。

(2)本期已实现收益指本期利息收入、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,本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

阶段 净值增长(%) ① 同期业绩比较基准收益率(%) ② ①-②

过去三个月 10.32% 14.07% -1.75% 13.06% -0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:100%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债基金指数。

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

阶段 净值增长(%) ① 同期业绩比较基准收益率(%) ② ①-②

过去三个月 10.32% 14.07% -1.75% 13.06% -0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:100%×富时中国A股600指数+20%×富时中国国债基金指数。

3.3 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时间	证券从业年限	说明
刘红辉	诺安价值增长基金经理、诺安价值基金基金经理、诺安高级管理人员	2011年3月17日	-	12

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合规情况的说明

报告期内,诺安价值增长混合型证券投资基金严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规,遵循了《诺安价值增长股票证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本公司投资运作未发生违法乱纪行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易原则的执行情况

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》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时涵盖投资研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评估等投资管理相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立专门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,建立不同的投资组合的证券备选库,对买卖对象实行集中统一管理,具体由投资决策委员会、风险管理委员会、投资总监、基金经理、基金经理助理、研究员、交易员等组成,并由基金经理对买卖对象进行严格的事前审批。

投资决策方面,公司设立专门公司所有投资组合适用的证券备选库,对买卖对象实行集中统一管理,具体由投资决策委员会、风险管理委员会、投资总监、基金经理、基金经理助理、研究员、交易员等组成,并由基金经理对买卖对象进行严格的事前审批。

投资组合方面,公司设立专门公司所有投资组合适用的证券备选库,对买卖对象实行集中统一管理,具体由基金经理、基金经理助理、研究员、交易员等组成,并由基金经理对买卖对象进行严格的事前审批。

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公平交易功能,交易中心按照投资时间优先、价格优先的原则执行指令,如果申购价格相同,则根据申购价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间同业交易,固定收益平台,交易所大宗交易,投资组合经理以投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间同业交易部门发送交易指令,并根据成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则确保各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 非公平交易的专项说明

本基金在报告期内不存在不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期期内存在异常交易行为,为本报告期内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股票,但存在成交金额不足该证券当日成交量5%的情况。

4.5 报告期内基金的分红情况

本基金在报告期期内没有分红情况。

4.6 报告期内基金的费用情况

本基金在报告期期内没有费用情况。

4.7 报告期内基金的税收情况

本基金在报告期期内没有税收情况。

4.8 报告期内基金的费用调整情况

本基金在报告期期内没有费用调整情况。

4.9 报告期内基金的费用计提、回收情况

本基金在报告期期内没有费用计提、回收情况。

4.10 报告期内基金的费用摊销情况

本基金在报告期期内没有费用摊销情况。

4.11 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.12 报告期内基金的费用调增情况

本基金在报告期期内没有费用调增情况。

4.13 报告期内基金的费用减免情况

本基金在报告期期内没有费用减免情况。

4.14 报告期内基金的费用豁免情况

本基金在报告期期内没有费用豁免情况。

4.15 报告期内基金的费用收取情况

本基金在报告期期内没有费用收取情况。

4.16 报告期内基金的费用支付情况

本基金在报告期期内没有费用支付情况。

4.17 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.18 报告期内基金的费用调减情况

本基金在报告期期内没有费用调减情况。

4.19 报告期内基金的费用摊销情况

本基金在报告期期内没有费用摊销情况。

4.20 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.21 报告期内基金的费用调增情况

本基金在报告期期内没有费用调增情况。

4.22 报告期内基金的费用减免情况

本基金在报告期期内没有费用减免情况。

4.23 报告期内基金的费用豁免情况

本基金在报告期期内没有费用豁免情况。

4.24 报告期内基金的费用收取情况

本基金在报告期期内没有费用收取情况。

4.25 报告期内基金的费用支付情况

本基金在报告期期内没有费用支付情况。

4.26 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.27 报告期内基金的费用调减情况

本基金在报告期期内没有费用调减情况。

4.28 报告期内基金的费用摊销情况

本基金在报告期期内没有费用摊销情况。

4.29 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.30 报告期内基金的费用调增情况

本基金在报告期期内没有费用调增情况。

4.31 报告期内基金的费用减免情况

本基金在报告期期内没有费用减免情况。

4.32 报告期内基金的费用豁免情况

本基金在报告期期内没有费用豁免情况。

4.33 报告期内基金的费用收取情况

本基金在报告期期内没有费用收取情况。

4.34 报告期内基金的费用支付情况

本基金在报告期期内没有费用支付情况。

4.35 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.36 报告期内基金的费用调减情况

本基金在报告期期内没有费用调减情况。

4.37 报告期内基金的费用摊销情况

本基金在报告期期内没有费用摊销情况。

4.38 报告期内基金的费用冲销情况

本基金在报告期期内没有费用冲销情况。

4.39 报告期内基金的费用调增情况

本基金在报告期期内没有费用调增情况。

4.40 报告期内基金的费用减免情况

本基金在报告期期内没有费用减免情况。

4.41 报告期内基金的费用豁免情况

本基金在报告期期内没有费用豁免情况。

4.42 报告期内基金的费用收取情况

本基金在报告期期内没有费用收取情况。

4.43 报告期内基金的费用支付情况

本基金在报告期期内没有费用支付情况。