诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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2015年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年6月18日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安创新驱动混合	
基金主代码	001411	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月18日	
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	
报告期末基金份额总额	4,642,465,782.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安创新驱动混合A	诺安创新驱动混合C
下属分级基金的交易代码:	001411	002051
报告期末下属分级基金的份额总额	1,216,741,029.76份	3,425,724,752.47份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取大类资产配置策略,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 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资产配置策略,根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,相机进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。 本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,动态优化投资组合,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。 2.股票投资策略 (1)创新驱动型相关主题上市公司的界定 创新型相关企业是指拥有自主知识产权的核心技术,知名品牌,具有良好的创新管理和文化,整体技术水平在同行业居于先进地位,在市场竞争中具有优势和持续发展能力的企业。创新驱动型公司可以简单的理解为传统行业在技术、品牌、管理文化等方面往新兴行业、朝阳行业转型的公司,也可以是部分新兴行业类公司在原有技术、文化的基础上进一步的突破。 创新驱动型企业往往具备一定的特征:如以研究开发为企业的核心职能之一;集研发、生产、销售三位一体;较早且基于想象地确定一个潜在市场;关注潜在市场,努力培养、帮助用户;有着高效的协调研究与开发、生产和销售的企业家精神;与客户和保持密切联系,紧且市场需求;结合国家新兴发展战略、拓展产业布局;通过外延或内部激励,实现效率的提高等等。 符合上述特征的企业,我们可以看成是创新驱动型企业。创新驱动型企业大多分布在高科技行业、消费品行业、知识密集型服务或国家政策倡导的新行业:如新能源汽车、工业机器人、智能建筑等。创新驱动型企业是一个国家最有活力的企业,应该成为政府重点扶植的对象,也是本基金未来重点的投资对象。 (2)公司基本面评价 在创新驱动型公司中,本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司。 1)公司所处行业市场空间相对于公司目前收入体量足够大 本基金主要通过行业数据以及公司披露等信息,对公司所处行业未来的市场容量判断,重点投资于行业处于蓝海阶段的公司。但在红海类行业里,如公司具备相关优势且有足够能力抢占竞争对手份额的,也是本基金投资的方向。 2)公司所在行业景气度较高,最好具备一定的政策扶持 本基金主要通过密切关注国家相关产业政策、规划动态,同时深入进行上、下游产业链调研,适时对各行业景气度变化情况进行研判,重点投资于行业景气度较高且、有政策支持、未来成长具有可持续性的公司。 3)公司所在行业竞争格局良好,有竞争优势 本基金主要通过密切跟踪行业集中度、行业内主要竞争对手策略及各公司产品(或服务)的市场份额,以及公司自身的竞争优势,判断公司所处行业格局,重点投资于处于行业龙头地位或具备成为龙头潜力的优势公司。 4)公司自身具备一定的壁垒或者优势 通过密切跟踪、调研相关公司以及竞争对手,了解公司在技术、管理、销售、资金等方面是否有对手不可复制的壁垒,以该特点出发评估公司的竞争力以及长期成长性,对具备壁垒的公司会给予重点投资。 5)公司管理层素质较高 选择管理层素质较高的公司,如高管管理团队具备较强的研发能力或者营销能力;公司已建立起完善的法人治理结构;激励与利益分配机制设置合理;公司长期愿景清晰;企业文化彰极向上,具备大的蓝图和发展战略。 (3)估值水平分析 本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点,选择合适的股票估值方法,可供选择的估值方法包括市盈率(P/E)、市净率法(P/B)、市盈率－长期成长法(PEG)、企业价值/销售收入(EV/SALES)、企业价值/息税折旧摊销前利润法(EV/EBITDA)、自由现金流贴现模型(FCFF,FCFE)或股利贴现模型(DDM)等。 通过估值水平分析,基金管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。 (4)股票组合的构建与调整 在估值分析的基础上,本基金将建立投资组合。当行业或公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时,本基金将对股票组合适时进行调整。 3.债券投资策略方面,本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。 4.权证投资策略方面,本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具,我们将结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。 5.股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎的原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。 在预判市场风险较大时,应用股指期货对冲策略,即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后,在面临市场下跌时择机卖出股指期货合约进行套期保值,当股市好转之后再将期指合约空单平仓。 6.资产支持证券投资策略 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数与中证全债指数的混合指数,即:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	洪渊
	联系电话	0755-83026688	(010)66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798

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	2015年6月18日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	诺安创新驱动混合A	诺安创新驱动混合C
本期已实现收益	5,455,315.43	-686,171.90
本期利润	9,678,947.95	9,578,768.34
本期加权平均净值利润率	0.39%	0.29%
本期基金份额净值增长率	1.30%	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0048	0.0049
期末基金资产净值	1,232,097,499.78	3,469,412,255.47
期末基金份额净值	1.013	1.013

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,详情请见相关公告。

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

诺安创新驱动混合A

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	1.10%	0.07%	11.02%	1.00%	-9.92%	-0.93%
过去六个月	1.60%	0.08%	-7.39%	1.60%	8.99%	-1.52%
自基金合同生效起至今	1.30%	0.08%	-14.50%	1.71%	15.80%	-1.63%

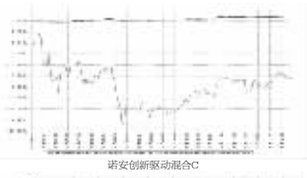
诺安创新驱动混合C

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
自基金合同生效起至今	0.30%	0.03%	1.11%	1.00%	-0.81%	-0.97%

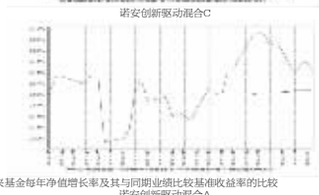
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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

诺安创新驱动混合A

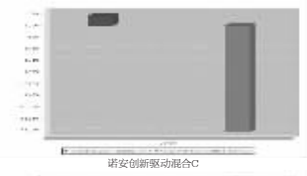


诺安创新驱动混合C

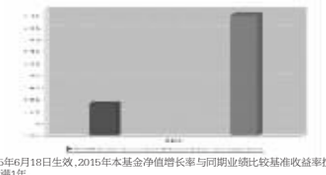


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安创新驱动混合A



诺安创新驱动混合C



注:本基金基金合同于2015年6月18日生效,2015年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算,截止2015年12月31日,本基金成立未满1年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2015年6月18日生效,截止2015年12月31日,本基金未进行利润分配。

§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2015年12月,本基金管理人共管理45只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、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、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、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、诺安多策略混合型证券投资基金、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、诺安孟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、诺安研究精选股票型证券投资基金、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、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安鸿鹄灵益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金。

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		
吴博俊	诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月18日	-	8	硕士,2008年加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2014年6月起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月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置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为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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,诺安创新驱动灵活配置混合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》及其他有关法律法规,遵守了《诺安创新驱动灵活配置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,以规范投资决策委员会、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,超过授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于询价、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。本报告期内本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

工业、消费、投资微降,经济下行压力仍在:2015年12月份,规模以上工业增加值同比实际增长6.9%,比11月份回落0.3个百分点。固定资产投资(不含农户)比上年名义增长10%,增速比1-11月份回落0.2个百分点,房地产投资不及预期。社会消费品零售总额同比名义增长11.1%,虽有回落,但整体上依然保持了今年下半年以来稳步回升的良好发展态势。本月工业、消费、投资增速均有所下降,份创新低,这也显示了中国经济下行仍然较大。

投资低位徘徊,经济增长动力面临调整:第四季度GDP同比增长6.8%,2015年全年增长6.9%,创25年新低。对经济增长起关键性作用的投资增长持续放缓,2015年全年全国房地产开发投资比上年名义仅增长1.0%。我国经济发展单纯依靠房地产行业拉动投资的发展路径难以为继。

外围经济方面,12月17日,美联储将利率上限提升25个基点,标志着超宽松时期的结束。人民币兑美元中间价在12月9日开始连续10连贬,随着未来人民币国际化进程的推进,人民币兑美元汇率将成为国际关注的标杆汇率,央行将在短期内阐力保持其灵活性,这也意味人民币有一定的贬值空间存在。

12月18日至21日中央经济工作会议召开,会议定调来年结构性改革,战略上要坚持稳中求进、把握好节奏和力度,战术上主要抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务。去产能,有利于化解企业产能过剩,加速结构调整;去库存,有利于释放房地产库存压力;去杠杆,可以防范系统性金融风险;减成本,帮助企业脱离困境提升利润。未来去产能进程中,企业经营定会面临一段时间的阵痛期,盈利恶化。但也只有产能出清,整个行业才能摆脱过剩产能的拖累,重焕生机,从而提振整个经济形势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,诺安创新驱动混合A的基金份额净值为1.013元。本报告期基金份额净值增长率为1.30%,同期业绩比较基准收益率为-14.50%。

截至报告期末,诺安创新驱动混合C的基金份额净值为1.013元。本报告期基金份额净值增长率为0.30%,同期业绩比较基准收益率为1.11%。

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2016年,经济层面的稳增长依然是主要方向,但国企改革的进一步细化、十三五规划的逐渐明朗都可能给改革、调结构赋予新的内容与方向。在现金、股票、债券、新股申购等资产类别的配置上我们将继续维持稳健+成长的组合。

股票投资方面,优质蓝筹股以及低估值业绩增长的成长股都还会是我们投资的方向,国企改革、互联网+、工业4.0、十三五规划等政策主题投资依然值得跟踪关注。同时,静待注册制推出的契机。债券配置方面,震荡市中,我们会适当加大在高等级、短期限的债券的配置比例以获取稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行(企业会计准则)估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部,财务综合部,合规与风险控制部,固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.8 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

本报告期内,本基金托管人在对诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

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、吴迪于2016年3月25日出具了德师报(审)字(16)第P0713号“无保留意见的审计报告”。投资者可以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:诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日
资 产:	
银行存款	73,722,047.83
结算备付金	3,973,215.87
存出保证金	120,173.67
交易性金融资产	962,228,818.19
其中:股票投资	48,579,818.19
基金投资	-
债券投资	913,649,000.00
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	3,267,166,223.59
应收证券清算款	400,079,527.05
应收利息	7,701,479.42
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	4,714,991,485.62
负债和所有者权益	本期末 2015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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	5,682,695.43
应付管理人报酬	6,173,840.47
应付托管费	1,028,973.42
应付销售服务费	305,457.75
应付交易费用	179,346.11
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	111,417.19
负债合计	13,481,730.37
所有者权益:	
实收基金	4,642,465,782.23
未分配利润	59,043,973.02
所有者权益合计	4,701,509,755.25
负债和所有者权益总计	4,714,991,485.62

注:①报告截止日2015年12月31日,基金份额总额4,642,465,782.23份,其中,诺安创新驱动混合A类基金份额净值人民币1,013元,基金份额1,216,741,029.76份;诺安创新驱动混合C类基金份额净值人民币1,013元,基金份额3,425,724,752.47份。

②本会计期间为2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	50,997,667.27
1.利息收入	26,964,290.21
其中:存款利息收入	5,235,031.74
债券利息收入	6,924,807.26
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	14,804,451.21
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-24,109,927.94
其中:股票投资收益	-24,517,448.34
基金投资收益	-
债券投资收益	277,309.01
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	130,211.39
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	14,488,572.76
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	33,654,732.24
减:二、费用	31,739,950.98
1. 管理人报酬	26,156,286.90
2. 托管费	4,359,381.19
3. 销售服务费	411,963.95
4. 交易费用	612,948.79
5. 利息支出	12,814.57
其中:卖出回购金融资产支出	12,814.57
6. 其他费用	186,555.58
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	19,257,716.29
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	19,257,716.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月18日(基金合同生效日)至2015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)	6,170,337,782.74	-	6,170,337,782.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,257,716.29	19,257,716.29
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)	-1,527,872,000.51	39,786,256.73	-1,488,085,743.78
其中:1.基金申购款	6,100,730,078.36	29,185,573.71	6,129,915,652.07
2.基金赎回款	-7,628,602,078.87	10,600,683.02	-7,618,001,395.85
四、本期向基金分配持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,642,465,782.23	59,043,973.02	4,701,509,755.25

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 基金基本情况

诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2015]1026号文《关于准予诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准,于2015年6月4日至2015年6月12日向社会进行公开募集,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资,募集的有效认购金额为人民币6,170,337,782.74元,其中净认购额为人民币6,170,023,846.48元,折合6,170,023,846.48份基金份额,有效认购金额产生的利息为人民币313,936.26元,折合313,936.26份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2015年6月18日,合同生效日基金份额为6,170,337,782.74份基金份额。

根据2015年11月18日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金新增基金份额类别并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》,自2015 年11 月18日起,本基金将设两级基金份额:A 类基金份额和C 类基金份额。A 类基金份额的基金代码为001411(与分级前基金代码相同)。新设C 类基金份额代码为002051。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于2016年3月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表所编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为2015年6月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2)金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益;应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本;股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(2)贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

(3)其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1)对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

(2)对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值小组认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(3)当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值小组认为必要时,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价