诺安全球黄金证券投资基金

【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	诺安全球黄金(QDII-FOF)
基金主代码	320013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月13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	830,241,053.15份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于境外有实物支持的黄金ETF,紧密跟踪金价走势,为投资者提供一类可有效分散组合风险的黄金类金融工具。
投资策略	本基金主要通过投资于有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪金价的投资目标。本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金ETF,之后基本上采取买入持有的投资策略,但根据标的ETF跟踪误差、流动性等因素定期进行调整和再平衡。本基金只买卖和持有黄金ETF份额,不直接买卖或持有实物黄金。本基金的具体投资策略包括ETF组合管理策略以及现金管理策略两部分组成。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。
风险收益特征	本基金为基金中基金,主要投资于实物黄金支持的黄金ETF,投资目标为紧密跟踪黄金价格,预期风险收益水平与黄金价格相似,在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	无	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York,NY 1005
办公地址		-	140 Broadway New York,NY 1005
邮政编码		-	NY 1005

2.5 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	2014年	2013年
本期已实现收益	-48,493,590.44	-83,310,993.46	-59,643,714.97
本期利润	-33,589,298.57	-7,372,105.64	-384,552,236.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0409	-0.0071	-0.3067
本期基金份额净值增长率	-6.00%	-2.05%	-28.93%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3258	-0.2831	-0.2676
期末基金资产净值	559,723,840.19	654,932,125.51	833,568,026.57
期末基金份额净值	0.674	0.717	0.732

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。

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

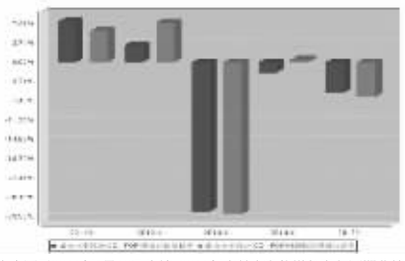
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.02%	0.84%	-2.87%	0.94%	-0.15%	-0.10%
过去六个月	-3.99%	0.86%	-3.85%	1.02%	-0.14%	-0.16%
过去一年	-6.00%	0.85%	-6.73%	0.93%	0.73%	-0.08%
过去三年	-34.56%	0.97%	-33.93%	1.07%	-0.63%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-27.06%	1.00%	-24.50%	1.14%	-2.56%	-0.14%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价格折成人民币后的收益率,伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)。

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

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。

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



注:本基金基金合同于2011年1月13日生效,2011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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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、诺安裕鑫收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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
宋青	国际业务部总监、诺安全球黄金证券投资基金基金经理、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理	2011年11月14日	-	7	学士学位,具有基金从业资格。曾先后任职于香港富海企业有限公司、中国银行广西分行、中国银行伦敦分行、深圳航空集团公司、道富环球投资管理亚洲有限公司上海代表处,从事外汇交易、证券投资、固定收益及贵金属商品交易等投资工作。2010年10月加入诺安基金管理有限公司,任国际业务部总监。2011年11月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2012年7月起任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)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》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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,诺安全球黄金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《诺安全球黄金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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2015年,黄金延续2014年的跌势,拾级而下,基本上以年底低点附近收场,全年下跌11%左右。主要因素有以下几个方面。

美联储加息预期逐渐升温,投资者资金流出黄金资产成为主导原因。2015年美国经济数据虽然略有反复,例如每月制造业新增订单依然处于下滑趋势,但总体来看美国经济数据较为靓丽,显示已经进入稳健恢复状态,失业率已从年初的5.7%下降至年末的5%,每月新增非农就业人口总体符合预期,其中个别月份表现格外亮眼。美国经济的恢复使得美联储加息预期不断升温,美元指数持续走强,3月美元指数攀上至经济危机以来高位,强势美元压制着金价的上升。尽管美国的通胀水平仍未达到加息目标,但美联储官员认为一旦未来全球大宗商品价格走稳,通胀就能走高,其对通胀的关注已转向具有前瞻性的通胀预期,而非实际进展,并于12月宣布升息25基点。近年除美国外全球各大经济体潜在增速放缓,使得全球对大宗商品需求下降,导致价格下跌,其中原油价格在2015年全年下跌35%。大宗商品价格的疲软引发通缩忧虑,不利于具有抗通胀属性黄金的价格上涨。

另一方面,2015年期间突发事件不断,引发短期避险情绪,使黄金价格受到一定提振。年初希腊债务危机爆发及国内政局动荡,使金融市场避险情绪大增。中东地缘政治冲突的升温、法国巴黎恐怖袭击等一系列突发事件使黄金行情得到拉升。期间中国股市动荡以及人民币贬值也加重了市场的悲观情绪,推动了黄金价格的上涨。而各央行的黄金增持策略也使黄金市场在强势美元压制下得到喘息。中国央行12月末黄金总储备5666万金衡盎司,约合1762.3公吨,自2009年以来增长了58%。俄罗斯央行自2007年就持续增加黄金储备,年初以来增加约208.4公吨,2015年末黄金储备1415公吨,同比增长17%。

回看运作情况,全年我们基本维持仓位跟踪价格,但是没有叙做汇率套保,享受了一些本币贬值的好处。

4.5.2 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0.674 元。本报告期基金份额净值增长率为-6.00%,同期业绩比较基准收益率为-6.73%。

4.6 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,市场动荡及黄金基本面的改善影响黄金价格变化,吸引投资者重新将资金配置于黄金。美联储2015年12月会议决定加息25基点,我们认为2016年美元加息将会放缓,目前市场利率期货仅预期加息一次。美国的加息意味着以美元计价并没有息率的黄金相对于美元资产竞争力下降,如果美元继续强势会令金价承压。另一方面,货币政策的分化使新兴经济体面临货币贬值压力,令全球金融市场较为动荡从而引发避险需求,提振金价。我们认为亚洲央行在2016年仍会继续增持黄金。过往黄金价格的走低将清洗部分高成本的金矿使得黄金市场供需趋向平衡。长期随着美国经济的持续复苏,经济活动的扩张,大宗商品价格走稳。黄金将走出中期的反弹行情并有机会反转,重拾升势。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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6次,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%。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。

4.9 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全球黄金QDII基金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,诺安全球黄金QDII基金证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安全球黄金QDII基金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。本报告期内,诺安全球黄金QDII基金证券投资基金未进行利润分配。

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全球黄金QDII基金基金管理有限公司编制和披露的诺安全球黄金QDII基金证券投资基金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

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P0683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:诺安全球黄金证券投资基金

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	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	40,826,582.73	33,193,779.48
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	524,111,867.23	616,577,582.91
其中:股票投资	-	-
基金投资	524,111,867.23	616,577,582.91
债券投资	-	-
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	-	12,028,621.47
应收利息	1,446.71	2,178.33
应收股利	-	-
应收申购款	575,105.92	881,330.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	27,000,000.00	-
资产总计	592,515,002.59	662,683,492.96
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	3,248,219.83	-
应付赎回款	2,217,238.55	6,898,842.26
应付管理人报酬	474,490.04	569,141.40
应付托管费	123,367.41	147,976.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	26,727,846.57	135,407.01
负债合计	32,791,162.40	7,751,367.45
所有者权益:		
实收基金	830,241,053.15	913,560,759.22
未分配利润	-270,517,212.96	-258,628,633.71
所有者权益合计	559,723,840.19	654,932,125.51
负债和所有者权益总计	592,515,002.59	662,683,492.96

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.674元,基金份额总额830,241,053.15份。

7.2 利润表

会计主体:诺安全球黄金证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	-26,011,343.14	3,205,420.35
1.利息收入	88,921.99	101,459.40
其中:存款利息收入	88,921.99	78,709.40
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	22,750.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-45,511,690.80	-73,577,918.56
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-45,511,690.80	-73,619,318.56
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	41,400.00
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	14,904,291.87	75,938,887.82
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	4,404,590.46	623,088.37
5.其他收入(损失以"-"号填列)	102,543.34	119,903.32
减:二、费用	7,577,955.43	10,577,525.99
1. 管理人报酬	5,829,502.09	8,044,823.92
2. 托管费	1,515,670.49	2,091,654.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	63,354.85	62,751.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	169,428.00	378,296.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-33,589,298.57	-7,372,105.64
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-33,589,298.57	-7,372,105.64

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安全球黄金证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	913,560,759.22	-258,628,633.71	654,932,125.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-33,589,298.57	-33,589,298.57
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)	-83,319,706.07	21,700,719.32	-61,618,986.75
其中:1.基金申购款	272,557,269.46	-79,563,239.20	192,994,030.26
2.基金赎回款	-355,876,975.53	101,263,958.52	-254,613,017.01
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	830,241,053.15	-270,517,212.96	559,723,840.19
项目	上年度可比期间 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)	1,138,067,640.93	-304,499,614.36	833,568,026.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-7,372,105.64	-7,372,105.64
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)	-224,506,881.71	53,243,086.29	-171,263,795.42
其中:1.基金申购款	139,537,306.90	-32,358,056.60	107,179,250.30
2.基金赎回款	-364,044,188.61	85,601,142.89	-278,443,045.72
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	913,560,759.22	-258,628,633.71	654,932,125.51

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

诺安全球黄金证券投资基金(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[2010]1712 号文《关于核准诺安全球黄金证券投资基金募集的批复》批准,于2010 年12月10日至2011年1月10日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,募集的有效认购金额为人民币3,209,667,460.52 元,其中净认购额为人民币3,196,195,768.30 元,折合3,196,195,768.30 份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币581,923.41 元,折合581,923.41 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2011年1月13日,合同生效日基金份额为3,196,777,691.71 份基金单位。

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,境外资产托管人为Brown Brothers Harriman &Co.(布朗兄弟哈里曼银行)。《诺安全球黄金证券投资基金合同》、《诺安全球黄金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 会计报表的编制基础

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(以下简称"企业会计准则")及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年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构
Brown Brothers Harriman & Co. (布朗兄弟哈里曼银行)	境外资产托管人

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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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。

7.4.7.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.7.1.3 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。

7.4.7.1.4 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,829,502.09	8,044,823.92
其中:支付销售机构的客户维护费	2,562,463.04	3,540,978.27

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,515,670.49	2,091,654.27

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.26%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.26%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行股份有限公司	3,408,430.84	79,728.89	15,049,708.56	68,854.52
Brown Brothers Harriman & Co. (布朗兄弟哈里曼银行)	37,418,151.89	9,093.56	18,144,070.92	9,637.66

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外托管人Brown Brothers Harriman & Co.(布朗兄弟哈里曼银行)保管,按适用利率或约定利率计息。

7.4.7.6 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。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金与境外资产托管人Brown Brothers Harriman & Co.(布朗兄弟哈里曼银行)进行外汇掉期交易,按合同约定汇率即期卖出人民币买入美元,远期卖出美元买入人民币。截至本报告期末2015年12月31日止,本基金未结算的外汇掉期交易为2016年1月7日卖出美元2,278,769.46元,买入人民币15,000,000.00元;2016年1月8日卖出美元1,861,667.93元,买入人民币12,000,000.00元。

7.4.8 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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2015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。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.9 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2015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524,111,867.23元,无属于第二层级和第三层级的余额(2014年12月31日:第一层级616,577,582.91元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

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。

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:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	524,111,867.23	88.46
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	40,826,582.73	6.89
8	其他各项资产	27,576,552.63	4.65
9	合计	592,515,002.59	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金