# 诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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:2017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2017年3月29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2016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2016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 | 诺安新动力混合 |
| 基金主代码 | 320018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月5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 | 27,996,237.36 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采取积极主动的分析化投资方法,运用多种投资策略灵活配置资产,深入挖掘新形势下推动中国经济持续发展、加快国际经济转型方式转变、促进经济结构转型的新动力,投资该新动力概念下具有高成长性和持续盈利能力的优质上市公司,在严格控制投资风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将实施和积主动的投资策略,运用多种方法进行灵活的资产配置。具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略与部分组成。<br>1.资产配置策略<br>本基金采取战略性资产配置(Strategic Asset Allocation, SAA)和战术性资产配置(Tactical Asset Allocation, TAA)相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,系统进行短期资产灵活配置,深入分析古大新动力所涉及行业面临的市场机遇与风险,在权益类资产和固定收益类资产间进行合理配置,通过积极选择构建在承受一定风险的前提下可获取较高收益的资产组合。<br>2.股票投资策略<br>本基金的股票投资策略主要由新动力主题筛选、构建备选股票库、精选个股和构建组合四个步骤组成。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券投资原分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate Anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield Spread Analysis)以及个券信息策略(Valuation Analysis)。<br>4.权证投资策略<br>权证投资属于本基金的辅助性投资工具,本基金将主要运用价值发现策略和获利交易策略,结合自身资产状况审慎投资,力图获得超值风险调整收益。<br>5.股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×60%+中证综合债券指数×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

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 | 马宏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-83369688 | (010)66106799 |
| | 电子邮箱 | info@lionfundcom.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-8998 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83369677 | (010)66106798 |

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.lionfundcom.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

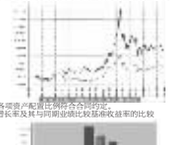
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -11,206,383.74 | 50,770,011.06 | 12,112,435.72 |
| 本期利润 | -11,136,004.27 | 29,218,296.56 | 31,096,178.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3346 | 0.4836 | 0.2631 |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.67% | 30.18% | 42.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5666 | 0.8717 | 0.2019 |
| 期末基金资产净值 | 43,660,833.10 | 75,348,990.21 | 109,844,202.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.560 | 1.872 | 1.438 |

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。

3.2 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 | -1.76% | 0.7% | 0.51% | 0.44% | -2.27% | 0.31% |
| 过去六个月 | -4.12% | 0.80% | 3.24% | 0.46% | -7.36% | 0.34% |
| 过去一年 | -16.67% | 1.48% | -5.60% | 0.84% | -11.07% | 0.64% |
| 过去三年 | 54.76% | 1.64% | 37.09% | 1.07% | 17.67% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 74.12% | 1.43% | 28.62% | 0.97% | 45.50% | 0.46% |

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×60%+中证综合债券指数×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



注:本基金合同于2012年3月5日生效,2012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业务的经验
截至2016年12月31日,本基金管理人共管理25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、诺安成长混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、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、诺安红利分红混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金联接基金(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、诺安汇鑫私募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、诺安鸿鹄混合型证券投资基金、诺安鸿鹄私募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、诺安鼎一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益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、诺安快行定期流动配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安保证宝货币市场基金、诺安金鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益宝货币市场基金、诺安稳健增益流动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、诺安稳健收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳健流动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、诺安稳健流动混合型证券投资基金、诺安先锋灵活股票型证券投资基金、诺安鼎益本报告期内共管理了上述基金的投资管理。
4.1.2 公司及相关部门的内部管理制度
本报告期内,本基金管理人在公司内部实施了以下内部控制和风险管理的措施:
1.公司成立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
2.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
3.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.1.3 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2017年3月29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2016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2016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 | 诺安新动力混合 |
| 基金主代码 | 320018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月5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 | 27,996,237.36 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采取积极主动的分析化投资方法,运用多种投资策略灵活配置资产,深入挖掘新形势下推动中国经济持续发展、加快国际经济转型方式转变、促进经济结构转型的新动力,投资该新动力概念下具有高成长性和持续盈利能力的优质上市公司,在严格控制投资风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将实施和积主动的投资策略,运用多种方法进行灵活的资产配置。具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略与部分组成。<br>1.资产配置策略<br>本基金采取战略性资产配置(Strategic Asset Allocation, SAA)和战术性资产配置(Tactical Asset Allocation, TAA)相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,系统进行短期资产灵活配置,深入分析古大新动力所涉及行业面临的市场机遇与风险,在权益类资产和固定收益类资产间进行合理配置,通过积极选择构建在承受一定风险的前提下可获取较高收益的资产组合。<br>2.股票投资策略<br>本基金的股票投资策略主要由新动力主题筛选、构建备选股票库、精选个股和构建组合四个步骤组成。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券投资原分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate Anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield Spread Analysis)以及个券信息策略(Valuation Analysis)。<br>4.权证投资策略<br>权证投资属于本基金的辅助性投资工具,本基金将主要运用价值发现策略和获利交易策略,结合自身资产状况审慎投资,力图获得超值风险调整收益。<br>5.股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×60%+中证综合债券指数×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

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 | 马宏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-83369688 | (010)66106799 |
| | 电子邮箱 | info@lionfundcom.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-8998 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83369677 | (010)66106798 |

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.lionfundcom.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 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -11,206,383.74 | 50,770,011.06 | 12,112,435.72 |
| 本期利润 | -11,136,004.27 | 29,218,296.56 | 31,096,178.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3346 | 0.4836 | 0.2631 |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.67% | 30.18% | 42.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5666 | 0.8717 | 0.2019 |
| 期末基金资产净值 | 43,660,833.10 | 75,348,990.21 | 109,844,202.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.560 | 1.872 | 1.438 |

注: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。

3.2 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 | -1.76% | 0.7% | 0.51% | 0.44% | -2.27% | 0.31% |
| 过去六个月 | -4.12% | 0.80% | 3.24% | 0.46% | -7.36% | 0.34% |
| 过去一年 | -16.67% | 1.48% | -5.60% | 0.84% | -11.07% | 0.64% |
| 过去三年 | 54.76% | 1.64% | 37.09% | 1.07% | 17.67% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 74.12% | 1.43% | 28.62% | 0.97% | 45.50% | 0.46% |

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×60%+中证综合债券指数×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



注:本基金合同于2012年3月5日生效,2012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业务的经验
截至2016年12月31日,本基金管理人共管理25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、诺安成长混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、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、诺安红利分红混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金联接基金(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、诺安汇鑫私募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、诺安鸿鹄混合型证券投资基金、诺安鸿鹄私募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、诺安鼎一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益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、诺安快行定期流动配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安保证宝货币市场基金、诺安金鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益宝货币市场基金、诺安稳健增益流动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、诺安稳健收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳健流动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、诺安稳健流动混合型证券投资基金、诺安先锋灵活股票型证券投资基金、诺安鼎益本报告期内共管理了上述基金的投资管理。
4.1.2 公司及相关部门的内部管理制度
本报告期内,本基金管理人在公司内部实施了以下内部控制和风险管理的措施:
1.公司成立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
2.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
3.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.1.3 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2017年3月29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2016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2016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 | 诺安新动力混合 |
| 基金主代码 | 320018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月5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 | 27,996,237.36 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采取积极主动的分析化投资方法,运用多种投资策略灵活配置资产,深入挖掘新形势下推动中国经济持续发展、加快国际经济转型方式转变、促进经济结构转型的新动力,投资该新动力概念下具有高成长性和持续盈利能力的优质上市公司,在严格控制投资风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将实施和积主动的投资策略,运用多种方法进行灵活的资产配置。具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略与部分组成。<br>1.资产配置策略<br>本基金采取战略性资产配置(Strategic Asset Allocation, SAA)和战术性资产配置(Tactical Asset Allocation, TAA)相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,系统进行短期资产灵活配置,深入分析古大新动力所涉及行业面临的市场机遇与风险,在权益类资产和固定收益类资产间进行合理配置,通过积极选择构建在承受一定风险的前提下可获取较高收益的资产组合。<br>2.股票投资策略<br>本基金的股票投资策略主要由新动力主题筛选、构建备选股票库、精选个股和构建组合四个步骤组成。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券投资原分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate Anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield Spread Analysis)以及个券信息策略(Valuation Analysis)。<br>4.权证投资策略<br>权证投资属于本基金的辅助性投资工具,本基金将主要运用价值发现策略和获利交易策略,结合自身资产状况审慎投资,力图获得超值风险调整收益。<br>5.股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×60%+中证综合债券指数×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

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 | 马宏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-83369688 | (010)66106799 |
| | 电子邮箱 | info@lionfundcom.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-8998 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83369677 | (010)66106798 |

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.lionfundcom.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 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -11,206,383.74 | 50,770,011.06 | 12,112,435.72 |
| 本期利润 | -11,136,004.27 | 29,218,296.56 | 31,096,178.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3346 | 0.4836 | 0.2631 |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.67% | 30.18% | 42.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5666 | 0.8717 | 0.2019 |
| 期末基金资产净值 | 43,660,833.10 | 75,348,990.21 | 109,844,202.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.560 | 1.872 | 1.438 |

注: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。

3.2 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 | -1.76% | 0.7% | 0.51% | 0.44% | -2.27% | 0.31% |
| 过去六个月 | -4.12% | 0.80% | 3.24% | 0.46% | -7.36% | 0.34% |
| 过去一年 | -16.67% | 1.48% | -5.60% | 0.84% | -11.07% | 0.64% |
| 过去三年 | 54.76% | 1.64% | 37.09% | 1.07% | 17.67% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 74.12% | 1.43% | 28.62% | 0.97% | 45.50% | 0.46% |

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×60%+中证综合债券指数×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



注:本基金合同于2012年3月5日生效,2012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业务的经验
截至2016年12月31日,本基金管理人共管理25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、诺安成长混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、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、诺安红利分红混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金联接基金(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、诺安汇鑫私募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、诺安鸿鹄混合型证券投资基金、诺安鸿鹄私募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、诺安鼎一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益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、诺安快行定期流动配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安保证宝货币市场基金、诺安金鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安鼎益宝货币市场基金、诺安稳健增益流动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、诺安稳健收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳健流动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、诺安稳健流动混合型证券投资基金、诺安先锋灵活股票型证券投资基金、诺安鼎益本报告期内共管理了上述基金的投资管理。
4.1.2 公司及相关部门的内部管理制度
本报告期内,本基金管理人在公司内部实施了以下内部控制和风险管理的措施:
1.公司成立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
2.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
3.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.公司设立了内部控制委员会,由公司分管内部控制工作的总经理担任委员会主任,委员由公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等部门的负责人组成。委员会主要负责公司内部控制、风险管理、法律、稽核、监察、人力资源、信息技术、基金管理、基金运作、基金销售、财务等各项工作的组织、协调、监督、检查、评估、报告等。
4.1.3 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2017年3月29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2016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2016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 | 诺安新动力混合 |
| 基金主代码 | 320018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年3月5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 | 27,996,237.36 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采取积极主动的分析化投资方法,运用多种投资策略灵活配置资产,深入挖掘新形势下推动中国经济持续发展、加快国际经济转型方式转变、促进经济结构转型的新动力,投资该新动力概念下具有高成长性和持续盈利能力的优质上市公司,在严格控制投资风险并保证充分流动性的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将实施和积主动的投资策略,运用多种方法进行灵活的资产配置。具体由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略与部分组成。<br>1.资产配置策略<br>本基金采取战略性资产配置(Strategic Asset Allocation, SAA)和战术性资产配置(Tactical Asset Allocation, TAA)相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,系统进行短期资产灵活配置,深入分析古大新动力所涉及行业面临的市场机遇与风险,在权益类资产和固定收益类资产间进行合理配置,通过积极选择构建在承受一定风险的前提下可获取较高收益的资产组合。<br>2.股票投资策略<br>本基金的股票投资策略主要由新动力主题筛选、构建备选股票库、精选个股和构建组合四个步骤组成。<br>3.债券投资策略<br>本基金的债券投资原分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate Anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield Spread Analysis)以及个券信息策略(Valuation Analysis)。<br>4.权证投资策略<br>权证投资属于本基金的辅助性投资工具,本基金将主要运用价值发现策略和获利交易策略,结合自身资产状况审慎投资,力图获得超值风险调整收益。<br>5.股指期货投资策略<br>本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×60%+中证综合债券指数×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合