

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月27日

1.1 重要提示

基金管理人承诺,遵守保本基金所披露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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年3月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证收益水平。基金的过往业绩并不代表其未来表现,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。
本报告自2014年3月1日起实施12月31日止。

1.2 基金简介

基金名称	诺安汇鑫保本混合
基金代码	350029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月28日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,045,148,562.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金严格控制风险,在保证投资组合资产安全的基础上,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过定期比例投资策略(CPPI Constant Proportion Portfolio Insurance)策略,在未来三年保本周期内,对资产配置严格遵循公司开发的保本策略进行动态调整,确保投资者投资本金的安全。同时,本基金通过积极稳健的投资策略,努力为基金资产获取最高的增值回报。本基金的资产配置上,采取分散投资,资产配置策略,债券投资策略,股票投资策略,股指期货投资策略,权证投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中国债券综合指数收益率+3%。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
办公地址	深圳市福田区	深圳市福田区
法定代表人	杨文奎	田国立
信息披露负责人	魏强	魏强
联系电话	0755-83382668	95566
电子邮箱	info@noanfund.com.cn	60166666@boc.com.cn
客户服务热线	400-888-9998	95566
传真	0755-8306277	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金财务报告及互联网网址	深圳商报深圳A131号(即东门大街19-20号)诺安基金管理有限公司
基金年度报告备置地点	www.noanfund.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年5月28日(基金合同生效日)至2012年12月31日
基金已实现收益	97,016,411.37	40,654,701.74
本期利润	38,014,769.94	46,487,627.41
加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0132
本期基金份额净值增长率	0.59%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0188	0.0134
期末基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77
期末基金份额净值	1.019	1.013

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,计入费用后将实际收益水平低于所列数字。
② 本期期末可供分配利润为本报告期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用的余额,本期利润为本期期末可供分配利润上本期公允价值变动损益。

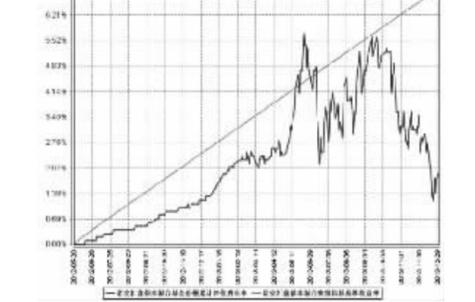
③ 期末可供分配利润是指采用资产负债表未分配利润与未分配利润与未分配利润已实现部分的孰低数。

3.2 基金业绩表现

阶段	跟踪偏离度标准差①	跟踪偏离度标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-3.04%	0.29%	1.09%	0.01%	-4.13%	0.28%
过去六个月	-0.59%	0.31%	2.1%	0.01%	-2.70%	0.30%
过去一年	0.59%	0.26%	4.31%	0.01%	-3.72%	0.27%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.22%	6.91%	0.01%	-5.04%	0.21%

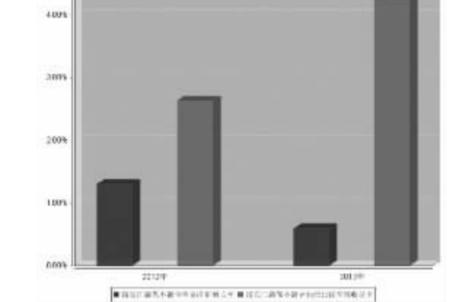
注:本基金的业绩比较基准为:保本周期期限的三年期银行定期存款税后收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较



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业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较



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业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.2.3.1 过去三年基金的利润分配情况	本基金的基金合同于2012年5月28日生效,截止2013年12月31日,本基金未进行利润分配。
3.2.3.2 过去三年基金的利润分配情况	本基金的基金合同于2012年5月28日生效,截止2013年12月31日,本基金未进行利润分配。

4 基金管理人

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至2013年12月,本基金管理人共管理29只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金、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100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金、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100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金。

4.1.2 基金管理人(或基金经理)及其管理基金的经验

姓名	职务	担任本基金的基金经理职务期限	证券从业资格	说明
魏强	基金管理部 基金经理	2012年5月28日	是	魏先生具有基金从业资格,曾就职于南京证券资产管理部,于2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任诺安基金管理部基金经理,负责诺安汇鑫保本混合基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金、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100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金。

注:①此处在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《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人(或基金经理)及其管理基金的经验

魏强先生具有基金从业资格,曾就职于南京证券资产管理部,于2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任诺安基金管理部基金经理,负责诺安汇鑫保本混合基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金、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100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金。

4.3 公平交易制度的执行情况

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内,公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内向同交易对手的交易情况进行了分析,未发现同交易对手在上交所和深交所出现异常交易行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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内,公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内向同交易对手的交易情况进行了分析,未发现同交易对手在上交所和深交所出现异常交易行为。

4.3.2 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投资组合与交易所公开交易的同一反向交易成交较少的单边交易并不存在超过本报告期末资产净值0.5%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。本报告期内基金管理人管理的投资组合与交易所公开交易的同一反向交易成交较少的单边交易并不存在超过本报告期末资产净值0.5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现

2013年经济增速保持平稳,CPI保持低位,央行逐步收紧货币政策,尤其是半年度的降息对市场利率下行较大,下半年资金一直维持紧张的状态,资金成本大幅提高,全年央行对货币政策的态度稳中偏紧,在这样背景下,国内股市大盘表现低迷,中小盘个股表现活跃,债券市场高低走,表现低迷,面对此市场环境,诺安汇鑫保本混合证券投资基金以中高风险资产配置为主,调整债券久期,降低组合杠杆,同时控制股票仓位,积极的参与债券二级市场,严格控制股票仓位,避免业绩损失,取得了较为理想的效果。

4.4.2 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1.019元,本报告期基金份额净值增长率为0.59%,同期业绩比较基准收益率为3.74%。

4.5 管理人(或基金经理)及其管理基金的经验

魏强先生具有基金从业资格,曾就职于南京证券资产管理部,于2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任诺安基金管理部基金经理,负责诺安汇鑫保本混合基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金、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100指数证券投资基金、诺安中小盘精选证券投资基金、诺安主题精选证券投资基金、诺安全球配置证券投资基金、诺安新兴产业交易型开放式证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式证券投资基金。

诺安汇鑫保本混合型证券投资基金

2013 年度报告摘要

2013年12月31日

单位:人民币元

项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年5月28日至2012年12月31日	上年度可比期间
当期发生的基金应计管理费	33,576,145.49	28,098,183.20	28,098,183.20
其中:支付托管费	17,196,688.70	12,872,223.29	12,872,223.29

注:基金管理人按照前一估值日基金资产净值的1.25%年费率计提,计算方法如下:
H=E×1.25%×当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理人每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

在保本周期内,若本基金按照合同约定变更为“诺安策略精选股票证券投资基金”,则基金管理人按照前一估值日基金资产净值的1.50%年费率计提,计算方法同上。

7.4.4.2 基金托管费

项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年5月28日至2012年12月31日	上年度可比期间
当期发生的基金应计托管费	5,596,076.61	4,183,003.52	4,183,003.52

注:基金管理人按照前一估值日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.25%×当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金管理人每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

在保本周期内,若本基金按照合同约定变更为“诺安策略精选股票证券投资基金”,则基金管理人按照前一估值日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法同上。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券交易情况

项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年5月28日至2012年12月31日	上年度可比期间
银行间同业拆借	0	0	0
债券回购	0	0	0
其他	0	0	0

注:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

7.4.4.4 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.5 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.6 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.7 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.8 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.9 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.10 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.11 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.12 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.13 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.14 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.15 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.16 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.17 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.18 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.19 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.20 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.21 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.22 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.23 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.24 报告期末基金资产净值

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年5月28日
基金资产净值	2,083,555,488.68	3,330,107,608.77	3,330,107,608.77

7.4.4.25 报告期末基金资产净值