诺安聚鑫宝货币市场基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:江苏银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月23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2014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2014年9月1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	诺安聚鑫宝货币	
基金主代码	000771	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月1日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,175,516,852.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安聚鑫宝货币A	诺安聚鑫宝货币B
下属分级基金的交易代码:	000771	000779
报告期末下属分级基金的份额总额	211,453.47份	5,175,305,398.54份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	黄兴越
	联系电话	0755-83026688	025-58588093
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	huangxingyue@jsbchina.cn
客户服务电话		400-888-8998	40086-96098
传真		0755-83026677	025-58588155

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	2014年9月1日(基金合同生效日)-2014年12月31日	
	诺安聚鑫宝货币A	诺安聚鑫宝货币B
本期已实现收益	1,812,213.51	34,067,333.71
本期利润	1,812,213.51	34,067,333.71
本期净值收益率	1.5208%	1.4558%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	
期末基金资产净值	211,453.47	5,175,305,398.54
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:①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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

②自2014年9月4日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安聚鑫宝货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	1.1121%	0.0006%	0.0894%	0.0000%	1.0227%	0.0006%
自基金合同生效起至今	1.5208%	0.0010%	0.1186%	0.0000%	1.4022%	0.0010%

诺安聚鑫宝货币B

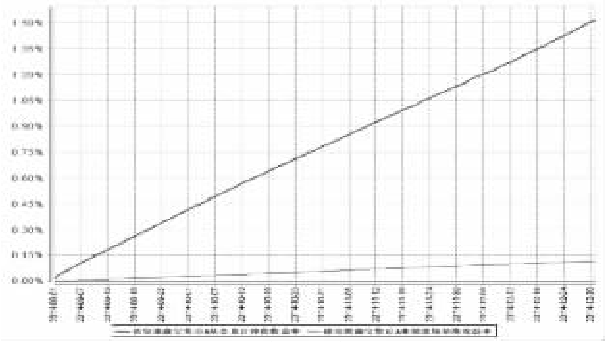
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1121%	0.0006%	0.0894%	0.0000%	1.0227%	0.0006%
自基金合同生效起至今	1.4558%	0.0013%	0.1157%	0.0000%	1.3401%	0.0013%

注:①本基金的利润分配方式是"每日分配,按日支付"。

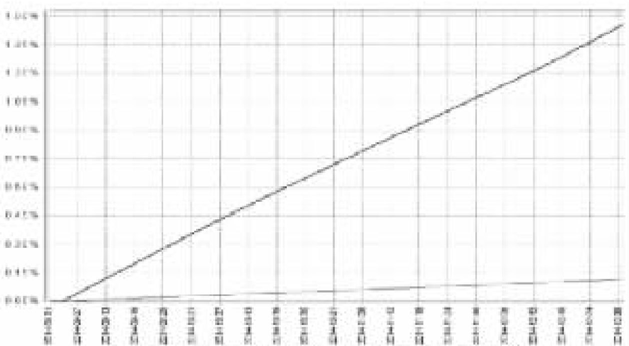
②本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

诺安聚鑫宝货币A



诺安聚鑫宝货币B

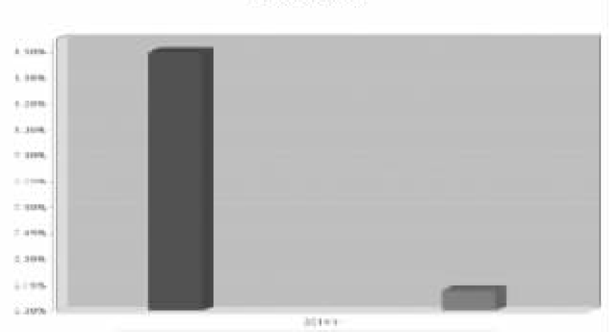


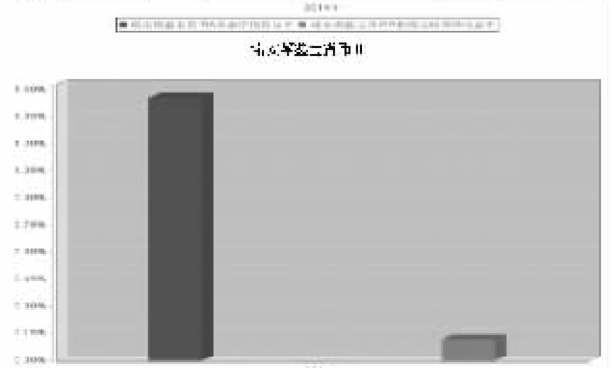
注:①本基金基金合同于2014年9月1日生效,自2014年9月4日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。截至2014年12月31日止,本基金成立未满1年。

②本基金建仓期为6个月,截至2014年12月31日止,本基金成立未满6个月。

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

诺安聚鑫宝货币A





注:本基金基金合同于2014年9月1日生效,2014年本基金净值增长率按本基金实际存续期计算;截至2014年12月31日止,本基金成立未满1年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

诺安聚鑫宝货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	1,788,920.14	23,264.94	28.43	1,812,213.51	
合计	1,788,920.14	23,264.94	28.43	1,812,213.51	

单位:人民币元

诺安聚鑫宝货币B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	32,585,084.94	786,305.36	695,943.41	34,067,333.71	
合计	32,585,084.94	786,305.36	695,943.41	34,067,333.71	

注:本基金基金合同于2014年9月1日生效,截至2014年12月31日止,本基金成立未满1年。

§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2014年12月,本基金管理人共管理37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、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、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、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、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、诺安多策略股票型证券投资基金、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、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。

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		
汪波	现金管理组负责人,诺安增利债券型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安天天宝货币市场基金基金经理、诺安理财宝货币市场基金基金经理、诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理及诺安货币市场基金基金经理	2014年11月29日	-	3	硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于上海银行股份有限公司、国信证券股份有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。2014年2月加入诺安基金管理有限公司,历任债券基金经理助理,现任现金管理组负责人。2014年4月起任诺安增利债券型证券投资基金基金经理以及诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。2014年11月起任诺安天天宝货币市场基金基金经理、诺安理财宝货币市场基金基金经理以及诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理。2015年1月起任诺安货币市场基金基金经理。
张乐赛	固定收益部总监、诺安货币市场基金基金经理、诺安保本混合型证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金基金经理、诺安天天宝货币市场基金基金经理、诺安理财宝货币市场基金基金经理、诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理、诺安聚利债券型证券投资基金基金经理	2014年9月1日	2014年12月13日	10	硕士,具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心;2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任固定收益部总监。曾于2009年8月至2012年1月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006年8月至2014年12月担任诺安货币市场基金的基金经理,2011年5月至2014年12月担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年5月至2014年12月担任诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理,2014年3月至2014年12月担任诺安天天宝货币市场基金基金经理,2014年5月至2014年12月担任诺安理财宝货币市场基金基金经理,2014年9月至2014年12月担任诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理,2014年11月至2014年12月担任诺安聚利债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处张乐赛先生的任职日期为基金合同生效之日,张乐赛先生的离职日期和汪波先生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《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,诺安聚鑫宝货币市场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《诺安聚鑫宝货币市场基金基金合同》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;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。

4.3.2 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

该基金规模持续增长,在以流动性管理作为重点的同时努力提高收益,效果显著。灵活进行逆回购和存款运作,在流动性的关键时点,安排相应的资金到期,使资产保持较强的流动性,以满足投资者日常的申购、赎回需求。

管理人始终坚持"确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益"的原则,注重信用风险的控制,严格执行内部债券评级制度,确保资产的安全性。在投资管理过程中,注重控制投资、交易及操作风险,对基金资产进行合理配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金投资组合的剩余期限为76天,影子定价偏离度为-0.0936%。本报告期诺安聚鑫宝货币A基金份额净值收益率为1.5208%,诺安聚鑫宝货币A的同期业绩比较基准收益率为0.1186%;本报告期诺安聚鑫宝货币B基金份额净值收益率为1.4558%,诺安聚鑫宝货币B的同期业绩比较基准收益率为0.1157%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着资金面紧张局面的缓解,短融收益率有望小幅下降,管理人将继续灵活进行逆回购和存款操作,在保证资产的流动性和安全性的基础上,秉持债券分散化投资的原则,通过动态调整债券资产比例,释放收益,为投资者创造更高的回报。

4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定,本基金收益"每日分配,按日支付"。本基金本期实现收益为35,879,547.22元,应分配利润35,879,547.22元,已实施利润分配35,879,547.22元,符合合同约定。

4.7 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

在托管诺安聚鑫宝货币市场基金的过程中,本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《诺安聚鑫宝货币市场基金基金合同》、《诺安聚鑫宝货币市场基金托管协议》的约定,对诺安聚鑫宝货币市场基金的基金管理人—诺安基金管理有限公司2014年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,诺安基金管理有限公司在诺安聚鑫宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,诺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的诺安聚鑫宝货币市场基金的年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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、洪锐明于2015年3月23日出具了德师报(审)字(15)第P0548号"无保留意见的审计报告"。投资者可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:诺安聚鑫宝货币市场基金
报告截止日: 2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日
资 产:	
银行存款	1,619,465,782.57
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	1,749,820,416.45
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	1,749,820,416.45
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	1,782,368,505.06
应收证券清算款	-
应收利息	24,810,931.23
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	5,176,465,635.31
负债和所有者权益	本期末 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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	186,967.37
应付销售服务费	-
应付交易费用	25,844.09
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	695,971.84
递延所得税负债	-
其他负债	40,000.00
负债合计	948,783.30
所有者权益:	
实收基金	5,175,516,852.01
未分配利润	-
所有者权益合计	5,175,516,852.01
负债和所有者权益总计	5,176,465,635.31

注:①报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额5,175,516,852.01份。其中,诺安聚鑫宝货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额211,453.47份;诺安聚鑫宝货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额5,175,305,398.54份。

②本会计期间为2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:诺安聚鑫宝货币市场基金
本报告期:2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	36,332,623.86
1.利息收入	36,332,623.86
其中:存款利息收入	25,660,952.45
债券利息收入	5,086,516.23
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	5,585,155.18
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
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	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	453,076.64
1.管理人报酬	-
2.托管费	398,609.51
3.销售服务费	-
4.交易费用	-
5.利息支出	4,467.13
其中:卖出回购金融资产支出	4,467.13
6.其他费用	50,000.00
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	35,879,547.22
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	35,879,547.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安聚鑫宝货币市场基金
本报告期:2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)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(基金合同后生效日)所有者权益(基金净值)	201,327,573.00	-	201,327,573.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,879,547.22	35,879,547.22
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)	4,974,189,279.01	-	4,974,189,279.01
其中:1.基金申购款	15,833,407,525.70	-	15,833,407,525.70
2.基金赎回款	-10,859,218,246.69	-	-10,859,218,246.69
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)	-	-35,879,547.22	-35,879,547.22
五、期末所有者权益(基金净值)	5,175,516,852.01	-	5,175,516,852.01

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

诺安聚鑫宝货币市场基金(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[2014]809号文《关于核准诺安聚鑫宝货币市场基金募集的批复》核准,于2014年8月28日向社会进行公开募集,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,共募集资金人民币201,327,573.00元,折合201,327,573.00份基金份额。基金合同生效日为2014年9月1日,合同生效日基金份额为201,327,573.00份基金单位。

根据《诺安基金管理有限公司关于诺安聚鑫宝货币市场基金新增基金份额类别的公告》,自2014年9月4日起,本基金设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。A级基金份额的基金代码为000771(与分级前基金代码相同),新设B级份额代码为000779。两级基金份额单独公布基金万份净值收益和7日年化收益率。不同级别的基金份额均适用相同的管理费率、托管费率和销售服务费。

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,基金托管人为江苏银行股份有限公司。《诺安聚鑫宝货币市场基金基金合同》、《诺安聚鑫宝货币市场基金招募说明书》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2015年3月23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(包括于2014年颁布的新的和修订的企业会计准则)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2014年12月31日的财务状况以及2014年9月1日(基金合同生效日)至2014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2014年9月1日(基金合同生效日)至2014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为债券投资,在资产负债表中作为交易性金融资产列报。

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,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,取得时支付的价款中包含已宣告但尚未发放的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。

本基金对所持有的债券投资、贷款及应收款项和其他金融负债以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内,本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

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,但是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

债券投资

买入银行间市场交易的债券于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券,于交易日按应付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

卖出银行间市场交易的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。

(2)贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金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

本基金的债券投资等金融资产,均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。在本基金存续期间,基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度,并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,恢复使用摊余成本估算公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债或间接可观察的输入值;

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。申购、赎回及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

本基金不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 本基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(2)本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

(3)"每日分配、按日支付"。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位;

(4)本基金每日进行收益支付,并只采用红利再投资的方式。若当日已实现收益大于零时,则增加投资者基金份额;若当日已实现收益等于零时,则保持投资者基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零,若当日已实现收益小于零时,相应缩减投资人基金份额;

(5)T 日申购且成功确认的基金份额, 自T+1 日起享有基金的收益分配权益;T 日赎回且成功确认的基金份额,自T+1 日起不享有基金的收益分配权益;

(6)法律法规或监管机构另有规定的从其规定;

(7)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

7.4.7 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
江苏银行股份有限公司	托管人、代销机构

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内不存在应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	0.00
其中:支付销售机构的客户维护费	0.00

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.33%÷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3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。

经管理人、基金销售服务机构友好协商一致同意,自该基金成立之日(2014年9月1日)起暂免收取该基金的基金管理费及基金销售服务费,具体恢复收取时间由双方共同商议后给出。截至本报告期末2014年12月31日止,本基金尚未恢复收取基金管理费。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	398,609.51

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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3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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安聚鑫宝货币A	诺安聚鑫宝货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	-	-	-
江苏银行股份有限公司(托管人)	-	-	-
合计	-	-	-

注:本基金的年销售服务费率为0.25%,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

经管理人、基金销售服务机构友好协商一致同意,自该基金成立之日(2014年9月1日)起暂免收取该基金的基金管理费及基金销售服务费,具体恢复收取时间由双方共同商议后给出。截至本报告期末2014年12月31日止,本基金尚未恢复收取基金销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
江苏银行股份有限公司	-	-	10,000,000.00	2,087.67	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2014年9月1日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行股份有限公司	219,465,782.57	8,017,638.70

注:本基金的银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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2014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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

7.4.10 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。公允价值计量层级参见附注7.4.4.5。

②各层级金融工具公允价值

于2014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二层级的余额为1,749,820,416.45元,无属于第一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。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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	固定收益投资	1,749,820,416.45	33.80
	其中:债券	1,749,820,416.45	33.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,782,368,505.06	34.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	60,916,722.88	1.18
3	银行存款和结算备付金合计	1,619,465,782.57	31.29
4	其他各项资产	24,810,931.23	0.48
5	合计	5,176,465,635.31	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.02	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	56.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	6.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	17.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.71	-

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,020,052.19	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,266,756.79	4.45
	其中:政策性金融债	230,266,756.79	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,499,533,607.47	28.97
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,749,820,416.45	33.81
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	1,500,000	150,275,934.51	2.90
2	071405005	14证金CP005	600,000	59,993,044.23	1.16
3	120215	12国开15	500,000	50,031,766.48	0.97
4	011461011	14五矿股SCP011	400,000	39,997,463.03	0.77
5	071442005	14西部证券CP005	400,000	39,994,624.87	0.77
6	071415012	14申万CP012	400,000	39,993,280.18	0.77
7	071404016	14广发CP016	400,000	39,990,221.08	0.77
8	041454078	14川交投CP003	400,000	39,981,752.13	0.77
9	011499070	14鲁黄金SCP001	400,000	39,973,425.58	0.77
10	011499094	14国联SCP003	400,000	39,954,005.63	0.77

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	-0.1743%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0315%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

8.8.2 本报告期内不存在"持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券"的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.8.3 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24,810,931.23
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	24,810,931.23

8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
诺安聚鑫宝货币A	618	342.16	1.74	0.00%	211,451.73	100.00%
诺安聚鑫宝货币B	111,469	46,428.20	1,395,783.05	0.03%	5,173,909,615.49	99.97%
合计	112,087	46,174.10	1,395,784.79	0.03%	5,174,121,067.22	99.97%

注:① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺安聚鑫宝货币A	7,068.96	3.3430%
	诺安聚鑫宝货币B	215.90	0.0000%
	合计	7,284.86	0.0001%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	诺安聚鑫宝货币A	0
	诺安聚鑫宝货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安聚鑫宝货币A	0
	诺安聚鑫宝货币B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	诺安聚鑫宝货币A	诺安聚鑫宝货币B
基金合同生效日(2014年9月1日)基金份额总额	201,327,573.00	-
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,380,463.14	15,830,027,062.56
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	204,496,582.67	10,654,721,664.02
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	211,453.47	5,175,305,398.54

注:总申购含红利再投、转换入份额,总赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。
本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为2万元。截至本报告期末,该事务所已提供审计服务的连续年限:2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

注:1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况:本报告期新增1家证券公司的2个交易单元:中信证券有限责任公司(2个交易单元)。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

(1)、实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3 亿元人民币。

(2)、财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3)、经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

(4)、内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

(6)、研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用证券公司交易单元无其他证券投资的情况。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2015年3月26日