诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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6月24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	诺安永鑫一年定期开放债券
基金主代码	000510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月24日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	305,012,682.35份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力求资产持续稳妥地保值增值,为投资者提供较好的养老资产管理工具。
投资策略	1、封闭期投资策略 在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 2、开放期投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	林葛
	联系电话	0755-83026688	010-66060069
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95599
传真		0755-83026677	010-68121816

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	2014年6月24日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	10,135,699.03
本期利润	17,745,849.32
加权平均基金份额本期利润	0.0582
本期基金份额净值增长率	5.80%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0332
期末基金资产净值	322,758,531.67
期末基金份额净值	1.058

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。

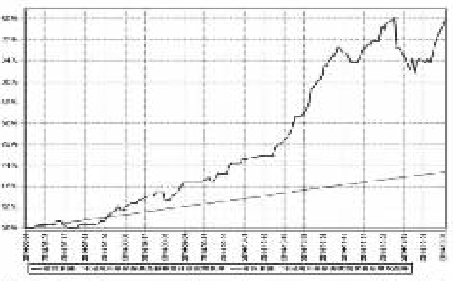
3.2 基金净值表现

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	3.83%	0.19%	0.74%	0.01%	3.09%	0.18%
过去六个月	5.69%	0.14%	1.51%	0.01%	4.18%	0.13%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.14%	1.56%	0.01%	4.24%	0.13%

注:本基金的业绩比较标准为:同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)。

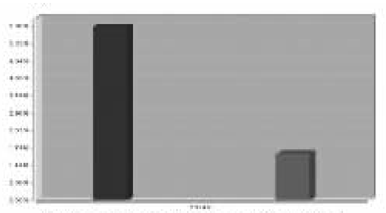
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:①本基金基金合同于2014年6月24日生效,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,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2014年6月24日生效,2014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2014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2014年6月24日生效,截止2014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		
谢志华	固定收益部执行总监、诺安纯债定期开放债券基金经理、诺安鸿鑫保本混合基金经理、诺安信用债券一年定期开放债券基金经理、诺安稳固收益一年期定期开放债券基金经理、诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理、诺安优化收益债券基金经理、诺安永鑫一年定期开放债券基金经理、诺安保本混合基金经理、诺安汇鑫保本混合基金经理及诺安聚利债券基金经理	2014年6月24日	-	9	理学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,现任固定收益部执行总监。2013年5月起任诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起任诺安稳固收益一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理,2014年6月起任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年11月起任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及诺安聚利债券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 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,诺安永鑫一年定期开放债券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《诺安永鑫一年定期开放债券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;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

2014年前三季度纯债资产表现强势,收益率连续下降,到了第四季度,大股票强势上涨,纯债资产被抛售,转债资产表现强势。

基金通过调节纯债资产的仓位和信用债的久期,并波段操作可转债资产,取得了一定的效果。

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1.058元。本报告期基金份额净值增长率为5.80%,同期业绩比较基准收益率为1.56%。

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,信用债收益率有望维持稳定,同时可转债资产有望获得一定的弹性。未来将结合权益类市场的风格变化,及债券的发行节奏,优化基金的投资组合。

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、监察稽核部和风险控制部、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12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

本基金的基金合同于2014年6月24日生效,截止2014年12月31日,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—诺安基金管理有限公司2014年1月1日至2014年12月31日基金的投资运作,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本基金的投资运作、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《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本基金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P0545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:诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

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	1,151,359.83
结算备付金	6,530,795.99
存出保证金	19,574.10
交易性金融资产	494,663,130.00
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	494,663,130.00
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	-
应收证券清算款	81,581.14
应收利息	10,655,058.52
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	513,101,499.58
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	189,999,646.60
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	54,432.16
应付销售服务费	136,080.38
应付交易费用	3,952.31
应交税费	-
应付利息	78,856.46
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	70,000.00
负债合计	190,342,967.91
所有者权益:	
实收基金	305,012,682.35
未分配利润	17,745,849.32
所有者权益合计	322,758,531.67
负债和所有者权益总计	513,101,499.58

注:①报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.058元,基金份额总额305,012,682.35份。

②本会计期间为2014年6月24日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2014年6月24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6月24日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	21,852,107.36
1.利息收入	12,289,476.65
其中:存款利息收入	828,388.56
债券利息收入	11,113,426.47
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	347,661.62
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,951,612.10
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,951,612.10
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)	7,610,150.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	868.32
减:二、费用	4,106,258.04
1.管理人报酬	-
2.托管费	324,889.40
3.销售服务费	812,223.37
4.交易费用	3,405.68
5.利息支出	2,861,561.92
其中:卖出回购金融资产支出	2,861,561.92
6.其他费用	104,177.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	17,745,849.32
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	17,745,849.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2014年6月24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6月24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(基金合同生效日)所有者权益(基金净值)	305,012,682.35	-	305,012,682.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,745,849.32	17,745,849.32
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	305,012,682.35	17,745,849.32	322,758,531.67

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

诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金(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[2013]1613号文《关于核准诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》批准,于2014年4月28日至2014年6月20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,募集的有效认购金额为人民币305,012,682.35元,其中净认购额为人民币304,848,457.60元,折合304,848,457.60份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币164,224.75元,折合164,224.75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2014年6月24日,合同生效日基金份额为305,012,682.35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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。《诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《诺安永鑫收益一年定期开放债券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6月24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6月24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

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

(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值。

具体投资品种的估值方法如下:

股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会2008年9月12日发布的[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定,若长期停牌股票的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%以上的,经基金管理人估值小组同意,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法),调整最近交易市价,确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资,按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票,于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值;若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按中国证监会相关规定处理。

债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按成本估值。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别确定公允价值。

权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前,采用估值技术确定公允价值,如估值技术难以可靠计量,则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前,采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量,则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

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直接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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

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)除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,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。

(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

(1)股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2)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。

(3)衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4)股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3.公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

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

开放期内,本基金不进行收益分配。

本基金封闭期内的收益分配原则如下:

(1)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12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)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。

(5)对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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
中国农业银行股份有限公司	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6月24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	-
其中:支付销售机构的客户维护费	118.10

本基金采用的浮动费率方式如下:

(1)本基金不收取固定管理费,以分档计提方式收取浮动管理费;

(2)本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后);

(3)封闭运作一年之后,基金管理人将以封闭期基金净值增长率为基础分档收取管理费。在分档模式下,基金管理人将封闭期基金净值增长率由低到高划分为四档并设定不同等级的管理费率。封闭期基金净值增长率越大的档,管理费率越高(具体档数、不同档数封闭期基金净值增长率起止点、不同档数管理费率如下表)。管理费在管理费计提日计提,并将对应四档管理费计提日基金份额净值。同时,管理费的提取将保证高档数的管理费计提日基金份额净值不低于低档数的管理费计提日基金份额净值。

表:基金管理费分档费率表

档数	封闭期基金净值增长率(N)	管理费率
1	N≤4.0%	0%
2	4.0%<N≤5.5%	Min(0.3%,(N-4%)/(1+N))
3	5.5%<N≤7%	Min(0.7%,(N-5.2%)/(1+N))
4	7%<N	Min(1.0%,(N-6.3%)/(1+N))

N为封闭期基金净值增长率。

基金管理费以封闭期最后一日资产净值为基数,在管理费计提日计提,管理费计提日结束后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管理费计提日结束后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、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月24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	324,889.40

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年6月24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
诺安基金管理有限公司(管理人)	315,168.52
中国农业银行股份有限公司(托管人)	290,430.49
合计	605,599.01

注:本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。

销售服务费额计算方法如下:

M=E×0.50%÷当年天数

M为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,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,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 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6月24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
中国农业银行股份有限公司	1,151,359.83	43,841.83

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业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,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额39,999,700.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041451043	14大族CP001	2015年1月5日	100.47	200,000	20,094,000.00
041462004	14东方CP001	2015年1月6日	100.97	200,000	20,194,000.00
合计				400,000	40,288,000.00

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,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额149,999,946.60元,分别于2015年1月5日及2015年1月8日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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一层级的余额为143,321,169.60元,属于第二层级的余额为351,341,960.40元,无属于第三层级的余额。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	494,663,130.00	96.41
	其中:债券	494,663,130.00	96.41
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	7,682,155.82	1.50
7	其他各项资产	10,756,213.76	2.10
8	合计	513,101,499.58	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未投资股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未投资股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未投资股票。

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	266,295,098.40	82.51
5	企业短期融资券	130,489,000.00	40.43
6	中期票据	80,138,000.00	24.83
7	可转债	17,741,031.60	5.50
8	其他	-	-
9	合计	494,663,130.00	153.26

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122510	12靖新城	300,000	31,242,000.00	9.68
2	041455002	14绵阳科发CP001	300,000	30,405,000.00	9.42
3	124359	13三明投	220,020	22,831,475.40	7.07
4	124378	13湘九华	200,000	20,700,000.00	6.41
5	101459041	14桑德MTN002	200,000	20,494,000.00	6.35

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

8.11.3 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	19,574.10
2	应收证券清算款	81,581.14
3	应收股利	-
4	应收利息	10,655,058.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,756,213.76

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	5,596,628.40	1.73
2	110023	民生转债	4,839,450.00	1.50
3	110020	南山转债	2,730,771.60	0.85
4	113001	中行转债	2,348,850.00	0.73

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 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

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
3,942	77,375.11	131,203,004.49	43.02%	173,809,677.86	56.98%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金基金份额。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年6月24日)基金份额总额	305,012,682.35
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	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	305,012,682.35

§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无重大人事变动。

因中国农业银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

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,基金的投资组合策略没有重大改变。

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4万元。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	
渤海证券	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:渤海证券股份有限公司(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

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
渤海证券	284,685,157.48	100.00%	5,862,232,000.00	100.00%	-	-

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