

# 诺安主题精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	诺安主题精选混合
基金主代码	320012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 15 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	232,463,074.58 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安主题精选股票型证券投资基金”变更为“诺安主题精选混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选主题, 稳健投资, 力图在不同的市场环境下均可突破局限, 在长期内获得超过比较基准的超额收益。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略, 具体由资产配置策略, 股票投资策略, 债券投资策略、权证投资策略四部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略方面, 本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置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, 积极进行短期资产灵活配置, 力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2. 股票投资策略方面, 本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。</p> <p>3. 债券投资策略方面, 本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略, 具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>4. 权证投资策略方面, 本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具, 我们将结合自身资产状况审慎投资, 力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	75%沪深 300 指数+25%中证全债指数
风险收益特征	本基金属于混合型基金, 预期风险与收益低于股票型基金, 高于债券型基金与货币市场基金, 属于中高风险、中高收益的基金品种。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	田青
	联系电话	0755-83026688	010-67595096
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	010-67595096
传真		0755-83026677	010-66275853

## 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	641,579,290.89	441,738,997.18	109,354,983.09
本期利润	277,154,989.40	782,684,643.73	191,723,762.58
加权平均基金份额本期利润	0.5407	0.6685	0.1507
本期基金份额净值增长率	26.58%	53.04%	17.76%
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	0.7675	0.1885	-0.0394
期末基金资产净值	410,872,221.97	2,626,200,116.15	1,026,767,108.35
期末基金份额净值	1.767	1.396	1.001

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

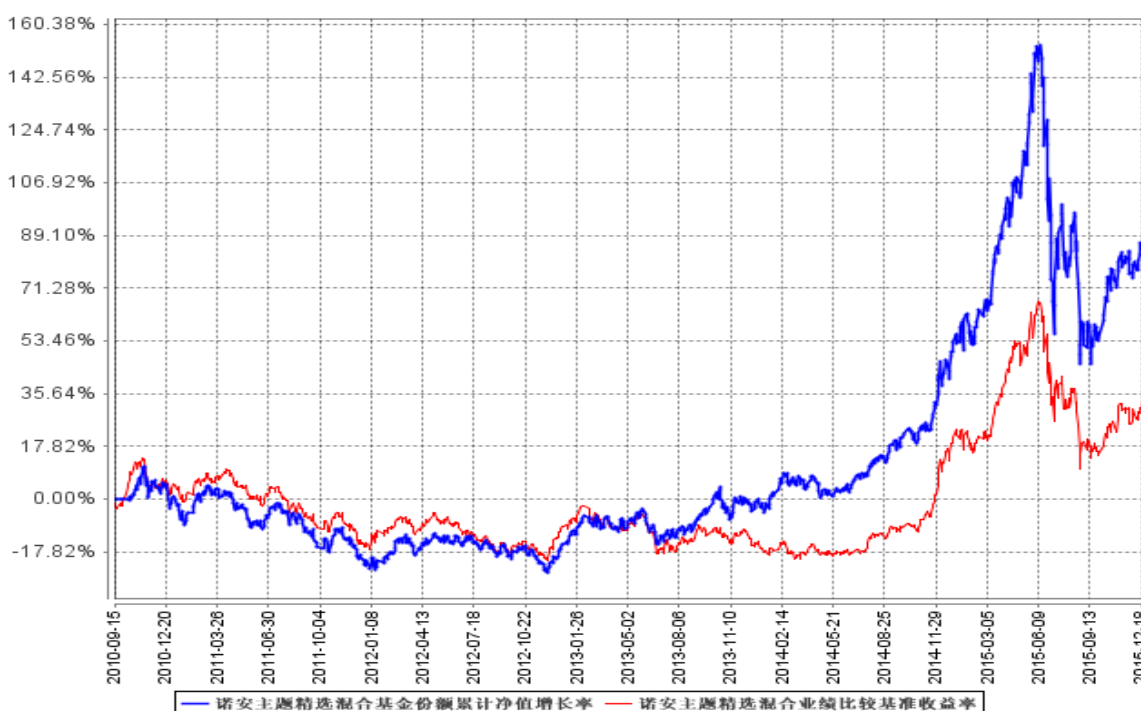
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	25.50%	1.54%	13.07%	1.25%	12.43%	0.29%
过去六个月	-6.95%	2.78%	-10.80%	2.01%	3.85%	0.77%
过去一年	26.58%	2.52%	7.91%	1.86%	18.67%	0.66%
过去三年	128.12%	1.72%	43.27%	1.34%	84.85%	0.38%
过去五年	93.52%	1.50%	25.73%	1.20%	67.79%	0.30%
自基金合同生效起至今	93.91%	1.50%	30.39%	1.21%	63.52%	0.29%

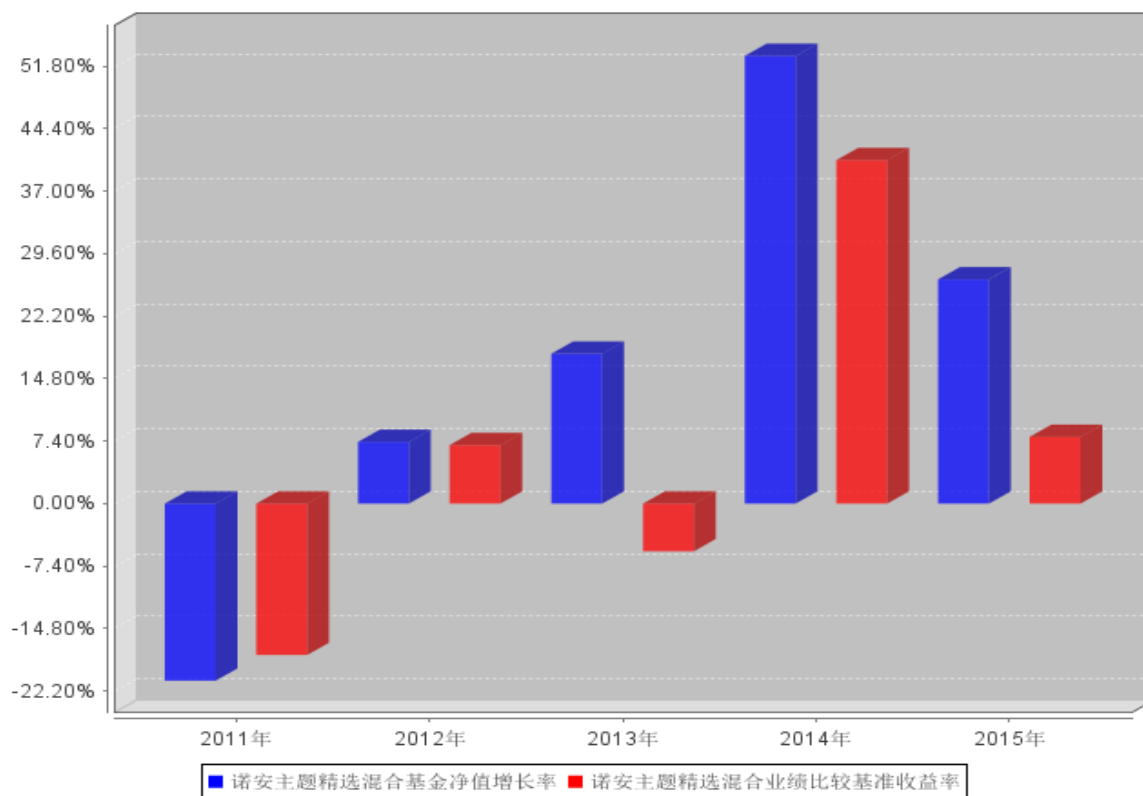
注：本基金的业绩比较基准为：75%沪深 300 指数+25%中证全债指数。

### 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 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	1.0000	81,982,066.29	61,572,924.10	143,554,990.39	本报告期分红一次
2013	-	-	-	-	
合计	1.0000	81,982,066.29	61,572,924.10	143,554,990.39	

## §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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗春蕾	诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理	2015 年 9 月 26 日	-	8	硕士，曾先后任职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银华基金管理有限公司，从事医药行业研究工作。2011 年 12 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2015 年 9 月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理。
刘魁	诺安新经济股票型证券投资基金基金经理、诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理、诺安低碳经济股票型证券投资	2015 年 1 月 17 日	2015 年 11 月 21 日	10	博士，曾先后任职于嘉实基金管理有限公司、诺安基金管理有限公司、富国基金管理有限公司，从事行业研究、投资及基金经理工作。曾于 2012 年 5 月至 2014 年 1 月任汉兴证券投资基金基金经理。2014 年加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2014 年 6 月至 2015 年 9 月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2015 年 1 月至 2015 年 11 月任诺安新经济股票型证券投资基金及诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月至 2015 年 11 月任诺安低

	基金基金经理、诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理				碳经济股票型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月至 2015 年 11 月任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理。
杨谷	副总经理、投资一部总监、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理	2010 年 9 月 15 日	2015 年 1 月 17 日	18	经济学硕士, CFA, 具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部; 2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司, 现任公司副总经理、投资一部总监。曾于 2006 年 11 月至 2007 年 11 月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理, 2010 年 9 月至 2015 年 1 月任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理, 2013 年 4 月至 2015 年 1 月任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理, 2006 年 2 月起任诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处杨谷先生的任职日期为基金合同生效之日，杨谷先生的离职日期、刘魁先生的任职日期和离职日期、罗春蕾女士的任职日期均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, 诺安主题精选混合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《诺安主题精选混合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**

2015 年 A 股市场剧烈波动，本基金出于对牛市的整体判断，选择以金融、地产、信息技术、医药等板块进行配置。从结果看，由于本轮牛市的热点主要集中在产业转型、互联网+、新兴行业等主题性机会，因此本基金 15 年的收益率略低于行业平均水平。

#### **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 1.767 元。本报告期基金份额净值增长率为 26.58%，同期业绩比较基准收益率为 7.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年新年伊始，人民币汇率在离岸市场的持续暴跌导致市场恐慌情绪加重，再加之熔断机制令市场骤然失去流动性，市场在第一周即出现暴跌，投资者信心受挫。

从宏观数据看，2015 年底虽然多项经济指标仍在下滑，但降幅已经有所收窄。从产业层面得到的反馈消息看，传统行业的出清虽然慢，但亦已经开始启动。因此，就国内经济基本面而言，我们认为仍处于经济转型、磨底的过程中。市场方面，虽然指数较 15 年顶部有大幅回调，但相当多个股的价格仍处于历史较高水平，亦高于 2015 年牛市启动前的价格。鉴于我们很难预期市场流动性、风险偏好会重回 2015 年以前的水平，因此本基金认为 2016 年可能不太具备牛市基础，反复震荡的概率更大。

风险方面，我们认为 2016 年的不确定性可能存在于人民币汇率方面。2015 年中国外汇储备下降、人民币对美元加速贬值、以及中国正式加入 SDR 后逐步放开外汇管制的预期，都加大了未来汇率的波动幅度。这可能带来国内市场整体风险偏好及流动性的变化，从而影响整体走势。

就本基金而言，我们一方面保持冷静，尽量以理性的态度对待投资，减少因情绪波动带来的误判。另一方面，我们希望通过精选个股、仓位控制来实现收益、减少回撤。

最后，我们衷心感谢给予我们信任与支持的投资人，愿以认真敬业的态度、持续稳健的收益来回报投资人。

#### 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、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。

#### 4.7 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六次,每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 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,本报告期末有收益分配事项。

#### 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### §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 P0682 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：诺安主题精选混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	84,614,812.88	352,982,916.50
结算备付金	1,334,881.78	8,339,164.55
存出保证金	224,253.11	744,483.34
交易性金融资产	326,046,848.09	2,243,894,853.18
其中：股票投资	326,046,848.09	1,996,254,268.68
基金投资	-	-
债券投资	-	247,640,584.50
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	-	29,950,409.15
应收利息	17,847.78	479,911.00
应收股利	-	-
应收申购款	225,665.87	780,144.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	412,464,309.51	2,637,171,882.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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	107,556.60	3,021,096.32
应付管理人报酬	456,249.23	3,105,040.00
应付托管费	76,041.53	517,506.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	612,212.84	4,183,702.65
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	340,027.34	144,420.56
负债合计	1,592,087.54	10,971,766.20
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	232,463,074.58	1,880,779,375.48
未分配利润	178,409,147.39	745,420,740.67
所有者权益合计	410,872,221.97	2,626,200,116.15
负债和所有者权益总计	412,464,309.51	2,637,171,882.35

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.767 元，基金份额总额 232,463,074.58 份。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>	299,858,364.75	823,448,661.52
1. 利息收入	976,284.32	2,711,661.93
其中：存款利息收入	913,777.96	1,028,033.29
债券利息收入	62,506.36	1,653,851.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	29,777.00
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	660,287,350.17	479,489,627.98
其中：股票投资收益	597,877,718.68	403,617,652.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	57,753,504.43	67,502,169.96
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	4,656,127.06	8,369,805.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-364,424,301.49	340,945,646.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,019,031.75	301,725.06
<b>减：二、费用</b>	22,703,375.35	40,764,017.79
1. 管理人报酬	12,686,450.20	19,404,040.75
2. 托管费	2,114,408.40	3,234,006.75
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	7,455,834.22	15,966,875.84
5. 利息支出	-	1,742,987.12
其中：卖出回购金融资产支出	-	1,742,987.12
6. 其他费用	446,682.53	416,107.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>277,154,989.40</b>	<b>782,684,643.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>277,154,989.40</b>	<b>782,684,643.73</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

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）	1,880,779,375.48	745,420,740.67	2,626,200,116.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	277,154,989.40	277,154,989.40
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）	-1,648,316,300.90	-844,166,582.68	-2,492,482,883.58
其中：1. 基金申购款	283,696,853.20	182,541,469.53	466,238,322.73
2. 基金赎回款	-1,932,013,154.10	-1,026,708,052.21	-2,958,721,206.31
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）	232,463,074.58	178,409,147.39	410,872,221.97
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	1,026,116,288.20	650,820.15	1,026,767,108.35

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	782,684,643.73	782,684,643.73
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)	854,663,087.28	105,640,267.18	960,303,354.46
其中:1.基金申购款	1,655,701,376.96	177,900,962.98	1,833,602,339.94
2.基金赎回款	-801,038,289.68	-72,260,695.80	-873,298,985.48
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)	-	-143,554,990.39	-143,554,990.39
五、期末所有者权益(基金净值)	1,880,779,375.48	745,420,740.67	2,626,200,116.15

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:

<u>          奥成文          </u>	<u>          薛有为          </u>	<u>          薛有为          </u>
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

诺安主题精选混合型证券投资基金(简称“本基金”)原名为诺安主题精选股票型证券投资基金,经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2010]984号文《关于核准诺安主题精选股票型证券投资基金募集的批复》批准,于2010年8月16日至2010年9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3,328,610,497.44元,其中净认购额为人民币3,309,062,286.68元,折合3,309,062,286.68份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币189,075.35元,折合189,075.35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2010年9月15日,合同生效日基金份额为3,309,251,362.03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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。《诺安主题精选股票型证券投资基金合同》、《诺安主题精选股票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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月6日起,诺安主题精选股票型证券投资基金名称

变更为诺安主题精选混合型证券投资基金，基金合同中的相关条款亦做相应修订。

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 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与最近一期年度报告相一致，会计估计变更详见 7.4.4.2 的说明。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定受益品种的估值处理标准》，本基金自 2015 年 3 月 26 日起，对所持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 26 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

##### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.5 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、注册登记及过户机构、直销机



	构
中国建设银行股份有限公司	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。

## 7.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.6.1.1 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。

#### 7.4.6.1.2 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。

#### 7.4.6.1.3 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。

### 7.4.6.2 关联方报酬

#### 7.4.6.2.1 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	12,686,450.20	19,404,040.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,937,330.86	3,425,968.08

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人于次月首日起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、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.6.2.2 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	2,114,408.40	3,234,006.75
----------------	--------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.6.4.1 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。

##### 7.4.6.4.2 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。

#### 7.4.6.5 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
中国建设银行股份有限公司	84,614,812.88	865,852.99	352,982,916.50	900,640.89

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

#### 7.4.6.6 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。

#### 7.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

## 7.4.7 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.7.1 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。

### 7.4.7.2 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。

### 7.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.7.3.1 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。

#### 7.4.7.3.2 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。

## 7.4.8 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 326,046,848.09 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 2,082,934,379.00 元，第二层级 160,960,474.18 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。如附注 7.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 26 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

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	326,046,848.09	79.05
	其中：股票	326,046,848.09	79.05
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	85,949,694.66	20.84
7	其他各项资产	467,766.76	0.11
8	合计	412,464,309.51	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,619,532.00	0.88
C	制造业	161,897,600.42	39.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	33,486,860.52	8.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,338,289.50	15.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,825,553.15	6.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,064,500.00	3.18
R	文化、体育和娱乐业	21,814,512.50	5.31
S	综合	-	-
	合计	326,046,848.09	79.35

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002368	太极股份	973,745	65,338,289.50	15.90
2	002004	华邦健康	1,580,200	22,359,830.00	5.44
3	600305	恒顺醋业	764,081	19,613,959.27	4.77
4	600079	人福医药	843,724	18,781,296.24	4.57
5	002294	信立泰	599,854	18,067,602.48	4.40
6	000919	金陵药业	1,026,171	17,650,141.20	4.30
7	600511	国药股份	450,950	17,100,024.00	4.16
8	000963	华东医药	199,937	16,386,836.52	3.99
9	601098	中南传媒	600,000	14,340,000.00	3.49
10	002376	新北洋	753,000	13,915,440.00	3.39

注：投资者欲了解本报告期末投资的所有股票明细，应阅读登载于[www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn)网站的年度报告正文。

### 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例 (%)
1	601166	兴业银行	69,542,103.00	2.65
2	600594	益佰制药	61,939,881.21	2.36
3	002368	太极股份	59,102,063.60	2.25
4	600089	特变电工	48,724,091.47	1.86
5	000623	吉林敖东	42,543,647.68	1.62
6	002340	格林美	31,207,753.85	1.19
7	002315	焦点科技	29,291,203.82	1.12
8	000963	华东医药	28,329,292.77	1.08
9	600161	天坛生物	26,013,118.54	0.99
10	601992	金隅股份	25,076,266.56	0.95
11	002004	华邦健康	23,530,099.37	0.90
12	600079	人福医药	23,314,938.13	0.89
13	002241	歌尔声学	22,385,511.23	0.85
14	601628	中国人寿	22,024,883.53	0.84
15	600775	南京熊猫	20,546,305.00	0.78
16	600875	东方电气	19,793,097.20	0.75
17	300339	润和软件	19,640,251.20	0.75
18	000001	平安银行	19,593,790.37	0.75
19	600305	恒顺醋业	18,990,697.19	0.72
20	300124	汇川技术	17,732,519.70	0.68

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	254,356,389.72	9.69
2	601628	中国人寿	190,713,743.34	7.26
3	000623	吉林敖东	173,767,988.88	6.62
4	600594	益佰制药	131,257,777.41	5.00
5	600048	保利地产	128,581,172.34	4.90
6	600016	民生银行	125,114,334.06	4.76
7	600536	中国软件	101,125,911.40	3.85
8	601166	兴业银行	65,211,566.25	2.48
9	600089	特变电工	56,348,881.73	2.15
10	000069	华侨城 A	55,487,332.11	2.11

11	002368	太极股份	52,375,679.29	1.99
12	002004	华邦健康	50,735,069.52	1.93
13	300006	莱美药业	47,173,995.49	1.80
14	000100	TCL 集团	46,951,538.68	1.79
15	601601	中国太保	41,230,278.03	1.57
16	600309	万华化学	41,142,805.26	1.57
17	600007	中国国贸	40,235,187.71	1.53
18	002405	四维图新	39,811,093.91	1.52
19	002509	天广消防	37,538,496.39	1.43
20	300339	润和软件	34,574,507.40	1.32

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,147,077,378.61
卖出股票收入（成交）总额	3,113,348,323.42

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 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	224,253.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,847.78
5	应收申购款	225,665.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	467,766.76

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。



**8.12.6 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
5,729	40,576.55	120,753,287.10	51.95%	111,709,787.48	48.05%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	1,952,665.98	0.8400%

**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	>=100
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（2010年9月15日）基金份额总额	3,309,251,362.03
本报告期期初基金份额总额	1,880,779,375.48
本报告期基金总申购份额	283,696,853.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,932,013,154.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	232,463,074.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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，基金管理人在 2015 年 3 月 28 日发布了《诺安基金管理有限公司关于董事会成员任职的公告》、2015 年 4 月 4 日发布了《诺安基金管理有限公司关于董事会成员任职的公告》、2015 年 12 月 19 日发布了《诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告》的公告，自 2015 年 3 月 28 日起，增选齐斌先生、李清章先生、奥成文先生担任诺安基金管理有限公司董事会董事。自 2015 年 4 月 4 日起，选举汤小青先生、史其禄先生、赵玲华女士担任诺安基金管理有限公司董事会独立董事。原董事会成员欧阳文安先生、朱秉刚先生、陆南屏先生不再担任公司独立董事职务。自 2015 年 12 月 19 日起，增聘曹园先生为公司副总经理。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 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 8 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：3 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无受稽查或处罚等情况。

## 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	
方正证券	1	1,287,597,604.92	30.22%	1,173,650.38	30.19%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	1,707,795,633.83	40.09%	1,554,774.96	39.99%	-
信达证券	1	486,107,240.38	11.41%	442,553.17	11.38%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	469,413,169.62	11.02%	433,595.69	11.15%	-
英大证券	1	268,461,432.41	6.30%	244,650.02	6.29%	-
中泰证券	1	41,042,560.87	0.96%	38,222.46	0.98%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

#### 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	243,267,498.60	100.00%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2015 年 8 月 6 日发布了《诺安基金管理有限公司关于诺安主题精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》的公告，自 2015 年 8 月 6 日起，诺安主题精选股票型证券投资基金变更为诺安主题精选混合型证券投资基金。

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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2016 年 3 月 30 日