

# 诺安先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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	诺安先锋混合
基金主代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 19 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	3,133,321,126.38 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安股票证券投资基金”变更为“诺安先锋混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角,发掘最具投资价值的企业,获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担和控制市场风险的情况下,取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产的配置比例;在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资;在个股选择层面,本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析,挖掘具有中长期投资价值的股票;在债券投资方面,本基金将运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×富时 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数
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	0755-83026688	(010)66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	558,321,389.83	5,688,846,083.88	615,269,915.70
本期利润	-541,139,967.58	4,843,420,262.47	2,233,228,225.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1644	0.8752	0.1832
本期基金份额净值增长率	-10.94%	41.31%	21.89%
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	0.3127	0.4740	-0.2348
期末基金资产净值	4,113,111,572.56	4,973,583,803.26	10,613,507,754.23
期末基金份额净值	1.3127	1.4740	1.0431

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。

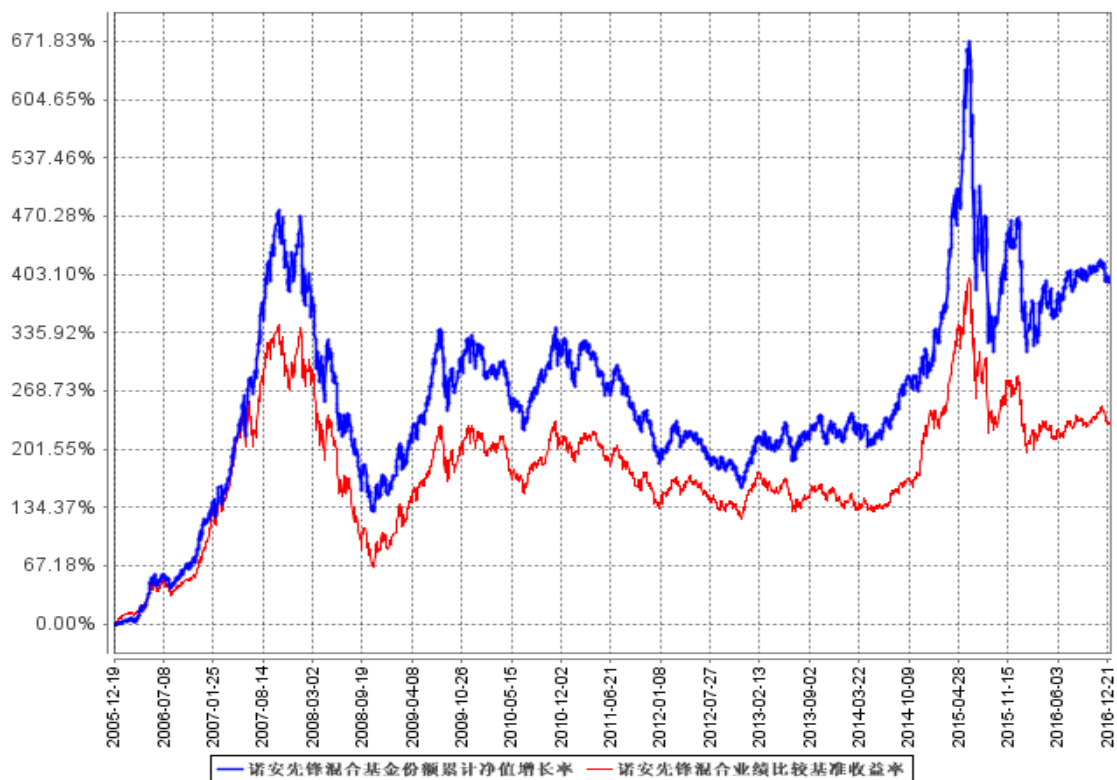
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-1.00%	0.73%	0.60%	0.56%	-1.60%	0.17%
过去六个月	1.42%	0.79%	3.12%	0.60%	-1.70%	0.19%
过去一年	-10.94%	1.57%	-11.76%	1.17%	0.82%	0.40%
过去三年	53.39%	1.82%	34.46%	1.43%	18.93%	0.39%
过去五年	66.40%	1.57%	38.04%	1.29%	28.36%	0.28%
自基金合同生效起至今	395.37%	1.60%	231.55%	1.49%	163.82%	0.11%

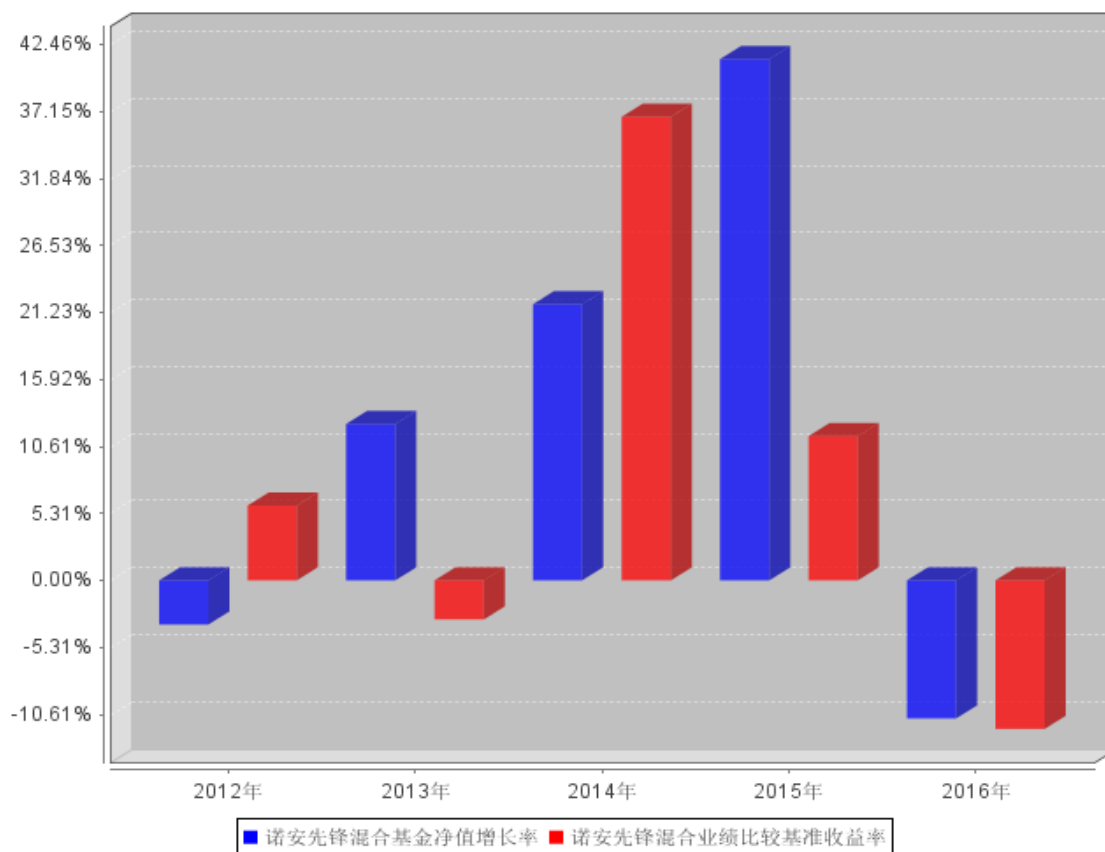
注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数。

### 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规定。

### 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

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基金的经验

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 52 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、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置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		
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	2006 年 6 月 22 日	-	19	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此处基金经理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, 诺安先锋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《诺安先锋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

2016 年全年，沪深 300 指数下跌 11.28%，本基金基准下跌 11.76%，本基金净值下跌 10.94%。

2016 年 A 股市场表现大致可分为年初的“熔断”剧烈下跌行情与此后的震荡上行行情。年初市场在高估值泡沫压力下，受人民币贬值忧虑与熔断交易机制设计缺陷等影响，以成长股为代表的板块跌幅较大，亦导致本基金净值年初产生较大的跌幅。在此之后，我们观察到，无论是中央政府对于供给侧改革政策的推进决心，还是微观层面部分重资产行业的市场化产能淘汰进度，均出现超预期的迹象，加之政府在基建等领域的加杠杆行为，使得我们认为部分周期行业的产品价格上涨逻辑具有相当时间的可持续性。因此，在年初熔断之后的市场震荡上行行情中，本基金遵循灵活的仓位、板块投资策略，在继续配置估值合理的优质成长股的同时，逐渐增配了化工、油服等周期行业，使得基金净值部分收复了年初的跌幅。

### 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 1.3127 元。本报告期基金份额净值增长率为-10.94%，同期业绩比较基准收益率为-11.76%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年国内经济形势，我们仍然坚持此前的核心看法：预计国内宏观经济政策未来一段时间仍将围绕着供给侧改革展开，在保证不发生系统性风险的前提下，推动资金脱虚入实、抑制资产泡沫将是各类经济政策的着力点，中央经济工作会议确立的中性货币政策有望得到较好的执行。同时，以政府主导的基建等领域的投资将是财政扩张的主要方向，宏观经济增速保持平稳的概率较大。从目前来看，市场对于国内宏观经济形势的认知基本趋于一致，政策预期较为明朗。不确定性较大的风险主要在于外部，包括出口贸易摩擦、输入性通胀带来的货币政策压力、人民币汇率波动等。

基于上述宏观逻辑判断，我们认为市场在未来一段时间下跌的风险不大。美国经济的短期复苏会拉动石油、铜等大宗商品价格，我们的资产配置将针对以上的判断做出相应的调整。

#### 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同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、风险控制部、固定收益事业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少一次,最多为六次;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

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

本报告期内,本基金托管人在对诺安先锋混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，诺安先锋混合型证券投资基金的托管人——诺安基金管理有限公司在诺安先锋混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，诺安先锋混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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、江丽雅于 2017 年 3 月 29 日出具了德师报(审)字(17)第 P00703 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：诺安先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	844,799,258.82	530,604,083.06
结算备付金	14,652,237.83	3,858,479.73
存出保证金	843,058.78	1,405,064.71
交易性金融资产	3,278,655,660.50	4,080,910,097.15
其中：股票投资	3,272,152,603.60	4,073,086,311.05
基金投资	-	-
债券投资	6,503,056.90	7,823,786.10
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	-	300,000,850.00
应收证券清算款	-	71,656,223.97
应收利息	145,939.94	187,973.93
应收股利	-	-
应收申购款	96,235.96	237,829.02
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,139,192,391.83	4,988,860,601.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015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	12,802,116.52	-
应付赎回款	2,544,056.13	6,227,282.25
应付管理人报酬	5,331,921.63	6,334,258.24
应付托管费	888,653.59	1,055,709.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,308,404.15	1,291,149.68
应交税费	25,000.00	25,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,667.25	343,398.45
负债合计	26,080,819.27	15,276,798.31
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	3,133,321,126.38	3,374,096,258.26
未分配利润	979,790,446.18	1,599,487,545.00
所有者权益合计	4,113,111,572.56	4,973,583,803.26
负债和所有者权益总计	4,139,192,391.83	4,988,860,601.57

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3127 元，基金份额总 3,133,321,126.38 份。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年	2015 年 1 月 1 日至 2015 年

	12 月 31 日	12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-436,324,353.82	5,036,318,665.31
1. 利息收入	5,310,656.58	7,723,640.39
其中：存款利息收入	5,106,829.82	7,328,593.77
债券利息收入	23,809.44	12,364.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	180,017.32	382,682.18
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	657,731,586.85	5,873,472,388.44
其中：股票投资收益	643,682,617.60	5,831,855,302.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	7,096,937.62
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	14,048,969.25	34,520,147.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,099,461,357.41	-845,425,821.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	94,760.16	548,457.89
<b>减：二、费用</b>	104,815,613.76	192,898,402.84
1. 管理人报酬	63,306,401.41	115,107,374.18
2. 托管费	10,551,066.97	19,184,562.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	30,557,695.89	58,196,775.95
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	400,449.49	409,690.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-541,139,967.58	4,843,420,262.47
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-541,139,967.58	4,843,420,262.47

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,374,096,258.26	1,599,487,545.00	4,973,583,803.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-541,139,967.58	-541,139,967.58
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）	-240,775,131.88	-78,557,131.24	-319,332,263.12
其中：1. 基金申购款	74,157,234.74	18,251,434.31	92,408,669.05
2. 基金赎回款	-314,932,366.62	-96,808,565.55	-411,740,932.17
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）	3,133,321,126.38	979,790,446.18	4,113,111,572.56
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2015年1月1日至2015年12月31日</b>		
项目	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）	10,175,180,640.18	438,327,114.05	10,613,507,754.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,843,420,262.47	4,843,420,262.47
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）	-6,801,084,381.92	-3,682,259,831.52	-10,483,344,213.44
其中：1. 基金申购款	349,776,682.74	172,662,244.07	522,438,926.81
2. 基金赎回款	-7,150,861,064.66	-3,854,922,075.59	-11,005,783,140.25
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）	3,374,096,258.26	1,599,487,545.00	4,973,583,803.26

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

诺安先锋混合型证券投资基金(简称“本基金”)原名为诺安股票证券投资基金,经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监基金字[2005]154号文《关于同意诺安股票证券投资基金设立的批复》批准,于2005年11月3日至2005年12月13日向社会进行公开募集,经利安达信隆会计师事务所验资,共募集资金人民币379,115,510.80元,折合379,115,510.80份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币85,441.25元,其中在基金设立募集期产生的利息为人民币61,905.56元,折合61,905.56份基金份额,其余利息为人民币23,535.69元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2005年12月19日,合同生效日基金份额为379,177,416.36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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安股票证券投资基金基金合同》、《诺安股票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,诺安股票证券投资基金名称变更为诺安先锋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2017年3月29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2016年12月31日的财务状况以及2016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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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要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[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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

(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,由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳,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,股息红利所得暂免征收个人所得税。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,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方



不再缴纳印花税。

(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
中国工商银行股份有限公司	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。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 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。

##### 7.4.8.2 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	63,306,401.41	115,107,374.18
其中：支付销售机构的客户维护费	10,671,992.04	20,117,648.05

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

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，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,551,066.97	19,184,562.40

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

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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管理费划款指令，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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。

#### 7.4.8.4 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。

##### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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

中国工商银行股份有限公司	844,799,258.82	4,970,738.09	530,604,083.06	7,089,188.31
--------------	----------------	--------------	----------------	--------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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。

#### 7.4.8.7 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。

### 7.4.9 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601222	林洋能源	2016年5月13日	2017年5月10日	新股流通受限	30.68	8.07	3,422,426	30,000,008.48	27,618,977.82	-
600575	皖江物流	2016年7月1日	2017年6月30日	新股流通受限	3.58	4.69	5,581,676	19,982,400.08	26,178,060.44	-
000413	东旭光电	2016年8月25日	2017年8月28日	新股流通受限	6.29	8.02	3,179,650	19,999,998.50	25,500,793.00	-
600604	市北高新	2016年8月31日	2017年8月29日	新股流通受限	15.31	17.11	1,306,336	20,000,004.16	22,351,408.96	-
000536	华映科技	2016年9月30日	2017年10月10日	新股流通受限	10.53	11.71	1,899,335	19,999,997.55	22,241,212.85	-
603885	吉祥航空	2016年5月13日	2017年5月11日	新股流通受限	22.82	23.05	876,424	19,999,995.68	20,201,573.20	-

002432	九安医疗	2016年 6月 24日	2017 年 6月 27日	新股流 通受限	15.20	15.37	1,058,588	16,090,537.60	16,270,497.56	-
600512	腾达建设	2016年 9月 28日	2017 年 9月 26日	新股流 通受限	4.39	4.63	2,955,473	12,974,526.47	13,683,839.99	-
603117	万林股份	2016年 9月8日	2017 年 9月 6日	新股流 通受限	16.41	16.50	425,783	6,987,099.03	7,025,419.50	-
002821	凯莱英	2016年 11月 11日	2017 年 11月 20日	新股流 通受限	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
300508	维宏股份	2016年 4月 12日	2017 年 4月 19日	新股流 通受限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
603823	百合花	2016年 12月 9日	2017 年 12月 20日	新股流 通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
601375	中原证券	2016年 12月 20日	2017 年 1月 3日	新股流 通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年 12月 28日	2017 年 1月 6日	新股流 通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年 12月 29日	2017 年 1月 9日	新股流 通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年 12月 29日	2017 年 1月 6日	新股流 通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天燃气	2016年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

603035	常熟汽饰	2016年 12月 27日	2017 年 1月 5日	新股流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年 12月 28日	2017 年 1月 5日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年 12月 29日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年 12月 28日	2017 年 1月 6日	新股流 通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年 12月 26日	2017 年 1月 3日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年 12月 27日	2017 年 1月 5日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年 12月 26日	2017 年 1月 4日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年 12月 27日	2017 年 1月 5日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：截至本报告期末 2016 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的债券及权证。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300098	高新兴	2016年11月17日	重大事项	15.84	2017年1月23日	14.26	2,977,916	41,221,366.82	47,170,189.44	-
600711	盛屯矿业	2016年12月19日	重大事项	7.02	2017年1月11日	7.38	6,442,148	52,101,514.29	45,223,878.96	-
300047	天源迪科	2016年8月15日	重大事项	19.90	2017年1月6日	19.00	1,414,169	23,586,610.28	28,141,963.10	-
600687	刚泰控股	2016年7月25日	重大事项	16.42	2017年1月18日	16.38	603,054	9,981,283.66	9,902,146.68	-
000166	申万宏源	2016年12月21日	重大事项	6.25	2017年1月26日	6.29	472,400	3,083,442.50	2,952,500.00	-
000750	国海证券	2016年12月15日	重大事项	6.97	2017年1月20日	6.27	423,100	3,138,003.00	2,949,007.00	-

**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 2016 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 2016 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。

②各层级金融工具公允价值

于 2016 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 2,954,251,450.59 元，属于第二层级的余额为 323,914,525.40 元，属于第三层级的余额为 489,684.51 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票(2015 年 12 月 31 日：第一层级 3,850,016,059.96 元，第二层级 230,894,037.19 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可转换债券，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；除证券交易所上市的可转换债券外，其他固定收益品种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	3,272,152,603.60	79.05
	其中：股票	3,272,152,603.60	79.05
2	固定收益投资	6,503,056.90	0.16
	其中：债券	6,503,056.90	0.16
	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	859,451,496.65	20.76
7	其他各项资产	1,085,234.68	0.03

8	合计	4,139,192,391.83	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	213,647,866.45	5.19
C	制造业	1,993,501,283.45	48.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,789,783.62	2.52
E	建筑业	214,360,078.43	5.21
F	批发和零售业	43,876,051.03	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	46,389,092.32	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	272,813,131.39	6.63
J	金融业	208,979,053.72	5.08
K	房地产业	115,092,217.21	2.80
L	租赁和商务服务业	7,025,419.50	0.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	52,678,584.76	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,272,152,603.60	79.55

### 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	600477	杭萧钢构	11,502,681	115,601,944.05	2.81
2	601318	中国平安	3,199,977	113,375,185.11	2.76



3	002353	杰瑞股份	4,863,517	98,729,395.10	2.40
4	300319	麦捷科技	2,251,468	88,460,177.72	2.15
5	300003	乐普医疗	4,710,873	84,465,952.89	2.05
6	300136	信维通信	2,033,552	57,956,232.00	1.41
7	600779	水井坊	3,004,817	57,422,052.87	1.40
8	002217	合力泰	3,024,456	54,137,762.40	1.32
9	600452	涪陵电力	1,265,808	52,758,877.44	1.28
10	002247	帝龙文化	2,896,691	52,401,140.19	1.27

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	002353	杰瑞股份	138,558,712.19	2.79
2	600477	杭萧钢构	120,132,189.18	2.42
3	000166	申万宏源	90,691,935.05	1.82
4	002241	歌尔股份	87,987,373.27	1.77
5	300003	乐普医疗	87,875,457.23	1.77
6	300319	麦捷科技	78,787,550.69	1.58
7	601233	桐昆股份	76,839,171.09	1.54
8	300070	碧水源	76,113,367.88	1.53
9	002589	瑞康医药	69,281,128.17	1.39
10	601888	中国国旅	66,489,155.19	1.34
11	000932	华菱钢铁	66,409,278.86	1.34
12	601688	华泰证券	64,809,483.97	1.30
13	600050	中国联通	64,687,509.14	1.30
14	600999	招商证券	62,274,741.50	1.25
15	300463	迈克生物	59,326,973.82	1.19
16	000776	广发证券	57,960,439.09	1.17
17	002271	东方雨虹	55,619,097.96	1.12
18	002236	大华股份	55,284,481.66	1.11
19	600256	广汇能源	55,036,650.74	1.11
20	600155	宝硕股份	54,714,916.56	1.10

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	222,830,735.45	4.48
2	601601	中国太保	194,427,065.86	3.91
3	300072	三聚环保	91,347,034.89	1.84
4	300296	利亚德	84,676,783.02	1.70
5	000166	申万宏源	84,645,018.41	1.70
6	600584	长电科技	82,070,952.59	1.65
7	000932	华菱钢铁	74,481,939.83	1.50
8	002589	瑞康医药	74,108,937.58	1.49
9	002408	齐翔腾达	71,782,597.73	1.44
10	300113	顺网科技	71,765,936.68	1.44
11	601628	中国人寿	68,384,835.77	1.37
12	002572	索菲亚	66,821,194.13	1.34
13	002573	清新环境	66,683,790.37	1.34
14	601788	光大证券	66,008,451.24	1.33
15	300115	长盈精密	64,832,467.89	1.30
16	601888	中国国旅	64,489,422.68	1.30
17	002616	长青集团	62,537,987.15	1.26
18	300017	网宿科技	61,374,435.63	1.23
19	002221	东华能源	60,735,358.54	1.22
20	601688	华泰证券	60,539,162.24	1.22

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	9,880,658,986.91
卖出股票收入（成交）总额	10,228,075,916.55

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

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,503,056.90	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,503,056.90	0.16

### 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	113008	电气转债	56,830	6,503,056.90	0.16

### 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

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

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 本基金本报告期投资的前十名股票中没有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	843,058.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	145,939.94
5	应收申购款	96,235.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,085,234.68

#### 8.12.4 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	113008	电气转债	6,503,056.90	0.16

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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
192,583	16,269.98	4,939,927.82	0.16%	3,128,381,198.56	99.84%

### 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	249,055.68	0.0079%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年12月19日）基金份额总额	379,177,416.36
本报告期期初基金份额总额	3,374,096,258.26
本报告期基金总申购份额	74,157,234.74
减：本报告期基金总赎回份额	314,932,366.62
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	3,133,321,126.38

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，基金管理人于2016年11月15日在《中国证券报》发布了《诺安基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告》、《诺安基金管理有限责任公司关于增聘高级管理人员的公告》的公告。自2016年11月15日起，陈勇不再担任公司督察长，转任公司副总经理。自2016年11月15日起，马宏任公司督察长。

本报告期内，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，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：4 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

2016 年 6 月，针对深圳证监局向公司出具的《关于对诺安基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，以及对相关人员的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力，一次性通过深圳证监局整改验收。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
中投证券		25,662,729,412.46	28.41%	5,273,709.62	28.41%	-
华泰证券		13,759,953,690.94	18.87%	3,501,654.27	18.87%	-
方正证券		13,146,719,126.55	15.79%	2,930,534.06	15.79%	-
申万宏源		22,129,104,378.32	10.68%	1,982,836.78	10.68%	-
长城证券		11,282,129,296.01	6.43%	1,194,049.61	6.43%	-
国都证券		11,068,524,339.39	5.36%	995,119.38	5.36%	-
银河证券	1	681,103,269.24	3.42%	634,312.75	3.42%	-
中信证券	1	622,812,210.53	3.12%	580,025.94	3.12%	-
长江证券	1	557,886,107.39	2.80%	519,560.54	2.80%	-
海通证券	1	540,103,038.68	2.71%	502,998.43	2.71%	-
国泰君安	1	367,919,542.66	1.85%	342,644.63	1.85%	-
中银国际	1	111,838,202.22	0.56%	104,155.56	0.56%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期减少 1 家证券公司的 1 个交易单元：金元证券有限责任公司（1 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，并能为本基金提供全面的信息服。
- (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
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

国都证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

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  
2017年3月30日