

# 诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2018 年 3 月 28 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，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2017 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66

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 .....	66
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 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>70</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安先锋混合型证券投资基金
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	2,698,593,511.97 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
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	秦维舟	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

## § 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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	73,032,144.81	558,321,389.83	5,688,846,083.88
本期利润	278,200,647.70	-541,139,967.58	4,843,420,262.47
加权平均基金份额本期利润	0.0944	-0.1644	0.8752
本期加权平均净值利润率	7.05%	-12.82%	63.38%
本期基金份额净值增长率	7.28%	-10.94%	41.31%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	1,101,875,339.95	979,790,446.18	1,599,487,545.00
期末可供分配基金份额利润	0.4083	0.3127	0.4740
期末基金资产净值	3,800,468,851.92	4,113,111,572.56	4,973,583,803.26
期末基金份额净值	1.4083	1.3127	1.4740
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	431.44%	395.37%	456.23%

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期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。

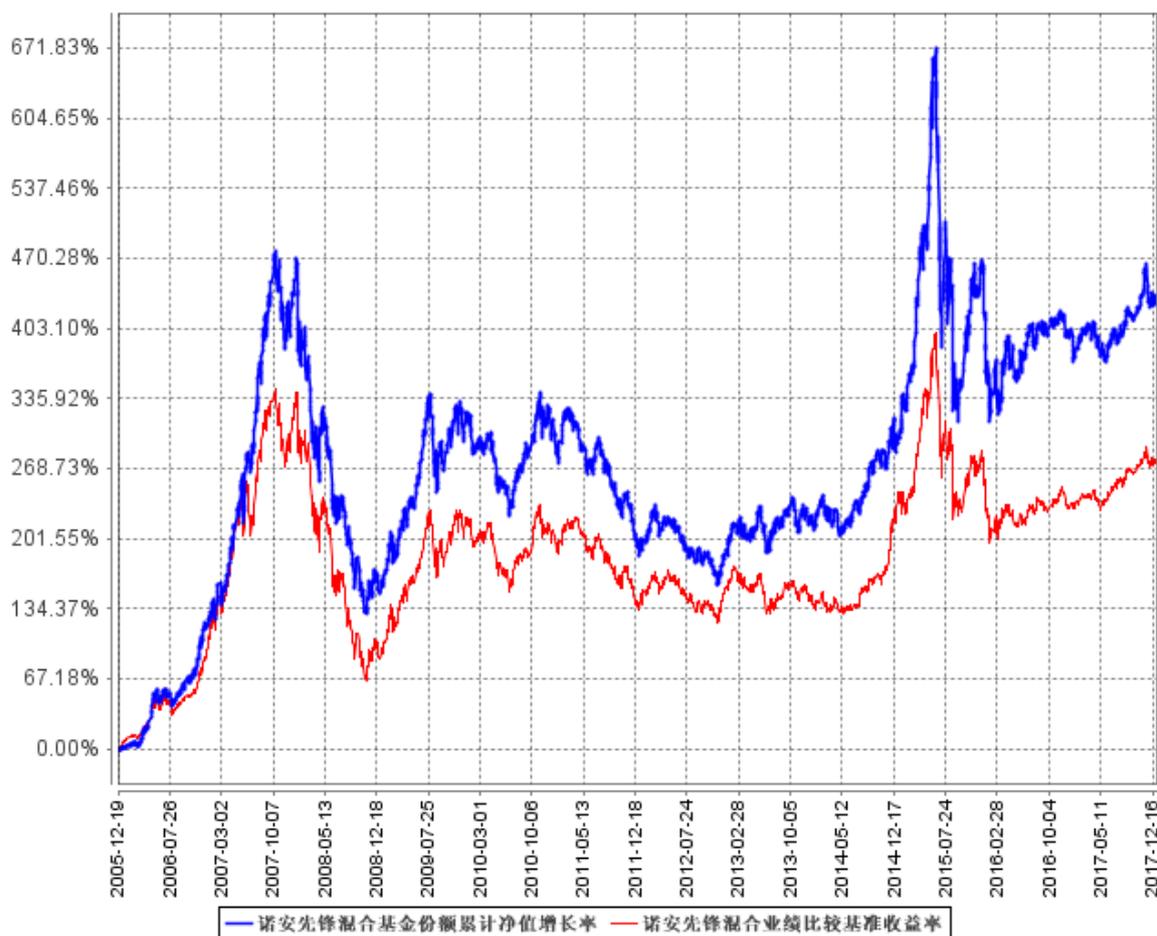
### 3.2 基金净值表现

#### 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	3.39%	0.87%	2.75%	0.62%	0.64%	0.25%
过去六个月	6.80%	0.75%	6.93%	0.55%	-0.13%	0.20%
过去一年	7.28%	0.74%	13.42%	0.51%	-6.14%	0.23%
过去三年	35.01%	1.75%	11.53%	1.35%	23.48%	0.40%
过去五年	84.96%	1.55%	47.79%	1.23%	37.17%	0.32%
自基金合同生效起至今	431.44%	1.55%	276.04%	1.44%	155.40%	0.11%

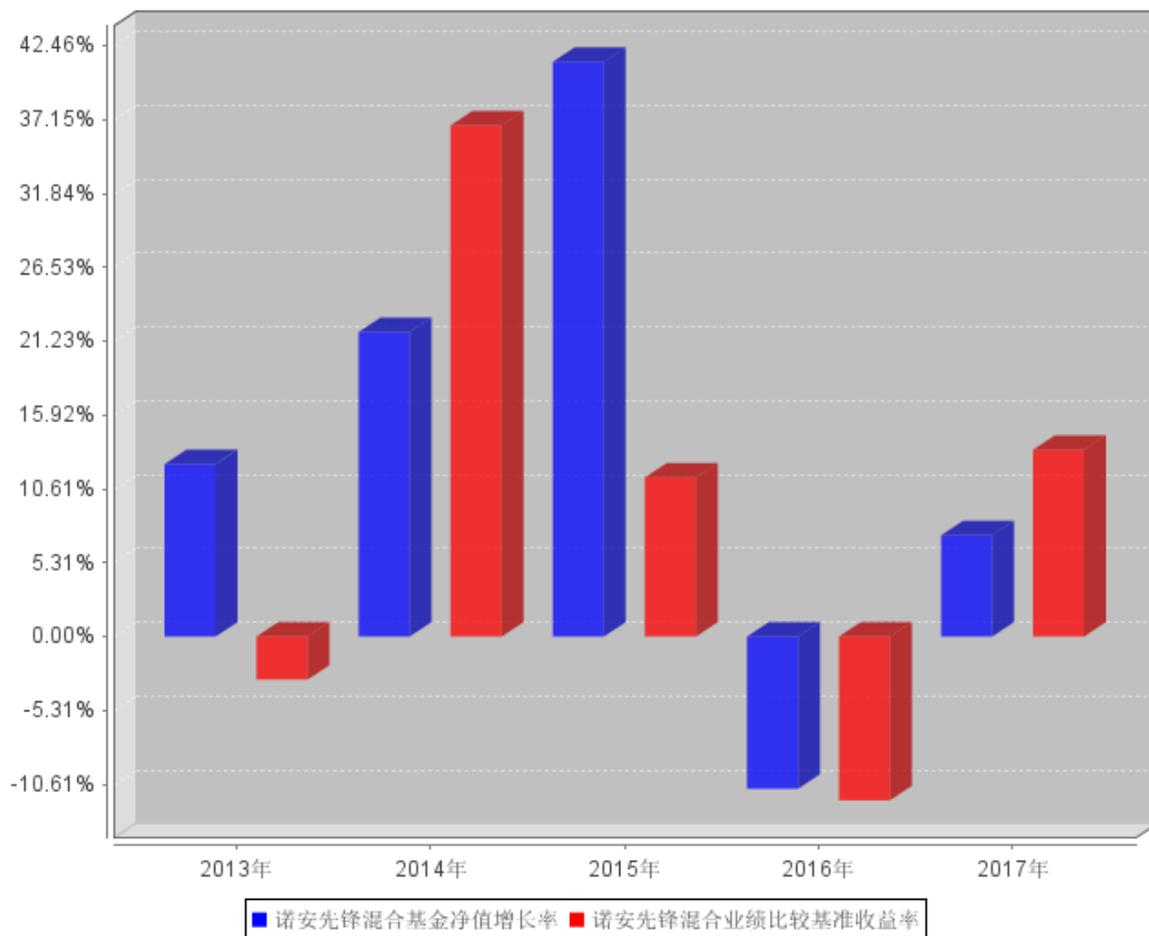
注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数。

### 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 2017 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 53 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、诺安行业轮动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、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、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置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、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金等。

#### 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、权	2006 年 6 月	-	20	经济学硕士, CFA, 具有基金从业资格。曾任

	益事业部总经理、投资一部总监、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理	22 日		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、权益事业部总经理、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合规守信情况的说明

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

整体而言，2017 年 A 股市场走势呈现出慢牛格局，价值投资理念深入人心，机构投资者凭借投研优势，取得了较好的业绩成果。回顾 2017 年，我们认为金融去杠杆、供给侧改革、全球经济复苏等三方面因素是过去一年 A 股市场各板块表现差异的宏观逻辑基础。在金融去杠杆的政策背景下，市场的风险偏好受到显著的压制，即使在积累了不少赚钱效应之后，投资者对于高估值板块的风险偏好也并未得到持续改善，以军工为代表的高估值板块全年表现显著弱于市场，而白酒家电等消费板块由于行业景气度高，估值与业绩增速匹配度好，成为 2017 年表现最好的板块之一；与此同时，在外资加大 A 股配置的背景下，其他部分行业龙头由于估值较低、业绩增长确定，在过去一年也经历了显著提估值的过程。2017 年市场对于国内供给侧改革政策进行了重估，部分乐观投资者甚至认为钢铁、煤炭等行业未来的周期性将被烫平，原因在于供给受到严格限制。推动 2017 年市场表现的全球经济复苏逻辑，在经历了年初的质疑之后，随着各层面数据的相互验证，市场疑虑已经基本消除，相应的石化、有色等周期板块也同样在 2017 年有较好的表现。

从本基金的角度来看，我们在 2017 年延续了以往的均衡配置风格，兼顾价值与成长，并对保险等金融板块有所侧重。

#### 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 1.4083 元。本报告期基金份额净值增长率为 7.28%，同期

业绩比较基准收益率为 13.42%。

#### 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 2018 年，在金融去杠杆的政策指引下，我们预期市场流动性难有实质改善的空间，金融强监管的政策导向不会发生变化，同时美联储货币政策的全球传导效应对我国央行的政策取向压力较之 2017 年将更为显著。从宏观经济的角度看，未来一段时间，我们仍然难以看到全球经济复苏趋势终止的迹象和逻辑，中国经济尽管面临着地产下行的压力，但在全球经济复苏的大背景下，制造业的资产负债表修复和再投资意愿的上升将对经济形成强有力的支撑。对于市场关注的通胀问题，我们认为尽管 2018 年面临原油价格上涨带来的输入型通胀压力，但在猪价等仍处于下行通道的背景下，整体来看，通胀不会成为 2018 年的风险因素。

在行业配置方面，在需求稳定和供给收缩的大格局下，周期板块未来仍有操作空间；而在 TMT 等成长板块，从目前来看，虽然板块估值还谈不上便宜，但部分行业成长逻辑确定、公司业绩增长确定的标的已进入战略买入的区间。总体来说，未来一段时间，我们仍将延续以往的均衡持仓风格。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内本基金管理人共管理了五十三只开放式基金——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、诺安行业轮动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、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、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置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、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金等。

在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以监察、稽核为主导的工作体系和流程。内部监察稽核人员依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度公司合法合规运作和内部风险控制的具体情况如下：

1、根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，监察稽核部在报告期内对公司各个部门进行了四次全面的监察稽核和多次临时性监察稽核。内容涉及公司及员工遵纪守法情况，内部控制制度、业务操作流程执行情况；涵盖基金销售、投资运作、后台保障等公司所有业务环节和工作岗位。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由监察稽核部跟踪问题的处理情况，确保了公司在各方面规范运作，切实地保障了基金份额持有人的利益。

2、对公司基金销售活动进行监督、指导，确保基金销售活动严格按照《销售管理办法》的规定处理基金代销机构、基金宣传推介材料、基金销售费用等方面的问题，不出现违法违规的情况。同时，督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。

3、公司所有对外发布的文件、资料及宣传材料，都事先由监察稽核部进行合规性审查，确保其内容真实、准确、合规，符合中国证监会对信息披露的相关要求。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的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、风险控制部、投资管理部、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验，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。

#### **4.8 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，本报告期末未有收益分配事项。

#### **4.9 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遵规守信、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管理人——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 2017 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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1801600 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺安先锋混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的诺安先锋混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实

	<p>务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>该基金管理人诺安基金管理有限公司治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与该基金管理人诺安基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	左艳霞	张品
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2018 年 3 月 28 日	

## § 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	251,286,344.58	844,799,258.82
结算备付金		10,568,543.01	14,652,237.83
存出保证金		824,135.52	843,058.78
交易性金融资产	7.4.7.2	2,905,359,295.68	3,278,655,660.50
其中：股票投资		2,869,100,619.80	3,272,152,603.60
基金投资		-	-
债券投资		36,258,675.88	6,503,056.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	649,200,643.80	-
应收证券清算款		948,839.01	-
应收利息	7.4.7.5	1,005,379.43	145,939.94
应收股利		-	-
应收申购款		97,940.77	96,235.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,819,291,121.80	4,139,192,391.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,763,976.19	12,802,116.52
应付赎回款		4,019,163.87	2,544,056.13
应付管理人报酬		4,855,353.68	5,331,921.63
应付托管费		809,225.62	888,653.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,078,514.06	4,308,404.15
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	7.4.7.8	271,036.46	180,667.25
负债合计		18,822,269.88	26,080,819.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,698,593,511.97	3,133,321,126.38
未分配利润	7.4.7.10	1,101,875,339.95	979,790,446.18
所有者权益合计		3,800,468,851.92	4,113,111,572.56
负债和所有者权益总计		3,819,291,121.80	4,139,192,391.83

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4083 元，基金份额总额 2,698,593,511.97 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		375,367,037.60	-436,324,353.82
1. 利息收入		8,645,654.21	5,310,656.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,346,049.17	5,106,829.82
债券利息收入		57,634.30	23,809.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,241,970.74	180,017.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		161,489,920.48	657,731,586.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	127,321,554.17	643,682,617.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	34,168,366.31	14,048,969.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	205,168,502.89	-1,099,461,357.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	62,960.02	94,760.16
<b>减：二、费用</b>		97,166,389.90	104,815,613.76
1. 管理人报酬		59,189,070.98	63,306,401.41
2. 托管费		9,864,845.15	10,551,066.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	27,723,084.94	30,557,695.89

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	389,388.83	400,449.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		278,200,647.70	-541,139,967.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		278,200,647.70	-541,139,967.58

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	3,133,321,126.38	979,790,446.18	4,113,111,572.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	278,200,647.70	278,200,647.70
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）	-434,727,614.41	-156,115,753.93	-590,843,368.34
其中：1. 基金申购款	25,664,394.74	8,697,754.94	34,362,149.68
2. 基金赎回款	-460,392,009.15	-164,813,508.87	-625,205,518.02
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）	2,698,593,511.97	1,101,875,339.95	3,800,468,851.92
项目	上年度可比期间 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	-	-541,139,967.58	-541,139,967.58



本基金的财务报表于 2018 年 3 月 28 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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

该金融资产已转移，且本基金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；

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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

所转移金融资产的账面价值

因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无

法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计

提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 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，每次收益分配时，分配比例不低于当时可分配收益的 50%，若《诺安先锋混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值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；

(c) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(d) 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；

(e) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(f) 每一基金份额享有同等分配权；

(g) 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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》的附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“估值指引”）的处理标准，本基金自 2017 年 12 月 25 日起，对本基金持有的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票、估值指引所称流通受限股票的估值方法进行调整，参考估值指引进行估值。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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 [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》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [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》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税 [2017] 56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所

得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10%的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7%的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(g) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	251,286,344.58	844,799,258.82
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	251,286,344.58	844,799,258.82

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,621,865,172.14	2,869,100,619.80	247,235,447.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	36,136,593.86	36,258,675.88
	银行间市场	-	-
	合计	36,136,593.86	36,258,675.88
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,658,001,766.00	2,905,359,295.68	247,357,529.68
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		3,230,783,633.71	3,272,152,603.60	41,368,969.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,683,000.00	6,503,056.90	820,056.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,683,000.00	6,503,056.90	820,056.90
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,236,466,633.71	3,278,655,660.50	42,189,026.79

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本年末及上年末未持有衍生金融资产 / 负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	300,000,000.00	-
银行间市场	349,200,643.80	-
合计	649,200,643.80	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本年末及上年末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	120,641.77	118,228.08
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,755.90	6,593.50
应收债券利息	98,422.02	20,739.06

应收买入返售证券利息	781,188.84	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	370.90	379.30
合计	1,005,379.43	145,939.94

注：此处其他列示的是应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本年末及上年末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,077,250.35	4,308,054.15
银行间市场应付交易费用	1,263.71	350.00
合计	6,078,514.06	4,308,404.15

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
应付赎回费	1,036.46	667.25
预提费用	270,000.00	180,000.00
合计	271,036.46	180,667.25

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,133,321,126.38	3,133,321,126.38
本期申购	25,664,394.74	25,664,394.74
本期赎回(以“-”号填列)	-460,392,009.15	-460,392,009.15
本期末	2,698,593,511.97	2,698,593,511.97

注：此处申购含转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,310,391,612.26	-1,330,601,166.08	979,790,446.18
本期利润	73,032,144.81	205,168,502.89	278,200,647.70

本期基金份额交易产生的变动数	-314,769,137.14	158,653,383.21	-156,115,753.93
其中：基金申购款	18,642,946.16	-9,945,191.22	8,697,754.94
基金赎回款	-333,412,083.30	168,598,574.43	-164,813,508.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,068,654,619.93	-966,779,279.98	1,101,875,339.95

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	4,211,710.14	4,970,738.09
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	119,984.15	115,202.85
其他	14,354.88	20,888.88
合计	4,346,049.17	5,106,829.82

注：此处其他列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	9,375,532,565.48	10,228,075,916.55
减：卖出股票成本总额	9,248,211,011.31	9,584,393,298.95
买卖股票差价收入	127,321,554.17	643,682,617.60

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金在本年度及上年度均无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本年度及上年度均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	34,168,366.31	14,048,969.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	34,168,366.31	14,048,969.25

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	205,168,502.89	-1,099,461,357.41
——股票投资	205,866,477.77	-1,098,140,628.21
——债券投资	-697,974.88	-1,320,729.20
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	205,168,502.89	-1,099,461,357.41

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	61,630.21	93,600.09
基金转换费收入	1,329.81	1,160.07
合计	62,960.02	94,760.16

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	27,723,084.94	30,557,695.89
银行间市场交易费用	-	-
合计	27,723,084.94	30,557,695.89

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
审计费用	70,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
汇划费	1,388.83	2,449.49
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	389,388.83	400,449.49

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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。

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	59,189,070.98	63,306,401.41
其中：支付销售机构的客户维护费	10,362,653.93	10,671,992.04

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,864,845.15	10,551,066.97

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。

### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	251,286,344.58	4,211,710.14	844,799,258.82	4,970,738.09

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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	2018年5月10日	新股流通受限	30.68	9.49	1,711,213	15,007,338.01	16,239,411.37	-
000413	东旭光电	2016年8月25日	2018年8月26日	新股流通受限	6.29	8.81	1,589,825	9,999,999.25	14,006,358.25	-

600575	皖江物流	2016年7月1日	2018年6月30日	新股流通受限	3.58	3.86	2,790,838	9,991,200.04	10,772,634.68	-
603885	吉祥航空	2016年5月13日	2018年5月11日	新股流通受限	22.82	14.72	613,496	9,999,984.80	9,030,661.12	-
600604	市北高新	2016年8月31日	2018年8月29日	新股流通受限	15.31	6.52	1,306,336	9,758,329.92	8,517,310.72	-
000536	华映科技	2016年9月30日	2018年10月10日	新股流通受限	10.53	4.69	1,519,468	9,998,099.44	7,126,304.92	-
600512	腾达建设	2016年9月28日	2018年9月26日	新股流通受限	4.39	4.25	1,477,736	6,635,034.64	6,280,378.00	-
002432	九安医疗	2016年6月24日	2018年6月27日	新股流通受限	15.20	8.64	529,294	7,108,418.42	4,573,100.16	-
603117	万林股份	2016年9月8日	2018年9月6日	新股流通受限	16.41	9.19	212,891	3,493,541.31	1,956,468.29	-
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年4月9日	新股流通受限	29.82	33.80	16,665	198,780.12	563,277.00	-
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月1日	新股流通受限	40.29	74.87	7,008	282,352.32	524,688.96	-
002892	科力尔	2017年8月10日	2018年8月17日	新股流通受限	17.56	32.16	11,000	193,160.00	353,760.00	-
002860	星帅尔	2017年3月31日	2018年4月12日	新股流通受限	19.81	39.79	7,980	158,083.80	317,524.20	-
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128028	赣锋转债	2017年12月21日	2018年1月19日	新债流通受限	100.00	100.00	9,771	977,100.00	977,100.00	-

注：1、本基金持有的流通受限股票“洁美科技”于2017年9月15日实施资本公积转增股本方案，转增股本后“洁美科技”的单位成本为11.93元/股。

2、截至本报告期末2017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权证。

#### 7.4.12.2 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
600807	天业股份	2017年12月25日	重大事项	10.01	-	-	1,643,300	15,700,677.00	16,449,433.00	-
000900	现代投资	2017年10月27日	重大事项	6.25	-	-	743,014	4,547,699.19	4,643,837.50	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	276,262	4,469,040.62	4,362,176.98	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项	7.62	-	-	485,700	3,792,102.44	3,701,034.00	-
002112	三变科技	2017年12月25日	重大事项	17.41	2018年2月22日	15.67	171,800	3,009,751.00	2,991,038.00	-
002622	融钰集团	2017年12月26日	重大事项	14.06	2018年1月24日	14.57	209,100	3,248,421.90	2,939,946.00	-
002545	东方铁塔	2017年12月4日	重大事项	8.67	-	-	275,800	2,298,407.17	2,391,186.00	-
000031	中粮地产	2017年7月24日	重大事项	8.00	-	-	177,100	1,334,455.00	1,416,800.00	-

002711	欧浦智网	2017年12月13日	重大事项	10.76	2018年1月11日	10.80	119,200	1,538,026.00	1,282,592.00	-
002787	华源控股	2017年12月21日	重大事项	10.65	2018年1月2日	10.94	105,300	1,109,758.93	1,121,445.00	-
002697	红旗连锁	2017年12月15日	重大事项	6.38	2018年1月3日	7.02	169,600	1,053,359.00	1,082,048.00	-
600162	香江控股	2017年11月10日	重大事项	3.37	2018年1月12日	3.71	243,300	907,775.55	819,921.00	-
300216	千山药机	2017年12月25日	重大事项	15.95	2018年1月18日	14.36	33,600	569,955.14	535,920.00	-
000695	滨海能源	2017年10月9日	重大事项	11.73	2018年1月15日	10.73	40,700	499,664.00	477,411.00	-
300173	智慧松德	2017年12月26日	重大事项	7.90	-	-	41,400	355,618.86	327,060.00	-
300356	光一科技	2017年12月26日	重大事项	6.99	2018年3月26日	6.29	38,300	266,576.13	267,717.00	-
300391	康跃科技	2017年12月25日	重大事项	13.13	2018年1月2日	13.25	15,300	209,442.00	200,889.00	-
002082	万邦德	2017年12月18日	重大事项	13.97	-	-	9,100	122,378.00	127,127.00	-
600903	贵州燃气	2017年12月28日	临时停牌	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
601619	嘉泽新能	2017年10月31日	重大事项	7.90	-	-	6,616	8,336.16	52,266.40	-
002442	龙星化工	2017年12月19日	重大事项	12.51	2018年1月3日	12.50	4,000	49,000.00	50,040.00	-

600539	狮头股份	2017年12月27日	重大事项	16.80	-	-	2,100	35,498.00	35,280.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	临时停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	临时停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300364	中文在线	2017年12月28日	重大事项	9.23	2018年1月5日	10.00	102	1,003.36	941.46	-
002425	凯撒文化	2017年12月28日	重大事项	7.21	2018年1月22日	7.35	69	1,003.13	497.49	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定

了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制办公会，实施董事会合规审查与风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险控制部向督察长负责，并向首席执行官汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以合规审查与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本年末及上年末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	9,186,737.40	6,503,056.90
AAA 以下	27,071,938.48	-
未评级	-	-
合计	36,258,675.88	6,503,056.90

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级的债券。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险控制部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原

则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	251,286,344.58	-	-	-	-	251,286,344.58
结算备付金	10,568,543.01	-	-	-	-	10,568,543.01
存出保证金	824,135.52	-	-	-	-	824,135.52
交易性金融资产	19,055,273.53	17,203,402.35	-	-	-2,869,100,619.80	2,905,359,295.68
买入返售金融资产	649,200,643.80	-	-	-	-	649,200,643.80
应收证券清算款	-	-	-	-	948,839.01	948,839.01
应收利息	-	-	-	-	1,005,379.43	1,005,379.43
应收申购款	308.21	-	-	-	97,632.56	97,940.77
资产总计	930,935,248.65	17,203,402.35	-	-	-2,871,152,470.80	3,819,291,121.80
负债						

应付证券清算款	-	-	-	-	2,763,976.19	2,763,976.19
应付赎回款	-	-	-	-	4,019,163.87	4,019,163.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,855,353.68	4,855,353.68
应付托管费	-	-	-	-	809,225.62	809,225.62
应付交易费用	-	-	-	-	6,078,514.06	6,078,514.06
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	271,036.46	271,036.46
负债总计	-	-	-	-	18,822,269.88	18,822,269.88
利率敏感度缺口	930,935,248.65	17,203,402.35	-	-	-2,852,330,200.92	3,800,468,851.92
上年度末 2016年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	844,799,258.82	-	-	-	-	844,799,258.82
结算备付金	14,652,237.83	-	-	-	-	14,652,237.83
存出保证金	843,058.78	-	-	-	-	843,058.78
交易性金融资产	6,503,056.90	-	-	-	-3,272,152,603.60	3,278,655,660.50
应收利息	-	-	-	-	145,939.94	145,939.94
应收申购款	-	-	-	-	96,235.96	96,235.96
资产总计	866,797,612.33	-	-	-	-3,272,394,779.50	4,139,192,391.83
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	12,802,116.52	12,802,116.52
应付赎回款	-	-	-	-	2,544,056.13	2,544,056.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,331,921.63	5,331,921.63
应付托管费	-	-	-	-	888,653.59	888,653.59
应付交易费用	-	-	-	-	4,308,404.15	4,308,404.15
应交税费	-	-	-	-	25,000.00	25,000.00
其他负债	-	-	-	-	180,667.25	180,667.25
负债总计	-	-	-	-	26,080,819.27	26,080,819.27
利率敏感度缺口	866,797,612.33	-	-	-	-3,246,313,960.23	4,113,111,572.56

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变化		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降27个基点	-	70,998.55
	市场利率上升27个基点	-	-70,998.55

注：于本年末，本基金均未持有对利率敏感的交易性债券资产。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	2,869,100,619.80	75.49	3,272,152,603.60	79.55
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	36,258,675.88	0.95	6,503,056.90	0.16
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,905,359,295.68	76.45	3,278,655,660.50	79.71

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化 其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	201,941,437.48	211,472,376.42
	2. 业绩比较基准下降 5%	-201,941,437.48	-211,472,376.42

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

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布在 95%的置信度下的置信度下，使用过去一年的历史数

据，按照 VaR 正态算法，计算未来一个交易日内，基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信度:95%		
	2. 观察期:一年		
分析	风险价值 (单位:人民币元)	本期末(2017年12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	44,516,326.01	47,449,534.31
	合计	44,516,326.01	47,449,534.31

#### 7.4.14 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) 以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 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: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2017 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次的余额为 2,778,628,976.90 元, 属于第二层次的余额为 125,667,771.59 元, 属于第三层次的余额为 1,062,547.19 元。(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 2,954,251,450.59 元, 第二层次 323,914,525.40 元, 第三层次 489,684.51 元)。

2017 年, 本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时, 本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2016 年 12 月 31 日: 无)。

##### (2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 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	2,869,100,619.80	75.12
	其中：股票	2,869,100,619.80	75.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,258,675.88	0.95
	其中：债券	36,258,675.88	0.95
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	649,200,643.80	17.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	261,854,887.59	6.86
8	其他各项资产	2,876,294.73	0.08
9	合计	3,819,291,121.80	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	4,294,875.27	0.11
B	采矿业	29,004,961.44	0.76
C	制造业	1,285,351,730.33	33.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,333,365.57	0.67
E	建筑业	105,964,629.15	2.79
F	批发和零售业	17,027,887.21	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	51,123,140.66	1.35
H	住宿和餐饮业	1,892,194.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,048,720.60	1.66
J	金融业	1,191,193,038.63	31.34
K	房地产业	43,091,728.08	1.13
L	租赁和商务服务业	11,450,746.13	0.30
M	科学研究和技术服务业	6,775,438.48	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,341,973.16	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,126,548.00	0.06
Q	卫生和社会工作	2,835,132.96	0.07
R	文化、体育和娱乐业	23,735,404.13	0.62
S	综合	3,509,106.00	0.09

合计	2,869,100,619.80	75.49
----	------------------	-------

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601336	新华保险	4,883,053	342,790,320.60	9.02
2	601628	中国人寿	9,159,799	278,915,879.55	7.34
3	601601	中国太保	4,953,380	205,168,999.60	5.40
4	601318	中国平安	2,534,581	177,369,978.38	4.67
5	000001	平安银行	9,772,853	129,978,944.90	3.42
6	000100	TCL 集团	21,949,306	85,602,293.40	2.25
7	002460	赣锋锂业	1,162,088	83,379,814.00	2.19
8	300296	利亚德	2,990,380	58,282,506.20	1.53
9	002273	水晶光电	2,107,854	49,724,275.86	1.31
10	600970	中材国际	4,453,129	44,041,445.81	1.16
11	000807	云铝股份	3,749,235	38,354,674.05	1.01
12	600196	复星医药	750,028	33,376,246.00	0.88
13	002236	大华股份	1,418,400	32,750,856.00	0.86
14	600703	三安光电	1,249,736	31,730,797.04	0.83
15	300097	智云股份	1,093,139	31,045,147.60	0.82
16	002497	雅化集团	2,234,800	29,789,884.00	0.78
17	600477	杭萧钢构	2,522,918	26,919,535.06	0.71
18	601011	宝泰隆	2,653,750	23,565,300.00	0.62
19	002258	利尔化学	1,430,258	23,170,179.60	0.61
20	603806	福斯特	647,638	22,084,455.80	0.58
21	603019	中科曙光	547,600	22,035,424.00	0.58
22	000951	中国重汽	1,260,926	21,977,940.18	0.58
23	000050	深天马 A	1,114,266	21,962,182.86	0.58
24	300115	长盈精密	958,000	19,227,060.00	0.51
25	002176	江特电机	1,665,927	18,858,293.64	0.50
26	300393	中来股份	528,178	18,433,412.20	0.49
27	600807	天业股份	1,643,300	16,449,433.00	0.43
28	601222	林洋能源	1,720,476	16,333,338.19	0.43
29	300003	乐普医疗	626,241	15,129,982.56	0.40
30	600392	盛和资源	782,900	14,875,100.00	0.39
31	000413	东旭光电	1,589,850	14,006,592.75	0.37
32	002517	恺英网络	591,400	13,134,994.00	0.35
33	300027	华谊兄弟	1,500,185	13,096,615.05	0.34

34	002371	北方华创	306,500	12,701,360.00	0.33
35	600201	生物股份	391,400	12,423,036.00	0.33
36	600183	生益科技	704,600	12,161,396.00	0.32
37	601988	中国银行	3,039,800	12,068,006.00	0.32
38	600575	皖江物流	2,881,676	11,140,528.58	0.29
39	002409	雅克科技	389,500	11,135,805.00	0.29
40	601939	建设银行	1,436,470	11,032,089.60	0.29
41	600690	青岛海尔	574,500	10,823,580.00	0.28
42	000910	大亚圣象	465,000	10,648,500.00	0.28
43	600110	诺德股份	1,124,000	10,610,560.00	0.28
44	000725	京东方A	1,803,000	10,439,370.00	0.27
45	600568	中珠医疗	1,331,000	10,341,870.00	0.27
46	600705	中航资本	1,865,800	10,299,216.00	0.27
47	002500	山西证券	1,060,800	9,780,576.00	0.26
48	002456	欧菲科技	474,800	9,776,132.00	0.26
49	300450	先导智能	168,545	9,602,008.65	0.25
50	600512	腾达建设	2,152,000	9,274,110.16	0.24
51	603885	吉祥航空	615,980	9,068,641.48	0.24
52	601117	中国化学	1,318,700	8,901,225.00	0.23
53	600604	市北高新	1,306,372	8,517,569.92	0.22
54	002365	永安药业	250,000	8,272,500.00	0.22
55	002635	安洁科技	314,810	8,213,392.90	0.22
56	600231	凌钢股份	1,590,200	8,110,020.00	0.21
57	000536	华映科技	1,624,536	7,645,340.84	0.20
58	600660	福耀玻璃	254,200	7,371,800.00	0.19
59	300050	世纪鼎利	924,600	7,276,602.00	0.19
60	600219	南山铝业	1,963,000	7,223,840.00	0.19
61	600584	长电科技	333,092	7,104,852.36	0.19
62	600674	川投能源	678,500	6,907,130.00	0.18
63	002194	武汉凡谷	653,100	6,739,992.00	0.18
64	001965	招商公路	475,189	6,581,367.65	0.17
65	002427	ST 尤夫	202,400	6,476,800.00	0.17
66	600130	波导股份	861,900	6,309,108.00	0.17
67	603559	中通国脉	161,200	6,223,932.00	0.16
68	000822	山东海化	664,300	6,011,915.00	0.16
69	000630	铜陵有色	2,002,700	5,847,884.00	0.15
70	002596	海南瑞泽	514,741	5,847,457.76	0.15
71	600691	阳煤化工	1,586,700	5,807,322.00	0.15
72	300074	华平股份	668,100	5,558,592.00	0.15

73	002128	露天煤业	499,600	5,535,568.00	0.15
74	601098	中南传媒	396,400	5,505,996.00	0.14
75	000538	云南白药	53,000	5,394,870.00	0.14
76	002853	皮阿诺	160,850	5,353,088.00	0.14
77	601881	中国银河	502,000	5,276,020.00	0.14
78	300145	中金环境	440,729	5,266,711.55	0.14
79	002570	贝因美	704,010	5,068,872.00	0.13
80	002432	九安医疗	572,025	4,971,353.08	0.13
81	600320	振华重工	770,730	4,701,453.00	0.12
82	000900	现代投资	743,014	4,643,837.50	0.12
83	600195	中牧股份	221,854	4,372,742.34	0.12
84	600525	长园集团	276,262	4,362,176.98	0.11
85	600028	中国石化	710,900	4,357,817.00	0.11
86	601699	潞安环能	372,295	4,236,717.10	0.11
87	002178	延华智能	302,632	4,203,558.48	0.11
88	002241	歌尔股份	241,400	4,188,290.00	0.11
89	600642	申能股份	712,300	4,174,078.00	0.11
90	000063	中兴通讯	112,635	4,095,408.60	0.11
91	601375	中原证券	654,300	4,037,031.00	0.11
92	300482	万孚生物	54,408	3,995,723.52	0.11
93	600507	方大特钢	311,700	3,955,473.00	0.10
94	002126	银轮股份	403,241	3,951,761.80	0.10
95	600600	青岛啤酒	99,883	3,928,398.39	0.10
96	600499	科达洁能	353,400	3,919,206.00	0.10
97	600100	同方股份	394,600	3,867,080.00	0.10
98	300116	坚瑞沃能	485,700	3,701,034.00	0.10
99	601899	紫金矿业	796,700	3,656,853.00	0.10
100	600133	东湖高新	393,000	3,650,970.00	0.10
101	000537	广宇发展	284,550	3,633,703.50	0.10
102	000797	中国武夷	327,262	3,593,336.76	0.09
103	600687	刚泰控股	297,558	3,514,159.98	0.09
104	002617	露笑科技	214,100	3,502,676.00	0.09
105	002650	加加食品	476,301	3,362,685.06	0.09
106	002540	亚太科技	433,300	3,293,080.00	0.09
107	300232	洲明科技	230,031	3,289,443.30	0.09
108	300209	天泽信息	178,300	3,259,324.00	0.09
109	600804	鹏博士	189,700	3,230,591.00	0.09
110	002555	三七互娱	155,900	3,202,186.00	0.08
111	000666	经纬纺机	163,200	3,169,344.00	0.08

112	600230	沧州大化	73,900	3,140,750.00	0.08
113	300585	奥联电子	164,100	3,091,644.00	0.08
114	300237	美晨生态	183,000	3,050,610.00	0.08
115	600728	佳都科技	366,500	3,023,625.00	0.08
116	002112	三变科技	171,800	2,991,038.00	0.08
117	600373	中文传媒	176,297	2,984,708.21	0.08
118	600759	洲际油气	697,000	2,969,220.00	0.08
119	002622	融钰集团	209,100	2,939,946.00	0.08
120	600848	上海临港	131,201	2,925,782.30	0.08
121	002397	梦洁股份	429,800	2,905,448.00	0.08
122	600516	方大炭素	100,600	2,905,328.00	0.08
123	300534	陇神戎发	286,350	2,866,363.50	0.08
124	600583	海油工程	461,900	2,840,685.00	0.07
125	000150	宜华健康	92,712	2,835,132.96	0.07
126	002254	泰和新材	243,360	2,832,710.40	0.07
127	000600	建投能源	343,590	2,649,078.90	0.07
128	002327	富安娜	252,800	2,641,760.00	0.07
129	600830	香溢融通	278,300	2,641,067.00	0.07
130	600596	新安股份	285,600	2,621,808.00	0.07
131	603203	快克股份	64,461	2,615,827.38	0.07
132	600545	卓郎智能	237,700	2,609,946.00	0.07
133	300323	华灿光电	160,000	2,608,000.00	0.07
134	002486	嘉麟杰	476,300	2,581,546.00	0.07
135	002821	凯莱英	42,818	2,562,657.30	0.07
136	002822	中装建设	326,300	2,561,455.00	0.07
137	603167	渤海轮渡	221,700	2,553,984.00	0.07
138	000599	青岛双星	396,900	2,504,439.00	0.07
139	002812	创新股份	24,000	2,469,600.00	0.06
140	002845	同兴达	86,800	2,465,988.00	0.06
141	000078	海王生物	413,700	2,440,830.00	0.06
142	002192	融捷股份	73,300	2,428,429.00	0.06
143	600338	西藏珠峰	58,300	2,428,195.00	0.06
144	603699	纽威股份	125,100	2,405,673.00	0.06
145	002545	东方铁塔	275,800	2,391,186.00	0.06
146	300349	金卡智能	60,200	2,383,920.00	0.06
147	300300	汉鼎宇佑	140,700	2,370,795.00	0.06
148	002083	孚日股份	348,417	2,327,425.56	0.06
149	002152	广电运通	304,900	2,268,456.00	0.06
150	600682	南京新百	60,000	2,267,400.00	0.06

151	000997	新大陆	124,100	2,225,113.00	0.06
152	600377	宁沪高速	225,300	2,219,205.00	0.06
153	000768	中航飞机	131,000	2,212,590.00	0.06
154	000935	四川双马	132,300	2,208,087.00	0.06
155	600753	东方银星	73,300	2,206,330.00	0.06
156	002003	伟星股份	191,230	2,189,583.50	0.06
157	000818	方大化工	167,800	2,178,044.00	0.06
158	601985	中国核电	294,300	2,163,105.00	0.06
159	600518	康美药业	95,915	2,144,659.40	0.06
160	603599	广信股份	105,800	2,067,332.00	0.05
161	603955	大千生态	47,200	2,039,984.00	0.05
162	300545	联得装备	31,100	2,030,830.00	0.05
163	600198	大唐电信	178,100	2,005,406.00	0.05
164	600076	康欣新材	270,600	1,997,028.00	0.05
165	600777	新潮能源	537,300	1,988,010.00	0.05
166	603133	碳元科技	60,900	1,978,641.00	0.05
167	002237	恒邦股份	185,700	1,972,134.00	0.05
168	600137	浪莎股份	77,200	1,971,688.00	0.05
169	603117	万林股份	212,983	1,957,367.13	0.05
170	002204	大连重工	454,000	1,956,740.00	0.05
171	600742	一汽富维	117,800	1,944,878.00	0.05
172	600739	辽宁成大	109,800	1,932,480.00	0.05
173	600202	哈空调	313,600	1,925,504.00	0.05
174	002043	兔宝宝	156,900	1,923,594.00	0.05
175	600179	安通控股	76,500	1,893,375.00	0.05
176	600754	锦江股份	58,600	1,892,194.00	0.05
177	600280	中央商场	240,300	1,891,161.00	0.05
178	300277	海联讯	228,200	1,875,804.00	0.05
179	002413	雷科防务	186,730	1,867,300.00	0.05
180	601633	长城汽车	162,193	1,863,597.57	0.05
181	603823	百合花	108,379	1,855,448.48	0.05
182	002141	贤丰控股	234,085	1,851,612.35	0.05
183	002210	飞马国际	147,850	1,830,383.00	0.05
184	600919	江苏银行	245,400	1,803,690.00	0.05
185	300269	联建光电	140,800	1,793,792.00	0.05
186	603377	东方时尚	44,600	1,783,108.00	0.05
187	300575	中旗股份	44,900	1,779,387.00	0.05
188	002268	卫士通	76,300	1,756,426.00	0.05
189	002848	高斯贝尔	112,300	1,739,527.00	0.05

190	600863	内蒙华电	580,592	1,724,358.24	0.05
191	002830	名雕股份	74,000	1,709,400.00	0.04
192	600643	爱建集团	153,400	1,699,672.00	0.04
193	600017	日照港	431,300	1,673,444.00	0.04
194	300342	天银机电	102,800	1,661,248.00	0.04
195	603058	永吉股份	135,200	1,641,328.00	0.04
196	002488	金固股份	137,000	1,638,520.00	0.04
197	300498	温氏股份	68,400	1,634,760.00	0.04
198	300285	国瓷材料	81,700	1,634,000.00	0.04
199	603011	合锻智能	148,500	1,632,015.00	0.04
200	600035	楚天高速	309,500	1,612,495.00	0.04
201	600595	中孚实业	301,356	1,612,254.60	0.04
202	002080	中材科技	60,400	1,591,540.00	0.04
203	300160	秀强股份	199,000	1,562,150.00	0.04
204	000036	华联控股	172,600	1,560,304.00	0.04
205	600791	京能置业	222,400	1,539,008.00	0.04
206	600210	紫江企业	322,565	1,535,409.40	0.04
207	002074	国轩高科	68,800	1,531,488.00	0.04
208	002602	世纪华通	44,800	1,522,304.00	0.04
209	002195	二三四五	258,000	1,506,720.00	0.04
210	000060	中金岭南	134,200	1,499,014.00	0.04
211	002723	金莱特	71,096	1,488,750.24	0.04
212	002799	环球印务	67,200	1,485,792.00	0.04
213	603729	龙韵股份	23,600	1,467,212.00	0.04
214	000429	粤高速 A	179,941	1,459,321.51	0.04
215	603578	三星新材	44,900	1,455,209.00	0.04
216	601333	广深铁路	260,600	1,451,542.00	0.04
217	002578	闽发铝业	310,500	1,443,825.00	0.04
218	300556	丝路视觉	66,878	1,443,227.24	0.04
219	603833	欧派家居	12,210	1,441,390.50	0.04
220	002842	翔鹭钨业	32,500	1,424,475.00	0.04
221	000031	中粮地产	177,100	1,416,800.00	0.04
222	002501	利源精制	136,500	1,415,505.00	0.04
223	603577	汇金通	103,528	1,409,016.08	0.04
224	603008	喜临门	76,200	1,408,938.00	0.04
225	000816	智慧农业	436,000	1,399,560.00	0.04
226	300602	飞荣达	26,800	1,396,280.00	0.04
227	600476	湘邮科技	86,000	1,393,200.00	0.04
228	002313	日海通讯	42,100	1,364,040.00	0.04

229	603878	武进不锈	80,400	1,363,584.00	0.04
230	002734	利民股份	54,090	1,357,118.10	0.04
231	600317	营口港	392,900	1,331,931.00	0.04
232	002309	中利集团	89,500	1,321,915.00	0.03
233	000760	斯太尔	224,300	1,309,912.00	0.03
234	603843	正平股份	89,200	1,308,564.00	0.03
235	600461	洪城水业	201,700	1,296,931.00	0.03
236	300569	天能重工	57,060	1,292,979.60	0.03
237	002711	欧浦智网	119,200	1,282,592.00	0.03
238	600529	山东药玻	57,300	1,269,768.00	0.03
239	300505	川金诺	39,700	1,247,771.00	0.03
240	600132	重庆啤酒	59,400	1,239,084.00	0.03
241	002203	海亮股份	156,500	1,220,700.00	0.03
242	600623	华谊集团	143,100	1,220,643.00	0.03
243	000669	金鸿控股	82,800	1,213,020.00	0.03
244	603165	荣晟环保	21,000	1,204,350.00	0.03
245	000518	四环生物	175,900	1,203,156.00	0.03
246	600197	伊力特	50,800	1,189,736.00	0.03
247	600022	山东钢铁	552,000	1,181,280.00	0.03
248	603517	绝味食品	29,900	1,178,658.00	0.03
249	300073	当升科技	44,384	1,166,855.36	0.03
250	002147	新光圆成	89,540	1,158,647.60	0.03
251	002547	春兴精工	144,500	1,151,665.00	0.03
252	002462	嘉事堂	43,700	1,137,948.00	0.03
253	000810	创维数字	163,300	1,134,935.00	0.03
254	300148	天舟文化	137,263	1,128,301.86	0.03
255	603126	中材节能	115,200	1,124,352.00	0.03
256	002787	华源控股	105,300	1,121,445.00	0.03
257	600400	红豆股份	155,750	1,119,842.50	0.03
258	002538	司尔特	126,200	1,118,132.00	0.03
259	600586	金晶科技	242,500	1,103,375.00	0.03
260	000970	中科三环	76,700	1,102,946.00	0.03
261	603300	华铁科技	135,100	1,098,363.00	0.03
262	000701	厦门信达	109,600	1,098,192.00	0.03
263	300507	苏奥传感	39,500	1,089,410.00	0.03
264	002014	永新股份	90,600	1,086,294.00	0.03
265	002418	康盛股份	121,400	1,084,102.00	0.03
266	002697	红旗连锁	169,600	1,082,048.00	0.03
267	300202	聚龙股份	59,785	1,073,140.75	0.03

268	002148	北纬科技	118,100	1,071,167.00	0.03
269	002197	证通电子	83,840	1,040,454.40	0.03
270	600308	华泰股份	164,560	1,033,436.80	0.03
271	300619	金银河	21,800	1,012,828.00	0.03
272	601882	海天精工	79,500	982,620.00	0.03
273	000955	欣龙控股	141,600	957,216.00	0.03
274	300406	九强生物	62,800	942,000.00	0.02
275	603818	曲美家居	63,500	924,560.00	0.02
276	000801	四川九洲	160,300	916,916.00	0.02
277	600143	金发科技	139,000	913,230.00	0.02
278	600116	三峡水利	102,300	910,470.00	0.02
279	002077	大港股份	60,200	898,786.00	0.02
280	002288	超华科技	157,500	894,600.00	0.02
281	300270	中威电子	67,500	887,625.00	0.02
282	000905	厦门港务	84,000	885,360.00	0.02
283	600319	亚星化学	87,200	884,208.00	0.02
284	000539	粤电力A	181,100	872,902.00	0.02
285	300462	华铭智能	35,900	861,959.00	0.02
286	300249	依米康	109,700	852,369.00	0.02
287	601118	海南橡胶	153,000	849,150.00	0.02
288	600033	福建高速	227,700	831,105.00	0.02
289	002827	高争民爆	45,200	827,160.00	0.02
290	600162	香江控股	243,300	819,921.00	0.02
291	002624	完美世界	24,400	816,424.00	0.02
292	300491	通合科技	45,080	803,325.60	0.02
293	600141	兴发集团	46,749	790,058.10	0.02
294	300011	鼎汉技术	75,700	784,252.00	0.02
295	300203	聚光科技	21,984	781,531.20	0.02
296	603929	亚翔集成	29,900	779,493.00	0.02
297	600506	香梨股份	56,891	777,699.97	0.02
298	600761	安徽合力	72,300	760,596.00	0.02
299	002215	诺普信	104,000	758,160.00	0.02
300	002567	唐人神	96,400	746,136.00	0.02
301	002389	南洋科技	35,300	745,889.00	0.02
302	600517	置信电气	114,600	741,462.00	0.02
303	600103	青山纸业	197,100	739,125.00	0.02
304	002155	湖南黄金	75,200	729,440.00	0.02
305	002437	誉衡药业	105,800	728,962.00	0.02
306	603899	晨光文具	29,400	725,004.00	0.02

307	000528	柳工	84,200	718,226.00	0.02
308	300502	新易盛	24,500	710,255.00	0.02
309	000049	德赛电池	17,800	704,702.00	0.02
310	000409	山东地矿	134,400	704,256.00	0.02
311	002138	顺络电子	41,800	693,044.00	0.02
312	601058	赛轮金宇	189,400	683,734.00	0.02
313	300284	苏交科	41,800	683,012.00	0.02
314	300360	炬华科技	61,400	682,768.00	0.02
315	603616	韩建河山	44,200	678,912.00	0.02
316	601010	文峰股份	167,600	678,780.00	0.02
317	600023	浙能电力	126,600	674,778.00	0.02
318	603778	乾景园林	96,900	673,455.00	0.02
319	600706	曲江文旅	35,114	672,081.96	0.02
320	600563	法拉电子	13,200	670,692.00	0.02
321	300083	劲胜智能	88,200	669,438.00	0.02
322	603131	上海沪工	31,500	669,060.00	0.02
323	000680	山推股份	131,235	667,986.15	0.02
324	603328	依顿电子	45,300	650,055.00	0.02
325	603966	法兰泰克	39,200	642,488.00	0.02
326	600694	大商股份	19,000	640,870.00	0.02
327	000610	西安旅游	54,400	637,568.00	0.02
328	002808	苏州恒久	53,100	636,669.00	0.02
329	601101	昊华能源	77,561	628,244.10	0.02
330	000852	石化机械	64,600	625,974.00	0.02
331	002212	南洋股份	31,200	624,624.00	0.02
332	002114	罗平锌电	35,200	623,040.00	0.02
333	603089	正裕工业	25,900	620,823.00	0.02
334	600967	内蒙一机	51,400	619,370.00	0.02
335	601700	风范股份	75,800	609,432.00	0.02
336	600998	九州通	32,100	608,295.00	0.02
337	000700	模塑科技	105,392	597,572.64	0.02
338	300451	创业软件	27,562	595,890.44	0.02
339	002826	易明医药	39,600	588,456.00	0.02
340	000571	新大洲A	107,700	581,580.00	0.02
341	300389	艾比森	50,000	581,500.00	0.02
342	002659	凯文教育	46,000	579,140.00	0.02
343	600151	航天机电	75,600	573,804.00	0.02
344	603036	如通股份	31,800	564,768.00	0.01
345	600470	六国化工	99,200	563,456.00	0.01

346	002859	洁美科技	16,665	563,277.00	0.01
347	300061	康旗股份	35,270	560,087.60	0.01
348	300288	朗玛信息	23,400	557,856.00	0.01
349	603198	迎驾贡酒	31,700	557,603.00	0.01
350	300631	久吾高科	23,360	551,529.60	0.01
351	002505	大康农业	193,400	549,256.00	0.01
352	000860	顺鑫农业	27,900	535,959.00	0.01
353	300216	千山药机	33,600	535,920.00	0.01
354	002145	中核钛白	89,333	535,104.67	0.01
355	600535	天士力	15,031	534,802.98	0.01
356	000707	双环科技	96,210	533,003.40	0.01
357	002099	海翔药业	91,715	530,112.70	0.01
358	300713	英可瑞	7,008	524,688.96	0.01
359	600318	新力金融	41,100	521,970.00	0.01
360	002346	柘中股份	26,900	502,761.00	0.01
361	600025	华能水电	94,713	501,978.90	0.01
362	002320	海峡股份	23,000	498,870.00	0.01
363	600269	赣粤高速	93,500	478,720.00	0.01
364	000695	滨海能源	40,700	477,411.00	0.01
365	600333	长春燃气	57,600	464,832.00	0.01
366	002703	浙江世宝	56,100	464,508.00	0.01
367	002330	得利斯	51,800	456,876.00	0.01
368	603323	吴江银行	54,600	449,358.00	0.01
369	603456	九洲药业	28,900	447,661.00	0.01
370	000028	国药一致	7,300	439,825.00	0.01
371	002445	中南文化	33,300	430,569.00	0.01
372	300567	精测电子	3,200	426,688.00	0.01
373	002743	富煌钢构	40,297	426,342.26	0.01
374	600136	当代明诚	30,400	425,296.00	0.01
375	300461	田中精机	7,200	415,296.00	0.01
376	601898	中煤能源	72,400	414,128.00	0.01
377	002350	北京科锐	40,900	412,681.00	0.01
378	603609	禾丰牧业	46,100	409,368.00	0.01
379	600177	雅戈尔	44,400	407,148.00	0.01
380	000815	美利云	26,900	406,190.00	0.01
381	600961	株冶集团	47,511	405,268.83	0.01
382	603069	海汽集团	31,500	402,885.00	0.01
383	300443	金雷风电	22,600	380,358.00	0.01
384	603979	金诚信	36,856	377,405.44	0.01

385	600078	澄星股份	71,100	375,408.00	0.01
386	600428	中远海特	66,800	374,748.00	0.01
387	300035	中科电气	49,800	373,002.00	0.01
388	603936	博敏电子	12,700	365,125.00	0.01
389	600300	维维股份	83,500	364,895.00	0.01
390	300620	光库科技	8,800	354,200.00	0.01
391	002892	科力尔	11,000	353,760.00	0.01
392	300548	博创科技	7,000	349,300.00	0.01
393	600661	新南洋	13,500	343,440.00	0.01
394	300125	易世达	12,700	339,725.00	0.01
395	002167	东方锆业	32,600	339,040.00	0.01
396	300459	金科文化	30,400	338,352.00	0.01
397	002154	报喜鸟	95,500	332,340.00	0.01
398	300573	兴齐眼药	13,400	332,320.00	0.01
399	600531	豫光金铅	50,800	329,184.00	0.01
400	600026	中远海能	53,600	328,032.00	0.01
401	000065	北方国际	18,000	327,600.00	0.01
402	300173	智慧松德	41,400	327,060.00	0.01
403	002002	鸿达兴业	47,800	326,952.00	0.01
404	300129	泰胜风能	40,500	326,025.00	0.01
405	300519	新光药业	16,400	323,900.00	0.01
406	002412	汉森制药	19,500	323,115.00	0.01
407	600336	澳柯玛	64,100	321,782.00	0.01
408	002039	黔源电力	20,700	321,471.00	0.01
409	000633	合金投资	31,900	319,957.00	0.01
410	002860	星帅尔	7,980	317,524.20	0.01
411	600479	千金药业	22,500	315,450.00	0.01
412	300568	星源材质	11,800	314,824.00	0.01
413	002403	爱仕达	25,200	311,724.00	0.01
414	603660	苏州科达	9,000	311,490.00	0.01
415	000975	银泰资源	23,100	308,616.00	0.01
416	600982	宁波热电	71,400	307,734.00	0.01
417	002557	洽洽食品	19,400	306,326.00	0.01
418	600262	北方股份	15,400	305,074.00	0.01
419	002172	澳洋科技	50,200	301,702.00	0.01
420	603039	泛微网络	4,700	299,343.00	0.01
421	000008	神州高铁	32,800	287,000.00	0.01
422	300081	恒信东方	28,200	286,794.00	0.01
423	002769	普路通	20,000	283,600.00	0.01

424	300467	迅游科技	6,000	281,700.00	0.01
425	300299	富春股份	31,163	272,364.62	0.01
426	603628	清源股份	19,000	268,660.00	0.01
427	300356	光一科技	38,300	267,717.00	0.01
428	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.01
429	603088	宁波精达	6,200	258,168.00	0.01
430	002685	华东重机	25,100	256,773.00	0.01
431	002234	民和股份	22,400	255,360.00	0.01
432	300579	数字认证	5,600	252,000.00	0.01
433	600810	神马股份	35,800	251,674.00	0.01
434	300449	汉邦高科	12,400	243,536.00	0.01
435	000881	中广核技	18,000	235,260.00	0.01
436	601107	四川成渝	56,900	234,428.00	0.01
437	000061	农产品	30,200	231,332.00	0.01
438	300087	荃银高科	20,977	228,649.30	0.01
439	600764	中国海防	8,200	228,042.00	0.01
440	000037	深南电 A	31,900	227,766.00	0.01
441	300394	天孚通信	10,000	223,500.00	0.01
442	002677	浙江美大	12,300	208,485.00	0.01
443	603038	华立股份	4,800	207,984.00	0.01
444	002771	真视通	11,000	206,800.00	0.01
445	300235	方直科技	17,400	203,580.00	0.01
446	300368	汇金股份	23,712	203,448.96	0.01
447	002671	龙泉股份	29,700	203,445.00	0.01
448	300427	红相电力	13,800	201,618.00	0.01
449	300391	康跃科技	15,300	200,889.00	0.01
450	603067	振华股份	14,600	197,538.00	0.01
451	000603	盛达矿业	16,400	197,128.00	0.01
452	603958	哈森股份	14,000	197,120.00	0.01
453	002563	森马服饰	25,000	196,500.00	0.01
454	000835	长城动漫	23,700	196,236.00	0.01
455	600557	康缘药业	14,000	188,720.00	0.00
456	600098	广州发展	26,400	186,648.00	0.00
457	300588	熙菱信息	6,400	186,240.00	0.00
458	601918	新集能源	47,900	185,852.00	0.00
459	600329	中新药业	12,400	184,388.00	0.00
460	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
461	600980	北矿科技	11,411	178,696.26	0.00
462	000929	兰州黄河	14,900	177,757.00	0.00

463	002498	汉缆股份	53,300	176,423.00	0.00
464	300595	欧普康视	3,480	176,262.00	0.00
465	600987	航民股份	15,600	175,968.00	0.00
466	600628	新世界	16,500	167,805.00	0.00
467	600601	方正科技	45,200	164,528.00	0.00
468	601019	山东出版	12,630	162,548.10	0.00
469	002705	新宝股份	13,200	162,228.00	0.00
470	002469	三维工程	24,100	159,060.00	0.00
471	300611	美力科技	10,600	155,184.00	0.00
472	300484	蓝海华腾	7,000	151,200.00	0.00
473	000576	广东甘化	8,800	149,776.00	0.00
474	000716	黑芝麻	26,600	148,960.00	0.00
475	300178	腾邦国际	11,100	147,630.00	0.00
476	601789	宁波建工	32,400	146,448.00	0.00
477	002776	柏堡龙	7,500	144,975.00	0.00
478	300440	运达科技	14,600	144,540.00	0.00
479	300587	天铁股份	6,000	139,200.00	0.00
480	603987	康德莱	11,400	138,852.00	0.00
481	300529	健帆生物	4,200	133,896.00	0.00
482	300617	安靠智电	2,600	131,820.00	0.00
483	000662	天夏智慧	8,800	130,856.00	0.00
484	002082	万邦德	9,100	127,127.00	0.00
485	603238	诺邦股份	5,400	126,306.00	0.00
486	603009	北特科技	11,900	123,403.00	0.00
487	600721	百花村	11,600	120,756.00	0.00
488	300546	雄帝科技	5,600	118,384.00	0.00
489	000985	大庆华科	5,663	117,903.66	0.00
490	603969	银龙股份	9,900	115,830.00	0.00
491	600180	瑞茂通	11,000	114,620.00	0.00
492	603737	三棵树	1,600	113,424.00	0.00
493	600190	锦州港	27,200	112,880.00	0.00
494	603659	璞泰来	2,012	111,303.84	0.00
495	603189	网达软件	6,800	110,568.00	0.00
496	300605	恒锋信息	4,000	108,480.00	0.00
497	600573	惠泉啤酒	11,900	108,052.00	0.00
498	002338	奥普光电	7,400	107,300.00	0.00
499	600261	阳光照明	19,400	107,088.00	0.00
500	300473	德尔股份	2,600	103,220.00	0.00
501	300470	日机密封	2,600	100,620.00	0.00

502	300561	汇金科技	3,000	98,760.00	0.00
503	600665	天地源	21,200	90,524.00	0.00
504	300259	新天科技	9,400	89,770.00	0.00
505	300385	雪浪环境	3,600	88,200.00	0.00
506	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.00
507	300708	聚灿光电	2,742	83,740.68	0.00
508	000637	茂化实华	14,000	83,580.00	0.00
509	600615	丰华股份	6,200	82,212.00	0.00
510	600510	黑牡丹	12,200	80,764.00	0.00
511	000606	神州易桥	9,000	80,280.00	0.00
512	300600	瑞特股份	1,800	78,660.00	0.00
513	601969	海南矿业	8,800	77,880.00	0.00
514	300576	容大感光	4,400	75,328.00	0.00
515	600933	爱柯迪	4,860	74,698.20	0.00
516	002803	吉宏股份	1,600	72,304.00	0.00
517	000570	苏常柴A	12,600	70,308.00	0.00
518	002913	奥士康	1,442	69,172.74	0.00
519	603266	天龙股份	2,600	66,716.00	0.00
520	600903	贵州燃气	3,928	66,226.08	0.00
521	000767	漳泽电力	22,200	65,268.00	0.00
522	300509	新美星	2,400	65,160.00	0.00
523	603619	中曼石油	1,760	61,212.80	0.00
524	000589	黔轮胎A	12,800	59,776.00	0.00
525	002911	佛燃股份	2,195	59,769.85	0.00
526	603661	恒林股份	830	56,855.00	0.00
527	300723	一品红	1,561	56,008.68	0.00
528	603605	珀莱雅	1,909	54,826.48	0.00
529	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
530	603738	泰晶科技	2,200	53,416.00	0.00
531	601619	嘉泽新能	6,616	52,266.40	0.00
532	002442	龙星化工	4,000	50,040.00	0.00
533	300719	安达维尔	1,898	49,765.56	0.00
534	603365	水星家纺	2,111	48,785.21	0.00
535	603890	春秋电子	1,126	47,438.38	0.00
536	601518	吉林高速	13,000	45,890.00	0.00
537	300726	宏达电子	1,548	44,737.20	0.00
538	603991	至正股份	1,500	42,240.00	0.00
539	603916	苏博特	2,450	42,042.00	0.00
540	603083	剑桥科技	877	41,473.33	0.00

541	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
542	603278	大业股份	1,624	37,498.16	0.00
543	002838	道恩股份	900	37,080.00	0.00
544	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
545	300711	广哈通信	1,347	36,220.83	0.00
546	002917	金奥博	1,090	35,643.00	0.00
547	600539	狮头股份	2,100	35,280.00	0.00
548	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.00
549	002910	庄园牧场	1,696	34,937.60	0.00
550	603970	中农立华	1,046	34,141.44	0.00
551	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
552	603685	晨丰科技	932	32,769.12	0.00
553	603809	豪能股份	900	32,436.00	0.00
554	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
555	603848	好太太	1,377	31,244.13	0.00
556	300731	科创新源	808	30,914.08	0.00
557	300729	乐歌股份	941	30,187.28	0.00
558	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.00
559	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
560	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.00
561	300721	怡达股份	745	28,496.25	0.00
562	300716	国立科技	948	24,572.16	0.00
563	002864	盘龙药业	781	22,375.65	0.00
564	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
565	300543	朗科智能	698	21,770.62	0.00
566	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
567	000586	汇源通信	1,100	19,723.00	0.00
568	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
569	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
570	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
571	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
572	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
573	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
574	002852	道道全	191	6,329.74	0.00
575	300521	爱司凯	160	2,704.00	0.00
576	002846	英联股份	100	1,909.00	0.00
577	002601	龙蟠佰利	97	1,553.94	0.00
578	600837	海通证券	100	1,287.00	0.00
579	600846	同济科技	124	1,194.12	0.00

580	600550	保变电气	170	1,060.80	0.00
581	300322	硕贝德	83	981.06	0.00
582	300364	中文在线	102	941.46	0.00
583	002311	海大集团	29	678.60	0.00
584	300230	永利股份	36	503.28	0.00
585	002503	搜于特	90	498.60	0.00
586	002425	凯撒文化	69	497.49	0.00
587	600172	黄河旋风	50	438.50	0.00
588	300251	光线传媒	41	428.45	0.00
589	002091	江苏国泰	41	367.77	0.00
590	600330	天通股份	33	364.65	0.00
591	002404	嘉欣丝绸	50	344.50	0.00
592	300036	超图软件	8	123.52	0.00
593	000876	新希望	12	89.40	0.00
594	002368	太极股份	2	50.74	0.00

#### 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	601628	中国人寿	269,054,390.41	6.54
2	601336	新华保险	263,366,786.75	6.40
3	601601	中国太保	235,369,734.01	5.72
4	000001	平安银行	157,521,170.26	3.83
5	300296	利亚德	99,836,143.48	2.43
6	002460	赣锋锂业	96,091,196.79	2.34
7	000100	TCL 集团	90,403,305.16	2.20
8	601318	中国平安	76,195,246.78	1.85
9	600703	三安光电	75,823,130.83	1.84
10	000807	云铝股份	70,827,907.03	1.72
11	601899	紫金矿业	63,496,951.00	1.54
12	300115	长盈精密	62,365,729.62	1.52
13	000069	华侨城 A	59,439,087.38	1.45
14	600028	中国石化	59,406,895.00	1.44
15	002517	恺英网络	57,725,482.84	1.40
16	000630	铜陵有色	57,025,787.00	1.39
17	002236	大华股份	54,690,147.74	1.33

18	600970	中材国际	53,823,444.96	1.31
19	002273	水晶光电	53,442,947.25	1.30
20	600525	长园集团	51,771,857.65	1.26

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	180,880,864.11	4.40
2	300003	乐普医疗	138,141,794.08	3.36
3	600477	杭萧钢构	125,720,095.11	3.06
4	300463	迈克生物	91,265,961.57	2.22
5	002241	歌尔股份	90,185,457.11	2.19
6	002217	合力泰	88,613,034.27	2.15
7	002353	杰瑞股份	85,801,167.39	2.09
8	300136	信维通信	82,374,560.88	2.00
9	002271	东方雨虹	76,328,349.92	1.86
10	002236	大华股份	75,025,289.34	1.82
11	300319	麦捷科技	71,826,633.77	1.75
12	601601	中国太保	68,984,391.12	1.68
13	300115	长盈精密	68,105,557.12	1.66
14	600703	三安光电	65,722,387.15	1.60
15	002507	涪陵榨菜	64,972,001.92	1.58
16	600779	水井坊	63,781,110.85	1.55
17	601899	紫金矿业	62,954,142.17	1.53
18	002410	广联达	62,016,216.19	1.51
19	002043	兔宝宝	60,358,578.13	1.47
20	002475	立讯精密	59,660,749.03	1.45

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	8,632,082,333.96
卖出股票收入（成交）总额	9,375,532,565.48

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）	36,258,675.88	0.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,258,675.88	0.95

### 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	75,830	7,490,487.40	0.20
2	128020	水晶转债	48,965	4,793,183.85	0.13
3	113014	林洋转债	29,250	3,456,765.00	0.09
4	113010	江南转债	17,670	1,834,499.40	0.05
5	113012	骆驼转债	18,520	1,765,326.40	0.05

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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，除赣锋锂业外，本报告期没有出现过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。

江西赣锋锂业股份有限公司在 2017 年 7 月 6 日、2017 年 8 月 30 日收到深圳证券交易所的监

管函。其主要原因是公司没有按照规定时间进行信息披露，2016 年度社会责任报告以及 2017 年半年报都延迟发布，属于违规行为。

截至本报告期末，赣锋锂业（002460）为本基金前十大重仓股。从投资角度，此事件发生不影响公司的业务经营和发展前景，也不影响公司的投资价值。本基金按照指数基准配置该股票，符合法规和公司制度。

### 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	824,135.52
2	应收证券清算款	948,839.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,005,379.43
5	应收申购款	97,940.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,876,294.73

### 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	7,490,487.40	0.20
2	113010	江南转债	1,834,499.40	0.05
3	113012	骆驼转债	1,765,326.40	0.05
4	123001	蓝标转债	1,738,260.00	0.05
5	128012	辉丰转债	1,640,672.00	0.04
6	110031	航信转债	1,591,360.00	0.04
7	127003	海印转债	1,568,930.00	0.04
8	127004	模塑转债	1,534,995.00	0.04
9	128015	久其转债	1,525,920.00	0.04
10	128013	洪涛转债	1,477,600.00	0.04
11	128014	永东转债	103,083.33	0.00

### 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
167,730	16,088.91	4,901,807.18	0.18%	2,693,691,704.79	99.82%

### 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	623,368.50	0.0231%

### 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	10~50
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（ 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, 133, 321, 126. 38
本报告期基金总申购份额	25, 664, 394. 74
减:本报告期基金总赎回份额	460, 392, 009. 15
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	2, 698, 593, 511. 97

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、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，本基金管理人于 2017 年 4 月 29 日于《证券时报》、《上海证券报》及《中国证券报》发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》的公告，自 2017 年 4 月 29 日起，旗下基金的会计师事务所由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 7 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：1 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	
招商证券		13,995,957,756.45	22.21%	3,721,448.05	22.21%	-
中投证券		23,216,572,730.86	17.88%	2,995,605.41	17.88%	-

中信证券	1	2,424,946,799.40	13.48%	2,258,359.24	13.48%	-
申万宏源	2	2,258,730,787.38	12.55%	2,103,567.89	12.55%	-
平安证券	1	1,864,757,693.27	10.36%	1,736,653.33	10.36%	-
广发证券	2	1,827,631,531.88	10.16%	1,702,072.33	10.16%	-
方正证券	1	1,212,899,559.53	6.74%	1,129,571.59	6.74%	-
国信证券	1	568,211,819.48	3.16%	529,177.13	3.16%	-
海通证券	1	435,221,031.30	2.42%	405,326.22	2.42%	-
长江证券	1	187,861,212.91	1.04%	174,955.82	1.04%	-
安信证券	2	107,106.30	0.00%	99.74	0.00%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 4 家证券公司的 4 个交易单元：广发证券股份有限公司（1 个交易单元）、安信证券股份有限公司（1 个交易单元）、平安证券股份有限公司（1 个交易单元）、国信证券股份有限公司（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
招商证券	3,432,624.95	15.12%	-	-	-	-
中投证券	-	-	180,000,000.00	4.61%	-	-
中信证券	6,653,954.60	29.30%	420,000,000.00	10.77%	-	-
申万宏源	8,877,515.77	39.09%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,745,662.20	16.49%	630,000,000.00	16.15%	-	-
方正证券	-	-	1,181,300,000.00	30.28%	-	-
国信证券	-	-	690,000,000.00	17.69%	-	-
海通证券	-	-	560,000,000.00	14.35%	-	-
长江证券	-	-	240,000,000.00	6.15%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017年1月3日
2	诺安先锋混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年1月19日
3	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 2 期-正文	基金管理人网站	2017年1月26日
4	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 2 期-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年1月26日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在懒猫金融开通定投业务及调整申购业务起点金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年2月10日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加首创证券基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年2月14日

7	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 2 月 23 日
8	诺安基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 6 日
9	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过部分代销机构办理申购、定投业务起点金额、最低赎回（保有）份额及费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 8 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在东北证券开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 13 日
11	诺安基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 29 日
12	诺安基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 29 日
13	诺安先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人网站	2017 年 3 月 30 日
14	诺安先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 30 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 31 日

16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 10 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 22 日
18	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 24 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 29 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通定投业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 5 月 12 日
21	诺安基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 8 日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票唐人神估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 8 日
23	诺安基金管理有限公司关于增加上海通华财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 8 日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行基金定投及电子银行渠道申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 12 日

25	诺安基金管理有限公司关于增加基煜基金为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 15 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 28 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 30 日
28	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017 年 7 月 1 日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 7 月 3 日
30	诺安基金管理有限公司关于增加中原银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 7 月 10 日
31	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 7 月 20 日
32	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华西证券申购及定投申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 7 月 21 日
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 1 日
34	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 1 期-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 3 日

35	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2017 年 8 月 3 日
36	诺安基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 15 日
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华安证券开通转换、定投业务并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 22 日
38	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
39	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年半年度报告-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 28 日
40	诺安基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 29 日
41	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销平台单笔定投申请最低金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 31 日
42	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中泰证券定投申购起点金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 9 月 6 日
43	诺安基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 10 月 18 日
44	诺安基金管理有限公司关于旗下部分	《证券时报》、	2017 年 10 月 19 日

	基金参加江苏银行基金定投及电子银行渠道申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	
45	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 10 月 25 日
46	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在南京银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 1 日
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 14 日
48	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 14 日
49	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 16 日
50	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在浦发银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 22 日
51	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国民生银行开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 11 月 28 日
52	诺安基金管理有限公司关于增加大河财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 5 日
53	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行开通转换业务的	《证券时报》、 《上海证券报》、	2017 年 12 月 5 日

	公告	《中国证券报》	
54	诺安基金管理有限公司关于通过网上直销现金宝账户申购（认购）及定投申购基金开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 7 日
55	诺安基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 13 日
56	诺安基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 22 日
57	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2018 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 28 日
58	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 29 日
59	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行开放式公募基金交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 29 日
60	诺安基金管理有限公司关于旗下产品缴纳增值税的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 30 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2017 年 12 月 30 日在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下产品缴纳增值税的公告》，自 2018 年 1 月 1 日起，旗下产品在运营过程中发生的增值税应税行为所产生的增值税及附加税费，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，同时由基金管理人按照规定完成相关的纳税申报。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安股票证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安先锋混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安先锋混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安股票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》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安先锋混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

2018 年 3 月 29 日