

# 诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 月 27 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 2019 年 3 月 26 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 2018 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 2018 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.....	15
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>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	84
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	88
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.....	88
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.....	88

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 .....	88
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 .....	88
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	89
8.12 投资组合报告附注 .....	89
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>91</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	91
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 .....	91
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>92</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>93</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	93
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 .....	93
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	93
11.4 基金投资策略的改变 .....	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	93
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 .....	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	93
11.8 其他重大事件 .....	96
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>104</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 .....	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	104
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>105</b>
13.1 备查文件目录 .....	105
13.2 存放地点 .....	105
13.3 查阅方式 .....	105

## § 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	2,475,430,594.22 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	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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。

注：自 2018 年 1 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“80%×富时中国 A600 指数+20%×富时中国国债全价指数”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

### 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	《上海证券报》
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-324,101,841.69	73,032,144.81	558,321,389.83
本期利润	-702,565,842.49	278,200,647.70	-541,139,967.58
加权平均基金份额本期利润	-0.2767	0.0944	-0.1644
本期加权平均净值利润率	-21.63%	7.05%	-12.82%
本期基金份额净值增长率	-19.80%	7.28%	-10.94%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	320,482,752.97	1,101,875,339.95	979,790,446.18
期末可供分配基金份额利润	0.1295	0.4083	0.3127
期末基金资产净值	2,795,913,347.19	3,800,468,851.92	4,113,111,572.56
期末基金份额净值	1.1295	1.4083	1.3127
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	326.23%	431.44%	395.37%

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。

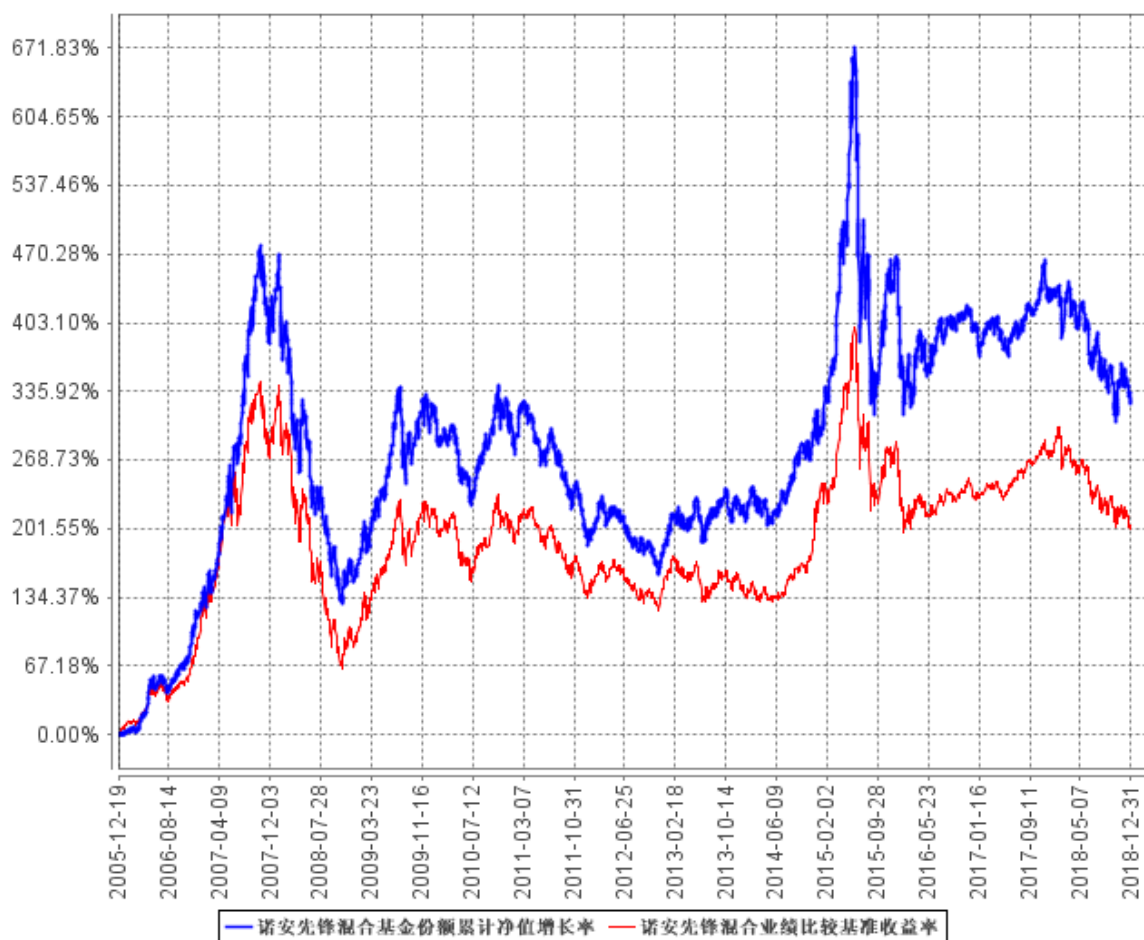
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-7.38%	1.57%	-9.45%	1.31%	2.07%	0.26%
过去六个月	-10.09%	1.43%	-10.62%	1.20%	0.53%	0.23%
过去一年	-19.80%	1.29%	-19.55%	1.07%	-0.25%	0.22%
过去三年	-23.37%	1.25%	-19.48%	0.96%	-3.89%	0.29%
过去五年	31.98%	1.56%	22.69%	1.23%	9.29%	0.33%
自基金合同生效起至今	326.23%	1.53%	202.52%	1.41%	123.71%	0.12%

注：本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

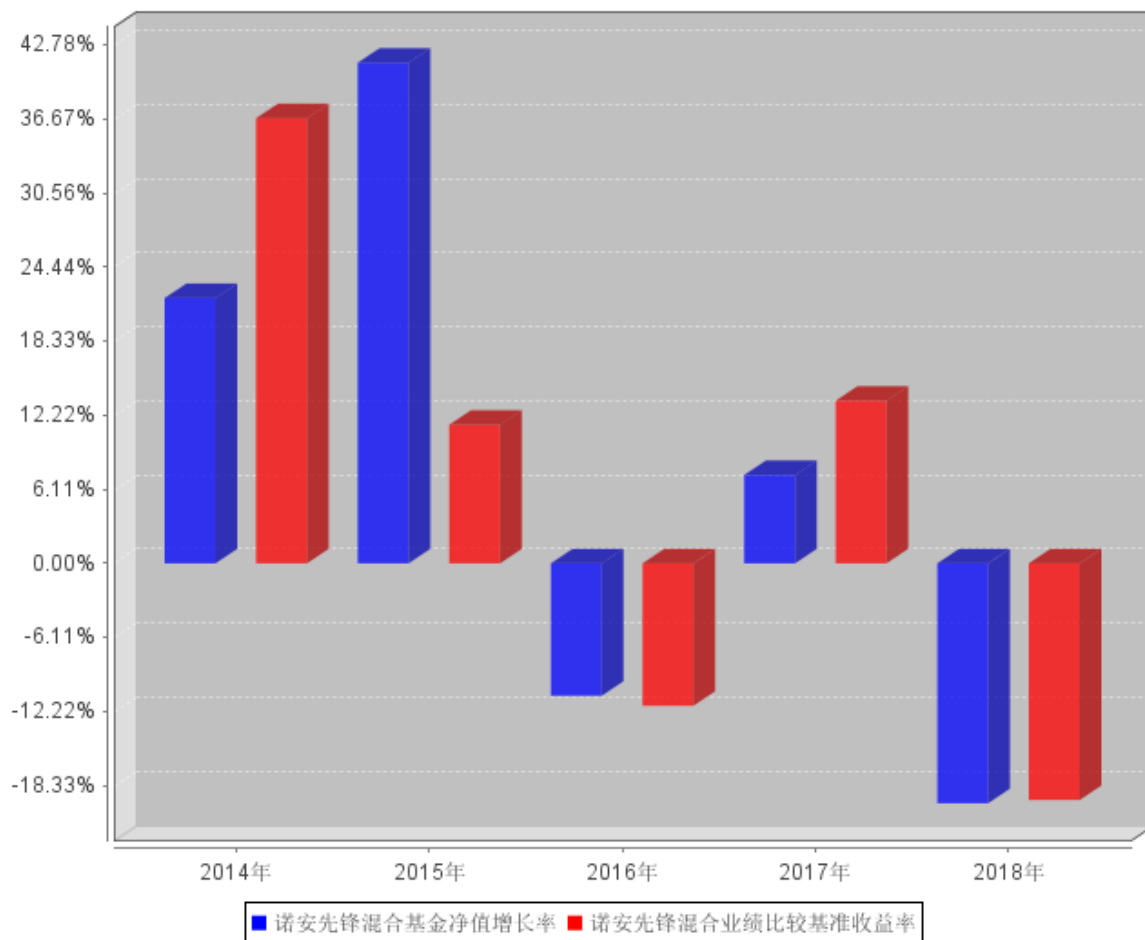
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 59 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、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、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、诺安策略精选股票型证券投资基金、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、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置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、诺安和鑫灵活配置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、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享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	本基金基金经理	2006年6月22日	-	21	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、权益投资事业部总经理、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

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 2 次，主要原因分别为采用量化策略的投资组合调仓导致、投资组合采用的投资策略导致。经检查未导致不公平交易和利益输送。

### 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

在 2017 年的年报里，我们对 2018 年的宏观、市场等趋势做了一个简要展望：“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”。

从实际的结果来看，仍有诸多超预期的因素导致 2018 年 A 股市场出现趋势性了超预期的下跌，其中包括：1、上半年金融去杠杆政策对于流动性的杀伤力超预期；2、房地产的挤出效应超预期，导致可选消费等行业需求出现萎缩，企业盈利预期不断下调；3、全球经济虽仍表现出较强的韧性，

但不断出现向下的拐点信号；4、中美贸易战。这些因素集中导致了 2018 年 A 股市场的盈利、估值出现双杀的局面。在此背景下，我们的组合采取了较为灵活的投资策略，在仓位和板块配置上没有局限于历史经验，取得了较好的业绩效果。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1295 元。本报告期基金份额净值增长率为-19.80%，同期业绩比较基准收益率为-19.55%。

#### 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 2019 年，宏观基本面有望先抑后扬，但“扬”的高度可能有限。对于“先抑后扬”的结论，理由主要在于：逆周期调节政策自 2018 年 7 月份开始不断加码，但宽货币向宽信用传导的过程相对以往有所拉长，考虑基数原因，宏观总需求增速和微观企业盈利在 2019 年上半年大概率会延续下滑的趋势，直至下半年企稳。至于为何“扬”的高度有限，理由主要在于：在债务杠杆处于高位的背景下，企业居民加杠杆的能力和动力不足，中央政府即使短期有加杠杆的意愿，面对目前的经济体量，更多的是“托底”权宜之计。

在上述判断之下，我们对于 2019 年的 A 股市场持谨慎乐观的态度，谨慎，是因为在基本面触底的过程中，企业盈利预期仍可能经历进一步的下调；乐观，是因为当前估值可能反应了大部分悲观预期，在持续宽松的货币环境下，权益资产的配置价值可能会凸显。

#### 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五十九只开放式基金——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、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、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、诺安策略精选股票型证券投资基金、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、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置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、诺安和鑫灵活配置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、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享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、权益投资事业部、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 2018 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 1901456 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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</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、在财务报表 7.4.2 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
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对其他信息负责。其他信息包括该基金 2018 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>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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> <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。</p>	
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	2019 年 3 月 26 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	338,428,917.73	251,286,344.58
结算备付金		28,188,056.98	10,568,543.01
存出保证金		1,122,327.68	824,135.52
交易性金融资产	7.4.7.2	2,456,609,015.79	2,905,359,295.68
其中：股票投资		2,190,004,018.19	2,869,100,619.80
基金投资		-	-
债券投资		266,604,997.60	36,258,675.88
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		12,903,806.15	948,839.01
应收利息	7.4.7.5	624,723.61	1,005,379.43
应收股利		-	-
应收申购款		77,442.27	97,940.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,837,954,290.21	3,819,291,121.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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		27,271,586.86	2,763,976.19
应付赎回款		849,262.70	4,019,163.87
应付管理人报酬		3,682,057.61	4,855,353.68
应付托管费		613,676.28	809,225.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,323,579.11	6,078,514.06
应交税费		30,628.78	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	270,151.68	271,036.46
负债合计		42,040,943.02	18,822,269.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,475,430,594.22	2,698,593,511.97
未分配利润	7.4.7.10	320,482,752.97	1,101,875,339.95
所有者权益合计		2,795,913,347.19	3,800,468,851.92
负债和所有者权益总计		2,837,954,290.21	3,819,291,121.80

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1295 元，基金份额总额 2,475,430,594.22 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-563,226,385.63	375,367,037.60
1. 利息收入		4,881,621.98	8,645,654.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,158,872.14	4,346,049.17
债券利息收入		1,331,685.58	57,634.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		391,064.26	4,241,970.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-189,669,449.27	161,489,920.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-217,668,816.82	127,321,554.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,151,139.72	-
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	31,150,507.27	34,168,366.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-378,464,000.80	205,168,502.89
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	25,442.46	62,960.02
<b>减：二、费用</b>		139,339,456.86	97,166,389.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	48,725,610.31	59,189,070.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,120,935.01	9,864,845.15
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	82,073,878.97	27,723,084.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4,709.05	-
7. 其他费用	7.4.7.20	414,323.52	389,388.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-702,565,842.49	278,200,647.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-702,565,842.49	278,200,647.70

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	2,698,593,511.97	1,101,875,339.95	3,800,468,851.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-702,565,842.49	-702,565,842.49
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）	-223,162,917.75	-78,826,744.49	-301,989,662.24
其中：1. 基金申购款	29,471,708.77	7,692,129.24	37,163,838.01
2. 基金赎回款	-252,634,626.52	-86,518,873.73	-339,153,500.25
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）	2,475,430,594.22	320,482,752.97	2,795,913,347.19
项目	上年度可比期间 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	3,133,321,126.38	979,790,446.18	4,113,111,572.56

金净值)			
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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

    
 奥成文  薛有为  薛有为  
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

诺安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。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《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。原诺安股票证券投资基金经中国证监会《关于同意诺安股票证券投资基金设立的批复》(证监许可[2005]154号)批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安股票证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2005年12月19日生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为379,177,416.36份基金份额,其中认购资金利息折合61,905.56份基金份额。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安先锋混合型证券投资基金基金合同》和《诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债。现金资产主要投资于各类银行存款。本基金组合投资比例是:股票资产60-95%;债券的比例

为 0-35%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

本基金的财务报表于 2019 年 3 月 26 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 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，在资金实际占用期间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，在资金实际占用期间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

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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〔2017〕56号《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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在2018年1月1日以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。

证券证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	338,428,917.73	251,286,344.58
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	338,428,917.73	251,286,344.58

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,303,066,396.78	2,190,004,018.19	-113,062,378.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	284,649,090.13	266,604,997.60
	银行间市场	-	-
	合计	284,649,090.13	266,604,997.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,587,715,486.91	2,456,609,015.79	-131,106,471.12
项目	上年度末 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	122,082.02
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

#### 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 2018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	-	-
项目	上年度末 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	-

##### 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	74,056.48	120,641.77
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	12,684.60	4,755.90
应收债券利息	537,477.53	98,422.02
应收资产支持证券利息	-	-
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	505.00	370.90

合计	624,723.61	1,005,379.43
----	------------	--------------

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
	2018年12月31日	2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,323,579.11	6,077,250.35
银行间市场应付交易费用	-	1,263.71
合计	9,323,579.11	6,078,514.06

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018年12月31日	2017年12月31日
应付赎回费	151.68	1,036.46
预提费用	270,000.00	270,000.00
合计	270,151.68	271,036.46

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,698,593,511.97	2,698,593,511.97
本期申购	29,471,708.77	29,471,708.77
本期赎回(以“-”号填列)	-252,634,626.52	-252,634,626.52
本期末	2,475,430,594.22	2,475,430,594.22

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	2,068,654,619.93	-966,779,279.98	1,101,875,339.95
本期利润	-324,101,841.69	-378,464,000.80	-702,565,842.49
本期基金份额交易产生的变动数	-177,172,077.01	98,345,332.52	-78,826,744.49
其中：基金申购款	22,142,019.93	-14,449,890.69	7,692,129.24
基金赎回款	-199,314,096.94	112,795,223.21	-86,518,873.73



本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,567,380,701.23	-1,246,897,948.26	320,482,752.97

#### 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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	2,714,229.92	4,211,710.14
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	424,235.87	119,984.15
其他	20,406.35	14,354.88
合计	3,158,872.14	4,346,049.17

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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	31,567,820,458.76	9,375,532,565.48
减：卖出股票成本总额	31,785,489,275.58	9,248,211,011.31
买卖股票差价收入	-217,668,816.82	127,321,554.17

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	92,552,516.05	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	95,432,626.20	-
减：应收利息总额	271,029.57	-
买卖债券差价收入	-3,151,139.72	-

**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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	31,150,507.27	34,168,366.31
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	31,150,507.27	34,168,366.31

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-378,464,000.80	205,168,502.89
——股票投资	-360,297,826.25	205,866,477.77
——债券投资	-18,166,174.55	-697,974.88
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-378,464,000.80	205,168,502.89

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	24,815.73	61,630.21
基金转换费收入	626.73	1,329.81
合计	25,442.46	62,960.02

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	82,073,878.97	27,723,084.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	82,073,878.97	27,723,084.94

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
汇划费	1,323.52	1,388.83
律师费用	25,000.00	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	414,323.52	389,388.83

**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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,725,610.31	59,189,070.98
其中：支付销售机构的客户维护费	8,510,882.34	10,362,653.93

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,120,935.01	9,864,845.15

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	338,428,917.73	2,714,229.92	251,286,344.58	4,211,710.14

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（2018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	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注	

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额		
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	新股流通受限	13.77	10.97	164,049	2,258,954.73	1,799,617.53	-
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

截至本报告期末 2018 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。

#### 7.4.12.2 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
600270	外运发展	2018年12月13日	重大事项	20.99	-	-	273,701	5,979,491.40	5,744,983.99	-
300455	康拓红外	2018年12月26日	重大事项	6.25	2019年1月2日	6.50	159,161	1,071,570.49	994,756.25	-
000708	大冶特钢	2018年12月25日	重大事项	8.77	2019年1月3日	9.65	17,263	160,494.93	151,396.51	-

#### 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 2018 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 2018 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。

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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本年末及上年末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本年末及上年末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	43,798,274.36	9,186,737.40
AAA 以下	222,806,723.24	27,071,938.48
未评级	-	-
合计	266,604,997.60	36,258,675.88

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本年末及上年末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本年末及上年末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**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 2018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	338,428,917.73	-	-	-	-	338,428,917.73
结算备付金	28,188,056.98	-	-	-	-	28,188,056.98
存出保证金	1,122,327.68	-	-	-	-	1,122,327.68
交易性金融资产	117,915,687.36	137,206,223.74	11,483,086.50	-	2,190,004,018.19	2,456,609,015.79
应收证券清算款	-	-	-	-	12,903,806.15	12,903,806.15
应收利息	-	-	-	-	624,723.61	624,723.61
应收申购款	298.21	-	-	-	77,144.06	77,442.27
资产总计	485,655,287.96	137,206,223.74	11,483,086.50	-	2,203,609,692.01	2,837,954,290.21
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	27,271,586.86	27,271,586.86
应付赎回款	-	-	-	-	849,262.70	849,262.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,682,057.61	3,682,057.61
应付托管费	-	-	-	-	613,676.28	613,676.28
应付交易费用	-	-	-	-	9,323,579.11	9,323,579.11
应交税费	-	-	-	-	30,628.78	30,628.78
其他负债	-	-	-	-	270,151.68	270,151.68
负债总计	-	-	-	-	42,040,943.02	42,040,943.02
利率敏感度缺口	485,655,287.96	137,206,223.74	11,483,086.50	-	2,161,568,748.99	2,795,913,347.19
上年度末 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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本年末及上年末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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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 2018年12月31日		上年度末 2017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	2,190,004,018.19	78.33	2,869,100,619.80	75.49
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	266,604,997.60	9.54	36,258,675.88	0.95
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	2,456,609,015.79	87.86	2,905,359,295.68	76.45

#### 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		
	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（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	138,579,445.05	201,941,437.48
	业绩比较基准下降5%	-138,579,445.05	-201,941,437.48

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×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，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里，基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信区间：95%		
	2. 观察期 一年		
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	基金投资组合的风险价值	59,850,842.84	44,516,326.01
	合计	59,850,842.84	44,516,326.01

#### 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2018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2,436,385,029.21元，属于第二层次的余额为20,173,840.78元，属于第三层次的余额为

50,145.80 元。(2017 年 12 月 31 日：第一层次 2,778,628,976.90 元，第二层次 125,667,771.59 元，第三层次 1,062,547.19 元)。

2018 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 2018 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(2017 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	2,190,004,018.19	77.17
	其中：股票	2,190,004,018.19	77.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	266,604,997.60	9.39
	其中：债券	266,604,997.60	9.39
	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	-	-
	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	366,616,974.71	12.92
8	其他各项资产	14,728,299.71	0.52
9	合计	2,837,954,290.21	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	44,335,234.66	1.59
B	采矿业	63,684,373.08	2.28
C	制造业	1,302,162,472.61	46.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	115,901,947.58	4.15
E	建筑业	58,356,274.69	2.09
F	批发和零售业	96,239,431.69	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	56,483,790.70	2.02
H	住宿和餐饮业	730,817.32	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	158,649,165.84	5.67
J	金融业	159,901,196.78	5.72
K	房地产业	31,402,671.52	1.12
L	租赁和商务服务业	17,760,145.06	0.64
M	科学研究和技术服务业	32,426,520.10	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	29,534,085.85	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	591,480.00	0.02

P	教育	412,716.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,912,531.19	0.07
R	文化、体育和娱乐业	11,689,801.15	0.42
S	综合	7,829,362.37	0.28
	合计	2,190,004,018.19	78.33

### 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	603799	华友钴业	1,864,627	56,143,918.97	2.01
2	600276	恒瑞医药	900,422	47,497,260.50	1.70
3	300003	乐普医疗	2,201,652	45,816,378.12	1.64
4	002456	欧菲科技	4,084,975	37,540,920.25	1.34
5	000963	华东医药	1,247,634	33,012,395.64	1.18
6	600900	长江电力	1,876,428	29,797,676.64	1.07
7	300498	温氏股份	1,069,230	27,992,441.40	1.00
8	600031	三一重工	3,342,331	27,875,040.54	1.00
9	600516	方大炭素	1,567,800	26,197,938.00	0.94
10	601766	中国中车	2,880,700	25,983,914.00	0.93
11	601166	兴业银行	1,576,501	23,552,924.94	0.84
12	002310	东方园林	2,818,600	19,617,456.00	0.70
13	300676	华大基因	301,245	18,074,700.00	0.65
14	601108	财通证券	2,361,500	17,050,030.00	0.61
15	600196	复星医药	730,900	17,008,043.00	0.61
16	601233	桐昆股份	1,740,760	16,989,817.60	0.61
17	600036	招商银行	656,200	16,536,240.00	0.59
18	002230	科大讯飞	665,559	16,399,373.76	0.59
19	601229	上海银行	1,435,290	16,060,895.10	0.57
20	002475	立讯精密	1,104,350	15,527,161.00	0.56
21	002110	三钢闽光	1,194,300	15,275,097.00	0.55
22	601668	中国建筑	2,529,780	14,419,746.00	0.52
23	601006	大秦铁路	1,744,900	14,360,527.00	0.51
24	600000	浦发银行	1,358,200	13,310,360.00	0.48
25	601818	光大银行	3,467,374	12,829,283.80	0.46
26	601328	交通银行	2,173,900	12,586,881.00	0.45
27	600886	国投电力	1,485,000	11,954,250.00	0.43
28	600406	国电南瑞	626,700	11,612,751.00	0.42
29	600782	新钢股份	2,267,100	11,539,539.00	0.41
30	000423	东阿阿胶	283,450	11,210,447.50	0.40

31	002262	恩华药业	1,173,600	10,585,872.00	0.38
32	603993	洛阳钼业	2,770,100	10,415,576.00	0.37
33	601607	上海医药	605,142	10,287,414.00	0.37
34	601318	中国平安	181,563	10,185,684.30	0.36
35	600795	国电电力	3,966,800	10,155,008.00	0.36
36	002013	中航机电	1,558,580	10,146,355.80	0.36
37	600583	海油工程	2,000,100	9,800,490.00	0.35
38	300433	蓝思科技	1,446,477	9,416,565.27	0.34
39	300296	利亚德	1,212,850	9,326,816.50	0.33
40	601988	中国银行	2,564,700	9,258,567.00	0.33
41	002025	航天电器	430,690	9,229,686.70	0.33
42	600547	山东黄金	301,300	9,114,325.00	0.33
43	600025	华能水电	2,869,800	9,039,870.00	0.32
44	300068	南都电源	630,400	8,964,288.00	0.32
45	600566	济川药业	266,399	8,932,358.47	0.32
46	300070	碧水源	1,141,651	8,904,877.80	0.32
47	300618	寒锐钴业	112,300	8,319,184.00	0.30
48	000830	鲁西化工	846,700	8,297,660.00	0.30
49	002422	科伦药业	401,101	8,282,735.65	0.30
50	002517	恺英网络	2,215,827	8,220,718.17	0.29
51	002153	石基信息	314,015	8,151,829.40	0.29
52	002294	信立泰	384,211	8,026,167.79	0.29
53	600519	贵州茅台	13,519	7,976,345.19	0.29
54	600816	安信信托	1,824,441	7,972,807.17	0.29
55	000852	石化机械	1,099,950	7,875,642.00	0.28
56	002668	奥马电器	1,613,300	7,856,771.00	0.28
57	601186	中国铁建	721,200	7,839,444.00	0.28
58	000825	太钢不锈	1,873,400	7,755,876.00	0.28
59	600674	川投能源	882,621	7,652,324.07	0.27
60	000735	罗牛山	787,200	7,604,352.00	0.27
61	000425	徐工机械	2,337,500	7,550,125.00	0.27
62	000513	丽珠集团	298,314	7,502,597.10	0.27
63	300429	强力新材	240,323	7,498,077.60	0.27
64	000717	韶钢松山	1,527,300	6,949,215.00	0.25
65	600271	航天信息	300,600	6,880,734.00	0.25
66	600256	广汇能源	1,817,479	6,833,721.04	0.24
67	600884	杉杉股份	520,187	6,720,816.04	0.24
68	600298	安琪酵母	259,405	6,544,788.15	0.23
69	002354	天神娱乐	1,217,220	6,378,232.80	0.23



70	002078	太阳纸业	1,099,504	6,267,172.80	0.22
71	002358	森源电气	348,100	6,196,180.00	0.22
72	600711	盛屯矿业	1,355,000	6,192,350.00	0.22
73	002030	达安基因	599,942	6,095,410.72	0.22
74	002414	高德红外	275,372	5,934,266.60	0.21
75	600377	宁沪高速	597,834	5,858,773.20	0.21
76	002383	合众思壮	492,917	5,831,208.11	0.21
77	600062	华润双鹤	477,161	5,768,876.49	0.21
78	002617	露笑科技	1,445,700	5,753,886.00	0.21
79	600270	外运发展	273,701	5,744,983.99	0.21
80	600986	科达股份	1,370,600	5,742,814.00	0.21
81	000989	九芝堂	578,655	5,676,605.55	0.20
82	300348	长亮科技	339,300	5,574,699.00	0.20
83	300159	新研股份	1,198,100	5,523,241.00	0.20
84	000543	皖能电力	1,152,500	5,520,475.00	0.20
85	600575	皖江物流	2,580,744	5,496,984.72	0.20
86	002589	瑞康医药	783,838	5,463,350.86	0.20
87	600273	嘉化能源	607,506	5,461,478.94	0.20
88	300098	高新兴	801,402	5,417,477.52	0.19
89	300287	飞利信	1,386,000	5,239,080.00	0.19
90	600967	内蒙一机	500,008	5,200,083.20	0.19
91	000938	紫光股份	163,600	5,114,136.00	0.18
92	300602	飞荣达	152,067	5,080,558.47	0.18
93	600132	重庆啤酒	162,000	4,978,260.00	0.18
94	002340	格林美	1,274,200	4,892,928.00	0.18
95	002353	杰瑞股份	323,399	4,850,985.00	0.17
96	601003	柳钢股份	735,500	4,832,235.00	0.17
97	002630	华西能源	1,692,180	4,822,713.00	0.17
98	600080	金花股份	665,800	4,767,128.00	0.17
99	600380	健康元	707,180	4,716,890.60	0.17
100	600022	山东钢铁	2,973,600	4,668,552.00	0.17
101	600737	中粮糖业	622,800	4,583,808.00	0.16
102	600760	中航沈飞	164,900	4,569,379.00	0.16
103	600490	鹏欣资源	998,800	4,544,540.00	0.16
104	000826	启迪桑德	434,605	4,515,545.95	0.16
105	002343	慈文传媒	500,260	4,512,345.20	0.16
106	600122	宏图高科	1,235,500	4,484,865.00	0.16
107	002131	利欧股份	3,044,700	4,475,709.00	0.16
108	603368	柳药股份	168,982	4,427,328.40	0.16

109	603726	朗迪集团	236,600	4,414,956.00	0.16
110	600323	瀚蓝环境	314,000	4,405,420.00	0.16
111	603386	广东骏亚	272,600	4,347,970.00	0.16
112	002428	云南锗业	869,300	4,346,500.00	0.16
113	603180	金牌厨柜	74,852	4,342,913.04	0.16
114	600810	神马股份	420,228	4,235,898.24	0.15
115	000725	京东方A	1,608,400	4,230,092.00	0.15
116	002716	金贵银业	686,600	4,208,858.00	0.15
117	002396	星网锐捷	242,700	4,179,294.00	0.15
118	300010	立思辰	556,900	4,043,094.00	0.14
119	600456	宝钛股份	267,700	4,039,593.00	0.14
120	300365	恒华科技	192,500	4,023,250.00	0.14
121	600073	上海梅林	536,500	3,996,925.00	0.14
122	002332	仙琚制药	642,684	3,939,652.92	0.14
123	300558	贝达药业	122,099	3,903,505.03	0.14
124	600567	山鹰纸业	1,233,700	3,849,144.00	0.14
125	002677	浙江美大	380,086	3,789,457.42	0.14
126	002038	双鹭药业	151,741	3,764,694.21	0.13
127	600023	浙能电力	795,400	3,762,242.00	0.13
128	002368	太极股份	160,533	3,724,365.60	0.13
129	002063	远光软件	675,026	3,658,640.92	0.13
130	002008	大族激光	120,000	3,643,200.00	0.13
131	000623	吉林敖东	251,770	3,633,041.10	0.13
132	002010	传化智联	558,500	3,630,250.00	0.13
133	300323	华灿光电	498,300	3,602,709.00	0.13
134	002019	亿帆医药	335,583	3,590,738.10	0.13
135	300699	光威复材	100,000	3,580,000.00	0.13
136	300706	阿石创	147,233	3,554,204.62	0.13
137	600267	海正药业	414,570	3,478,242.30	0.12
138	600426	华鲁恒升	288,082	3,477,149.74	0.12
139	600804	鹏博士	489,500	3,441,185.00	0.12
140	600797	浙大网新	477,200	3,440,612.00	0.12
141	000990	诚志股份	285,063	3,423,606.63	0.12
142	002477	雏鹰农牧	2,275,600	3,413,400.00	0.12
143	600177	雅戈尔	471,100	3,387,209.00	0.12
144	601901	方正证券	636,016	3,377,244.96	0.12
145	600660	福耀玻璃	147,200	3,353,216.00	0.12
146	000977	浪潮信息	210,333	3,348,501.36	0.12
147	300353	东土科技	382,800	3,341,844.00	0.12

148	600183	生益科技	324,600	3,265,476.00	0.12
149	000566	海南海药	637,200	3,262,464.00	0.12
150	002745	木林森	287,700	3,248,133.00	0.12
151	000999	华润三九	130,300	3,239,258.00	0.12
152	002908	德生科技	179,900	3,225,607.00	0.12
153	002095	生意宝	163,673	3,221,084.64	0.12
154	600569	安阳钢铁	1,054,600	3,195,438.00	0.11
155	300463	迈克生物	217,700	3,178,420.00	0.11
156	600867	通化东宝	227,887	3,167,629.30	0.11
157	002258	利尔化学	234,900	3,086,586.00	0.11
158	300630	普利制药	69,100	3,044,546.00	0.11
159	600422	昆药集团	481,721	2,977,035.78	0.11
160	600236	桂冠电力	521,700	2,931,954.00	0.10
161	601800	中国交建	260,100	2,928,726.00	0.10
162	600750	江中药业	172,585	2,921,864.05	0.10
163	002434	万里扬	441,000	2,906,190.00	0.10
164	300009	安科生物	215,832	2,883,515.52	0.10
165	000429	粤高速 A	339,872	2,851,526.08	0.10
166	300294	博雅生物	104,800	2,828,552.00	0.10
167	300394	天孚通信	116,400	2,813,388.00	0.10
168	603619	中曼石油	180,600	2,802,912.00	0.10
169	600161	天坛生物	131,870	2,802,237.50	0.10
170	600718	东软集团	240,452	2,777,220.60	0.10
171	300266	兴源环境	784,800	2,770,344.00	0.10
172	002503	搜于特	1,176,300	2,764,305.00	0.10
173	600827	百联股份	326,342	2,757,589.90	0.10
174	600503	华丽家族	899,200	2,742,560.00	0.10
175	603077	和邦生物	1,679,900	2,721,438.00	0.10
176	601788	光大证券	309,600	2,715,192.00	0.10
177	300607	拓斯达	87,100	2,678,325.00	0.10
178	600604	市北高新	345,600	2,664,576.00	0.10
179	300284	苏交科	251,600	2,609,092.00	0.09
180	002094	青岛金王	534,100	2,601,067.00	0.09
181	002179	中航光电	77,200	2,600,096.00	0.09
182	603399	吉翔股份	264,600	2,598,372.00	0.09
183	002727	一心堂	145,670	2,590,012.60	0.09
184	600548	深高速	286,560	2,573,308.80	0.09
185	000718	苏宁环球	808,400	2,570,712.00	0.09
186	002376	新北洋	167,200	2,564,848.00	0.09

187	002501	利源精制	899,600	2,545,868.00	0.09
188	603899	晨光文具	84,127	2,544,841.75	0.09
189	603986	兆易创新	40,822	2,544,027.04	0.09
190	000667	美好置业	1,016,700	2,541,750.00	0.09
191	300707	威唐工业	152,500	2,540,650.00	0.09
192	603357	设计总院	126,689	2,527,445.55	0.09
193	300373	扬杰科技	173,278	2,502,134.32	0.09
194	002642	荣之联	387,239	2,493,819.16	0.09
195	002430	杭氧股份	266,402	2,490,858.70	0.09
196	002247	聚力文化	528,500	2,462,810.00	0.09
197	300177	中海达	240,714	2,462,504.22	0.09
198	600011	华能国际	329,891	2,434,595.58	0.09
199	002254	泰和新材	223,400	2,421,656.00	0.09
200	300166	东方国信	233,500	2,419,060.00	0.09
201	002600	领益智造	965,632	2,414,080.00	0.09
202	002242	九阳股份	149,413	2,392,102.13	0.09
203	600143	金发科技	477,200	2,362,140.00	0.08
204	002127	南极电商	312,900	2,353,008.00	0.08
205	300202	聚龙股份	364,916	2,350,059.04	0.08
206	300700	岱勒新材	93,686	2,340,276.28	0.08
207	600572	康恩贝	392,700	2,328,711.00	0.08
208	300008	天海防务	897,653	2,324,921.27	0.08
209	300647	超频三	158,500	2,312,515.00	0.08
210	603938	三孚股份	121,966	2,307,596.72	0.08
211	002431	棕榈股份	645,800	2,305,506.00	0.08
212	002712	思美传媒	385,900	2,303,823.00	0.08
213	002308	威创股份	517,300	2,301,985.00	0.08
214	002562	兄弟科技	541,438	2,301,111.50	0.08
215	600118	中国卫星	132,622	2,297,013.04	0.08
216	603389	亚振家居	219,256	2,295,610.32	0.08
217	300653	正海生物	49,000	2,267,230.00	0.08
218	300327	中颖电子	123,936	2,259,353.28	0.08
219	600738	兰州民百	394,200	2,246,940.00	0.08
220	600266	北京城建	279,500	2,213,640.00	0.08
221	600624	复旦复华	362,100	2,190,705.00	0.08
222	300384	三联虹普	184,333	2,182,502.72	0.08
223	603718	海利生物	172,316	2,181,520.56	0.08
224	601016	节能风电	937,100	2,174,072.00	0.08
225	600061	国投资本	240,038	2,157,941.62	0.08

226	600017	日照港	777,100	2,144,796.00	0.08
227	600098	广州发展	377,500	2,136,650.00	0.08
228	002266	浙富控股	524,000	2,132,680.00	0.08
229	002034	旺能环境	194,700	2,130,018.00	0.08
230	300671	富满电子	123,800	2,121,932.00	0.08
231	002182	云海金属	338,602	2,112,876.48	0.08
232	603686	龙马环卫	193,700	2,103,582.00	0.08
233	600392	盛和资源	244,300	2,103,423.00	0.08
234	603658	安图生物	42,744	2,089,754.16	0.07
235	600739	辽宁成大	199,784	2,089,740.64	0.07
236	600695	绿庭投资	391,230	2,085,255.90	0.07
237	603260	合盛硅业	47,600	2,084,880.00	0.07
238	601857	中国石油	288,948	2,083,315.08	0.07
239	002345	潮宏基	462,400	2,066,928.00	0.07
240	603516	淳中科技	89,500	2,066,555.00	0.07
241	002665	首航节能	716,600	2,013,646.00	0.07
242	600197	伊力特	154,492	2,013,030.76	0.07
243	000539	粤电力A	432,900	2,004,327.00	0.07
244	300346	南大光电	224,180	1,986,234.80	0.07
245	600848	上海临港	96,000	1,985,280.00	0.07
246	600811	东方集团	541,400	1,981,524.00	0.07
247	600668	尖峰集团	167,400	1,975,320.00	0.07
248	000536	华映科技	1,054,900	1,972,663.00	0.07
249	002927	泰永长征	45,170	1,958,571.20	0.07
250	000078	海王生物	654,300	1,949,814.00	0.07
251	601088	中国神华	108,500	1,948,660.00	0.07
252	600781	辅仁药业	153,855	1,946,265.75	0.07
253	002511	中顺洁柔	228,300	1,945,116.00	0.07
254	600165	新日恒力	399,300	1,944,591.00	0.07
255	300487	蓝晓科技	78,602	1,935,967.26	0.07
256	601918	新集能源	642,100	1,932,721.00	0.07
257	002901	大博医疗	64,700	1,914,473.00	0.07
258	300180	华峰超纤	170,800	1,904,420.00	0.07
259	002903	宇环数控	109,109	1,885,403.52	0.07
260	300726	宏达电子	103,000	1,862,240.00	0.07
261	002049	紫光国微	64,100	1,852,490.00	0.07
262	002240	威华股份	253,600	1,848,744.00	0.07
263	300366	创意信息	252,200	1,846,104.00	0.07
264	600594	益佰制药	327,628	1,808,506.56	0.06

265	600211	西藏药业	61,240	1,807,192.40	0.06
266	600790	轻纺城	494,800	1,806,020.00	0.06
267	601138	工业富联	164,355	1,803,164.07	0.06
268	300449	汉邦高科	116,700	1,799,514.00	0.06
269	300409	道氏技术	137,200	1,798,692.00	0.06
270	300705	九典制药	153,100	1,795,863.00	0.06
271	600072	中船科技	257,400	1,794,078.00	0.06
272	300164	通源石油	287,300	1,787,006.00	0.06
273	000762	西藏矿业	264,300	1,781,382.00	0.06
274	600433	冠豪高新	493,300	1,780,813.00	0.06
275	603612	索通发展	152,309	1,772,876.76	0.06
276	603696	安记食品	182,200	1,763,696.00	0.06
277	600059	古越龙山	266,460	1,758,636.00	0.06
278	601717	郑煤机	316,060	1,747,811.80	0.06
279	002462	嘉事堂	120,593	1,742,568.85	0.06
280	002595	豪迈科技	108,900	1,742,400.00	0.06
281	603609	禾丰牧业	224,800	1,742,200.00	0.06
282	601179	中国西电	518,500	1,742,160.00	0.06
283	002460	赣锋锂业	78,594	1,735,355.52	0.06
284	603801	志邦家居	72,255	1,734,842.55	0.06
285	002011	盾安环境	409,000	1,730,070.00	0.06
286	002077	大港股份	452,900	1,725,549.00	0.06
287	300039	上海凯宝	424,826	1,724,793.56	0.06
288	300036	超图软件	93,908	1,721,333.64	0.06
289	000813	德展健康	187,021	1,716,852.78	0.06
290	300115	长盈精密	207,762	1,701,570.78	0.06
291	002493	荣盛石化	168,250	1,697,642.50	0.06
292	300616	尚品宅配	27,905	1,695,786.85	0.06
293	600292	远达环保	343,230	1,692,123.90	0.06
294	600694	大商股份	69,790	1,688,220.10	0.06
295	600960	渤海汽车	479,100	1,686,432.00	0.06
296	002004	华邦健康	364,500	1,680,345.00	0.06
297	000009	中国宝安	387,700	1,670,987.00	0.06
298	002555	三七互娱	176,392	1,665,140.48	0.06
299	600648	外高桥	121,166	1,664,820.84	0.06
300	601158	重庆水务	299,400	1,664,664.00	0.06
301	002910	庄园牧场	140,126	1,659,091.84	0.06
302	603167	渤海轮渡	189,119	1,656,682.44	0.06
303	002479	富春环保	381,300	1,651,029.00	0.06

304	002352	顺丰控股	50,367	1,649,519.25	0.06
305	300291	华录百纳	370,100	1,646,945.00	0.06
306	603039	泛微网络	22,700	1,641,210.00	0.06
307	600420	现代制药	179,087	1,636,855.18	0.06
308	300335	迪森股份	258,300	1,619,541.00	0.06
309	002047	宝鹰股份	236,200	1,617,970.00	0.06
310	002068	黑猫股份	270,700	1,597,130.00	0.06
311	603776	永安行	80,889	1,596,748.86	0.06
312	601098	中南传媒	127,600	1,595,000.00	0.06
313	002192	融捷股份	87,273	1,591,859.52	0.06
314	300554	三超新材	85,287	1,590,602.55	0.06
315	600796	钱江生化	305,235	1,578,064.95	0.06
316	002806	华锋股份	85,320	1,565,622.00	0.06
317	002245	澳洋顺昌	399,900	1,551,612.00	0.06
318	002099	海翔药业	341,700	1,544,484.00	0.06
319	600736	苏州高新	293,300	1,542,758.00	0.06
320	002766	索菱股份	281,000	1,534,260.00	0.05
321	601211	国泰君安	99,500	1,524,340.00	0.05
322	300047	天源迪科	137,200	1,524,292.00	0.05
323	002659	凯文教育	181,500	1,522,785.00	0.05
324	600479	千金药业	194,420	1,508,699.20	0.05
325	002610	爱康科技	958,400	1,504,688.00	0.05
326	000581	威孚高科	85,067	1,502,283.22	0.05
327	603477	振静股份	200,500	1,501,745.00	0.05
328	002394	联发股份	148,913	1,501,043.04	0.05
329	002360	同德化工	274,900	1,500,954.00	0.05
330	000528	柳工	246,900	1,498,683.00	0.05
331	600259	广晟有色	66,800	1,493,648.00	0.05
332	600612	老凤祥	33,100	1,489,500.00	0.05
333	000883	湖北能源	404,500	1,484,515.00	0.05
334	002298	中电兴发	250,500	1,477,950.00	0.05
335	300468	四方精创	122,542	1,476,631.10	0.05
336	300613	富瀚微	16,300	1,466,674.00	0.05
337	002557	洽洽食品	76,523	1,456,997.92	0.05
338	603338	浙江鼎力	25,800	1,453,056.00	0.05
339	603040	新坐标	54,619	1,450,134.45	0.05
340	002390	信邦制药	354,473	1,449,794.57	0.05
341	601669	中国电建	298,234	1,449,417.24	0.05
342	002173	创新医疗	199,200	1,446,192.00	0.05

343	002055	得润电子	149,200	1,442,764.00	0.05
344	002433	太安堂	306,400	1,437,016.00	0.05
345	603505	金石资源	116,400	1,431,720.00	0.05
346	603626	科森科技	187,611	1,431,471.93	0.05
347	603856	东宏股份	113,300	1,426,447.00	0.05
348	300713	英可瑞	65,608	1,413,852.40	0.05
349	002086	东方海洋	323,600	1,410,896.00	0.05
350	002679	福建金森	81,400	1,404,150.00	0.05
351	603056	德邦股份	84,500	1,398,475.00	0.05
352	300422	博世科	140,556	1,392,909.96	0.05
353	603157	拉夏贝尔	161,700	1,384,152.00	0.05
354	600235	民丰特纸	223,100	1,378,758.00	0.05
355	600131	岷江水电	225,900	1,377,990.00	0.05
356	603789	星光农机	111,690	1,376,020.80	0.05
357	603886	元祖股份	78,500	1,373,750.00	0.05
358	300668	杰恩设计	75,600	1,363,068.00	0.05
359	002675	东诚药业	170,100	1,338,687.00	0.05
360	300661	圣邦股份	19,400	1,330,840.00	0.05
361	000584	哈工智能	210,800	1,323,824.00	0.05
362	603108	润达医疗	183,825	1,321,701.75	0.05
363	600309	万华化学	47,131	1,319,196.69	0.05
364	002039	黔源电力	101,400	1,318,200.00	0.05
365	603823	百合花	85,900	1,314,270.00	0.05
366	603012	创力集团	163,400	1,312,102.00	0.05
367	300508	维宏股份	53,280	1,308,556.80	0.05
368	601177	杭齿前进	145,062	1,302,656.76	0.05
369	600128	弘业股份	164,300	1,301,256.00	0.05
370	600678	四川金顶	231,100	1,296,471.00	0.05
371	603978	深圳新星	68,300	1,287,455.00	0.05
372	600261	阳光照明	373,100	1,272,271.00	0.05
373	002737	葵花药业	85,900	1,269,602.00	0.05
374	000726	鲁泰A	130,250	1,264,727.50	0.05
375	002042	华孚时尚	232,400	1,261,932.00	0.05
376	600054	黄山旅游	134,127	1,258,111.26	0.04
377	300731	科创新源	47,900	1,257,375.00	0.04
378	603160	汇顶科技	15,854	1,247,709.80	0.04
379	002111	威海广泰	128,051	1,247,216.74	0.04
380	002410	广联达	59,718	1,242,731.58	0.04
381	600172	黄河旋风	407,120	1,241,716.00	0.04



382	603729	龙韵股份	80,025	1,235,586.00	0.04
383	600351	亚宝药业	218,600	1,230,718.00	0.04
384	600231	凌钢股份	460,600	1,229,802.00	0.04
385	300645	正元智慧	39,200	1,221,864.00	0.04
386	300236	上海新阳	49,244	1,221,743.64	0.04
387	600667	太极实业	238,600	1,219,246.00	0.04
388	300659	中孚信息	60,922	1,205,646.38	0.04
389	603881	数据港	48,690	1,204,590.60	0.04
390	000685	中山公用	172,071	1,204,497.00	0.04
391	600111	北方稀土	137,300	1,204,121.00	0.04
392	002079	苏州固锔	257,600	1,202,992.00	0.04
393	000910	大亚圣象	116,100	1,196,991.00	0.04
394	002907	华森制药	63,300	1,192,572.00	0.04
395	000831	五矿稀土	141,900	1,187,703.00	0.04
396	603557	起步股份	159,300	1,186,785.00	0.04
397	002472	双环传动	207,800	1,186,538.00	0.04
398	300462	华铭智能	77,539	1,186,346.70	0.04
399	002902	铭普光磁	50,100	1,185,366.00	0.04
400	600110	诺德股份	291,000	1,181,460.00	0.04
401	002867	周大生	42,601	1,177,065.63	0.04
402	300485	赛升药业	118,800	1,165,428.00	0.04
403	600033	福建高速	390,900	1,160,973.00	0.04
404	300309	吉艾科技	143,300	1,154,998.00	0.04
405	300738	奥飞数据	28,432	1,152,917.60	0.04
406	002036	联创电子	133,607	1,149,020.20	0.04
407	002696	百洋股份	127,700	1,144,192.00	0.04
408	002529	海源复材	168,100	1,141,399.00	0.04
409	002567	唐人神	201,300	1,141,371.00	0.04
410	000818	航锦科技	123,417	1,139,138.91	0.04
411	000638	万方发展	203,600	1,129,980.00	0.04
412	000586	汇源通信	97,500	1,128,075.00	0.04
413	600094	大名城	308,000	1,124,200.00	0.04
414	603937	丽岛新材	100,377	1,121,211.09	0.04
415	300074	华平股份	292,200	1,119,126.00	0.04
416	002161	远望谷	206,335	1,118,335.70	0.04
417	000553	沙隆达A	122,200	1,115,686.00	0.04
418	000683	远兴能源	467,800	1,108,686.00	0.04
419	002251	步步高	149,110	1,106,396.20	0.04
420	002463	沪电股份	154,200	1,105,614.00	0.04

421	603365	水星家纺	73,988	1,104,640.84	0.04
422	002573	清新环境	152,863	1,103,670.86	0.04
423	300363	博腾股份	124,495	1,103,025.70	0.04
424	000839	中信国安	326,900	1,101,653.00	0.04
425	300093	金刚玻璃	180,300	1,101,633.00	0.04
426	603008	喜临门	118,900	1,096,258.00	0.04
427	002151	北斗星通	51,900	1,095,090.00	0.04
428	600596	新安股份	102,160	1,092,090.40	0.04
429	603598	引力传媒	122,200	1,091,246.00	0.04
430	300237	美晨生态	300,300	1,090,089.00	0.04
431	002090	金智科技	64,685	1,088,648.55	0.04
432	300297	蓝盾股份	217,613	1,088,065.00	0.04
433	600888	新疆众和	258,513	1,080,584.34	0.04
434	000968	蓝焰控股	101,300	1,078,845.00	0.04
435	002426	胜利精密	463,600	1,075,552.00	0.04
436	002386	天原集团	200,200	1,071,070.00	0.04
437	603329	上海雅仕	66,850	1,061,578.00	0.04
438	002753	永东股份	117,188	1,057,035.76	0.04
439	002317	众生药业	126,556	1,056,742.60	0.04
440	002739	万达电影	47,800	1,043,474.00	0.04
441	300534	陇神戎发	182,100	1,041,612.00	0.04
442	300681	英搏尔	30,100	1,041,159.00	0.04
443	600222	太龙药业	306,019	1,040,464.60	0.04
444	300298	三诺生物	97,620	1,034,772.00	0.04
445	002270	华明装备	223,303	1,033,892.89	0.04
446	000779	三毛派神	118,799	1,029,987.33	0.04
447	600018	上港集团	198,100	1,026,158.00	0.04
448	600507	方大特钢	102,400	1,022,976.00	0.04
449	000902	新洋丰	114,129	1,022,595.84	0.04
450	601566	九牧王	77,103	1,021,614.75	0.04
451	002027	分众传媒	194,400	1,018,656.00	0.04
452	002287	奇正藏药	40,700	1,018,314.00	0.04
453	600805	悦达投资	220,231	1,013,062.60	0.04
454	300703	创源文化	68,950	1,010,807.00	0.04
455	300065	海兰信	98,800	1,009,736.00	0.04
456	300612	宣亚国际	67,675	1,009,711.00	0.04
457	002928	华夏航空	53,900	1,008,469.00	0.04
458	600809	山西汾酒	28,753	1,007,792.65	0.04
459	002236	大华股份	87,800	1,006,188.00	0.04

460	002133	广宇集团	289,300	998,085.00	0.04
461	300680	隆盛科技	58,600	997,372.00	0.04
462	300572	安车检测	23,000	997,050.00	0.04
463	600252	中恒集团	387,700	996,389.00	0.04
464	300455	康拓红外	159,161	994,756.25	0.04
465	603303	得邦照明	83,780	992,793.00	0.04
466	601200	上海环境	74,800	992,596.00	0.04
467	002022	科华生物	105,308	987,789.04	0.04
468	600083	博信股份	54,800	986,400.00	0.04
469	603026	石大胜华	50,900	982,370.00	0.04
470	600329	中新药业	78,900	981,516.00	0.04
471	600770	综艺股份	208,000	979,680.00	0.04
472	603896	寿仙谷	36,970	978,595.90	0.04
473	600557	康缘药业	95,100	977,628.00	0.03
474	002912	中新赛克	12,000	972,720.00	0.03
475	002685	华东重机	196,400	966,288.00	0.03
476	300193	佳士科技	134,500	965,710.00	0.03
477	300739	明阳电路	45,750	965,325.00	0.03
478	002626	金达威	80,300	965,206.00	0.03
479	300692	中环环保	72,945	959,226.75	0.03
480	002154	报喜鸟	315,900	957,177.00	0.03
481	600969	郴电国际	161,260	956,271.80	0.03
482	300519	新光药业	68,900	952,887.00	0.03
483	601991	大唐发电	302,400	952,560.00	0.03
484	300254	仟源医药	146,600	949,968.00	0.03
485	600200	江苏吴中	159,900	946,608.00	0.03
486	000517	荣安地产	408,300	943,173.00	0.03
487	002926	华西证券	112,644	942,830.28	0.03
488	601116	三江购物	87,502	942,396.54	0.03
489	002697	红旗连锁	183,300	940,329.00	0.03
490	002438	江苏神通	163,700	938,001.00	0.03
491	600308	华泰股份	215,500	937,425.00	0.03
492	603599	广信股份	89,100	935,550.00	0.03
493	601107	四川成渝	268,000	932,640.00	0.03
494	300270	中威电子	146,100	932,118.00	0.03
495	300730	科创信息	52,200	931,770.00	0.03
496	603839	安正时尚	86,880	929,616.00	0.03
497	002043	兔宝宝	182,700	926,289.00	0.03
498	002444	巨星科技	97,386	923,219.28	0.03

499	300708	聚灿光电	85,400	918,050.00	0.03
500	601799	星宇股份	19,300	916,750.00	0.03
501	603319	湘油泵	45,200	914,848.00	0.03
502	601678	滨化股份	216,500	913,630.00	0.03
503	002327	富安娜	120,800	907,208.00	0.03
504	600819	耀皮玻璃	221,300	905,117.00	0.03
505	300562	乐心医疗	91,440	900,684.00	0.03
506	300342	天银机电	125,398	887,817.84	0.03
507	000049	德赛电池	30,930	887,072.40	0.03
508	603269	海鸥股份	61,400	879,248.00	0.03
509	603676	卫信康	77,700	875,679.00	0.03
510	002275	桂林三金	68,300	874,240.00	0.03
511	000166	申万宏源	213,850	870,369.50	0.03
512	603890	春秋电子	73,600	869,216.00	0.03
513	600497	驰宏锌锗	211,600	867,560.00	0.03
514	600611	大众交通	216,300	863,037.00	0.03
515	002736	国信证券	102,500	857,925.00	0.03
516	002065	东华软件	122,658	852,473.10	0.03
517	601366	利群股份	130,500	845,640.00	0.03
518	600312	平高电气	104,200	841,936.00	0.03
519	002334	英威腾	196,200	839,736.00	0.03
520	601002	晋亿实业	156,800	838,880.00	0.03
521	600201	生物股份	50,400	836,640.00	0.03
522	600742	一汽富维	83,800	836,324.00	0.03
523	600586	金晶科技	295,300	835,699.00	0.03
524	601958	金钼股份	141,066	835,110.72	0.03
525	600597	光明乳业	99,500	831,820.00	0.03
526	002489	浙江永强	314,762	830,971.68	0.03
527	002654	万润科技	209,800	828,710.00	0.03
528	002598	山东章鼓	122,200	828,516.00	0.03
529	000860	顺鑫农业	25,940	827,226.60	0.03
530	002609	捷顺科技	148,871	824,745.34	0.03
531	603607	京华激光	45,220	823,456.20	0.03
532	000702	正虹科技	147,638	820,867.28	0.03
533	000533	万家乐	323,500	818,455.00	0.03
534	600703	三安光电	72,306	817,780.86	0.03
535	600855	航天长峰	89,700	809,991.00	0.03
536	600616	金枫酒业	170,102	809,685.52	0.03
537	002318	久立特材	127,700	809,618.00	0.03

538	600208	新湖中宝	278,700	808,230.00	0.03
539	600593	大连圣亚	30,300	802,647.00	0.03
540	000758	中色股份	219,700	801,905.00	0.03
541	601086	国芳集团	158,000	801,060.00	0.03
542	300709	精研科技	30,100	794,339.00	0.03
543	300493	润欣科技	86,850	792,072.00	0.03
544	600863	内蒙华电	342,000	790,020.00	0.03
545	002267	陕天然气	106,300	785,557.00	0.03
546	300514	友讯达	63,200	784,944.00	0.03
547	300408	三环集团	46,300	783,396.00	0.03
548	002850	科达利	42,364	781,615.80	0.03
549	600360	华微电子	151,700	779,738.00	0.03
550	002225	濮耐股份	176,300	779,246.00	0.03
551	000050	深天马 A	79,298	777,913.38	0.03
552	603813	原尚股份	41,900	775,150.00	0.03
553	600416	湘电股份	150,100	774,516.00	0.03
554	002082	万邦德	104,800	773,424.00	0.03
555	002033	丽江旅游	135,200	766,584.00	0.03
556	603661	恒林股份	25,800	765,228.00	0.03
557	601169	北京银行	135,000	757,350.00	0.03
558	002435	长江润发	142,900	755,941.00	0.03
559	600114	东睦股份	120,380	754,782.60	0.03
560	300686	智动力	68,180	752,025.40	0.03
561	002497	雅化集团	113,200	751,648.00	0.03
562	300290	荣科科技	127,297	751,052.30	0.03
563	000776	广发证券	59,178	750,377.04	0.03
564	600728	佳都科技	108,700	748,943.00	0.03
565	600981	汇鸿集团	199,200	745,008.00	0.03
566	000996	中国中期	89,000	744,040.00	0.03
567	603367	辰欣药业	48,900	742,302.00	0.03
568	300437	清水源	63,500	741,680.00	0.03
569	000100	TCL 集团	302,300	740,635.00	0.03
570	000739	普洛药业	99,500	740,280.00	0.03
571	300001	特锐德	42,179	739,397.87	0.03
572	000703	恒逸石化	64,100	738,432.00	0.03
573	300750	宁德时代	9,999	737,926.20	0.03
574	002551	尚荣医疗	159,600	734,160.00	0.03
575	603816	顾家家居	16,303	733,635.00	0.03
576	000881	中广核技	108,800	731,136.00	0.03

577	300506	名家汇	50,700	730,080.00	0.03
578	002707	众信旅游	115,500	729,960.00	0.03
579	002930	宏川智慧	28,200	728,970.00	0.03
580	300285	国瓷材料	43,600	726,812.00	0.03
581	600979	广安爱众	181,500	726,000.00	0.03
582	300639	凯普生物	49,100	721,279.00	0.03
583	603712	七一二	40,387	719,292.47	0.03
584	002847	盐津铺子	33,400	718,100.00	0.03
585	002688	金河生物	160,600	716,276.00	0.03
586	002339	积成电子	117,022	716,174.64	0.03
587	300480	光力科技	78,274	715,424.36	0.03
588	300168	万达信息	59,500	713,405.00	0.03
589	300321	同大股份	56,300	712,195.00	0.03
590	300584	海辰药业	29,502	712,178.28	0.03
591	600675	中华企业	127,400	710,892.00	0.03
592	002845	同兴达	41,100	710,619.00	0.03
593	000036	华联控股	128,033	705,461.83	0.03
594	600897	厦门空港	33,130	705,337.70	0.03
595	600079	人福医药	69,200	701,688.00	0.03
596	300760	迈瑞医疗	6,407	699,772.54	0.03
597	600116	三峡水利	95,500	699,060.00	0.03
598	002177	御银股份	217,500	691,650.00	0.02
599	600330	天通股份	124,720	687,207.20	0.02
600	603738	泰晶科技	53,830	680,949.50	0.02
601	600192	长城电工	159,200	673,416.00	0.02
602	603199	九华旅游	35,395	672,505.00	0.02
603	600528	中铁工业	63,900	670,950.00	0.02
604	300678	中科信息	35,620	670,368.40	0.02
605	300545	联得装备	32,400	670,356.00	0.02
606	002220	天宝食品	260,834	665,126.70	0.02
607	603579	荣泰健康	23,432	664,531.52	0.02
608	002499	科林环保	89,300	660,820.00	0.02
609	002137	麦达数字	97,465	660,812.70	0.02
610	603900	莱绅通灵	55,069	655,871.79	0.02
611	603825	华扬联众	47,200	654,664.00	0.02
612	600410	华胜天成	111,600	653,976.00	0.02
613	002864	盘龙药业	20,465	653,038.15	0.02
614	603016	新宏泰	38,800	647,960.00	0.02
615	300717	华信新材	45,140	647,307.60	0.02

616	002872	天圣制药	75,450	645,852.00	0.02
617	600207	安彩高科	148,700	645,358.00	0.02
618	600429	三元股份	116,650	640,408.50	0.02
619	603878	武进不锈	56,400	639,012.00	0.02
620	600581	八一钢铁	179,400	638,664.00	0.02
621	002922	伊戈尔	36,800	638,112.00	0.02
622	600195	中牧股份	59,843	636,729.52	0.02
623	300592	华凯创意	70,500	636,615.00	0.02
624	300642	透景生命	16,750	634,155.00	0.02
625	600415	小商品城	181,000	631,690.00	0.02
626	601966	玲珑轮胎	45,972	627,517.80	0.02
627	000657	中钨高新	117,320	624,142.40	0.02
628	603079	圣达生物	38,640	623,649.60	0.02
629	000957	中通客车	139,900	622,555.00	0.02
630	000419	通程控股	151,965	620,017.20	0.02
631	002096	南岭民爆	118,300	619,892.00	0.02
632	601881	中国银河	90,600	617,892.00	0.02
633	002459	天业通联	73,800	617,706.00	0.02
634	002900	哈三联	51,100	617,288.00	0.02
635	002819	东方中科	29,500	616,550.00	0.02
636	300370	安控科技	233,100	615,384.00	0.02
637	600901	江苏租赁	103,835	613,664.85	0.02
638	603223	恒通股份	59,100	613,458.00	0.02
639	600285	羚锐制药	81,400	612,128.00	0.02
640	000863	三湘印象	155,642	608,560.22	0.02
641	603139	康惠制药	39,100	603,313.00	0.02
642	300031	宝通科技	45,600	601,464.00	0.02
643	002138	顺络电子	43,400	600,656.00	0.02
644	601996	丰林集团	211,800	599,394.00	0.02
645	600232	金鹰股份	119,400	597,000.00	0.02
646	300322	硕贝德	62,404	595,334.16	0.02
647	002521	齐峰新材	106,800	594,876.00	0.02
648	300154	瑞凌股份	123,742	593,961.60	0.02
649	300736	百邦科技	26,500	591,480.00	0.02
650	600663	陆家嘴	45,500	591,045.00	0.02
651	603037	凯众股份	32,843	587,889.70	0.02
652	300364	中文在线	121,400	587,576.00	0.02
653	002664	长鹰信质	47,800	586,984.00	0.02
654	000993	闽东电力	127,900	584,503.00	0.02

655	603229	奥翔药业	51,049	584,000.56	0.02
656	600513	联环药业	97,508	580,172.60	0.02
657	300352	北信源	176,200	579,698.00	0.02
658	000785	武汉中商	88,500	577,905.00	0.02
659	002028	思源电气	58,400	576,408.00	0.02
660	000016	深康佳A	177,400	574,776.00	0.02
661	600226	瀚叶股份	204,800	573,440.00	0.02
662	600582	天地科技	167,000	571,140.00	0.02
663	300111	向日葵	283,700	570,237.00	0.02
664	603106	恒银金融	55,200	568,560.00	0.02
665	002231	奥维通信	83,100	566,742.00	0.02
666	600686	金龙汽车	82,700	566,495.00	0.02
667	002773	康弘药业	16,600	565,562.00	0.02
668	002706	良信电器	91,522	564,690.74	0.02
669	002048	宁波华翔	54,100	564,263.00	0.02
670	000338	潍柴动力	72,620	559,174.00	0.02
671	600378	天科股份	62,780	557,486.40	0.02
672	600475	华光股份	67,500	553,500.00	0.02
673	300471	厚普股份	101,000	549,440.00	0.02
674	603608	天创时尚	49,600	548,576.00	0.02
675	002293	罗莱生活	63,181	546,515.65	0.02
676	603299	井神股份	106,400	545,832.00	0.02
677	002607	亚夏汽车	75,800	545,760.00	0.02
678	002169	智光电气	152,400	545,592.00	0.02
679	000713	丰乐种业	119,030	545,157.40	0.02
680	300053	欧比特	66,700	544,272.00	0.02
681	600856	中天能源	144,800	538,656.00	0.02
682	603737	三棵树	14,800	538,128.00	0.02
683	002088	鲁阳节能	63,400	536,998.00	0.02
684	603668	天马科技	73,487	533,515.62	0.02
685	600081	东风科技	73,696	532,822.08	0.02
686	300246	宝莱特	48,400	531,916.00	0.02
687	601212	白银有色	179,900	530,705.00	0.02
688	300412	迦南科技	81,200	529,424.00	0.02
689	601007	金陵饭店	65,600	529,392.00	0.02
690	300442	普丽盛	41,300	523,271.00	0.02
691	002009	天奇股份	69,040	521,942.40	0.02
692	600019	宝钢股份	80,100	520,650.00	0.02
693	603111	康尼机电	131,248	519,742.08	0.02



694	600929	湖南盐业	63,100	519,313.00	0.02
695	000597	东北制药	51,100	519,176.00	0.02
696	002056	横店东磁	93,727	518,310.31	0.02
697	002873	新天药业	31,783	516,155.92	0.02
698	000788	北大医药	98,800	515,736.00	0.02
699	002880	卫光生物	12,800	514,432.00	0.02
700	600735	新华锦	99,632	514,101.12	0.02
701	000837	秦川机床	130,700	513,651.00	0.02
702	600366	宁波韵升	102,400	513,024.00	0.02
703	002265	西仪股份	56,600	510,532.00	0.02
704	300400	劲拓股份	34,082	507,821.80	0.02
705	300516	久之洋	18,400	506,368.00	0.02
706	002561	徐家汇	65,619	505,266.30	0.02
707	603011	合锻智能	115,600	502,860.00	0.02
708	603963	大理药业	42,760	502,857.60	0.02
709	600307	酒钢宏兴	262,700	501,757.00	0.02
710	002923	润都股份	21,120	496,742.40	0.02
711	002817	黄山胶囊	28,800	495,360.00	0.02
712	002758	华通医药	69,000	494,730.00	0.02
713	600395	盘江股份	98,628	494,126.28	0.02
714	002843	泰嘉股份	40,700	490,435.00	0.02
715	600071	凤凰光学	65,427	489,393.96	0.02
716	002061	浙江交科	47,630	489,160.10	0.02
717	300712	永福股份	33,400	488,308.00	0.02
718	002895	川恒股份	40,756	487,441.76	0.02
719	300664	鹏鹞环保	40,600	487,200.00	0.02
720	600576	祥源文化	115,200	483,840.00	0.02
721	603939	益丰药房	11,572	482,552.40	0.02
722	601163	三角轮胎	42,800	476,792.00	0.02
723	000869	张裕A	18,200	473,200.00	0.02
724	000552	靖远煤电	184,600	472,576.00	0.02
725	002223	鱼跃医疗	24,050	471,620.50	0.02
726	300214	日科化学	85,700	471,350.00	0.02
727	600353	旭光股份	117,700	469,623.00	0.02
728	603690	至纯科技	30,800	467,544.00	0.02
729	300279	和晶科技	95,200	466,480.00	0.02
730	601199	江南水务	130,800	465,648.00	0.02
731	600113	浙江东日	64,700	461,311.00	0.02
732	000516	国际医学	93,000	460,350.00	0.02

733	600168	武汉控股	79,500	457,125.00	0.02
734	603316	诚邦股份	58,928	456,102.72	0.02
735	000430	张家界	94,016	455,037.44	0.02
736	002280	联络互动	116,200	449,694.00	0.02
737	600133	东湖高新	70,800	446,040.00	0.02
738	002292	奥飞娱乐	78,800	446,008.00	0.02
739	603043	广州酒家	16,300	441,404.00	0.02
740	000997	新大陆	30,100	440,664.00	0.02
741	600780	通宝能源	136,300	440,249.00	0.02
742	000523	广州浪奇	110,699	437,261.05	0.02
743	002780	三夫户外	34,607	437,086.41	0.02
744	300043	星辉娱乐	130,700	433,924.00	0.02
745	000969	安泰科技	95,200	433,160.00	0.02
746	002319	乐通股份	28,300	432,707.00	0.02
747	300672	国科微	11,800	428,458.00	0.02
748	603387	基蛋生物	15,980	424,588.60	0.02
749	000609	中迪投资	80,800	424,200.00	0.02
750	603085	天成自控	54,940	424,136.80	0.02
751	603990	麦迪科技	12,900	423,894.00	0.02
752	603868	飞科电器	11,100	423,798.00	0.02
753	600348	阳泉煤业	83,900	422,856.00	0.02
754	603001	奥康国际	41,800	422,598.00	0.02
755	000698	沈阳化工	116,000	422,240.00	0.02
756	600463	空港股份	58,800	421,008.00	0.02
757	000738	航发控制	34,899	420,881.94	0.02
758	000756	新华制药	75,800	420,690.00	0.02
759	600063	皖维高新	180,500	420,565.00	0.02
760	002404	嘉欣丝绸	78,500	419,975.00	0.02
761	600664	哈药股份	106,000	418,700.00	0.01
762	002925	盈趣科技	9,510	417,298.80	0.01
763	002366	台海核电	44,200	414,596.00	0.01
764	603757	大元泵业	22,020	414,196.20	0.01
765	600661	昂立教育	21,100	412,716.00	0.01
766	002045	国光电器	89,400	411,240.00	0.01
767	603811	诚意药业	25,300	410,619.00	0.01
768	000608	阳光股份	83,700	410,130.00	0.01
769	603208	江山欧派	15,400	409,794.00	0.01
770	600510	黑牡丹	67,604	409,680.24	0.01
771	603758	秦安股份	67,600	408,980.00	0.01

772	603100	川仪股份	54,200	407,584.00	0.01
773	600191	华资实业	103,300	407,002.00	0.01
774	300258	精锻科技	33,276	406,965.48	0.01
775	002641	永高股份	124,800	406,848.00	0.01
776	603507	振江股份	18,500	405,890.00	0.01
777	002593	日上集团	133,300	405,232.00	0.01
778	300406	九强生物	41,200	404,996.00	0.01
779	002228	合兴包装	94,200	403,176.00	0.01
780	603980	吉华集团	34,200	402,534.00	0.01
781	002731	萃华珠宝	23,200	401,360.00	0.01
782	000301	东方盛虹	73,100	399,126.00	0.01
783	601020	华钰矿业	47,000	397,620.00	0.01
784	002653	海思科	33,300	395,937.00	0.01
785	002363	隆基机械	83,180	395,936.80	0.01
786	002828	贝肯能源	33,750	394,875.00	0.01
787	300624	万兴科技	7,300	394,638.00	0.01
788	603076	乐惠国际	16,100	393,967.00	0.01
789	603060	国检集团	20,200	393,900.00	0.01
790	000402	金融街	60,993	392,794.92	0.01
791	603683	晶华新材	28,400	392,772.00	0.01
792	603895	天永智能	15,100	392,600.00	0.01
793	000030	富奥股份	105,800	392,518.00	0.01
794	000886	海南高速	104,100	390,375.00	0.01
795	002500	山西证券	65,800	389,536.00	0.01
796	002249	大洋电机	118,025	389,482.50	0.01
797	000812	陕西金叶	112,312	388,599.52	0.01
798	300716	国立科技	34,500	388,125.00	0.01
799	002833	弘亚数控	11,400	387,600.00	0.01
800	002566	益盛药业	67,500	387,450.00	0.01
801	600488	天药股份	103,700	386,801.00	0.01
802	000682	东方电子	116,143	384,433.33	0.01
803	002565	顺灏股份	101,922	384,245.94	0.01
804	601882	海天精工	54,500	383,680.00	0.01
805	000153	丰原药业	74,500	383,675.00	0.01
806	002550	千红制药	100,912	383,465.60	0.01
807	000420	吉林化纤	201,600	383,040.00	0.01
808	600995	文山电力	57,701	381,403.61	0.01
809	000705	浙江震元	62,500	378,750.00	0.01
810	300611	美力科技	43,600	371,472.00	0.01

811	603615	茶花股份	43,000	366,790.00	0.01
812	300239	东宝生物	98,300	363,710.00	0.01
813	002031	巨轮智能	189,600	356,448.00	0.01
814	000096	广聚能源	38,500	356,125.00	0.01
815	600620	天宸股份	65,900	355,860.00	0.01
816	002649	博彦科技	48,500	355,505.00	0.01
817	600343	航天动力	46,700	354,920.00	0.01
818	600976	健民集团	24,800	354,144.00	0.01
819	002309	中利集团	42,400	353,616.00	0.01
820	600283	钱江水利	31,510	352,912.00	0.01
821	300722	新余国科	11,400	351,576.00	0.01
822	002909	集泰股份	32,300	350,778.00	0.01
823	000596	古井贡酒	6,500	350,740.00	0.01
824	603306	华懋科技	24,566	350,065.50	0.01
825	002577	雷柏科技	35,700	347,718.00	0.01
826	000089	深圳机场	44,600	347,434.00	0.01
827	600337	美克家居	86,000	339,700.00	0.01
828	000965	天保基建	87,600	337,260.00	0.01
829	002178	延华智能	91,700	336,539.00	0.01
830	600707	彩虹股份	81,300	335,769.00	0.01
831	603577	汇金通	36,850	333,861.00	0.01
832	002723	金莱特	36,900	332,838.00	0.01
833	603725	天安新材	29,800	332,568.00	0.01
834	002487	大金重工	99,200	331,328.00	0.01
835	002891	中宠股份	9,951	329,278.59	0.01
836	002389	南洋科技	26,900	328,449.00	0.01
837	300434	金石东方	36,200	318,560.00	0.01
838	603116	红蜻蜓	45,640	318,110.80	0.01
839	300466	赛摩电气	61,500	314,880.00	0.01
840	603822	嘉澳环保	13,500	314,415.00	0.01
841	600371	万向德农	50,210	313,812.50	0.01
842	300557	理工光科	14,100	313,725.00	0.01
843	000951	中国重汽	28,100	313,034.00	0.01
844	002244	滨江集团	78,200	311,236.00	0.01
845	300472	新元科技	22,700	308,947.00	0.01
846	002171	楚江新材	66,500	307,895.00	0.01
847	600609	金杯汽车	98,900	306,590.00	0.01
848	600075	新疆天业	67,480	305,009.60	0.01
849	600890	中房股份	36,800	304,336.00	0.01

850	002165	红宝丽	88,100	303,945.00	0.01
851	600499	科达洁能	74,900	302,596.00	0.01
852	600099	林海股份	53,366	302,585.22	0.01
853	600468	百利电气	56,250	300,937.50	0.01
854	000582	北部湾港	42,690	300,537.60	0.01
855	601677	明泰铝业	33,900	297,981.00	0.01
856	300559	佳发教育	8,600	296,270.00	0.01
857	002274	华昌化工	57,475	291,398.25	0.01
858	601515	东风股份	41,040	291,384.00	0.01
859	002693	双成药业	74,892	291,329.88	0.01
860	000690	宝新能源	42,850	288,380.50	0.01
861	300329	海伦钢琴	40,436	285,882.52	0.01
862	300424	航新科技	20,500	285,770.00	0.01
863	002239	奥特佳	142,200	284,400.00	0.01
864	300665	飞鹿股份	29,520	283,096.80	0.01
865	600350	山东高速	62,000	282,720.00	0.01
866	002197	证通电子	40,300	282,100.00	0.01
867	002316	亚联发展	39,900	278,901.00	0.01
868	002196	方正电机	54,980	278,748.60	0.01
869	603819	神力股份	17,200	277,780.00	0.01
870	600917	重庆燃气	39,000	277,680.00	0.01
871	600138	中青旅	21,500	277,135.00	0.01
872	300227	光韵达	29,200	277,108.00	0.01
873	002341	新纶科技	23,300	276,804.00	0.01
874	600613	神奇制药	56,200	275,942.00	0.01
875	002344	海宁皮城	60,400	274,820.00	0.01
876	600070	浙江富润	42,000	273,840.00	0.01
877	300282	三盛教育	22,800	273,600.00	0.01
878	600051	宁波联合	50,564	272,539.96	0.01
879	603021	山东华鹏	47,200	271,872.00	0.01
880	603136	天目湖	9,200	269,836.00	0.01
881	002920	德赛西威	15,500	268,925.00	0.01
882	300583	赛托生物	8,100	268,515.00	0.01
883	300658	延江股份	23,700	268,047.00	0.01
884	603456	九洲药业	41,900	266,484.00	0.01
885	000625	长安汽车	40,222	265,062.98	0.01
886	002541	鸿路钢构	37,514	263,348.28	0.01
887	002123	梦网集团	36,900	263,097.00	0.01
888	002752	昇兴股份	36,090	261,652.50	0.01

889	002325	洪涛股份	89,900	261,609.00	0.01
890	600551	时代出版	30,304	261,220.48	0.01
891	600217	中再资环	63,700	260,533.00	0.01
892	601965	中国汽研	36,600	259,128.00	0.01
893	601588	北辰实业	95,300	258,263.00	0.01
894	000850	华茂股份	80,700	258,240.00	0.01
895	601319	中国人保	47,913	257,771.94	0.01
896	603500	祥和实业	24,458	255,096.94	0.01
897	600461	洪城水业	46,120	253,660.00	0.01
898	002568	百润股份	27,700	253,178.00	0.01
899	000417	合肥百货	58,300	252,439.00	0.01
900	300396	迪瑞医疗	21,200	251,856.00	0.01
901	603606	东方电缆	27,837	248,584.41	0.01
902	000905	厦门港务	41,000	248,460.00	0.01
903	600783	鲁信创投	15,800	247,744.00	0.01
904	002613	北玻股份	92,681	246,531.46	0.01
905	601689	拓普集团	16,600	245,348.00	0.01
906	300147	香雪制药	39,700	243,758.00	0.01
907	600851	海欣股份	35,010	242,969.40	0.01
908	600517	置信电气	76,100	241,998.00	0.01
909	600803	新奥股份	24,300	241,542.00	0.01
910	000761	本钢板材	71,700	240,912.00	0.01
911	000888	峨眉山A	42,200	238,852.00	0.01
912	300221	银禧科技	46,300	238,445.00	0.01
913	603855	华荣股份	30,100	237,188.00	0.01
914	300482	万孚生物	9,300	236,313.00	0.01
915	300465	高伟达	39,308	236,241.08	0.01
916	603308	应流股份	29,420	235,948.40	0.01
917	600537	亿晶光电	83,100	235,173.00	0.01
918	002919	名臣健康	11,724	234,128.28	0.01
919	600978	宜华生活	56,500	231,650.00	0.01
920	300385	雪浪环境	16,300	229,993.00	0.01
921	600356	恒丰纸业	41,800	229,482.00	0.01
922	000716	黑芝麻	81,500	227,385.00	0.01
923	000529	广弘控股	50,700	227,136.00	0.01
924	002553	南方轴承	43,904	226,983.68	0.01
925	600241	时代万恒	39,332	225,765.68	0.01
926	002322	理工环科	24,841	225,556.28	0.01
927	002534	杭锅股份	42,100	225,235.00	0.01

928	002670	国盛金控	22,300	224,784.00	0.01
929	300200	高盟新材	31,800	224,190.00	0.01
930	603909	合诚股份	8,663	222,639.10	0.01
931	300669	沪宁股份	12,200	222,528.00	0.01
932	000021	深科技	38,700	222,525.00	0.01
933	600560	金白天正	27,500	222,200.00	0.01
934	000733	振华科技	20,300	222,082.00	0.01
935	300194	福安药业	68,900	221,169.00	0.01
936	002818	富森美	10,634	221,080.86	0.01
937	002548	金新农	32,900	220,101.00	0.01
938	300479	神思电子	16,900	219,700.00	0.01
939	600868	梅雁吉祥	76,500	218,025.00	0.01
940	603898	好莱客	14,109	216,290.97	0.01
941	002793	东音股份	21,203	216,270.60	0.01
942	603633	徕木股份	21,480	215,229.60	0.01
943	002107	沃华医药	32,513	214,910.93	0.01
944	002277	友阿股份	67,800	214,248.00	0.01
945	000531	穗恒运 A	42,300	214,038.00	0.01
946	300520	科大国创	14,200	212,858.00	0.01
947	300747	锐科激光	1,543	212,316.80	0.01
948	002362	汉王科技	15,900	212,265.00	0.01
949	002246	北化股份	32,100	212,181.00	0.01
950	002868	绿康生化	14,155	211,192.60	0.01
951	000828	东莞控股	28,237	210,930.39	0.01
952	603126	中材节能	40,900	210,635.00	0.01
953	000970	中科三环	28,700	210,371.00	0.01
954	002938	鹏鼎控股	11,980	209,889.60	0.01
955	600055	万东医疗	23,930	207,712.40	0.01
956	600984	建设机械	40,720	206,450.40	0.01
957	603611	诺力股份	16,740	205,567.20	0.01
958	300131	英唐智控	47,900	205,491.00	0.01
959	300419	浩丰科技	39,400	204,486.00	0.01
960	600599	熊猫金控	20,100	203,211.00	0.01
961	601117	中国化学	37,900	203,144.00	0.01
962	603066	音飞储存	28,700	202,335.00	0.01
963	000632	三木集团	52,401	202,267.86	0.01
964	600615	丰华股份	19,300	202,264.00	0.01
965	300360	炬华科技	30,859	202,126.45	0.01
966	603038	华立股份	12,050	200,030.00	0.01

967	300625	三雄极光	14,166	199,315.62	0.01
968	600792	云煤能源	74,200	198,856.00	0.01
969	002412	汉森制药	13,951	198,243.71	0.01
970	300087	荃银高科	19,296	197,976.96	0.01
971	002803	吉宏股份	13,400	197,650.00	0.01
972	601218	吉鑫科技	86,800	197,036.00	0.01
973	300448	浩云科技	19,014	196,604.76	0.01
974	600100	同方股份	20,200	196,546.00	0.01
975	600823	世茂股份	52,100	195,896.00	0.01
976	000700	模塑科技	66,002	194,705.90	0.01
977	300382	斯莱克	35,270	194,337.70	0.01
978	601500	通用股份	29,200	192,428.00	0.01
979	300354	东华测试	23,600	192,340.00	0.01
980	600531	豫光金铅	55,000	191,950.00	0.01
981	002842	翔鹭钨业	12,700	191,897.00	0.01
982	601369	陕鼓动力	31,650	191,482.50	0.01
983	000759	中百集团	35,840	189,235.20	0.01
984	300481	濮阳惠成	17,600	189,024.00	0.01
985	600199	金种子酒	41,200	188,284.00	0.01
986	300222	科大智能	12,100	187,550.00	0.01
987	603566	普莱柯	15,800	186,598.00	0.01
988	603680	今创集团	11,720	185,058.80	0.01
989	600127	金健米业	64,100	182,685.00	0.01
990	002144	宏达高科	18,574	182,025.20	0.01
991	600060	海信电器	20,600	178,808.00	0.01
992	601198	东兴证券	18,700	178,772.00	0.01
993	300390	天华超净	23,900	175,426.00	0.01
994	603055	台华新材	16,400	173,512.00	0.01
995	002186	全聚德	15,214	173,135.32	0.01
996	300118	东方日升	30,400	172,976.00	0.01
997	603871	嘉友国际	5,000	172,750.00	0.01
998	002117	东港股份	12,100	171,215.00	0.01
999	000601	韶能股份	46,000	171,120.00	0.01
1,000	600229	城市传媒	25,400	170,688.00	0.01
1,001	002187	广百股份	20,900	170,335.00	0.01
1,002	300528	幸福蓝海	20,132	169,108.80	0.01
1,003	603803	瑞斯康达	16,645	168,613.85	0.01
1,004	002533	金杯电工	38,100	168,021.00	0.01
1,005	300685	艾德生物	4,100	167,731.00	0.01



1,006	600303	曙光股份	42,800	167,348.00	0.01
1,007	002374	丽鹏股份	55,000	167,200.00	0.01
1,008	000949	新乡化纤	62,300	166,964.00	0.01
1,009	603688	石英股份	15,163	166,793.00	0.01
1,010	300527	中国应急	25,258	166,702.80	0.01
1,011	300235	方直科技	20,291	165,371.65	0.01
1,012	000416	民生控股	40,400	165,236.00	0.01
1,013	300242	佳云科技	38,400	165,120.00	0.01
1,014	002091	江苏国泰	29,100	162,960.00	0.01
1,015	600647	同达创业	13,600	161,568.00	0.01
1,016	603161	科华控股	10,300	161,401.00	0.01
1,017	603879	永悦科技	16,300	158,762.00	0.01
1,018	300426	唐德影视	23,200	158,224.00	0.01
1,019	002936	郑州银行	30,805	156,181.35	0.01
1,020	300491	通合科技	10,000	155,900.00	0.01
1,021	000929	兰州黄河	25,000	155,250.00	0.01
1,022	300205	天喻信息	19,000	154,660.00	0.01
1,023	603300	华铁科技	32,179	154,459.20	0.01
1,024	603648	畅联股份	14,800	154,364.00	0.01
1,025	603138	海量数据	8,200	152,766.00	0.01
1,026	002130	沃尔核材	47,100	152,604.00	0.01
1,027	002286	保龄宝	27,900	152,334.00	0.01
1,028	601162	天风证券	24,427	152,180.21	0.01
1,029	300533	冰川网络	4,800	151,632.00	0.01
1,030	000708	大冶特钢	17,263	151,396.51	0.01
1,031	002105	信隆健康	37,620	149,727.60	0.01
1,032	300536	农尚环境	17,400	149,292.00	0.01
1,033	002355	兴民智通	19,701	149,136.57	0.01
1,034	002756	永兴特钢	12,400	147,808.00	0.01
1,035	601858	中国科传	16,900	147,706.00	0.01
1,036	601577	长沙银行	17,329	147,643.08	0.01
1,037	000882	华联股份	66,000	147,180.00	0.01
1,038	603005	晶方科技	8,818	144,791.56	0.01
1,039	300444	双杰电气	21,983	144,428.31	0.01
1,040	600163	中闽能源	45,100	143,418.00	0.01
1,041	002480	新筑股份	29,300	142,984.00	0.01
1,042	600189	吉林森工	38,100	142,113.00	0.01
1,043	000014	沙河股份	15,100	140,279.00	0.01
1,044	002878	元隆雅图	5,500	139,590.00	0.00

1,045	002453	华软科技	26,700	138,840.00	0.00
1,046	603998	方盛制药	29,730	138,839.10	0.00
1,047	300723	一品红	5,200	138,788.00	0.00
1,048	600683	京投发展	33,200	138,444.00	0.00
1,049	601666	平煤股份	39,100	137,632.00	0.00
1,050	600858	银座股份	27,600	136,344.00	0.00
1,051	002681	奋达科技	36,900	135,054.00	0.00
1,052	603527	众源新材	12,980	134,602.60	0.00
1,053	600592	龙溪股份	25,000	134,000.00	0.00
1,054	300569	天能重工	10,415	133,832.75	0.00
1,055	601869	长飞光纤	3,345	133,030.65	0.00
1,056	603022	新通联	19,503	132,620.40	0.00
1,057	603906	龙蟠科技	15,500	131,595.00	0.00
1,058	002381	双箭股份	19,100	127,970.00	0.00
1,059	603630	拉芳家化	9,630	126,153.00	0.00
1,060	601368	绿城水务	21,700	125,643.00	0.00
1,061	600861	北京城乡	17,886	124,307.70	0.00
1,062	300231	银信科技	19,100	124,150.00	0.00
1,063	300695	兆丰股份	2,200	124,080.00	0.00
1,064	300097	智云股份	11,100	123,987.00	0.00
1,065	300417	南华仪器	8,200	123,820.00	0.00
1,066	601139	深圳燃气	23,000	123,510.00	0.00
1,067	603002	宏昌电子	35,500	123,185.00	0.00
1,068	600727	鲁北化工	22,400	122,976.00	0.00
1,069	002255	海陆重工	31,400	122,774.00	0.00
1,070	002578	闽发铝业	36,600	122,244.00	0.00
1,071	002805	丰元股份	8,308	122,127.60	0.00
1,072	600909	华安证券	25,800	121,776.00	0.00
1,073	600843	上工申贝	18,200	120,848.00	0.00
1,074	603089	正裕工业	7,400	120,620.00	0.00
1,075	600135	乐凯胶片	21,400	120,482.00	0.00
1,076	600833	第一医药	13,100	119,603.00	0.00
1,077	603788	宁波高发	8,191	118,359.95	0.00
1,078	600865	百大集团	21,300	118,215.00	0.00
1,079	600237	铜峰电子	35,700	117,453.00	0.00
1,080	000719	中原传媒	14,900	117,263.00	0.00
1,081	300655	晶瑞股份	8,600	116,444.00	0.00
1,082	603123	翠微股份	19,434	114,660.60	0.00
1,083	002527	新时达	21,200	113,632.00	0.00

1,084	300511	雪榕生物	19,000	113,430.00	0.00
1,085	002083	孚日股份	22,390	110,382.70	0.00
1,086	000798	中水渔业	21,202	110,250.40	0.00
1,087	300724	捷佳伟创	3,870	110,217.60	0.00
1,088	300515	三德科技	12,600	109,494.00	0.00
1,089	000919	金陵药业	17,209	107,900.43	0.00
1,090	603636	南威软件	11,200	107,520.00	0.00
1,091	002740	爱迪尔	20,500	107,215.00	0.00
1,092	002832	比音勒芬	3,200	106,880.00	0.00
1,093	600158	中体产业	12,018	106,840.02	0.00
1,094	002351	漫步者	21,500	106,210.00	0.00
1,095	300727	润禾材料	5,340	105,198.00	0.00
1,096	600966	博汇纸业	33,100	103,934.00	0.00
1,097	603806	福斯特	3,860	103,448.00	0.00
1,098	600768	宁波富邦	10,700	103,041.00	0.00
1,099	300095	华伍股份	22,400	102,816.00	0.00
1,100	002342	巨力索具	31,000	102,610.00	0.00
1,101	002646	青青稞酒	9,500	101,745.00	0.00
1,102	002203	海亮股份	12,900	101,394.00	0.00
1,103	300683	海特生物	3,700	100,825.00	0.00
1,104	002810	山东赫达	5,642	100,596.86	0.00
1,105	000899	赣能股份	22,900	100,302.00	0.00
1,106	002614	奥佳华	6,261	99,862.95	0.00
1,107	601599	鹿港文化	31,800	99,216.00	0.00
1,108	603360	百傲化学	8,000	98,880.00	0.00
1,109	603877	太平鸟	5,219	98,065.01	0.00
1,110	300247	乐金健康	28,400	97,412.00	0.00
1,111	600530	交大昂立	22,000	97,240.00	0.00
1,112	002393	力生制药	4,500	96,885.00	0.00
1,113	300555	路通视信	11,900	95,676.00	0.00
1,114	603859	能科股份	5,400	94,986.00	0.00
1,115	603916	苏博特	8,400	93,912.00	0.00
1,116	603009	北特科技	16,070	93,045.30	0.00
1,117	603030	全筑股份	18,200	92,820.00	0.00
1,118	600562	国睿科技	7,200	92,664.00	0.00
1,119	600692	亚通股份	13,000	91,910.00	0.00
1,120	603181	皇马科技	6,400	91,072.00	0.00
1,121	002097	山河智能	16,400	91,020.00	0.00
1,122	002788	鹭燕医药	7,153	90,270.86	0.00

1, 123	000590	启迪古汉	11, 800	89, 680.00	0.00
1, 124	002184	海得控制	9, 500	88, 635.00	0.00
1, 125	002579	中京电子	10, 300	88, 477.00	0.00
1, 126	601008	连云港	28, 700	87, 822.00	0.00
1, 127	600269	赣粤高速	22, 300	86, 970.00	0.00
1, 128	600268	国电南自	20, 300	86, 072.00	0.00
1, 129	600975	新五丰	25, 200	85, 176.00	0.00
1, 130	600508	上海能源	8, 800	84, 920.00	0.00
1, 131	000612	焦作万方	21, 300	84, 348.00	0.00
1, 132	002811	亚泰国际	4, 615	83, 070.00	0.00
1, 133	300579	数字认证	3, 650	83, 001.00	0.00
1, 134	603220	贝通信	3, 815	82, 709.20	0.00
1, 135	300693	盛弘股份	5, 550	82, 528.50	0.00
1, 136	600148	长春一东	5, 800	81, 838.00	0.00
1, 137	601288	农业银行	22, 600	81, 360.00	0.00
1, 138	601908	京运通	25, 800	81, 270.00	0.00
1, 139	600769	祥龙电业	20, 700	80, 730.00	0.00
1, 140	600618	氯碱化工	12, 400	80, 476.00	0.00
1, 141	600723	首商股份	12, 900	80, 109.00	0.00
1, 142	002100	天康生物	19, 058	80, 043.60	0.00
1, 143	300371	汇中股份	6, 400	79, 168.00	0.00
1, 144	603096	新经典	1, 280	79, 001.60	0.00
1, 145	603979	金诚信	10, 400	77, 896.00	0.00
1, 146	002809	红墙股份	5, 150	77, 765.00	0.00
1, 147	603298	杭叉集团	6, 500	76, 830.00	0.00
1, 148	601606	长城军工	6, 290	75, 857.40	0.00
1, 149	603326	我乐家居	6, 740	75, 488.00	0.00
1, 150	603496	恒为科技	3, 100	75, 485.00	0.00
1, 151	002890	弘宇股份	4, 060	74, 907.00	0.00
1, 152	603693	江苏新能	5, 384	74, 245.36	0.00
1, 153	600076	康欣新材	17, 800	72, 980.00	0.00
1, 154	300453	三鑫医疗	6, 619	72, 941.38	0.00
1, 155	300626	华瑞股份	8, 200	72, 488.00	0.00
1, 156	603926	铁流股份	5, 200	71, 864.00	0.00
1, 157	601068	中铝国际	13, 770	71, 741.70	0.00
1, 158	002643	万润股份	7, 084	71, 690.08	0.00
1, 159	300521	爱司凯	8, 107	71, 179.46	0.00
1, 160	300549	优德精密	6, 218	70, 823.02	0.00
1, 161	002808	恒久科技	5, 480	70, 144.00	0.00

1,162	002887	绿茵生态	4,400	69,740.00	0.00
1,163	002869	金溢科技	4,400	69,564.00	0.00
1,164	601208	东材科技	18,600	68,820.00	0.00
1,165	603569	长久物流	6,400	68,800.00	0.00
1,166	600521	华海药业	6,180	68,350.80	0.00
1,167	300461	田中精机	3,800	67,716.00	0.00
1,168	601567	三星医疗	12,000	67,560.00	0.00
1,169	002823	凯中精密	6,500	67,015.00	0.00
1,170	603966	法兰泰克	7,650	66,096.00	0.00
1,171	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
1,172	300066	三川智慧	19,800	65,736.00	0.00
1,173	002587	奥拓电子	13,500	65,610.00	0.00
1,174	600444	国机通用	6,800	64,940.00	0.00
1,175	000823	超声电子	8,300	64,740.00	0.00
1,176	603663	三祥新材	3,800	64,600.00	0.00
1,177	000736	中交地产	8,600	63,898.00	0.00
1,178	002114	罗平锌电	9,400	62,604.00	0.00
1,179	603829	洛凯股份	6,500	61,815.00	0.00
1,180	603331	百达精工	4,200	61,572.00	0.00
1,181	300530	达志科技	2,000	61,320.00	0.00
1,182	600251	冠农股份	12,402	61,265.88	0.00
1,183	002429	兆驰股份	31,600	60,040.00	0.00
1,184	600173	卧龙地产	15,600	58,812.00	0.00
1,185	600558	大西洋	18,600	58,776.00	0.00
1,186	603590	康辰药业	1,828	58,678.80	0.00
1,187	300629	新劲刚	3,800	58,482.00	0.00
1,188	603991	至正股份	3,148	57,230.64	0.00
1,189	300447	全信股份	6,100	56,608.00	0.00
1,190	603685	晨丰科技	3,800	54,378.00	0.00
1,191	603587	地素时尚	2,442	53,699.58	0.00
1,192	603416	信捷电气	2,600	52,468.00	0.00
1,193	603583	捷昌驱动	1,321	51,888.88	0.00
1,194	603578	三星新材	2,761	51,879.19	0.00
1,195	601518	吉林高速	20,000	51,600.00	0.00
1,196	000518	四环生物	14,900	51,554.00	0.00
1,197	000861	海印股份	20,500	51,455.00	0.00
1,198	300698	万马科技	2,800	51,044.00	0.00
1,199	002933	新兴装备	1,262	50,757.64	0.00
1,200	600243	青海华鼎	13,100	50,697.00	0.00

1,201	300112	万讯自控	8,100	50,382.00	0.00
1,202	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00
1,203	002935	天奥电子	1,160	49,508.80	0.00
1,204	300634	彩讯股份	2,058	49,124.46	0.00
1,205	002682	龙洲股份	11,400	49,020.00	0.00
1,206	300082	奥克股份	8,000	48,000.00	0.00
1,207	000815	美利云	7,100	47,925.00	0.00
1,207	002627	宜昌交运	7,500	47,925.00	0.00
1,208	002620	瑞和股份	8,200	47,806.00	0.00
1,209	002937	兴瑞科技	2,114	47,755.26	0.00
1,210	603706	东方环宇	1,765	47,584.40	0.00
1,211	603078	江化微	1,640	47,314.00	0.00
1,212	300621	维业股份	4,900	47,040.00	0.00
1,213	002678	珠江钢琴	8,073	46,177.56	0.00
1,214	603196	日播时尚	3,700	46,028.00	0.00
1,215	300694	蠡湖股份	2,485	45,997.35	0.00
1,216	600153	建发股份	6,500	45,825.00	0.00
1,217	603713	密尔克卫	1,626	45,056.46	0.00
1,218	603105	芯能科技	3,410	44,602.80	0.00
1,219	300748	金力永磁	2,008	43,593.68	0.00
1,220	603110	东方材料	4,020	42,531.60	0.00
1,221	603808	歌力思	2,592	42,094.08	0.00
1,222	300150	世纪瑞尔	10,100	41,612.00	0.00
1,223	603800	道森股份	3,700	41,588.00	0.00
1,224	600167	联美控股	4,593	41,520.72	0.00
1,225	002040	南京港	5,300	41,234.00	0.00
1,226	300640	德艺文创	4,300	40,979.00	0.00
1,227	002238	天威视讯	6,300	40,950.00	0.00
1,228	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.00
1,229	000544	中原环保	8,000	40,560.00	0.00
1,230	603297	永新光学	936	40,482.00	0.00
1,231	002216	三全食品	5,400	39,312.00	0.00
1,232	600078	澄星股份	11,900	37,723.00	0.00
1,233	603779	威龙股份	2,800	37,100.00	0.00
1,234	002615	哈尔斯	7,500	36,225.00	0.00
1,235	002454	松芝股份	8,800	35,992.00	0.00
1,236	600501	航天晨光	5,900	35,813.00	0.00
1,237	603192	汇得科技	1,207	34,918.51	0.00
1,238	603790	雅运股份	1,591	33,681.47	0.00

1,239	002104	恒宝股份	5,625	32,962.50	0.00
1,240	600363	联创光电	4,100	32,800.00	0.00
1,241	300512	中亚股份	2,700	32,400.00	0.00
1,242	000978	桂林旅游	6,160	32,216.80	0.00
1,243	600509	天富能源	9,000	32,130.00	0.00
1,244	002418	康盛股份	10,400	32,032.00	0.00
1,245	600992	贵绳股份	4,600	31,832.00	0.00
1,246	600543	莫高股份	4,841	31,611.73	0.00
1,247	000801	四川九洲	7,300	31,609.00	0.00
1,248	002671	龙泉股份	7,700	31,570.00	0.00
1,249	603618	杭电股份	6,000	31,320.00	0.00
1,250	300314	戴维医疗	3,705	30,936.75	0.00
1,251	600589	广东榕泰	7,500	30,600.00	0.00
1,252	300219	鸿利智汇	3,900	29,874.00	0.00
1,253	300749	顶固集创	1,316	29,531.04	0.00
1,254	600190	锦州港	10,750	28,702.50	0.00
1,255	600405	动力源	6,970	28,507.30	0.00
1,256	000524	岭南控股	4,100	28,290.00	0.00
1,257	603657	春光科技	975	28,119.00	0.00
1,258	002765	蓝黛传动	4,200	26,208.00	0.00
1,259	002046	轴研科技	4,100	26,035.00	0.00
1,260	600262	北方股份	1,500	26,025.00	0.00
1,261	600367	红星发展	3,600	25,776.00	0.00
1,262	002470	金正大	4,000	25,280.00	0.00
1,263	600035	楚天高速	8,100	23,895.00	0.00
1,264	002084	海鸥住工	5,900	22,951.00	0.00
1,265	300252	金信诺	2,100	22,890.00	0.00
1,266	600379	宝光股份	3,400	22,746.00	0.00
1,267	601595	上海电影	1,800	22,014.00	0.00
1,268	002250	联化科技	2,330	21,971.90	0.00
1,269	600731	湖南海利	5,181	21,863.82	0.00
1,270	000677	恒天海龙	7,900	20,540.00	0.00
1,271	002546	新联电子	5,400	20,358.00	0.00
1,272	603601	再升科技	2,540	19,380.20	0.00
1,273	600178	东安动力	4,523	18,996.60	0.00
1,274	601929	吉视传媒	9,200	18,860.00	0.00
1,275	603960	克来机电	671	18,640.38	0.00
1,276	000005	世纪星源	6,800	18,224.00	0.00
1,277	002276	万马股份	3,611	18,199.44	0.00

1,278	600785	新华百货	1,100	17,985.00	0.00
1,279	600159	大龙地产	7,400	17,834.00	0.00
1,280	002540	亚太科技	3,800	17,556.00	0.00
1,281	000925	众合科技	2,721	15,917.85	0.00
1,282	300307	慈星股份	3,100	14,818.00	0.00
1,283	600459	贵研铂业	1,284	14,226.72	0.00
1,284	000561	烽火电子	2,500	14,025.00	0.00
1,285	603218	日月股份	847	13,992.44	0.00
1,286	603288	海天味业	198	13,622.40	0.00
1,287	000665	湖北广电	1,900	13,604.00	0.00
1,288	600644	乐山电力	2,932	13,164.68	0.00
1,289	603339	四方科技	870	13,006.50	0.00
1,290	600882	广泽股份	1,500	11,505.00	0.00
1,291	000599	青岛双星	3,100	11,470.00	0.00
1,292	603955	大千生态	791	10,994.90	0.00
1,293	603638	艾迪精密	390	9,441.90	0.00
1,294	603833	欧派家居	104	8,290.88	0.00
1,295	001896	豫能控股	2,300	7,015.00	0.00
1,296	603716	塞力斯	340	6,470.20	0.00
1,297	603988	中电电机	588	5,885.88	0.00
1,298	603203	快克股份	300	5,880.00	0.00
1,299	300666	江丰电子	132	5,454.24	0.00
1,300	603660	苏州科达	315	5,251.05	0.00
1,301	603388	元成股份	500	5,020.00	0.00
1,302	600779	水井坊	158	5,003.86	0.00
1,303	300347	泰格医药	111	4,745.25	0.00
1,304	603233	大参林	111	4,424.46	0.00
1,305	603383	顶点软件	140	4,160.80	0.00
1,306	603989	艾华集团	180	3,625.20	0.00
1,307	603156	养元饮品	87	3,617.46	0.00
1,308	002905	金逸影视	277	3,609.31	0.00
1,309	002812	恩捷股份	70	3,458.70	0.00
1,310	002789	建艺集团	210	3,425.10	0.00
1,311	600391	航发科技	292	3,191.56	0.00
1,312	600535	天士力	166	3,187.20	0.00
1,313	300702	天宇股份	137	2,993.45	0.00
1,314	603585	苏利股份	140	2,879.80	0.00
1,315	601360	三六零	137	2,790.69	0.00
1,316	000988	华工科技	230	2,746.20	0.00



1,317	000538	云南白药	36	2,662.56	0.00
1,318	002016	世荣兆业	287	2,588.74	0.00
1,319	600487	亨通光电	150	2,557.50	0.00
1,320	002590	万安科技	400	2,544.00	0.00
1,321	300423	鲁亿通	131	2,309.53	0.00
1,322	300637	扬帆新材	93	2,290.59	0.00
1,323	600230	沧州大化	140	2,261.00	0.00
1,324	000333	美的集团	61	2,248.46	0.00
1,325	002851	麦格米特	105	2,226.00	0.00
1,326	603098	森特股份	160	2,187.20	0.00
1,327	002709	天赐材料	98	2,122.68	0.00
1,328	000605	渤海股份	222	2,106.78	0.00
1,329	002876	三利谱	65	2,077.40	0.00
1,330	300660	江苏雷利	100	1,922.00	0.00
1,331	603933	睿能科技	100	1,872.00	0.00
1,332	300620	光库科技	42	1,850.10	0.00
1,333	002361	神剑股份	500	1,820.00	0.00
1,334	603639	海利尔	68	1,804.72	0.00
1,335	002268	卫士通	100	1,786.00	0.00
1,336	601601	中国太保	61	1,734.23	0.00
1,337	300543	朗科智能	98	1,659.14	0.00
1,338	600038	中直股份	43	1,606.48	0.00
1,339	002881	美格智能	82	1,460.42	0.00
1,340	603336	宏辉果蔬	90	1,399.50	0.00
1,341	600009	上海机场	27	1,370.52	0.00
1,342	603225	新风鸣	73	1,368.75	0.00
1,343	300667	必创科技	50	1,329.50	0.00
1,344	002365	永安药业	125	1,305.00	0.00
1,345	300740	御家汇	72	1,303.20	0.00
1,346	603369	今世缘	88	1,275.12	0.00
1,347	300532	今天国际	126	1,265.04	0.00
1,348	002035	华帝股份	141	1,247.85	0.00
1,349	300244	迪安诊断	82	1,243.94	0.00
1,350	603828	柯利达	162	1,231.20	0.00
1,351	300648	星云股份	70	1,150.10	0.00
1,352	300589	江龙船艇	100	1,100.00	0.00
1,353	300679	电连技术	40	1,090.80	0.00
1,354	300582	英飞特	106	1,061.06	0.00
1,355	603637	镇海股份	70	1,034.60	0.00

1,356	002202	金风科技	102	1,018.98	0.00
1,357	601336	新华保险	24	1,013.76	0.00
1,358	000786	北新建材	72	990.72	0.00
1,359	300046	台基股份	88	974.16	0.00
1,360	002484	江海股份	157	967.12	0.00
1,361	600980	北矿科技	97	949.63	0.00
1,362	300308	中际旭创	23	935.87	0.00
1,363	600688	上海石化	184	918.16	0.00
1,364	603568	伟明环保	40	914.00	0.00
1,365	600706	曲江文旅	89	905.13	0.00
1,366	600993	马应龙	67	899.14	0.00
1,367	300691	联合光电	40	890.40	0.00
1,368	300568	星源材质	40	887.60	0.00
1,369	600446	金证股份	91	864.50	0.00
1,370	300286	安科瑞	100	842.00	0.00
1,371	300441	鲍斯股份	124	840.72	0.00
1,372	300507	苏奥传感	49	837.41	0.00
1,373	600874	创业环保	101	833.25	0.00
1,374	600690	青岛海尔	60	831.00	0.00
1,375	002918	蒙娜丽莎	50	830.00	0.00
1,376	000628	高新发展	83	819.21	0.00
1,377	601838	成都银行	99	796.95	0.00
1,378	002741	光华科技	48	760.80	0.00
1,379	000915	山大华特	51	754.80	0.00
1,380	002488	金固股份	111	735.93	0.00
1,381	300395	菲利华	50	717.50	0.00
1,382	002507	涪陵榨菜	33	712.80	0.00
1,383	300632	光莆股份	50	712.00	0.00
1,384	603025	大豪科技	58	646.70	0.00
1,385	300326	凯利泰	76	646.00	0.00
1,386	601225	陕西煤业	84	624.96	0.00
1,387	002180	纳思达	27	618.84	0.00
1,388	603689	皖天然气	58	613.64	0.00
1,389	603701	德宏股份	52	592.80	0.00
1,390	000921	海信家电	83	586.81	0.00
1,391	002284	亚太股份	134	569.50	0.00
1,392	000551	创元科技	88	511.28	0.00
1,393	002580	圣阳股份	100	506.00	0.00
1,394	601633	长城汽车	89	498.40	0.00

1,395	300431	暴风集团	59	492.06	0.00
1,396	000768	中航飞机	37	489.88	0.00
1,397	002391	长青股份	45	474.75	0.00
1,398	002419	天虹股份	41	449.77	0.00
1,399	300251	光线传媒	58	440.80	0.00
1,400	000576	广东甘化	72	432.00	0.00
1,401	002703	浙江世宝	100	419.00	0.00
1,402	300021	大禹节水	100	415.00	0.00
1,403	002906	华阳集团	42	409.92	0.00
1,404	603600	永艺股份	55	385.00	0.00
1,405	300232	洲明科技	40	381.60	0.00
1,406	600719	大连热电	100	381.00	0.00
1,407	600826	兰生股份	40	380.40	0.00
1,408	600821	津劝业	95	379.05	0.00
1,409	603118	共进股份	60	378.00	0.00
1,410	300402	宝色股份	49	377.30	0.00
1,411	000027	深圳能源	71	372.75	0.00
1,412	600481	双良节能	99	329.67	0.00
1,413	600315	上海家化	12	327.60	0.00
1,414	002686	亿利达	47	327.59	0.00
1,415	600376	首开股份	45	323.55	0.00
1,416	002051	中工国际	29	321.32	0.00
1,417	300565	科信技术	20	291.60	0.00
1,418	600859	王府井	21	284.76	0.00
1,419	000800	一汽轿车	43	284.66	0.00
1,420	002588	史丹利	73	283.97	0.00
1,421	603020	爱普股份	36	267.48	0.00
1,422	002466	天齐锂业	9	263.88	0.00
1,423	000782	美达股份	61	260.47	0.00
1,424	600808	马钢股份	73	252.58	0.00
1,425	002328	新朋股份	41	229.60	0.00
1,426	002003	伟星股份	32	224.64	0.00
1,427	300310	宜通世纪	43	218.01	0.00
1,428	600512	腾达建设	100	215.00	0.00
1,429	000157	中联重科	60	213.60	0.00
1,430	600982	宁波热电	60	199.80	0.00
1,431	000760	斯太尔	60	197.40	0.00
1,432	002512	达华智能	35	185.85	0.00
1,433	000678	襄阳轴承	32	160.00	0.00

1,434	601021	春秋航空	5	159.05	0.00
1,435	600365	通葡股份	42	152.46	0.00
1,436	002611	东方精工	40	150.00	0.00
1,437	601801	皖新传媒	22	146.96	0.00
1,438	601010	文峰股份	50	145.00	0.00
1,439	000973	佛塑科技	43	138.03	0.00
1,440	603129	春风动力	8	127.84	0.00
1,441	002863	今飞凯达	20	127.40	0.00
1,442	000790	泰合健康	26	105.56	0.00
1,443	000898	鞍钢股份	20	102.60	0.00
1,444	603239	浙江仙通	9	93.69	0.00
1,445	601777	力帆股份	22	83.82	0.00
1,446	600400	红豆股份	20	75.00	0.00
1,447	002241	歌尔股份	8	55.04	0.00
1,448	002170	芭田股份	16	46.72	0.00
1,449	600590	泰豪科技	6	32.34	0.00
1,450	002751	易尚展示	1	21.48	0.00
1,451	600693	东百集团	4	21.00	0.00
1,452	300179	四方达	4	16.12	0.00
1,453	002385	大北农	5	16.00	0.00
1,454	600824	益民集团	4	13.36	0.00
1,455	002205	国统股份	1	11.70	0.00
1,456	600386	北巴传媒	2	6.64	0.00
1,457	600218	全柴动力	1	4.50	0.00
1,458	600082	海泰发展	1	4.49	0.00
1,459	002650	加加食品	1	3.60	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	600519	贵州茅台	199,767,624.17	5.26
2	601166	兴业银行	194,952,281.45	5.13
3	600029	南方航空	193,473,927.37	5.09
4	603799	华友钴业	180,996,572.81	4.76
5	002460	赣锋锂业	176,727,180.56	4.65
6	002456	欧菲科技	172,410,700.16	4.54
7	601328	交通银行	160,047,826.85	4.21

8	002027	分众传媒	151,245,446.36	3.98
9	000725	京东方A	148,816,721.00	3.92
10	600016	民生银行	148,456,426.68	3.91
11	600487	亨通光电	145,686,737.73	3.83
12	600104	上汽集团	145,064,066.43	3.82
13	601111	中国国航	143,364,259.17	3.77
14	603993	洛阳钼业	140,951,658.33	3.71
15	600332	白云山	135,480,936.89	3.56
16	600028	中国石化	135,089,626.84	3.55
17	300070	碧水源	127,583,977.77	3.36
18	601006	大秦铁路	126,935,264.85	3.34
19	601818	光大银行	126,317,166.19	3.32
20	600900	长江电力	126,189,717.24	3.32
21	601988	中国银行	123,441,864.70	3.25
22	002241	歌尔股份	119,754,643.01	3.15
23	600276	恒瑞医药	118,714,642.47	3.12
24	000963	华东医药	116,680,186.49	3.07
25	300136	信维通信	115,946,614.11	3.05
26	601857	中国石油	115,945,682.23	3.05
27	300003	乐普医疗	110,905,645.15	2.92
28	600660	福耀玻璃	110,595,902.36	2.91
29	002236	大华股份	109,939,136.05	2.89
30	002202	金风科技	107,417,040.62	2.83
31	002405	四维图新	105,921,377.15	2.79
32	601229	上海银行	104,294,540.36	2.74
33	600703	三安光电	99,660,271.48	2.62
34	601288	农业银行	99,119,760.62	2.61
35	600887	伊利股份	98,127,636.33	2.58
36	601318	中国平安	97,740,665.72	2.57
37	000735	罗牛山	96,087,500.54	2.53
38	002466	天齐锂业	94,792,775.57	2.49
39	002415	海康威视	93,406,092.52	2.46
40	601939	建设银行	90,321,084.51	2.38
41	002304	洋河股份	89,623,280.94	2.36
42	600196	复星医药	88,831,750.58	2.34
43	002310	东方园林	87,966,621.63	2.31

44	002371	北方华创	85,568,902.16	2.25
45	600036	招商银行	83,064,909.30	2.19
46	600535	天士力	82,871,342.51	2.18
47	000776	广发证券	81,646,100.50	2.15
48	002008	大族激光	81,533,136.21	2.15
49	000538	云南白药	79,956,117.67	2.10
50	600518	康美药业	79,833,013.18	2.10
51	300122	智飞生物	77,134,698.43	2.03
52	601607	上海医药	76,710,955.74	2.02
53	600000	浦发银行	76,257,296.14	2.01

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	601628	中国人寿	279,802,939.78	7.36
2	601318	中国平安	277,835,363.48	7.31
3	002460	赣锋锂业	266,458,788.45	7.01
4	601336	新华保险	229,675,821.21	6.04
5	601601	中国太保	214,172,969.12	5.64
6	600519	贵州茅台	193,246,416.20	5.08
7	600029	南方航空	187,307,349.90	4.93
8	000001	平安银行	171,855,595.63	4.52
9	601166	兴业银行	161,795,635.28	4.26
10	000725	京东方 A	155,298,262.88	4.09
11	600487	亨通光电	149,469,626.60	3.93
12	002027	分众传媒	149,080,846.23	3.92
13	601328	交通银行	147,014,309.40	3.87
14	002456	欧菲科技	145,632,447.01	3.83
15	600016	民生银行	144,941,651.28	3.81
16	600028	中国石化	139,215,450.29	3.66
17	600104	上汽集团	138,733,845.30	3.65
18	601111	中国国航	137,627,299.70	3.62
19	002236	大华股份	135,938,687.88	3.58
20	600332	白云山	133,836,410.29	3.52
21	600703	三安光电	131,560,152.08	3.46
22	601988	中国银行	129,352,036.48	3.40

23	002241	歌尔股份	126,423,282.61	3.33
24	603799	华友钴业	120,609,479.21	3.17
25	300136	信维通信	116,522,332.18	3.07
26	603993	洛阳钼业	116,013,599.21	3.05
27	601818	光大银行	115,831,466.73	3.05
28	601006	大秦铁路	115,172,795.72	3.03
29	300070	碧水源	114,207,675.82	3.01
30	601857	中国石油	113,580,048.93	2.99
31	600660	福耀玻璃	111,820,662.36	2.94
32	300296	利亚德	110,240,218.76	2.90
33	002405	四维图新	109,286,659.03	2.88
34	601288	农业银行	108,540,426.43	2.86
35	601939	建设银行	108,487,964.08	2.85
36	002371	北方华创	108,236,632.29	2.85
37	002202	金风科技	106,389,164.47	2.80
38	600887	伊利股份	103,496,964.29	2.72
39	600196	复星医药	102,469,407.72	2.70
40	000100	TCL 集团	100,599,192.39	2.65
41	000807	云铝股份	99,599,361.35	2.62
42	600900	长江电力	94,962,293.22	2.50
43	002466	天齐锂业	92,611,030.42	2.44
44	000735	罗牛山	91,885,487.84	2.42
45	002415	海康威视	89,908,869.82	2.37
46	002304	洋河股份	88,469,950.11	2.33
47	601229	上海银行	86,304,299.74	2.27
48	002273	水晶光电	81,879,143.24	2.15
49	002635	安洁科技	81,751,510.81	2.15
50	000538	云南白药	81,311,387.80	2.14
51	000776	广发证券	81,233,398.57	2.14
52	002008	大族激光	81,216,808.00	2.14
53	002497	雅化集团	80,745,077.61	2.12
54	600535	天士力	79,814,651.49	2.10
55	600518	康美药业	79,536,794.75	2.09
56	300122	智飞生物	79,130,028.06	2.08
57	300003	乐普医疗	79,126,679.46	2.08

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	31,466,690,500.22
卖出股票收入（成交）总额	31,567,820,458.76

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）	266,604,997.60	9.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	266,604,997.60	9.54

**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	127005	长证转债	187,048	18,399,911.76	0.66
2	127006	敖东转债	154,987	14,867,902.91	0.53
3	123001	蓝标转债	149,853	14,364,908.58	0.51
4	128016	雨虹转债	129,119	12,782,781.00	0.46
5	132015	18 中油 EB	117,450	11,483,086.50	0.41

**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

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 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	1,122,327.68
2	应收证券清算款	12,903,806.15
3	应收股利	-
4	应收利息	624,723.61
5	应收申购款	77,442.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,728,299.71

### 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	127005	长证转债	18,399,911.76	0.66
2	127006	敖东转债	14,867,902.91	0.53
3	123001	蓝标转债	14,364,908.58	0.51
4	128016	雨虹转债	12,782,781.00	0.46
5	113019	玲珑转债	10,389,790.00	0.37
6	110031	航信转债	10,265,755.20	0.37
7	127003	海印转债	10,166,394.30	0.36
8	128018	时达转债	9,934,974.40	0.36
9	128037	岩土转债	9,826,345.13	0.35
10	128023	亚太转债	9,781,237.62	0.35
11	128038	利欧转债	9,752,156.40	0.35
12	128013	洪涛转债	9,732,371.67	0.35
13	123003	蓝思转债	9,674,581.40	0.35
14	127004	模塑转债	9,585,979.14	0.34
15	113014	林洋转债	9,510,087.40	0.34
16	128036	金农转债	9,481,508.68	0.34
17	128020	水晶转债	9,420,123.09	0.34
18	123007	道氏转债	9,294,423.20	0.33
19	113017	吉视转债	9,133,832.70	0.33
20	113505	杭电转债	9,119,245.20	0.33
21	110040	生益转债	7,237,058.40	0.26
22	128032	双环转债	7,114,297.86	0.25
23	128015	久其转债	6,060,698.64	0.22
24	113015	隆基转债	5,736,966.80	0.21
25	110042	航电转债	3,649,520.90	0.13
26	128025	特一转债	3,644,240.25	0.13
27	128026	众兴转债	3,484,193.12	0.12
28	128028	赣锋转债	2,710,625.35	0.10

#### 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
154,686	16,002.94	4,411,803.06	0.18%	2,471,018,791.16	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	1,030,346.15	0.0416%

### 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	2,698,593,511.97
本报告期基金总申购份额	29,471,708.77
减:本报告期基金总赎回份额	252,634,626.52
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	2,475,430,594.22

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，经诺安基金管理有限公司 2018 年度股东会决议通过，同意选举赵照先生、孙晓刚先生担任诺安基金管理有限公司的董事，原董事会成员齐斌先生、李清章先生不再担任公司董事职务。同意选举秦江卫先生担任诺安基金管理有限公司的监事，原监事会成员李京先生不再担任公司监事职务。上述董事、监事变更事项已报深圳证监局备案并在各基金的《招募说明书》中披露。

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 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：2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、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	
华福证券		18,835,868,345.37	14.02%	6,285,072.84	13.33%	-

平安证券	1	18,628,195,316.89	13.69%	5,784,326.56	12.26%	-
山西证券		17,876,139,088.01	12.50%	5,460,254.71	11.58%	-
招商证券		16,363,436,007.16	10.10%	5,249,933.47	11.13%	-
申万宏源		25,722,290,694.11	9.08%	3,136,750.39	6.65%	-
广发证券		15,477,839,886.58	8.69%	4,452,630.53	9.44%	-
国信证券		15,389,807,136.68	8.55%	4,965,936.59	10.53%	-
中信证券		12,856,713,557.70	4.53%	2,660,458.89	5.64%	-
国泰君安		12,203,758,427.84	3.50%	2,052,377.14	4.35%	-
中投证券		22,106,740,838.49	3.34%	1,962,026.84	4.16%	-
太平洋证券		11,730,386,215.77	2.75%	711,695.47	1.51%	-
长江证券		11,576,995,965.82	2.50%	1,468,622.63	3.11%	-
国都证券		11,499,369,532.65	2.38%	1,396,357.90	2.96%	-
东吴证券	1	992,438,429.58	1.57%	408,195.18	0.87%	-
安信证券	2	908,237,933.20	1.44%	373,542.75	0.79%	-
广州证券	1	488,289,852.01	0.77%	454,742.51	0.96%	-
方正证券	1	368,722,701.53	0.59%	343,376.65	0.73%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	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 2 家证券公司的 2 个交易单元：华福证券有限责任公司（1 个交易单元）、山西证券股份有限公司（1 个交易单元）。

本报告期减少 1 家证券公司的 1 个交易单元:广发证券股份有限公司(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, 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
华福证券	61,294,699.90	14.23%	-	-	-	-
平安证券	71,525,208.80	16.60%	-	-	-	-
山西证券	11,553,610.30	2.68%	-	-	-	-
招商证券	76,915,633.07	17.85%	-	-	-	-
申万宏源	30,026,666.55	6.97%	-	-	-	-
广发证券	31,914,579.20	7.41%	-	-	-	-
国信证券	56,835,512.21	13.19%	-	-	-	-
中信证券	26,640,253.80	6.18%	-	-	-	-
国泰君安	31,117,525.47	7.22%	-	-	-	-
中投证券	30,028,778.35	6.97%	-	-	-	-

广州证券	392,479.70	0.09%	-	-	-	-
方正证券	2,632,103.00	0.61%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 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	2018年1月2日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业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》	2018年1月9日
3	诺安基金管理有限公司关于增加上海攀赢金融信息服务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》	2018年1月12日
4	诺安基金管理有限公司关于增加上	《证券时报》、	2018年1月17日



	海挖财金融信息服务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	《上海证券报》、 《中国证券报》	
5	诺安基金管理有限公司关于变更诺安先锋混合型证券投资基金业绩比较基准及修改基金合同的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 1 月 20 日
6	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 1 月 22 日
7	诺安基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 1 月 26 日
8	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过江苏银行办理申购起点、最低赎回份额、最低持有份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 1 月 29 日
9	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 2 期-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 2 月 2 日
10	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 2 期-正文	基金管理人网站	2018 年 2 月 2 日
11	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中原银行办理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》	2018 年 2 月 2 日
12	诺安基金管理有限公司关于延长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》	2018 年 2 月 6 日

13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在恒天明泽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》	2018 年 2 月 9 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 9 日
15	诺安基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）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》	2018 年 3 月 20 日
16	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告	基金管理人网站	2018 年 3 月 29 日
17	诺安先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 29 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金根据流动性规定调整赎回费率的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 30 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下基金根据流动性规定修改基金合同和托管协议的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 31 日
20	诺安先锋混合型证券投资基金基金合同（2018 年 3 月修订）	基金管理人网站	2018 年 3 月 31 日
21	诺安先锋混合型证券投资基金托管协议（2018 年 3 月修订）	基金管理人网站	2018 年 3 月 31 日
22	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》	2018 年 3 月 31 日

23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加昆仑银行基金费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 31 日
24	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》	2018 年 3 月 31 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海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》	2018 年 4 月 3 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的费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 4 月 3 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商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》	2018 年 4 月 17 日
28	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 4 月 21 日
29	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行办理定期定额投资业务的规则的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 5 月 23 日
30	诺安基金管理有限公司关于延长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》	2018 年 5 月 30 日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河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》	2018 年 6 月 1 日

32	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券的费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 6 月 8 日
33	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票天齐锂业估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 6 月 16 日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票新光圆成估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 6 月 20 日
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在北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》	2018 年 6 月 22 日
36	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》	2018 年 6 月 29 日
37	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	2018 年 6 月 30 日
38	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	2018 年 7 月 2 日
39	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 7 月 18 日
40	诺安基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构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》	2018 年 7 月 20 日
41	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国联证券的费率优惠活动	《证券时报》、 《上海证券报》、	2018 年 8 月 1 日

	动的公告	《中国证券报》	
42	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2018 年第 1 期-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 8 月 3 日
43	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2018 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2018 年 8 月 3 日
44	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 8 月 15 日
45	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信银行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》	2018 年 8 月 15 日
46	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信建投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》	2018 年 8 月 15 日
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东北证券的费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 8 月 21 日
48	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年半年度报告	基金管理人网站	2018 年 8 月 27 日
49	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年半年度报告-摘要	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 8 月 27 日
50	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达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》	2018 年 9 月 4 日
51	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在东海证券开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 9 月 10 日

52	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在信达证券开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 9 月 11 日
53	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票美的集团估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 9 月 22 日
54	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票云南白药估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 9 月 27 日
55	诺安基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）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》	2018 年 10 月 12 日
56	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京农村商业银行开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 10 月 16 日
57	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 10 月 26 日
58	诺安基金管理有限公司关于增加南京苏宁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》	2018 年 11 月 12 日
59	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过宁波银行办理申购起点、追加申购起点的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2018 年 12 月 7 日
60	诺安基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为旗下部分	《证券时报》、 《上海证券报》、	2018 年 12 月 27 日

	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	《中国证券报》	
61	诺安基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份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、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》	2018 年 12 月 27 日
62	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“2019 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》	2018 年 12 月 28 日
63	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行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》	2018 年 12 月 28 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

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，我司于 2018 年 3 月 31 日在公司网站和指定媒体发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金根据流动性规定修改基金合同和托管协议的公告》的公告，对旗下部分基金的《基金合同》、《托管协议》的相关条款进行修订。



## § 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 2018 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

2019 年 3 月 27 日