

# 诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2016 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 2 月 16 日（基金合同生效日）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.....                         | 6         |
| 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>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 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>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 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.....                 | 12        |
| 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.....             | 13        |
| 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>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 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..... | 15        |
| 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>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 16        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>17</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 17        |
| 7.2 利润表.....                                 | 18        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 19        |
| 7.4 报表附注.....                                | 20        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 42        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 42        |
| 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.....       | 43        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 45        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 46        |
| 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.....      | 47        |
| 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.....   | 47        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 47        |
| 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 .....    | 47        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 48        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>49</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 49        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 49        |
| 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 .....     | 50        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>50</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>50</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 50        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 51        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 51        |
| 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 .....         | 51        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 51        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金   |
| 基金简称       | 诺安安鑫保本混合          |
| 基金主代码      | 002291            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2016年2月16日        |
| 基金管理人      | 诺安基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 4,591,984,262.12份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过投资组合保险策略，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳健增长。   |
| 投资策略 | <p>本基金主要采取固定比例投资组合保险（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略，在保本周期中，基金管理人对稳健资产和风险资产的配置严格按照保本模型进行优化动态调整，确保投资者投资本金的安全和收益的锁定。同时，基金管理人在严格的风险控制基础上，通过积极稳健的投资策略，力争为投资人取得超额回报。</p> <p>本基金的投资策略由三部分组成：资产配置策略、稳健资产投资策略、风险资产投资策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金资产配置原则是：在有效控制风险的基础上，根据类别资产市场相对风险度，按照固定比例投资组合保险（CPPI）策略动态调整稳健资产和风险资产的比例。</p> <p>2、稳健资产投资策略</p> <p>本基金通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。</p> <p>3、风险资产投资策略</p> <p>（1）股票投资策略</p> <p>本基金充分发挥管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。</p> <p>（2）股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。<br>(3) 权证投资策略<br>本基金在权证投资方面主要运用的策略包括：价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，本基金会结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。 |
| 业绩比较基准 | 保本周期同期限的 2 年期银行定期存款税后收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。  |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                        | 基金托管人                 |
|---------|------|------------------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 诺安基金管理有限公司                   | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 马宏                           | 田青                    |
|         | 联系电话 | 0755-83026688                | 010-67595096          |
|         | 电子邮箱 | info@lionfund.com.cn         | tianqingl.zh@ccb.com  |
| 客户服务电话  |      | 400-888-8998                 | 010-67595096          |
| 传真      |      | 0755-83026677                | 010-66275853          |
| 注册地址    |      | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址    |      | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码    |      | 518048                       | 100033                |
| 法定代表人   |      | 秦维舟                          | 王洪章                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |  |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                                    |
| 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<br>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 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼       |
| 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 |
| 基金保证人  | 中国投融资担保股份有限公司      | 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 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 | 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| 本期已实现收益              | 43,320,384.28    |
| 本期利润                 | -10,645,402.94   |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.0022          |
| 本期加权平均净值利润率          | -0.22%           |
| 本期基金份额净值增长率          | -0.30%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2016 年末</b>   |
| 期末可供分配利润             | -12,998,503.24   |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.0028          |
| 期末基金资产净值             | 4,578,985,758.88 |
| 期末基金份额净值             | 0.997            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2016 年末</b>   |
| 基金份额累计净值增长率          | -0.30%           |

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

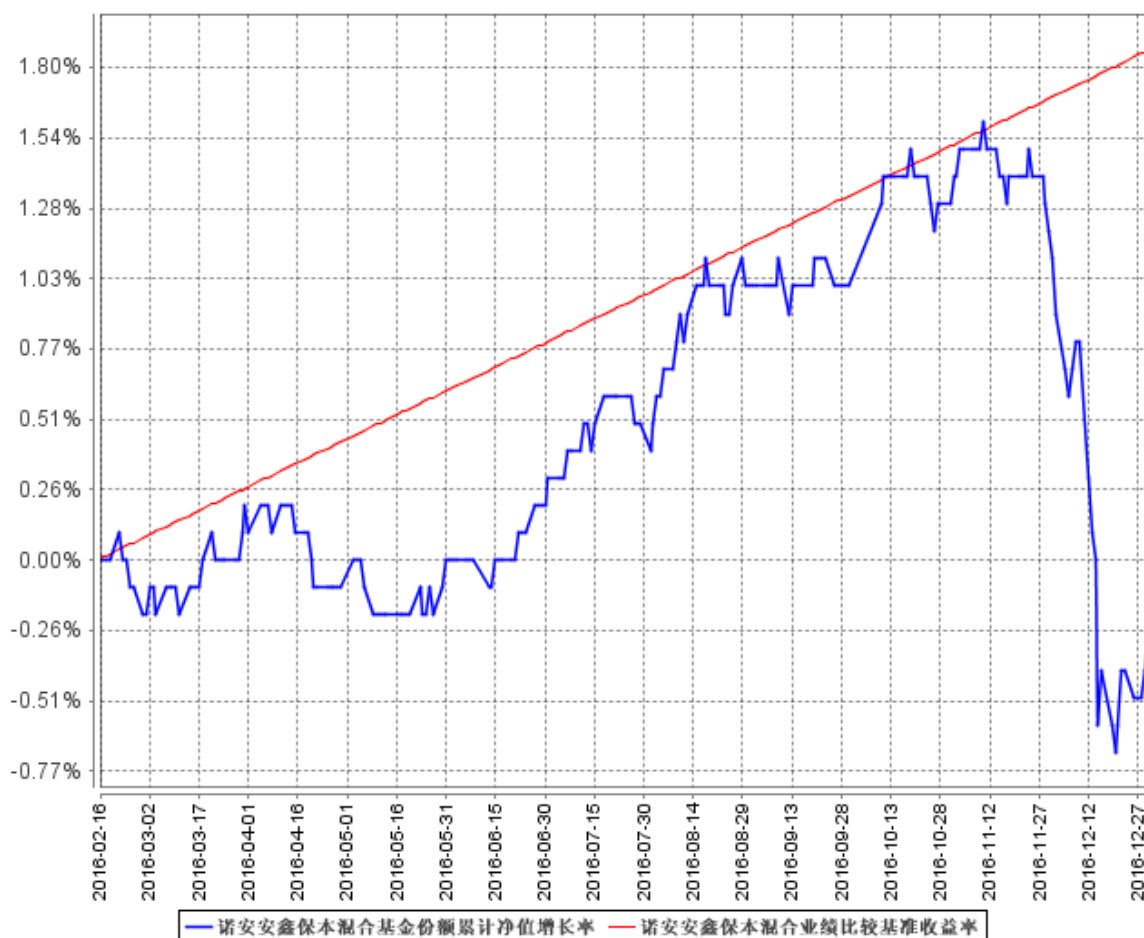
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -1.29%   | 0.14%       | 0.54%      | 0.01%         | -1.83% | 0.13% |
| 过去六个月      | -0.50%   | 0.11%       | 1.07%      | 0.01%         | -1.57% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.30%   | 0.09%       | 1.87%      | 0.01%         | -2.17% | 0.08% |

注：本基金的业绩比较基准为：保本周期同期限的 2 年期银行定期存款税后收益率。

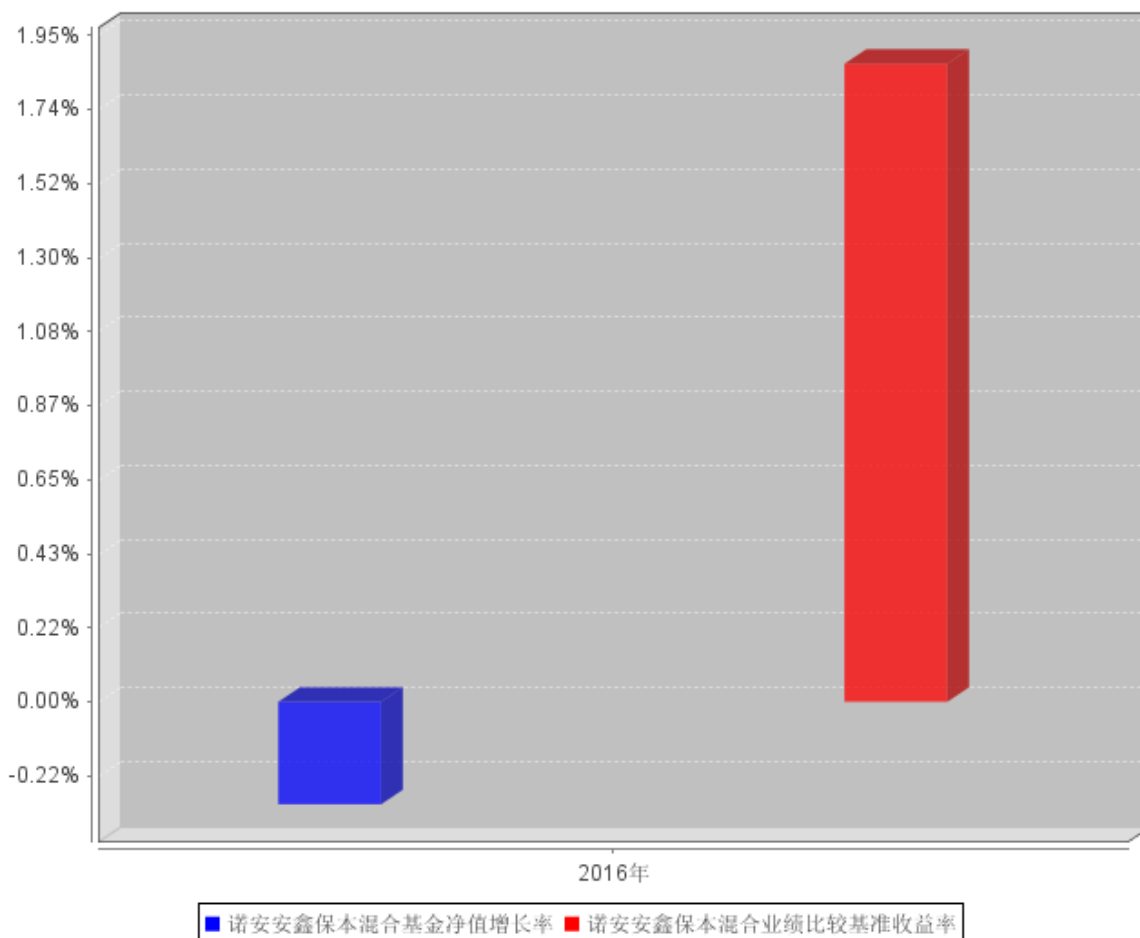
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 2016 年 2 月 16 日生效，2016 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 2 月 16 日生效，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 52 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型

开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 谢志华 | 固定收益事业部副总经理、总裁助理，诺安纯债定期开放债券基金经理、诺安鸿鑫保本混合基金经理、诺安优化收益债券基金经理、 | 2016年2月16日      | -    | 11     | 理学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司，从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券基金经理，2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司，任投资经理，现任固定收益事业部副总经理、 |

|  |   |  |  |  |
|--|---|--|--|--|
|  | 诺安保本混合基金经理、诺安汇鑫保本混合基金经理、诺安聚利债券基金经理、诺安利鑫保本混合基金经理、诺安景鑫保本混合基金经理、诺安益鑫保本混合基金经理、诺安安鑫保本混合基金经理、诺安理财宝货币基金经理、诺安聚鑫宝货币基金经理、诺安货币基金经理、诺安和鑫保本混合基金经理。 |  |  | 总裁助理。2013 年 11 月至 2016 年 2 月任诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理，2015 年 3 月至 2016 年 2 月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券基金经理，2013 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安信用债券一年定期开放债券基金经理，2014 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安永鑫收益一年定期开放债券基金经理，2013 年 8 月至 2016 年 3 月任诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理。2013 年 5 月起任诺安鸿鑫保本混合及诺安纯债定期开放债券基金经理，2013 年 12 月起任诺安优化收益债券基金经理，2014 年 11 月起任诺安保本混合、诺安汇鑫保本混合及诺安聚利债券基金经理，2015 年 12 月起任诺安利鑫保本混合及诺安景鑫保本混合基金经理，2016 年 1 月起任诺安益鑫保本混合基金经理，2016 年 2 月起任诺安安鑫保本混合、诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理，2016 年 4 月任诺安和鑫保本混合基金经理。 |
|--|---|--|--|--|

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间, 诺安安鑫保本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《诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定, 遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3 日内、5 日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情

况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年前三季度，在充裕的流动性推动下，债券市场延续了前两年的牛市行情，收益率震荡下行，降至历史较低水平。四季度货币政策边际收紧，金融去杠杆导向下监管政策有所趋严，市场预期转变，收益率快速上行，至年末收益率普遍大幅高于年初。

投资运作上，诺安安鑫保本混合缓步建仓，控制了建仓节奏和组合久期，以较低仓位进行了股票的波段操作。

##### 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 0.997 元。本报告期基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，金融去杠杆进程预计仍将延续，货币政策稳健中性背景下资金面可能维持紧平衡。在去杠杆阶段性完成后，重点关注来自于基本面的机会，此外还需关注美联储加息进程、市场风险偏好变化等因素。

诺安安鑫保本混合将在当前配置的基础上，积极寻找调整后可能出现的机会，并积极进行股票的波段操作。同时将继续加强对持仓债券信用资质的跟踪管理，严控信用风险。

#### 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五十二只开放式基金—诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债

券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期末有收益分配事项。

#### 4.9 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 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     | 德师报(审)字(17)第 P00747 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      | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金全体持有人   |
| 引言段          | 我们审计了后附的诺安安鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“诺安安鑫保本混合”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。   |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是诺安安鑫保本混合的基金管理人诺安基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)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而导致的重大错报。   |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。<br>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总 |



|           |  |     |
|-----------|--|-----|
|           | 体列报。<br>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。  |     |
| 审计意见段     | 我们认为，诺安安鑫保本混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了诺安安鑫保本混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |     |
| 注册会计师的姓名  | 王明静  | 江丽雅 |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)   |     |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海  |     |
| 审计报告日期    | 2017 年 3 月 29 日  |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：诺安安鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 108,587,178.12          |
| 结算备付金      |         | 1,939,939.54            |
| 存出保证金      |         | 123,188.68              |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 3,311,783,325.91        |
| 其中：股票投资    |         | 63,787,579.91           |
| 基金投资       |         | -                       |
| 债券投资       |         | 3,247,995,746.00        |
| 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 | 1,116,312,994.47        |
| 应收证券清算款    |         | -                       |
| 应收利息       | 7.4.7.5 | 49,004,095.91           |
| 应收股利       |         | -                       |
| 应收申购款      |         | -                       |
| 递延所得税资产    |         | -                       |
| 其他资产       | 7.4.7.6 | -                       |
| 资产总计       |         | 4,587,750,722.63        |

| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|-------------------------|
| <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       |          | -                       |
| 应付赎回款         |          | 2,411,570.08            |
| 应付管理人报酬       |          | 4,707,275.71            |
| 应付托管费         |          | 784,545.93              |
| 应付销售服务费       |          | -                       |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 744,330.26              |
| 应交税费          |          | -                       |
| 应付利息          |          | -                       |
| 应付利润          |          | -                       |
| 递延所得税负债       |          | -                       |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 117,241.77              |
| 负债合计          |          | 8,764,963.75            |
| <b>所有者权益:</b> |          |                         |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 4,591,984,262.12        |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -12,998,503.24          |
| 所有者权益合计       |          | 4,578,985,758.88        |
| 负债和所有者权益总计    |          | 4,587,750,722.63        |

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.997 元，基金份额总额 4,591,984,262.12 份。

②本会计期间为 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安安鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目         | 附注号      | 本期<br>2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016<br>年 12 月 31 日 |
|-------------|----------|---|
| <b>一、收入</b> |          | 50,574,470.22                                       |
| 1. 利息收入     |          | 114,725,968.29                                      |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.11 | 23,692,972.12                                       |
| 债券利息收入      |          | 53,659,370.72                                       |
| 资产支持证券利息收入  |          | -   |
| 买入返售金融资产收入  |          | 37,373,625.45                                       |

|                            |          |                |
|----------------------------|----------|----------------|
| 其他利息收入                     |          | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |          | -13,205,687.86 |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12 | -13,741,217.08 |
| 基金投资收益                     |          | -              |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13 | -85,621.00     |
| 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 | 621,150.22     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17 | -53,965,787.22 |
| 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 | 3,019,977.01   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | 61,219,873.16  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 50,874,757.51  |
| 2. 托管费                     |          | 8,479,126.20   |
| 3. 销售服务费                   |          | -              |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | 1,562,568.26   |
| 5. 利息支出                    |          | 71,281.14      |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 71,281.14      |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 232,140.05     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -10,645,402.94 |
| 减：所得税费用                    |          | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -10,645,402.94 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安安鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                |                  |
|--------------------------|---------------------------------------|----------------|------------------|
|                          | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初（基金合同生效日）所有者权益（基金净值） | 4,970,702,393.56                      | -              | 4,970,702,393.56 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                                     | -10,645,402.94 | -10,645,402.94   |



### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,公允价值变

动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(2)贷款及应收款项

#### 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

#### (3) 其他金融负债

##### 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值小组认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值小组认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

(4) 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

#### 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值小组同意，可参考类似投

资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法), 调整最近交易市价, 确定公允价值。

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

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

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

#### 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别确定公允价值。

#### 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

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

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

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

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值, 基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性, 被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;



第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### 2. 投资收益

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

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

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

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

### 3. 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬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。

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

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 保本周期内，本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；保本周期到期后，若本基金按基金合同约定变更为“诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金”，则基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政

策和会计估计。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳, 个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (4) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。
- (5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 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<br>2016年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 108,587,178.12     |
| 定期存款         | -                  |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  |
| 其他存款         | -                  |
| 合计：          | 108,587,178.12     |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016年12月31日 |                  |                  |
|---------------|--------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                 | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 63,707,130.86      | 63,787,579.91    | 80,449.05        |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场              | 412,999,086.56   | 403,073,746.00   |
|               | 银行间市场              | 2,889,042,895.71 | 2,844,922,000.00 |
|               | 合计                 | 3,302,041,982.27 | 3,247,995,746.00 |
| 资产支持证券        | -                  | -                | -                |
| 基金            | -                  | -                | -                |
| 其他            | -                  | -                | -                |
| 合计            | 3,365,749,113.13   | 3,311,783,325.91 | -53,965,787.22   |

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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<br>2016年12月31日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 1,116,312,994.47   | -         |
| 合计    | 1,116,312,994.47   | -         |

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末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<br>2016年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 52,072.08          |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 872.90             |
| 应收债券利息     | 48,249,120.94      |
| 应收买入返售证券利息 | 701,974.59         |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 其他         | 55.40              |
| 合计         | 49,004,095.91      |

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 661,733.29         |
| 银行间市场应付交易费用 | 82,596.97          |
| 合计          | 744,330.26         |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2016年12月31日 |
|-------|--------------------|
| 应付赎回费 | 36,911.77          |
| 其它应付款 | 330.00             |
| 预提费用  | 80,000.00          |
| 合计    | 117,241.77         |

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 4,970,702,393.56                      | 4,970,702,393.56 |
| 本期申购          | 3,352,064.32                          | 3,352,064.32     |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -382,070,195.76                       | -382,070,195.76  |
| 本期末           | 4,591,984,262.12                      | 4,591,984,262.12 |

注：1. 本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

2. 本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额的情况，详见于附注 7.4.1 基金基本情况。

#### 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        |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -             | -              | -              |
| 本期利润           | 43,320,384.28 | -53,965,787.22 | -10,645,402.94 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,464,078.41 | 110,978.11     | -2,353,100.30  |
| 其中：基金申购款       | 17,557.58     | 8,719.65       | 26,277.23      |
| 基金赎回款          | -2,481,635.99 | 102,258.46     | -2,379,377.53  |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 40,856,305.87 | -53,854,809.11 | -12,998,503.24 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | 22,354,999.99                         |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 341,909.18                            |
| 其他        | 759.96                                |
| 合计        | 23,692,972.12                         |

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

#### 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<br>2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|----|---------------------------------------|
|    |                                       |

|            |                |
|------------|----------------|
| 卖出股票成交总额   | 490,310,924.84 |
| 减：卖出股票成本总额 | 504,052,141.92 |
| 买卖股票差价收入   | -13,741,217.08 |

#### 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                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额   | 292,588,446.35                  |
| 减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 286,511,508.66                  |
| 减：应收利息总额               | 6,162,558.69                    |
| 买卖债券差价收入               | -85,621.00                      |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 621,150.22                      |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               |
| 合计          | 621,150.22                      |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -53,965,787.22                  |
| ——股票投资     | 80,449.05                       |
| ——债券投资     | -54,046,236.27                  |
| ——资产支持证券投资 | -                               |
| ——贵金属投资    | -                               |
| ——其他       | -                               |
| 2. 衍生工具    | -                               |
| ——权证投资     | -                               |
| 3. 其他      | -                               |

|    |                |
|----|----------------|
| 合计 | -53,965,787.22 |
|----|----------------|

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 1,917,934.10                    |
| 基金转换费收入 | 4,317.41                        |
| 其他      | 1,097,725.50                    |
| 合计      | 3,019,977.01                    |

注：本报告期内“其他”为募集期后利息收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,547,543.26                    |
| 银行间市场交易费用 | 15,025.00                       |
| 合计        | 1,562,568.26                    |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                              |
|-------|---------------------------------|
|       | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 审计费用  | 80,000.00                       |
| 信息披露费 | 80,000.00                       |
| 汇划费   | 53,140.05                       |
| 开户费   | 400.00                          |
| 账户维护费 | 18,600.00                       |
| 律师费用  | -                               |
| 合计    | 232,140.05                      |

### 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，本基金无需要披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露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                |
|------------|------------------------|
| 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 |



|                |          |
|----------------|----------|
| 中国建设银行股份有限公司   | 托管人、代销机构 |
| 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    |

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                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2016年2月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 50,874,757.51                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 17,487,333.07                   |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期   |  |
|----------------|--|--|
|                | 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |  |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,479,126.20                               |  |

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

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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   |            |
|--------------|--|------------|
|              | 2016 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |            |
|              | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 中国建设银行股份有限公司 | 108,587,178.12                             | 995,302.99 |

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

#### 7.4.10.6 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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

## 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                  |                 |        |       |        |              |            |              |    |
|----------------------|------|------------------|-----------------|--------|-------|--------|--------------|------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日            | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额       | 备注 |
| 300508               | 维宏股份 | 2016 年 4 月 12 日  | 2017 年 4 月 19 日 | 新股流通受限 | 20.08 | 121.49 | 10,383       | 208,490.64 | 1,261,430.67 | -  |
| 601375               | 中原证券 | 2016 年 12 月 20 日 | 2017 年 1 月 3 日  | 新股流通受限 | 4.00  | 4.00   | 26,695       | 106,780.00 | 106,780.00   | -  |
| 603228               | 景旺电子 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 6 日  | 新股流通受限 | 23.16 | 23.16  | 3,491        | 80,851.56  | 80,851.56    | -  |
| 603877               | 太平鸟  | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 9 日  | 新股流通受限 | 21.30 | 21.30  | 3,180        | 67,734.00  | 67,734.00    | -  |
| 300583               | 赛托生物 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 6 日  | 新股流通受限 | 40.29 | 40.29  | 1,582        | 63,738.78  | 63,738.78    | -  |
| 603689               | 皖天然气 | 2016 年 12 月 30 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股流通受限 | 7.87  | 7.87   | 4,818        | 37,917.66  | 37,917.66    | -  |
| 603035               | 常熟汽饰 | 2016 年 12 月 27 日 | 2017 年 1 月 5 日  | 新股流通受限 | 10.44 | 10.44  | 2,316        | 24,179.04  | 24,179.04    | -  |
| 603266               | 天龙股份 | 2016 年 12 月 30 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股流通受限 | 14.63 | 14.63  | 1,562        | 22,852.06  | 22,852.06    | -  |
| 300587               | 天铁股份 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 5 日  | 新股流通受限 | 14.11 | 14.11  | 1,438        | 20,290.18  | 20,290.18    | -  |
| 002840               | 华统股份 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股流通受限 | 6.55  | 6.55   | 1,814        | 11,881.70  | 11,881.70    | -  |
| 002838               | 道恩   | 2016 年           | 2017 年          | 新股流    | 15.28 | 15.28  | 681          | 10,405.68  | 10,405.68    | -  |

|        | 股份   | 12月28日      | 1月6日       | 通受限    |      |      |       |           |           |   |
|--------|------|-------------|------------|--------|------|------|-------|-----------|-----------|---|
| 603186 | 华正新材 | 2016年12月26日 | 2017年1月3日  | 新股流通受限 | 5.37 | 5.37 | 1,874 | 10,063.38 | 10,063.38 | - |
| 603032 | 德新交运 | 2016年12月27日 | 2017年1月5日  | 新股流通受限 | 5.81 | 5.81 | 1,628 | 9,458.68  | 9,458.68  | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016年12月26日 | 2017年1月4日  | 新股流通受限 | 9.30 | 9.30 | 1,006 | 9,355.80  | 9,355.80  | - |
| 300591 | 万里马  | 2016年12月30日 | 2017年1月10日 | 新股流通受限 | 3.07 | 3.07 | 2,397 | 7,358.79  | 7,358.79  | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016年12月27日 | 2017年1月5日  | 新股流通受限 | 4.94 | 4.94 | 1,380 | 6,817.20  | 6,817.20  | - |

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限债券和权证。

#### 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 |
|--------|------|-------------|------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 000887 | 中鼎股份 | 2016年11月18日 | 重大事项 | 24.85  | 2017年2月15日 | 23.99  | 599,905 | 15,372,070.35 | 14,907,639.25 | -  |
| 603986 | 兆易创新 | 2016年9月19日  | 重大事项 | 177.97 | 2017年3月13日 | 195.77 | 1,133   | 26,353.58     | 201,640.01    | -  |
| 002795 | 永和智控 | 2016年12月2日  | 重大事项 | 91.60  | 2017年3月22日 | 82.44  | 1,450   | 21,532.50     | 132,820.00    | -  |
| 300526 | 中潜股份 | 2016年12月7日  | 重大事项 | 107.03 | -          | -      | 984     | 10,332.00     | 105,317.52    | -  |
| 002798 | 帝王洁具 | 2016年11月2日  | 重大事项 | 67.00  | 2017年1月17日 | 60.34  | 1,056   | 11,161.92     | 70,752.00     | -  |

|        |          |                        |          |       |                    |       |       |          |           |   |
|--------|----------|------------------------|----------|-------|--------------------|-------|-------|----------|-----------|---|
| 300537 | 广信材<br>料 | 2016 年<br>10 月 12<br>日 | 重大事<br>项 | 48.79 | 2017 年 1<br>月 13 日 | 43.91 | 1,024 | 9,410.56 | 49,960.96 | - |
|--------|----------|------------------------|----------|-------|--------------------|-------|-------|----------|-----------|---|

### 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 2016 年 12 月 31 日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无债券作为质押。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险,并设定适当的投资限额,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成:第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导;第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部及风险控制部所监控;第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

#### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,并且通过分散化投资以降低信用风险。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,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

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1    | 189,102,000.00          |
| A-1 以下 | -                       |
| 未评级    | 1,228,795,000.00        |
| 合计     | 1,417,897,000.00        |

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

②以上未评级的债券为期限在一年以内(含一年)的国债、政策性金融债、央行票据及超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 776,707,030.40          |
| AAA 以下 | 520,188,715.60          |
| 未评级    | 533,203,000.00          |
| 合计     | 1,830,098,746.00        |

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

②以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本

和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所持有的大部分金融资产和金融负债均计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上受市场利率变化的影响。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、债券投资及买入返售金融资产等。

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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<br>2016 年<br>12 月 31<br>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                          | 108,587,178.12   | -              | -                | -              | -              | 108,587,178.12   |
| 结算备付金                         | 1,939,939.54     | -              | -                | -              | -              | 1,939,939.54     |
| 存出保证金                         | 123,188.68       | -              | -                | -              | -              | 123,188.68       |
| 交易性金融资产                       | 1,304,501,149.20 | 198,849,000.00 | 1,162,992,596.80 | 581,653,000.00 | 63,787,579.91  | 3,311,783,325.91 |
| 买入返售金融资产                      | 1,116,312,994.47 | -              | -                | -              | -              | 1,116,312,994.47 |
| 应收利息                          | -                | -              | -                | -              | 49,004,095.91  | 49,004,095.91    |
| 资产总计                          | 2,531,464,450.01 | 198,849,000.00 | 1,162,992,596.80 | 581,653,000.00 | 112,791,675.82 | 4,587,750,722.63 |
| 负债                            |                  |                |                  |                |                |                  |
| 应付赎回款                         | -                | -              | -                | -              | 2,411,570.08   | 2,411,570.08     |
| 应付管理人报酬                       | -                | -              | -                | -              | 4,707,275.71   | 4,707,275.71     |

|         |                  |                |                  |                |                |                  |
|---------|------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 应付托管费   | -                | -              | -                | -              | 784,545.93     | 784,545.93       |
| 应付交易费用  | -                | -              | -                | -              | 744,330.26     | 744,330.26       |
| 其他负债    | -                | -              | -                | -              | 117,241.77     | 117,241.77       |
| 负债总计    | -                | -              | -                | -              | 8,764,963.75   | 8,764,963.75     |
| 利率敏感度缺口 | 2,531,464,450.01 | 198,849,000.00 | 1,162,992,596.80 | 581,653,000.00 | 104,026,712.07 | 4,578,985,758.88 |

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |               |   |
|----|---------------|---|
| 假设 | 市场利率发生变化      |   |
|    | 其他市场变量保持不变    |   |
| 分析 | 相关风险变量的变动     | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）<br>本期末（2016年12月31日） |
|    | 市场利率下降 27 个基点 | 19,753,498.13<br>-                              |
|    | 市场利率上升 27 个基点 | -19,753,498.13                                  |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金所面临的其他价格风险主要由所持有的金融工具的公允价值决定。通过分散化投资，本基金有效降低了投资组合的其他价格风险，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。

基金的投资组合比例为：债券、银行存款、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%。股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中本基金持有的全部



权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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<br>2016 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 63,787,579.91           | 1.39          |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | 3,247,995,746.00        | 70.93         |
| 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            | 3,311,783,325.91        | 72.32         |

#### 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. 置信度 95%        |                        |
|   | 2. 观察期 一年         |                        |
| 分析  | 风险价值<br>(单位：人民币元) | 本期末 (2016 年 12 月 31 日) |
|   | 基金投资组合的风险价值       | 4,697,267.30           |
|   | 合计                | 4,697,267.30           |

#### 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) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

### ②各层级金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 52,532,314.86 元，属于第二层级的余额为 3,258,761,326.54 元，属于第三层级的余额为 489,684.51 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票。

### ③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；除证券交易所上市的可转换债券外，其他固定收益品种采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 63,787,579.91    | 1.39          |
|    | 其中：股票             | 63,787,579.91    | 1.39          |
| 2  | 固定收益投资            | 3,247,995,746.00 | 70.80         |
|    | 其中：债券             | 3,247,995,746.00 | 70.80         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 1,116,312,994.47 | 24.33         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 110,527,117.66   | 2.41          |
| 7  | 其他各项资产            | 49,127,284.59    | 1.07          |
| 8  | 合计                | 4,587,750,722.63 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 40,221.20     | 0.00         |
| C  | 制造业              | 61,736,913.03 | 1.35         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,917.66     | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 118,924.74    | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 185,794.62    | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 9,458.68      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,551,569.98  | 0.03         |
| J  | 金融业              | 106,780.00    | 0.00         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 63,787,579.91 | 1.39         |

### 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  | 600771 | 广誉远  | 1,313,572 | 43,925,847.68 | 0.96         |
| 2  | 000887 | 中鼎股份 | 599,905   | 14,907,639.25 | 0.33         |
| 3  | 300508 | 维宏股份 | 10,383    | 1,261,430.67  | 0.03         |
| 4  | 600996 | 贵广网络 | 12,500    | 234,875.00    | 0.01         |
| 5  | 601127 | 小康股份 | 8,662     | 231,621.88    | 0.01         |
| 6  | 603986 | 兆易创新 | 1,133     | 201,640.01    | 0.00         |
| 7  | 603708 | 家家悦  | 5,874     | 185,794.62    | 0.00         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 8  | 002831 | 裕同科技 | 2,219  | 153,554.80 | 0.00 |
| 9  | 002795 | 永和智控 | 1,450  | 132,820.00 | 0.00 |
| 10 | 603823 | 百合花  | 3,762  | 123,167.88 | 0.00 |
| 11 | 300568 | 星源材质 | 1,310  | 107,262.80 | 0.00 |
| 12 | 601375 | 中原证券 | 26,695 | 106,780.00 | 0.00 |
| 13 | 300526 | 中潜股份 | 984    | 105,317.52 | 0.00 |
| 14 | 603098 | 森特股份 | 4,293  | 103,332.51 | 0.00 |
| 15 | 300570 | 太辰光  | 1,810  | 100,093.00 | 0.00 |
| 16 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641  | 88,403.48  | 0.00 |
| 17 | 603228 | 景旺电子 | 3,491  | 80,851.56  | 0.00 |
| 18 | 603878 | 武进不锈 | 2,000  | 80,000.00  | 0.00 |
| 19 | 603660 | 苏州科达 | 2,353  | 75,813.66  | 0.00 |
| 20 | 603928 | 兴业股份 | 2,670  | 74,359.50  | 0.00 |
| 21 | 603585 | 苏利股份 | 1,041  | 72,578.52  | 0.00 |
| 22 | 002798 | 帝王洁具 | 1,056  | 70,752.00  | 0.00 |
| 23 | 002832 | 比音勒芬 | 1,158  | 70,290.60  | 0.00 |
| 24 | 603577 | 汇金通  | 2,460  | 69,642.60  | 0.00 |
| 25 | 603218 | 日月股份 | 1,652  | 68,805.80  | 0.00 |
| 26 | 603877 | 太平鸟  | 3,180  | 67,734.00  | 0.00 |
| 27 | 300583 | 赛托生物 | 1,582  | 63,738.78  | 0.00 |
| 28 | 002827 | 高争民爆 | 2,059  | 60,905.22  | 0.00 |
| 29 | 603033 | 三维股份 | 1,160  | 59,821.20  | 0.00 |
| 30 | 002826 | 易明医药 | 2,181  | 57,316.68  | 0.00 |
| 31 | 601882 | 海天精工 | 2,148  | 54,215.52  | 0.00 |
| 32 | 603416 | 信捷电气 | 1,076  | 53,886.08  | 0.00 |
| 33 | 002825 | 纳尔股份 | 1,139  | 53,521.61  | 0.00 |
| 34 | 603036 | 如通股份 | 2,114  | 51,771.86  | 0.00 |
| 35 | 300537 | 广信材料 | 1,024  | 49,960.96  | 0.00 |
| 36 | 603559 | 中通国脉 | 899    | 48,447.11  | 0.00 |
| 37 | 002833 | 弘亚数控 | 2,743  | 48,331.66  | 0.00 |
| 38 | 603389 | 亚振家居 | 1,963  | 47,327.93  | 0.00 |
| 39 | 603058 | 永吉股份 | 3,869  | 42,675.07  | 0.00 |
| 40 | 603319 | 湘油泵  | 721    | 40,736.50  | 0.00 |
| 41 | 002828 | 贝肯能源 | 1,042  | 40,221.20  | 0.00 |
| 42 | 603886 | 元祖股份 | 2,242  | 39,683.40  | 0.00 |
| 43 | 603689 | 皖天然气 | 4,818  | 37,917.66  | 0.00 |
| 44 | 300582 | 英飞特  | 1,359  | 35,157.33  | 0.00 |
| 45 | 603239 | 浙江仙通 | 924    | 29,059.80  | 0.00 |
| 46 | 002835 | 同为股份 | 1,126  | 24,220.26  | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 47 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | 0.00 |
| 48 | 603266 | 天龙股份 | 1,562 | 22,852.06 | 0.00 |
| 49 | 300587 | 天铁股份 | 1,438 | 20,290.18 | 0.00 |
| 50 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | 0.00 |
| 51 | 002840 | 华统股份 | 1,814 | 11,881.70 | 0.00 |
| 52 | 002838 | 道恩股份 | 681   | 10,405.68 | 0.00 |
| 53 | 603186 | 华正新材 | 1,874 | 10,063.38 | 0.00 |
| 54 | 603032 | 德新交运 | 1,628 | 9,458.68  | 0.00 |
| 55 | 300586 | 美联新材 | 1,006 | 9,355.80  | 0.00 |
| 56 | 300591 | 万里马  | 2,397 | 7,358.79  | 0.00 |
| 57 | 300588 | 熙菱信息 | 1,380 | 6,817.20  | 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末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 000503 | 海虹控股 | 169,506,204.99 | 3.70            |
| 2  | 600771 | 广誉远  | 72,372,261.34  | 1.58            |
| 3  | 601616 | 广电电气 | 59,390,392.02  | 1.30            |
| 4  | 601328 | 交通银行 | 56,514,538.20  | 1.23            |
| 5  | 002197 | 证通电子 | 39,998,475.69  | 0.87            |
| 6  | 601818 | 光大银行 | 34,163,215.00  | 0.75            |
| 7  | 300418 | 昆仑万维 | 23,556,050.90  | 0.51            |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 19,998,681.85  | 0.44            |
| 9  | 002104 | 恒宝股份 | 19,997,789.42  | 0.44            |
| 10 | 000887 | 中鼎股份 | 15,372,070.35  | 0.34            |
| 11 | 300229 | 拓尔思  | 14,870,472.44  | 0.32            |
| 12 | 000961 | 中南建设 | 9,999,311.00   | 0.22            |
| 13 | 600570 | 恒生电子 | 9,998,472.00   | 0.22            |
| 14 | 000861 | 海印股份 | 7,682,067.20   | 0.17            |
| 15 | 002353 | 杰瑞股份 | 4,016,520.68   | 0.09            |
| 16 | 601229 | 上海银行 | 1,837,844.48   | 0.04            |
| 17 | 600919 | 江苏银行 | 1,288,873.74   | 0.03            |
| 18 | 601163 | 三角轮胎 | 479,868.01     | 0.01            |
| 19 | 601997 | 贵阳银行 | 436,725.60     | 0.01            |
| 20 | 600977 | 中国电影 | 399,633.84     | 0.01            |

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末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 000503 | 海虹控股 | 160,469,103.23 | 3.50            |
| 2  | 601616 | 广电电气 | 60,654,261.33  | 1.32            |
| 3  | 601328 | 交通银行 | 56,386,315.06  | 1.23            |
| 4  | 601818 | 光大银行 | 34,374,961.44  | 0.75            |
| 5  | 002197 | 证通电子 | 33,551,656.82  | 0.73            |
| 6  | 600771 | 广誉远  | 23,777,034.27  | 0.52            |
| 7  | 300418 | 昆仑万维 | 22,442,506.08  | 0.49            |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 18,621,925.30  | 0.41            |
| 9  | 002104 | 恒宝股份 | 15,079,804.28  | 0.33            |
| 10 | 300229 | 拓尔思  | 12,731,325.53  | 0.28            |
| 11 | 000961 | 中南建设 | 11,105,508.50  | 0.24            |
| 12 | 600570 | 恒生电子 | 7,947,260.55   | 0.17            |
| 13 | 000861 | 海印股份 | 7,353,350.13   | 0.16            |
| 14 | 002353 | 杰瑞股份 | 4,299,559.74   | 0.09            |
| 15 | 601229 | 上海银行 | 2,523,349.40   | 0.06            |
| 16 | 600919 | 江苏银行 | 2,126,134.08   | 0.05            |
| 17 | 600977 | 中国电影 | 1,096,590.55   | 0.02            |
| 18 | 601997 | 贵阳银行 | 897,341.86     | 0.02            |
| 19 | 601163 | 三角轮胎 | 769,741.27     | 0.02            |
| 20 | 002797 | 第一创业 | 687,220.93     | 0.02            |

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 | 567,759,272.78 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 490,310,924.84 |

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      | 812,783,000.00   | 17.75 |
|    | 其中：政策性金融债 | 812,783,000.00   | 17.75 |
| 4  | 企业债券      | 456,250,400.00   | 9.96  |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,138,317,000.00 | 24.86 |
| 6  | 中期票据      | 832,528,000.00   | 18.18 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 8,117,346.00     | 0.18  |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 3,247,995,746.00 | 70.93 |

### 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  | 160210    | 16 国开 10          | 4,500,000 | 432,765,000.00 | 9.45         |
| 2  | 160414    | 16 农发 14          | 2,800,000 | 279,580,000.00 | 6.11         |
| 3  | 101551027 | 15 中建三局<br>MTN001 | 500,000   | 50,480,000.00  | 1.10         |
| 4  | 011699771 | 16 张江<br>SCP001   | 500,000   | 50,135,000.00  | 1.09         |
| 5  | 011699793 | 16 中原高速<br>SCP001 | 500,000   | 50,130,000.00  | 1.09         |

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除广誉远外，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。

2016年5月18日，广誉远中药股份有限公司收到上海证券交易所《关于对广誉远中药股份有限公司子公司涉诉事项的监管工作函》，公司于2016年5月25日公告《广誉远中药股份有限公司关于上海证券交易所对公司子公司涉诉事项的监管工作函的回复公告》。主要因为公司子公司山西广誉远国药有限公司的前身为山西中药厂，1994年12月12日，山西中药厂为太谷县纺织厂在国家开发银行的1800万元银行借款提供连带责任保证。2003年，西安东盛集团有限公司受让山西广誉远95%股权；2007年，公司受让山西广誉远95%股权。该对外担保事项在东盛集团2003年受让山西广誉远股权时未在审计报告、评估报告中列示。因此，东盛集团及公司在涉诉事项发生前，一直未知有该笔对外担保的存在，亦无法履行信息披露义务。鉴于以上情况，该笔担保债务实际承担人为晋中市国资委，公司认为本诉讼不会对山西广誉远本期及期后利润产生影响，亦不会对其持续经营和盈利能力产生影响。

截至本报告期末，广誉远（600771）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司经营业绩出现拐点，成长性较好，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有广誉远。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 123,188.68 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |



|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | -             |
| 4 | 应收利息  | 49,004,095.91 |
| 5 | 应收申购款 | -             |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 49,127,284.59 |

#### 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  | 110035 | 白云转债 | 2,934,633.60 | 0.06          |
| 2  | 127003 | 海印转债 | 1,005,255.60 | 0.02          |
| 3  | 113010 | 江南转债 | 762,660.00   | 0.02          |

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1  | 000887 | 中鼎股份 | 14,907,639.25 | 0.33          | 重大事项     |
| 2  | 300508 | 维宏股份 | 1,261,430.67  | 0.03          | 新股流通受限   |
| 3  | 603986 | 兆易创新 | 201,640.01    | 0.00          | 重大事项     |
| 4  | 002795 | 永和智控 | 132,820.00    | 0.00          | 重大事项     |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 18,518       | 247,974.09    | 1,108,880,975.96 | 24.15%     | 3,483,103,286.16 | 75.85%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年2月16日）基金份额总额          | 4,970,702,393.56 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 4,970,702,393.56 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 3,352,064.32     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 382,070,195.76   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期末基金份额总额                        | 4,591,984,262.12 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 8 万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：4 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 方正证券 | 1      | 577,967,314.67 | 55.16%       | 528,373.35 | 54.70%     | -  |
| 华西证券 | 1      | 469,780,133.25 | 44.84%       | 437,505.85 | 45.30%     | -  |

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期新增 2 家证券公司的 2 个交易单元：方正证券股份有限公司(1 个交易单元)、华西证券股份有限公司(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 |
| 方正证券 | -             | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华西证券 | 77,317,580.36 | 100.00%      | 48,867,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 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关于诺安安鑫保本混合在直销网上交易开展基金认购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2016年1月11日 |
| 2  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金份额发售公告                    | 《中国证券报》 | 2016年1月11日 |
| 3  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金招募说明书                       | 《中国证券报》 | 2016年1月11日 |
| 4  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金保证合同                        | 基金管理人网站 | 2016年1月11日 |
| 5  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金托管协议                        | 基金管理人网站 | 2016年1月11日 |
| 6  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金合同摘要                      | 《中国证券报》 | 2016年1月11日 |
| 7  | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金合同                        | 基金管理人网站 | 2016年1月11日 |

|    |  |                                |                 |
|----|--|--------------------------------|-----------------|
| 8  | 诺安基金管理有限公司关于诺安安鑫保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告         | 《中国证券报》                        | 2016 年 1 月 15 日 |
| 9  | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海银行为代销机构的公告             | 《上海证券报》、<br>《中国证券报》            | 2016 年 1 月 16 日 |
| 10 | 诺安基金管理有限公司关于诺安安鑫保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告         | 《中国证券报》                        | 2016 年 1 月 18 日 |
| 11 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券费率优惠活动的公告            | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 1 月 20 日 |
| 12 | 诺安基金管理有限公司关于诺安安鑫保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告         | 《中国证券报》                        | 2016 年 1 月 20 日 |
| 13 | 诺安基金管理有限公司关于诺安安鑫保本混合型证券投资基金认购申请确认比例的公告       | 《中国证券报》                        | 2016 年 2 月 5 日  |
| 14 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金合同生效公告                      | 《中国证券报》                        | 2016 年 2 月 17 日 |
| 15 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 2 月 25 日 |
| 16 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加恒丰银行费率优惠活动的公告            | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 2 月 29 日 |
| 17 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国民生银行开通定投业务的公告           | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 3 月 21 日 |
| 18 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金                             | 《证券时报》、                        | 2016 年 4 月 1 日  |

|    |   |                                |                 |
|----|---|--------------------------------|-----------------|
|    | 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                                 | 《上海证券报》、<br>《中国证券报》            |                 |
| 19 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行关于“财智组合”基金申购费率优惠活动的公告                 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 4 月 7 日  |
| 20 | 诺安基金管理有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 4 月 12 日 |
| 21 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京汇成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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 4 月 28 日 |
| 22 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告                           | 《中国证券报》                        | 2016 年 5 月 9 日  |
| 23 | 诺安基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开展定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 5 月 10 日 |
| 24 | 诺安基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 5 月 10 日 |
| 25 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 5 月 10 日 |
| 26 | 诺安基金管理有限公司关于增加中证  | 《证券时报》、                        | 2016 年 5 月 24 日 |

|    |   |                                |                 |
|----|---|--------------------------------|-----------------|
|    | 金牛（北京）投资咨询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》、<br>《中国证券报》            |                 |
| 27 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在首创证券开通定投、转换业务的公告                             | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 5 月 27 日 |
| 28 | 诺安基金管理有限公司关于直销账户变更的公告   | 《中国证券报》                        | 2016 年 6 月 14 日 |
| 29 | 诺安基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 6 月 15 日 |
| 30 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务及开展优惠费率活动的公告              | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 6 月 17 日 |
| 31 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告                      | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 6 月 30 日 |
| 32 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2016 上半年最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告            | 基金管理人网站                        | 2016 年 7 月 1 日  |
| 33 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告                                  | 《中国证券报》                        | 2016 年 7 月 21 日 |
| 34 | 诺安基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 8 月 3 日  |
| 35 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京  | 《证券时报》、                        | 2016 年 8 月 18 日 |

|    |   |                                |                 |
|----|---|--------------------------------|-----------------|
|    | 格上富信投资顾问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》、<br>《中国证券报》            |                 |
| 36 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要                                 | 《中国证券报》                        | 2016 年 8 月 29 日 |
| 37 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告                                   | 基金管理人网站                        | 2016 年 8 月 29 日 |
| 38 | 诺安基金管理有限公司关于调整网上直销单笔申购、定投申请最低金额及赎回申请最低份额的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 8 月 30 日 |
| 39 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 6 日  |
| 40 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 6 日  |
| 41 | 诺安基金管理有限公司关于增加泰信财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 6 日  |
| 42 | 诺安基金管理有限公司关于通过网上直销现金宝账户申购（认购）及定投申购基金开展费率优惠活动的公告               | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 7 日  |
| 43 | 诺安基金管理有限公司关于直销网上交易开展基金申购（认购）及定投申购费率优惠活动的公告                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 12 日 |
| 44 | 诺安基金管理有限公司关于增加凤凰  | 《证券时报》、                        | 2016 年 9 月 14 日 |



|    |   |                                |                  |
|----|---|--------------------------------|------------------|
|    | 金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告             | 《上海证券报》、<br>《中国证券报》            |                  |
| 45 | 诺安基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 14 日  |
| 46 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告                | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 9 月 20 日  |
| 47 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 1 期-正文                      | 基金管理人网站                        | 2016 年 9 月 30 日  |
| 48 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）2016 年第 1 期-摘要                      | 《中国证券报》                        | 2016 年 9 月 30 日  |
| 49 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票海虹控股估值调整的公告                           | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 10 月 11 日 |
| 50 | 诺安基金管理有限公司关于增加天津国美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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 10 月 18 日 |
| 51 | 诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告                              | 《中国证券报》                        | 2016 年 10 月 25 日 |
| 52 | 诺安基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 10 月 26 日 |
| 53 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京电盈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           | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 10 月 26 日 |

|    |   |                                |             |
|----|---|--------------------------------|-------------|
|    | 展费率优惠活动的公告  |                                |             |
| 54 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年11月11日 |
| 55 | 诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告                                   | 《中国证券报》                        | 2016年11月15日 |
| 56 | 诺安基金管理有限公司关于督察长变更的公告                                      | 《中国证券报》                        | 2016年11月15日 |
| 57 | 诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过国美基金定投申购起点金额的公告                     | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年11月29日 |
| 58 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告              | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年11月29日 |
| 59 | 诺安基金管理有限公司关于增加和谐保险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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年12月7日  |
| 60 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中鼎股份估值调整的公告                         | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年12月13日 |
| 61 | 诺安基金管理有限公司关于增加北京懒猫金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告       | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016年12月14日 |
| 62 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通定投业务的公告                  | 《上海证券报》、<br>《中国证券报》            | 2016年12月19日 |
| 63 | 诺安基金管理有限公司关于调整旗下  | 《证券时报》、                        | 2016年12月27日 |

|    |  |                                |                  |
|----|--|--------------------------------|------------------|
|    | 部分基金通过部分代销机构办理认（申）购、定投业务起点金额的公告                  | 《上海证券报》、<br>《中国证券报》            |                  |
| 64 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券有限责任公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 12 月 28 日 |
| 65 | 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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 12 月 30 日 |
| 66 | 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“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 12 月 30 日 |
| 67 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加恒丰银行基金申购费率优惠活动的公告            | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》 | 2016 年 12 月 31 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 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安安鑫保本混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安安鑫保本混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安安鑫保本混合型证券投资基金保证合同》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥诺安安鑫保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安安鑫保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 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  
2017年3月30日