

# 诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
11.1 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.....	48

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中小盘精选混合型证券投资基金
基金简称	诺安中小盘精选混合
基金主代码	320011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 28 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	348,460,122.73 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安中小盘精选股票型证券投资基金”变更为“诺安中小盘精选混合型证券投资基金”

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资,在有效控制组合风险的基础上,力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为四部分:资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及权证投资策略。</p> <p>1、资产配置策略 本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择达到在承受一定风险的前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2、股票投资策略 本基金的股票投资策略分三步进行,首先是确定基本股票池,其次是进行个股基本面鉴别,最后是股票组合最终确认。</p> <p>3、债券投资策略 本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略,具体包括利率预测策略(Interest rate anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield spread analysis)以及个券估值策略(Valuation analysis)等。</p> <p>4、权证投资策略 本基金的权证投资部分主要运用的投资策略包括:价值发现策略和价差策略。作为辅助性投资工具,本基金结合自身资产状况审慎投资于权证资产,力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	中证 700 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。
--------	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	郭明
	联系电话	0755-83026688	(010)66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		秦维舟	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	7,750,867.67
本期利润	62,693,918.64
加权平均基金份额本期利润	0.1796
本期加权平均净值利润率	6.83%
本期基金份额净值增长率	7.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	545,511,293.11
期末可供分配基金份额利润	1.5655
期末基金资产净值	955,883,658.97
期末基金份额净值	2.743
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	189.41%

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

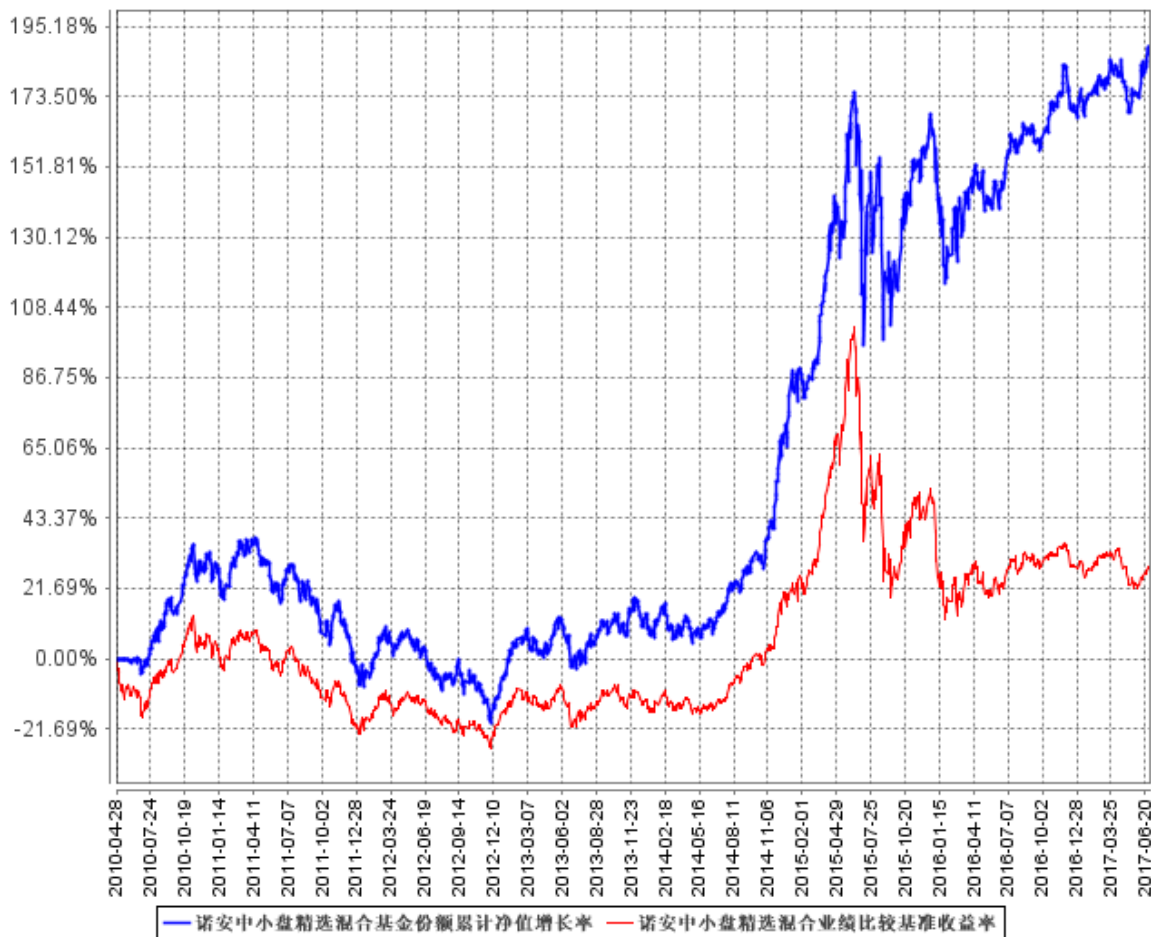
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.46%	0.69%	4.57%	0.64%	0.89%	0.05%
过去三个月	2.89%	0.67%	-1.87%	0.72%	4.76%	-0.05%
过去六个月	7.19%	0.59%	0.29%	0.64%	6.90%	-0.05%
过去一年	15.84%	0.60%	2.65%	0.67%	13.19%	-0.07%
过去三年	156.12%	1.58%	48.34%	1.57%	107.78%	0.01%
自基金合同生效起至今	189.41%	1.39%	28.45%	1.34%	160.96%	0.05%

注：自 2015 年 8 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由原来的“(60%×天相中盘指数+40%×天相小盘指数)×80%+20%×中证全债指数”，变更为“中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率



×20%”。

### 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：①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。

②自 2015 年 8 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由原来的“(60%×天相中盘指数+40%×天相小盘指数)×80%+20%×中证全债指数”，变更为“中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2017 年 6 月 30 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、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、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、诺安高端制造股票型证券投资基金等。

#### 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		
韩冬燕	投资二部执行	2016 年 9 月 13 日	-	13	硕士, 曾任职于华夏基金管理有限公司, 先后从事

	总监，诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理、诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理、诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理。			于基金清算、行业研究工作。2010 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，从事行业研究工作，现任投资二部执行总监。2015 年 11 月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安中小盘精选混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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。

#### **4.3.2 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**

随着去产能、去库存、供给侧改革等经济政策的推进，2017 年上半年经济的宏观基本面向好，CPI 保持稳定，工业企业的利润大幅上升，货币政策保持稳健中性，受宏观的经济金融因素影响，今年上半年的 A 股市场呈现指数震荡上行、结构分化明显的走势。估值仍然比较高的创业板和中小板中绝大多数公司股价均有较大的向下调整，但是中证 100、上证 50 这些指数中的蓝筹股都获得了比较大的上涨幅度。

从上半年各板块的盈利预期、宏观政策形势、估值等综合来看，我们认为消费制造、周期、金融板块的结构性机会有其业绩及产业趋势支持，考虑到长期增长的空间和持续性，我们二季度在结构配置上继续侧重于估值不高、长期增长相对确定的消费品制造和医药领域，集中持有估值不高、长期成长性比较好的公司。

#### **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 2.743 元。本报告期基金份额净值增长率为 7.19%，同期

业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2016 年 2 季度至今,中国经济增速超出预期,实体经济盈利逐步好转,经济呈现复苏态势,对于未来宏观经济走势的判断,我们认为既要考虑周期也要考虑结构;中国经济增长从 2010 年第 3 季度开始进入下行周期,经过将近 7 年的市场调整和经济政策的持续推进,其中还包含了 PPI 持续为负的三年多的实体经济通缩期,经济继续大幅回落的风险已经在很大程度上释放,但经济持续发展需要的结构改善和金融风险的释放都需要时间,且近期的经济复苏很大程度上靠政府的积极作为,市场力量和创新动力仍待提高,复苏将是一个曲折而漫长的过程。

影响证券市场未来走势的关键因素在于经济复苏的力度、质量和持续性,货币收紧的节奏和力度等。经济的短期复苏和业绩改善已在市场此前的上涨和结构性机会中有所反映,金融风险的释放仍然需要去杠杆,需要稳健中性的货币,流动性边际趋紧,市场进一步的上涨需要更多的基本面正向变化,或者风险偏好的进一步上行。经济的整体复苏是曲折的,产业层面呈现出来的制造业升级、消费升级、产业整合趋势虽然缓慢但却相对确定,我们将继续基于长期稳健增长和产业趋势变动的方向进行结构配置。

为持有人实现持续的复利增长是我们的职业追求,为此我们将精勤不倦。衷心感谢持有人把投资的任务托付给我们!

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于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,本报告期未有收益分配事项。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对诺安中小盘精选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，诺安中小盘精选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中小盘精选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，诺安中小盘精选混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半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中小盘精选混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	281,457,922.11	304,210,483.33
结算备付金		1,098,711.48	2,319,145.00
存出保证金		544,276.89	436,265.69
交易性金融资产	6.4.7.2	676,674,315.75	623,381,083.33
其中：股票投资		676,674,315.75	623,381,083.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	53,026.14	64,861.93
应收股利		-	-
应收申购款		1,012,779.33	351,185.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		960,841,031.70	930,763,024.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	11,259,548.60
应付赎回款		2,572,919.73	33,312,749.66
应付管理人报酬		1,150,720.24	1,243,317.32
应付托管费		191,786.71	207,219.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	904,542.20	1,393,412.90
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	137,403.85	265,283.83
负债合计		4,957,372.73	47,681,531.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	348,460,122.73	345,054,099.53
未分配利润	6.4.7.10	607,423,536.24	538,027,393.30
所有者权益合计		955,883,658.97	883,081,492.83
负债和所有者权益总计		960,841,031.70	930,763,024.71

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.743 元，基金份额总额 348,460,122.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		74,249,124.75	-18,264,749.38
1.利息收入		1,001,232.01	813,707.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,001,232.01	813,707.12
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,030,543.91	18,519,133.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,993,605.67	7,964,455.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,036,938.24	10,554,677.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	54,943,050.97	-38,135,554.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	274,297.86	537,963.96
<b>减：二、费用</b>		11,555,206.11	11,243,591.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,833,344.52	7,025,271.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,138,890.75	1,170,878.64
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	3,433,854.92	2,922,456.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	149,115.92	124,984.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,693,918.64	-29,508,341.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,693,918.64	-29,508,341.10

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	345,054,099.53	538,027,393.30	883,081,492.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,693,918.64	62,693,918.64
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）	3,406,023.20	6,702,224.30	10,108,247.50
其中：1.基金申购款	118,532,936.21	195,264,269.27	313,797,205.48
2.基金赎回款	-115,126,913.01	-188,562,044.97	-303,688,957.98
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）	348,460,122.73	607,423,536.24	955,883,658.97
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	337,540,997.58	498,981,332.98	836,522,330.56
二、本期经营活动产生的基	-	-29,508,341.10	-29,508,341.10



## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

## 6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 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。

### 6.4.5.2 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

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《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] 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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税。
- (3) 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，暂不征收企业所得税。
- (4) 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（以下简称“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。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、债券收入免征增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，资产管理产品管理人运营资产管理产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资产管理产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。
- (5) 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。
- (6) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2016 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2016 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (7) 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。
- (8) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日

活期存款	281,457,922.11
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	281,457,922.11

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	619,906,263.19	676,674,315.75	56,768,052.56
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	619,906,263.19	676,674,315.75	56,768,052.56

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	52,360.77
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	444.96

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	220.41
合计	53,026.14

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	904,542.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	904,542.20

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,473.93
预提费用	128,929.92
合计	137,403.85

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	345,054,099.53	345,054,099.53
本期申购	118,532,936.21	118,532,936.21
本期赎回(以“-”号填列)	-115,126,913.01	-115,126,913.01
本期末	348,460,122.73	348,460,122.73

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

**6.4.7.10 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	531,972,509.68	6,054,883.62	538,027,393.30
本期利润	7,750,867.67	54,943,050.97	62,693,918.64
本期基金份额交易产生的变动数	5,787,915.76	914,308.54	6,702,224.30
其中：基金申购款	184,991,585.85	10,272,683.42	195,264,269.27
基金赎回款	-179,203,670.09	-9,358,374.88	-188,562,044.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	545,511,293.11	61,912,243.13	607,423,536.24

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	979,587.32
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	16,250.60
其他	5,394.09
合计	1,001,232.01

注：本报告期内“其他”为申购款利息收入及保证金利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,136,671,412.77
减：卖出股票成本总额	1,121,677,807.10
买卖股票差价收入	14,993,605.67

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资。



**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,036,938.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,036,938.24

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	54,943,050.97
——股票投资	54,943,050.97
——债券投资	-
——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	54,943,050.97

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	272,517.70
基金转换费收入	1,780.16
合计	274,297.86

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	3,433,824.48
银行间市场交易费用	30.44
合计	3,433,854.92

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,752.78
信息披露费	99,177.14
汇划费	186.00
合计	149,115.92

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

### 6.4.10.1.3 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无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,833,344.52	7,025,271.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,371,741.31	1,325,732.57

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 年费率计提。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, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,138,890.75	1,170,878.64

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托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.74%	4.60%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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	281,457,922.11	979,587.32	273,135,722.12	785,907.64

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。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 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。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603823	百合花	2016 年 12 月 9 日	2017 年 12 月 18 日	新股流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.2 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
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项	6.85	2017年8月21日	8.22	4,330,000	28,600,342.38	29,660,500.00	-
300582	英飞特	2017年6月5日	重大事项	18.92	2017年8月2日	26.35	2,038	20,181.15	38,558.96	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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发行的证券,不得超过该证券的 10%。

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.3 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‘6.4.12’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。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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一定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、结算备付金及存出保证

金等。

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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 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	281,457,922.11	-	-	-	-	281,457,922.11
结算备付金	1,098,711.48	-	-	-	-	1,098,711.48
存出保证金	544,276.89	-	-	-	-	544,276.89
交易性金融资产	-	-	-	-	676,674,315.75	676,674,315.75
应收利息	-	-	-	-	53,026.14	53,026.14
应收申购款	3,690.00	-	-	-	1,009,089.33	1,012,779.33
资产总计	283,104,600.48	-	-	-	677,736,431.22	960,841,031.70
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	2,572,919.73	2,572,919.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,150,720.24	1,150,720.24
应付托管费	-	-	-	-	191,786.71	191,786.71
应付交易费用	-	-	-	-	904,542.20	904,542.20
其他负债	-	-	-	-	137,403.85	137,403.85
负债总计	-	-	-	-	4,957,372.73	4,957,372.73
利率敏感度缺口	283,104,600.48	-	-	-	672,779,058.49	955,883,658.97
上年度末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	304,210,483.33	-	-	-	-	304,210,483.33
结算备付金	2,319,145.00	-	-	-	-	2,319,145.00
存出保证金	436,265.69	-	-	-	-	436,265.69
交易性金融资产	-	-	-	-	623,381,083.33	623,381,083.33
应收利息	-	-	-	-	64,861.93	64,861.93
应收申购款	11,977.92	-	-	-	339,207.51	351,185.43
资产总计	306,977,871.94	-	-	-	623,785,152.77	930,763,024.71
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	11,259,548.60	11,259,548.60
应付赎回款	-	-	-	-	33,312,749.66	33,312,749.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,243,317.32	1,243,317.32
应付托管费	-	-	-	-	207,219.57	207,219.57
应付交易费用	-	-	-	-	1,393,412.90	1,393,412.90



其他负债	-	-	-	265,283.83	265,283.83
负债总计	-	-	-	47,681,531.88	47,681,531.88
利率敏感度缺口	306,977,871.94	-	-	-576,103,620.89	883,081,492.83

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末无债券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金为股票型基金,投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、央行票据、资产支持证券、权证以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。

本基金投资组合中股票等权益类金融工具投资比例占基金资产净值的 60%-95%(其中权证投资比例不超过基金资产净值的 3%);债券等固定收益类金融工具投资比例占基金资产净值的 5%-40%(其中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%);本基金将不低于 80%的股票资产投资于国内股票市场上具有良好成长性和基本面的中小盘股票。于 2017 年 6 月 30 日,本基金面临的整体其他价格风险列示如下:

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	676,674,315.75	70.79	623,381,083.33	70.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	676,674,315.75	70.79	623,381,083.33	70.59

**6.4.13.4.3 其他价格风险的敏感性分析**

假设	业绩比较基准发生变化		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	24,533,091.55	30,498,066.41
	业绩比较基准下降 5%	-24,533,091.55	-30,498,066.41

注：本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

**6.4.13.4.4 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 (单位: 人民币元)	本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	8,637,001.09	7,317,024.12
	合计	8,637,001.09	7,317,024.12

**6.4.14 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。

## ② 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 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 646,851,573.69 元,属于第二层级的余额为 29,699,058.96 元,属于第三层级的余额为 123,683.10 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。(2016 年 12 月 31 日:第一层级的余额为 622,902,145.52 元,属于第二层级的余额为 19,949.16 元,属于第三层级的余额为 458,988.65 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，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的公允价值列入第一层级。

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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	676,674,315.75	70.43
	其中：股票	676,674,315.75	70.43
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	282,556,633.59	29.41
7	其他各项资产	1,610,082.36	0.17
8	合计	960,841,031.70	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	57,453,787.17	6.01
C	制造业	458,899,238.67	48.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,234.64	0.01
E	建筑业	164,783.04	0.02
F	批发和零售业	129,113,943.76	13.51
G	交通运输、仓储和邮政业	73,097.20	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,978,632.66	3.14
J	金融业	457,472.37	0.05
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	56,474.68	0.01
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	378,651.56	0.04
S	综合	-	-
	合计	676,674,315.75	70.79

### 7.3 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	601607	上海医药	1,801,028	52,013,688.64	5.44
2	600597	光明乳业	3,899,790	49,722,322.50	5.20
3	600993	马应龙	2,199,852	47,912,776.56	5.01
4	603899	晨光文具	2,725,381	47,421,629.40	4.96
5	600332	白云山	1,600,000	46,464,000.00	4.86
6	000869	张裕A	1,200,000	44,640,000.00	4.67
7	002294	信立泰	1,199,906	42,788,647.96	4.48
8	000538	云南白药	442,427	41,521,773.95	4.34
9	600887	伊利股份	1,609,983	34,759,532.97	3.64
10	601899	紫金矿业	9,999,985	34,299,948.55	3.59
11	000999	华润三九	1,006,473	31,955,517.75	3.34
12	600600	青岛啤酒	861,800	30,249,180.00	3.16
13	002271	东方雨虹	814,998	30,236,425.80	3.16
14	600050	中国联通	4,330,000	29,660,500.00	3.10
15	600511	国药股份	805,394	29,187,478.56	3.05
16	600741	华域汽车	1,199,931	29,086,327.44	3.04
17	600305	恒顺醋业	2,584,760	26,519,637.60	2.77
18	600028	中国石化	3,899,952	23,126,715.36	2.42
19	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.08
20	002821	凯莱英	4,586	334,640.42	0.04
21	600977	中国电影	16,446	307,869.12	0.03
22	601997	贵阳银行	17,048	269,528.88	0.03
23	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.02
24	002812	创新股份	2,211	179,091.00	0.02
25	002831	裕同科技	2,219	166,425.00	0.02
26	603626	科森科技	2,496	162,689.28	0.02
27	002833	弘亚数控	2,743	160,465.50	0.02
28	600996	贵广网络	12,500	149,625.00	0.02
29	603515	欧普照明	2,845	102,761.40	0.01
30	603393	新天然气	2,492	98,234.64	0.01

31	002852	道道全	1,271	96,596.00	0.01
32	603660	苏州科达	2,353	96,355.35	0.01
33	603358	华达科技	1,769	89,617.54	0.01
34	603189	网达软件	3,898	83,729.04	0.01
35	603658	安图生物	1,911	82,364.10	0.01
36	603577	汇金通	2,460	75,743.40	0.01
37	603298	杭叉集团	3,641	75,477.93	0.01
38	603032	德新交运	1,628	73,097.20	0.01
39	601811	新华文轩	4,549	70,782.44	0.01
40	002820	桂发祥	1,772	60,230.28	0.01
41	603036	如通股份	2,114	59,424.54	0.01
42	300601	康泰生物	2,109	59,178.54	0.01
43	603887	城地股份	1,751	58,413.36	0.01
44	603637	镇海股份	1,802	56,474.68	0.01
45	601992	金隅股份	8,478	54,852.66	0.01
46	603585	苏利股份	1,562	53,810.90	0.01
47	300611	美力科技	2,402	53,684.70	0.01
48	603416	信捷电气	1,506	52,725.06	0.01
49	002827	高争民爆	2,059	49,621.90	0.01
50	603929	亚翔集成	2,193	49,386.36	0.01
51	300588	熙菱信息	1,380	48,010.20	0.01
52	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
53	603035	常熟汽饰	2,316	46,760.04	0.00
54	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
55	002803	吉宏股份	1,165	45,435.00	0.00
56	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
57	603090	宏盛股份	1,371	39,087.21	0.00
58	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.00
59	300548	博创科技	754	36,154.30	0.00
60	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
61	002810	山东赫达	957	30,901.53	0.00
62	300536	农尚环境	876	30,747.60	0.00
63	002817	黄山胶囊	839	30,506.04	0.00
64	300605	恒锋信息	916	29,128.80	0.00
65	002828	贝肯能源	1,042	27,123.26	0.00
66	300621	维业股份	1,218	26,235.72	0.00
67	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
68	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
69	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00

70	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
71	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
72	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
73	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
74	002297	博云新材	1,524	16,276.32	0.00
75	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
76	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
77	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
78	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
79	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
80	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
81	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
82	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	601899	紫金矿业	90,033,614.24	10.20
2	002241	歌尔股份	61,224,286.12	6.93
3	603899	晨光文具	59,093,669.92	6.69
4	000999	华润三九	58,947,808.98	6.68
5	600511	国药股份	57,653,179.94	6.53
6	600332	白云山	53,729,743.01	6.08
7	600600	青岛啤酒	53,109,306.60	6.01
8	600028	中国石化	51,871,835.72	5.87
9	000625	长安汽车	47,856,785.34	5.42
10	600029	南方航空	46,461,551.18	5.26
11	002294	信立泰	41,132,741.30	4.66
12	600362	江西铜业	39,464,295.21	4.47
13	600305	恒顺醋业	37,256,128.38	4.22
14	600050	中国联通	36,328,379.46	4.11
15	000876	新希望	36,240,467.99	4.10
16	600477	杭萧钢构	35,770,918.11	4.05
17	002271	东方雨虹	34,614,901.07	3.92
18	300003	乐普医疗	34,522,096.89	3.91

19	000069	华侨城 A	32,709,808.82	3.70
20	000967	盈峰环境	24,895,172.44	2.82
21	600741	华域汽车	24,436,597.83	2.77
22	002242	九阳股份	23,098,322.25	2.62
23	600549	厦门钨业	22,774,517.95	2.58
24	000599	青岛双星	21,801,457.00	2.47
25	002310	东方园林	18,668,434.42	2.11
26	600872	中炬高新	17,795,488.15	2.02

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。

#### 7.4.2 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	000625	长安汽车	69,536,032.91	7.87
2	002241	歌尔股份	61,140,262.98	6.92
3	601899	紫金矿业	54,730,619.24	6.20
4	600598	北大荒	49,514,641.63	5.61
5	600029	南方航空	47,571,385.92	5.39
6	000963	华东医药	47,322,486.13	5.36
7	000538	云南白药	45,209,384.55	5.12
8	002353	杰瑞股份	44,520,670.55	5.04
9	002294	信立泰	41,525,380.77	4.70
10	300003	乐普医疗	41,021,762.92	4.65
11	000599	青岛双星	38,554,266.44	4.37
12	600271	航天信息	36,718,681.64	4.16
13	600362	江西铜业	36,455,353.33	4.13
14	600477	杭萧钢构	35,617,474.24	4.03
15	000876	新希望	35,545,916.25	4.03
16	000069	华侨城 A	32,665,962.65	3.70
17	601928	凤凰传媒	32,216,224.31	3.65
18	600583	海油工程	29,450,114.23	3.33
19	600511	国药股份	29,032,588.71	3.29
20	600028	中国石化	28,659,895.96	3.25
21	000999	华润三九	26,743,561.59	3.03
22	000967	盈峰环境	25,508,154.58	2.89
23	600549	厦门钨业	24,533,255.04	2.78
24	600600	青岛啤酒	24,147,553.85	2.73



25	002242	九阳股份	21,570,271.10	2.44
26	000869	张裕A	20,268,948.99	2.30
27	002557	洽洽食品	19,669,019.67	2.23

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,120,027,988.55
卖出股票收入（成交）总额	1,136,671,412.77

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 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。

##### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 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。**

**7.12.2 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。**

### 7.12.3 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	544,276.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53,026.14
5	应收申购款	1,012,779.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,610,082.36

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
26,707	13,047.52	134,418,678.06	38.58%	214,041,444.67	61.42%

### 8.2 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	506,720.67	0.1454%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年4月28日）基金份额总额	1,428,556,041.60
本报告期期初基金份额总额	345,054,099.53
本报告期基金总申购份额	118,532,936.21
减：本报告期基金总赎回份额	115,126,913.01
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	348,460,122.73

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
东方证券	1	972,174,285.87	43.17%	905,385.97	43.17%	-

爱建证券	1	758,897,800.55	33.70%	706,763.05	33.70%	-
万联证券	1	323,725,086.62	14.37%	301,485.71	14.37%	-
西南证券	1	197,295,277.28	8.76%	183,741.07	8.76%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：本报告期退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：高华证券股份有限公司（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。
- (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》。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 1 月 19 日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京农村商业银行费率	《证券时报》、 《上海证券报》、	2017 年 1 月 19 日

	优惠活动的公告	《中国证券报》	
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在懒猫金融开通定投业务及调整申购业务起点金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年2月10日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加首创证券基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年2月14日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年2月23日
7	诺安基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月6日
8	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过部分代销机构办理申购、定投业务起点金额、最低赎回（保有）份额及费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月8日
9	诺安基金管理有限公司关于增加福建漳州农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月10日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在东北证券开通转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月13日
11	诺安基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月29日
12	诺安基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月29日
13	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人网站	2017年3月30日
14	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017年3月30日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年3月31日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中国联通估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017年4月22日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下基	《证券时报》、	2017年4月22日

	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	《上海证券报》、 《中国证券报》	
18	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 24 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 29 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通定投业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 5 月 12 日
21	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过江苏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》	2017 年 5 月 19 日
22	诺安基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 8 日
23	诺安基金管理有限公司关于增加上海通华财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 8 日
24	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2017 年 6 月 12 日
25	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 1 期-摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 12 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行基金定投及电子银行渠道申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 12 日
27	诺安基金管理有限公司关于增加基煜基金为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 15 日
28	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 28 日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 30 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。



## § 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中小盘精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中小盘精选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中小盘精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2017 年半年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安中小盘精选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 8 月 28 日