

# 诺安中证创业成长指数分级 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.....	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.4 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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金		
基金简称	诺安中证创业成长指数分级		
场内简称	诺安中创		
基金主代码	163209		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年3月29日		
基金管理人	诺安基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	20,275,665.73份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年4月27日		
下属分级基金的基金简称	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
下属分级基金场内简称:	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
下属分级基金的交易代码	163209	150073	150075
报告期末下属分级基金份额总额	14,109,460.73份	2,466,482.00份	3,699,723.00份

注：本基金的下属分级基金的基金简称、交易代码均为在深圳证券交易所上市交易的简称及交易代码。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金实施被动式投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。		
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在中证创业成长指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证创业成长指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证创业成长指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率 + 5%×金融同业存款利率		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额看，诺安稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；诺安进取份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	较高风险、较高预期收益	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	王永民
	联系电话	0755-83026688	010-66594896
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95566
传真		0755-83026677	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		秦维舟	田国立

## 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	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京西城区太平桥大街 17 号

### § 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	-856,065.57
本期利润	987,137.54
加权平均基金份额本期利润	0.0451
本期加权平均净值利润率	4.03%
本期基金份额净值增长率	3.99%
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	-4,017,970.96
期末可供分配基金份额利润	-0.1982
期末基金资产净值	23,407,406.78
期末基金份额净值	1.154
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	72.13%

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

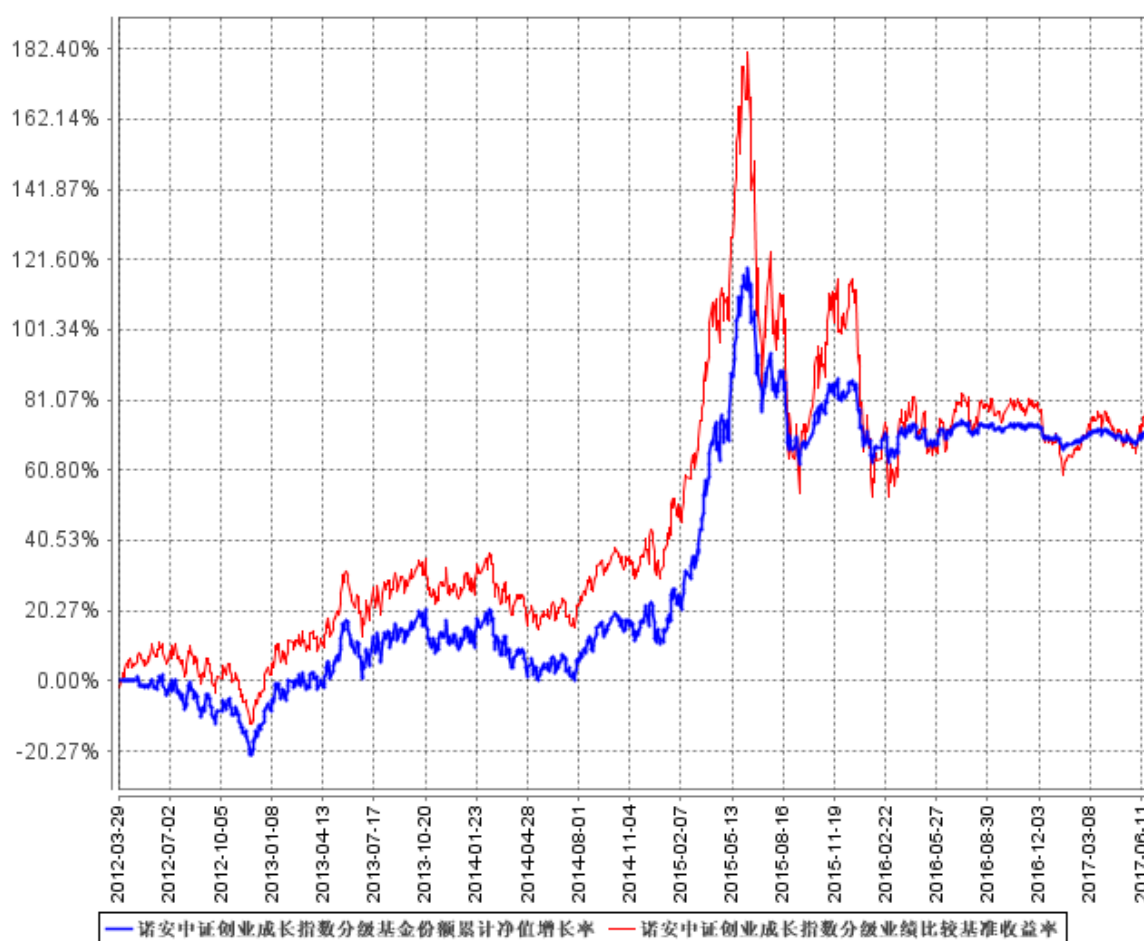
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.87%	0.87%	7.16%	0.83%	-1.29%	0.04%
过去三个月	0.61%	0.86%	2.42%	0.84%	-1.81%	0.02%
过去六个月	3.99%	0.82%	6.13%	0.83%	-2.14%	-0.01%
过去一年	-2.17%	0.82%	0.55%	0.84%	-2.72%	-0.02%
过去三年	64.62%	2.04%	46.18%	1.89%	18.44%	0.15%
自基金合同生效起至今	72.13%	1.79%	79.28%	1.70%	-7.15%	0.09%

注：本基金的业绩比较基准为：中证创业成长指数收益率×95% + 金融同业存款利率×5%。



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



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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		
梅律吾	指数组负责人、诺	2012 年 7 月 28 日	-	20	硕士, 具有基金从业资格。曾任职于长城证券

	<p>安中证100指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理</p>				<p>公司、鹏华基金管理有限公司；2005年3月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监，现任指数组负责人。曾于2007年11月至2009年10月担任诺安价值增长混合型证券投资基金基金经理，2009年3月至2010年10月担任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011年9月至2012年11月任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2014年2月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年6月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理。</p>
<p>李玉良</p>	<p>诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安</p>	<p>2015年3月7日</p>	<p>-</p>	<p>13</p>	<p>博士，曾任职于中国工商银行股份有限公司，从事内部风险管理及稽核工作。2010年6月加入诺安基金管理有限公司，历任产品经理、基金经理助理。2015年3月起任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2015年7月起任</p>

	精选回报 灵活配置 混合型证 券投资基 金基金经 理、诺安 积极回报 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 进取回报 灵活配置 混合型证 券投资基 金				诺安多策略混合型证 券投资基金基金经理， 2016 年 3 月起任诺安 精选回报灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理，2016 年 9 月 起任诺安积极回报灵 活配置混合型证券投 资基金基金经理、诺安 优选回报灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理、诺安进取回 报灵活配置混合型证 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，诺安中证创业成长指数分级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《诺安中证创业成长指数分级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

上半年全球经济呈现强劲复苏态势，欧美与亚洲新兴经济体均表现良好。

预期中的黑天鹅没有起飞。英国脱欧并没有导致欧盟动荡。美国新一届总统上任，保持平稳过渡，没有对全球经济和政治产生太多的负面影响。中国经济维持稳中向好的局面。基建和房地产市场繁荣依旧。外部需求回暖，带动了外贸出口上升，这主要受益于欧洲经济好转。

从全球利率环境来看，美联储加息周期向纵深推进，上半年加息两次。其他国家央行逐渐跟随，只是加息节奏不同而已。中国央行虽然没有上调存贷款名义利率，但是市场利率已进入上行周期。十年期国债利率 2016 年 11 月降到 2.7% 低点，自此迅速攀升，上半年跨越 3.7%，而且上行周期没有结束。

上半年国内强劲的经济基本面与趋紧的利率环境并行。由此导致 A 股市场出现严重的两极分化局面。中小创股票熊市与蓝筹股牛市同在。由于市场无风险收益率持续上行，中小创股票高估值水平难以为继，出现了“杀估值”行情，由此导致中小创股票熊市。

蓝筹股牛市完全靠业绩增长驱动。受益于强劲的经济基本面，消费类、金融类与周期类蓝筹股上半年经营业绩均有可观的增长。蓝筹股估值水平本来就处于低位，因此免受市场无风险收益率上行的冲击。蓝筹股维持现有的低估值水平，业绩增长驱动股价上涨。

中证创业成长指数成份股以中小创股票居多，但属于有基本面支持的中小创股票。因此在中小创熊市中仍然抗跌，上半年该指数涨幅超过 6%。本基金复制该指数，上半年实现了正收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.154 元。本报告期基金份额净值增长率为 3.99%，同期业绩比较基准收益率为 6.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济增长速度会略有放缓，但是仍然增长无忧。中国央行在强化金融监管和去杠杆的同时，全力呵护实体经济的流动性，从而保证实体经济免受负面影响。中国政府坚定不移推动供给侧改革，传统产业过剩的局面大为改观，行业集中度逐渐提高，微观企业利润显著改善。因此下半年蓝筹股的基本面仍然值得期待。

从全球利率环境来看，美联储加息周期仍在途中，下半年还会加息 1-2 次，并且将缩表提上议程。在全球利率上行的大环境之中，国内市场利率上行趋势没有结束。无风险收益率仍然有上升空间。因此中小创股票“杀估值”行情没有结束。中小创股票目前与合理估值水平仍相差甚远。

由此可以预见，下半年 A 股市场仍然是蓝筹股唱主角，中小创股票内部会有分化。有基本面支持且估值下调到合理水平的中小创股票，逐渐迎来投资机会，但这只是极少数中小创股票，绝大多数中小创股票仍需消化估值泡沫。

中证创业成长指数有良好的基本面支持，因此下半年有望继续表现为抗跌，甚至获取正收益。本基金继续复制该指数，由此为基金持有人创造投资回报。

#### 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**

根据本基金基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额)不进行收益分配。

#### **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,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案,包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等,并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诺安中证创业成长指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

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	1,703,120.00	1,663,031.68
结算备付金		22.09	-
存出保证金		988.32	2,505.83
交易性金融资产	6.4.7.2	21,919,101.34	23,695,035.27
其中：股票投资		21,919,101.34	23,695,035.27
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		-	913,352.44
应收利息	6.4.7.5	254.27	338.45
应收股利		-	-
应收申购款		9,987.02	199.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,633,473.04	26,274,463.43
<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		22.09	-
应付赎回款		34,841.90	443,823.54
应付管理人报酬		19,052.60	22,755.70
应付托管费		3,810.52	4,551.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	19,030.72	14,567.85
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	149,308.43	91,660.44
负债合计		226,066.26	577,358.66
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	17,463,362.74	19,959,908.68
未分配利润	6.4.7.10	5,944,044.04	5,737,196.09
所有者权益合计		23,407,406.78	25,697,104.77
负债和所有者权益总计		23,633,473.04	26,274,463.43

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，诺安创业成长份额净值 1.154 元，诺安稳健份额净值 1.024 元，诺安进取份额净值 1.241 元；基金份额总额 20,275,665.73 份，其中诺安创业成长份额 14,109,460.73 份，诺安稳健份额 2,466,482.00 份，诺安进取份额 3,699,723.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

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>		1,368,049.56	-5,020,164.27
1.利息收入		6,249.01	7,969.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,249.01	7,969.07
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）		-485,836.92	-3,965,576.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-574,272.89	-4,100,033.72
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	6.4.7.13.5	-	-
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	88,435.97	134,457.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,843,203.11	-1,071,586.00
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	4,434.36	9,029.34

列)			
<b>减：二、费用</b>		380,912.02	410,216.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	121,635.41	140,204.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,327.03	28,040.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	34,502.44	34,923.68
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	200,447.14	207,046.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		987,137.54	-5,430,380.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		987,137.54	-5,430,380.39

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

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）	19,959,908.68	5,737,196.09	25,697,104.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	987,137.54	987,137.54
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）	-2,496,545.94	-780,289.59	-3,276,835.53
其中：1.基金申购款	661,702.09	194,704.21	856,406.30
2.基金赎回款	-3,158,248.03	-974,993.80	-4,133,241.83
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）	17,463,362.74	5,944,044.04	23,407,406.78
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）	22,550,871.45	13,549,344.11	36,100,215.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,430,380.39	-5,430,380.39
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）	-1,910,008.01	-507,925.32	-2,417,933.33
其中：1.基金申购款	3,586,889.88	1,261,160.75	4,848,050.63
2.基金赎回款	-5,496,897.89	-1,769,086.07	-7,265,983.96
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）	20,640,863.44	7,611,038.40	28,251,901.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2011]1705 号文《关于核准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的批复》批准,于 2012 年 2 月 27 日至 2012 年 3 月 23 日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,募集的扣除认购费用后的净认购金额为人民币 1,208,257,982.10 元,其中场内认购方式募集资金净额为人民币 90,978,000.00 元,场外认购方式募集资金净额为人民币 1,117,279,982.10 元,共折合 1,208,257,982.10 份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币 918,652.82 元,折合 918,652.82 份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为 2012 年 3 月 29 日,合同生效日基金份额为 1,209,176,634.92 份基金单位。

本基金的基金份额包括诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额(简称“诺安创业成长份额”)、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“诺安稳健份额”)与诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“诺安进取份额”)。其

中，诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

在诺安稳健份额、诺安创业成长份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照基金合同的规则进行基金的定期份额折算。诺安稳健份额和诺安进取份额按照基金合同进行参考净值计算，对诺安稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份诺安创业成长份额将按 4 份诺安稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于诺安稳健份额期末的约定应得收益，即诺安稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内诺安创业成长份额分配给诺安稳健份额持有人。诺安创业成长份额持有人持有的每 10 份诺安创业成长份额将按 4 份诺安稳健份额获得新增诺安创业成长份额的分配。持有场外诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外诺安创业成长份额的分配；持有场内诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内诺安创业成长份额的分配。经过上述份额折算，诺安稳健份额和诺安创业成长份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对诺安稳健份额和诺安创业成长份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元；当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为 4:6，份额折算后诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的基金份额净值均调整为 1 元。当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为 4:6，份额折算后诺安创业成长份额净值、诺安稳健份额参考净值、诺安进取份额参考净值均调整为 1 元。

基金合同生效后，诺安创业成长份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。诺安稳健份额与诺安进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》、《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

## 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相一致。

## 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	1,703,120.00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,703,120.00

#### 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	21,634,704.95	21,919,101.34	284,396.39
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	21,634,704.95	21,919,101.34	284,396.39

#### 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	253.82
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	-
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	0.45
合计	254.27

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	19,030.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	19,030.72

#### 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	131.29
预提费用	99,177.14
指数使用费	50,000.00
合计	149,308.43

#### 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	22,763,642.67	19,959,908.68
本期申购	176.62	154.86
本期赎回(以“-”号填列)	-1,730.59	-1,517.37
2017年1月3日 基金拆分/份额 折算前	22,762,088.70	19,958,546.17
基金拆分/份额折算变动份额	410,406.78	-
本期申购	768,033.34	661,547.23
本期赎回(以“-”号填列)	-3,664,863.09	-3,156,730.66

本期末	20,275,665.73	17,463,362.74
-----	---------------	---------------

注：①根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2017 年 1 月 3 日为份额折算基准日，对诺安创业成长的场外份额、场内份额以及诺安稳健份额实施定期份额折算。

②本期申购含转换转入份(金)额以及上述不定期折算中诺安创业成长份额的份额增加数，本期赎回含转换转出份(金)额。

③根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回诺安创业成长份额，诺安稳健份额和诺安进取份额只可在深圳证券交易所上市交易，故本表不再单独披露诺安稳健和诺安进取份额的情况。

#### 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	-3,651,708.77	9,388,904.86	5,737,196.09
本期利润	-856,065.57	1,843,203.11	987,137.54
本期基金份额交易产生的变动数	489,803.38	-1,270,092.97	-780,289.59
其中：基金申购款	-128,080.88	322,785.09	194,704.21
基金赎回款	617,884.26	-1,592,878.06	-974,993.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,017,970.96	9,962,015.00	5,944,044.04

#### 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	6,147.39
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	93.00
其他	8.62
合计	6,249.01

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	12,371,171.30
减：卖出股票成本总额	12,945,444.19
买卖股票差价收入	-574,272.89

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 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	88,435.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	88,435.97

#### 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	1,843,203.11
——股票投资	1,843,203.11
——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	1,843,203.11

#### 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	4,434.36

合计	4,434.36
----	----------

#### 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	34,502.44
银行间市场交易费用	-
合计	34,502.44

#### 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	19,835.79
信息披露费	49,588.57
汇划费	1,270.00
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	200,447.14

注：1、“上市费”为深交所向本基金征收的上市年费。上市年费为60,000元/年。

2、指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，逐日计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币50,000.00元。

### 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、直销机构
交通银行股份有限公司	托管人

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其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	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
当期发生的基金应支付的管理费	121,635.41	140,204.87
其中：支付销售机构的客户维护费	25,220.66	28,244.98

注：基金管理费按前一日基金财产净值的 1.0% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，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	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
当期发生的基金应支付的托管费	24,327.03	28,040.99

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提, 按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、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**

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**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
中国银行股份有限公司	1,703,120.00	6,147.39	2,472,923.75	7,690.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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

本基金合同约定，在存续期内，本基金（包含诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额）不进行利润分配。

#### 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

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证券。

##### 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
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项	28.64	-	-	23,696	1,315,980.86	678,653.44	-
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项	20.24	-	-	21,955	484,362.61	444,369.20	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事项	7.68	-	-	40,222	380,202.74	308,904.96	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大事项	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	10,775	346,019.50	215,500.00	-
000034	神州数码	2017 年 3 月 21 日	重大事项	24.45	2017 年 7 月 18 日	22.01	7,673	188,815.03	187,604.85	-
000836	鑫茂科技	2017 年 5 月 24 日	重大事项	6.05	-	-	25,633	197,337.48	155,079.65	-
300267	尔康制药	2017 年 5 月 10 日	重大事项	11.46	-	-	12,986	209,654.93	148,819.56	-
002504	*ST 弘高	2017 年 5 月 2 日	重大事项	8.10	-	-	11,974	114,334.50	96,989.40	-
300252	金信诺	2017 年 4 月 27 日	重大事项	21.65	2017 年 7 月 27 日	19.49	4,012	175,364.29	86,859.80	-
300100	双林股份	2017 年 4 月 5 日	重大事项	25.96	-	-	3,065	128,052.83	79,567.40	-

##### 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、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。

##### **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。

##### **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。

#### **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，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	1,703,120.00	-	-	-	-	1,703,120.00
结算备付金	22.09	-	-	-	-	22.09
存出保证金	988.32	-	-	-	-	988.32
交易性金融资产	-	-	-	-	21,919,101.34	21,919,101.34
应收利息	-	-	-	-	254.27	254.27
应收申购款	-	-	-	-	9,987.02	9,987.02
资产总计	1,704,130.41	-	-	-	21,929,342.63	23,633,473.04
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	22.09	22.09
应付赎回款	-	-	-	-	34,841.90	34,841.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	19,052.60	19,052.60

应付托管费	-	-	-	-	3,810.52	3,810.52
应付交易费用	-	-	-	-	19,030.72	19,030.72
其他负债	-	-	-	-	149,308.43	149,308.43
负债总计	-	-	-	-	226,066.26	226,066.26
利率敏感度缺口	1,704,130.41	-	-	-	-21,703,276.37	23,407,406.78
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	1,663,031.68	-	-	-	-	1,663,031.68
存出保证金	2,505.83	-	-	-	-	2,505.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-23,695,035.27	23,695,035.27
应收证券清算款	-	-	-	-	913,352.44	913,352.44
应收利息	-	-	-	-	338.45	338.45
应收申购款	-	-	-	-	199.76	199.76
资产总计	1,665,537.51	-	-	-	-24,608,925.92	26,274,463.43
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	443,823.54	443,823.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	22,755.70	22,755.70
应付托管费	-	-	-	-	4,551.13	4,551.13
应付交易费用	-	-	-	-	14,567.85	14,567.85
其他负债	-	-	-	-	91,660.44	91,660.44
负债总计	-	-	-	-	577,358.66	577,358.66
利率敏感度缺口	1,665,537.51	-	-	-	-24,031,567.26	25,697,104.77

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资,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。本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证创业成长指数成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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。

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比

例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。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	21,919,101.34	93.64	23,695,035.27	92.21
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	21,919,101.34	93.64	23,695,035.27	92.21

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化		
	其他市场变量保持不变		
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）
	1. 业绩比较基准上升 5	1,166,186.55	1,216,652.19
	2. 业绩比较基准下降 5	-1,166,186.55	-1,216,652.19

注：本基金的业绩比较基准为：中证创业成长指数收益率×95% + 金融同业存款利率×5%。

#### 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	316,338.60	326,707.72

	合计	316,338.60	326,707.72
--	----	------------	------------

#### 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 19,516,753.08 元，属于第二层级的余额为 2,402,348.26 元，无属于第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层级 21,204,947.85 元，第二层级 2,490,087.42 元，无属于第三层级的余额)。

###### ③ 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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。

###### ④ 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

##### 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	21,919,101.34	92.75
	其中：股票	21,919,101.34	92.75
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	1,703,142.09	7.21
7	其他各项资产	11,229.61	0.05
8	合计	23,633,473.04	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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	1,976,811.82	8.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,976,607.24	46.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	194,944.38	0.83
E	建筑业	520,393.98	2.22
F	批发和零售业	655,953.57	2.80
G	交通运输、仓储和邮政业	315,110.70	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,757,612.51	11.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	337,326.70	1.44
L	租赁和商务服务业	538,973.32	2.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	265,418.46	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	792, 556. 26	3. 39
R	文化、体育和娱乐业	601, 035. 95	2. 57
S	综合	-	-
	合计	19, 932, 744. 89	85. 16

### 7.2.2 期末积极投资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	-	-
C	制造业	1, 210, 713. 61	5. 17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	96, 989. 40	0. 41
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	678, 653. 44	2. 90
J	金融业	-	-
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	1, 986, 356. 45	8. 49

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	300498	温氏股份	67, 519	1, 582, 645. 36	6. 76
2	300072	三聚环保	19, 811	733, 997. 55	3. 14
3	002466	天齐锂业	13, 132	713, 724. 20	3. 05
4	300136	信维通信	17, 606	704, 592. 12	3. 01

5	002460	赣锋锂业	11,848	547,970.00	2.34
6	002572	索菲亚	12,453	510,573.00	2.18
7	300156	神雾环保	13,657	447,403.32	1.91
8	002044	美年健康	26,200	445,400.00	1.90
9	300017	网宿科技	31,872	384,695.04	1.64
10	002074	国轩高科	11,773	371,438.15	1.59
11	002027	分众传媒	26,502	364,667.52	1.56
12	002092	中泰化学	27,800	353,060.00	1.51
13	300115	长盈精密	12,033	351,122.94	1.50
14	300296	利亚德	18,238	342,874.40	1.46
15	300144	宋城演艺	16,185	337,780.95	1.44
16	002407	多氟多	13,900	305,661.00	1.31
17	300033	同花顺	4,801	298,670.21	1.28
18	002411	必康股份	10,289	297,557.88	1.27
19	002624	完美世界	8,381	287,468.30	1.23
20	002217	合力泰	28,300	279,604.00	1.19
21	002366	台海核电	5,800	272,078.00	1.16
22	000820	神雾节能	7,101	269,695.98	1.15
23	002573	清新环境	14,103	265,418.46	1.13
24	002558	巨人网络	5,420	250,512.40	1.07
25	300113	顺网科技	9,154	246,242.60	1.05
26	002352	顺丰控股	4,600	244,536.00	1.04
27	002019	亿帆医药	14,577	243,144.36	1.04
28	300244	迪安诊断	7,301	229,689.46	0.98
29	002555	三七互娱	8,963	229,183.91	0.98
30	300182	捷成股份	22,561	215,683.16	0.92
31	002714	牧原股份	7,743	210,764.46	0.90
32	300014	亿纬锂能	11,300	205,095.00	0.88
33	300207	欣旺达	17,221	203,035.59	0.87
34	002640	跨境通	9,388	199,495.00	0.85
35	600856	中天能源	17,313	194,944.38	0.83
36	300253	卫宁健康	24,749	193,289.69	0.83
37	002635	安洁科技	5,277	191,132.94	0.82
38	000034	神州数码	7,673	187,604.85	0.80
39	002477	雏鹰农牧	41,400	183,402.00	0.78
40	600779	水井坊	7,353	180,736.74	0.77
41	002468	申通快递	6,700	170,247.00	0.73
42	002002	鸿达兴业	21,200	165,996.00	0.71
43	002036	联创电子	9,956	164,274.00	0.70

44	002043	兔宝宝	11,800	163,312.00	0.70
45	002517	恺英网络	4,597	161,768.43	0.69
46	600076	康欣新材	17,800	159,666.00	0.68
47	000036	华联控股	17,446	158,758.60	0.68
48	002709	天赐材料	3,683	151,629.11	0.65
49	300450	先导智能	2,879	149,045.83	0.64
50	300267	尔康制药	12,986	148,819.56	0.64
51	000687	华讯方舟	9,700	146,858.00	0.63
52	300294	博雅生物	3,500	144,340.00	0.62
53	300118	东方日升	9,970	140,078.50	0.60
54	300376	易事特	15,436	140,004.52	0.60
55	002018	华信国际	20,100	137,685.00	0.59
56	002091	江苏国泰	13,900	132,745.00	0.57
57	300237	美晨科技	7,116	122,822.16	0.52
58	000018	神州长城	15,814	119,711.98	0.51
59	000150	宜华健康	4,840	117,466.80	0.50
60	600285	羚锐制药	10,400	116,792.00	0.50
61	600986	科达股份	8,500	115,260.00	0.49
62	300297	蓝盾股份	10,500	114,975.00	0.49
63	002636	金安国纪	6,400	110,528.00	0.47
64	002210	飞马国际	6,400	109,888.00	0.47
65	000957	中通客车	9,016	105,487.20	0.45
66	000065	北方国际	4,400	104,632.00	0.45
67	002120	韵达股份	2,000	103,200.00	0.44
68	300131	英唐智控	11,916	100,332.72	0.43
69	002147	新光圆成	6,200	96,348.00	0.41
70	000802	北京文化	6,400	93,184.00	0.40
71	300506	名家汇	3,200	90,336.00	0.39
72	000055	方大集团	12,000	87,360.00	0.37
73	000892	欢瑞世纪	8,700	87,261.00	0.37
74	300302	同有科技	4,677	84,232.77	0.36
75	000952	广济药业	5,601	84,183.03	0.36
76	300426	唐德影视	3,500	82,810.00	0.35
77	000070	特发信息	7,000	82,250.00	0.35
78	002314	南山控股	12,290	82,220.10	0.35
79	300231	银信科技	6,100	80,520.00	0.34
80	300100	双林股份	3,065	79,567.40	0.34
81	300056	三维丝	5,101	77,331.16	0.33
82	300457	赢合科技	1,100	75,240.00	0.32



83	600119	长江投资	4,801	70,574.70	0.30
84	300242	明家联合	7,100	67,379.00	0.29
85	002841	视源股份	900	66,798.00	0.29
86	000796	凯撒旅游	5,315	64,417.80	0.28
87	300497	富祥股份	1,200	63,348.00	0.27
88	002270	华明装备	5,630	60,353.60	0.26
89	300246	宝莱特	2,200	60,170.00	0.26
90	000565	渝三峡 A	5,700	58,710.00	0.25
91	002172	澳洋科技	6,552	52,678.08	0.23
92	603579	荣泰健康	400	51,928.00	0.22
93	002323	雅百特	5,016	51,363.84	0.22
94	603239	浙江仙通	1,800	46,854.00	0.20
95	300121	阳谷华泰	3,300	45,540.00	0.19
96	300484	蓝海华腾	1,378	41,836.08	0.18
97	600828	茂业商业	4,300	35,776.00	0.15
98	603929	亚翔集成	1,400	31,528.00	0.13
99	300571	平治信息	200	27,732.00	0.12

### 7.3.2 期末积极投资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	300104	乐视网	23,696	678,653.44	2.90
2	002252	上海莱士	21,955	444,369.20	1.90
3	002426	胜利精密	40,222	308,904.96	1.32
4	300367	东方网力	10,775	215,500.00	0.92
5	000836	鑫茂科技	25,633	155,079.65	0.66
6	002504	*ST 弘高	11,974	96,989.40	0.41
7	300252	金信诺	4,012	86,859.80	0.37

### 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	300498	温氏股份	1,442,693.29	5.61
2	002044	美年健康	432,876.92	1.68
3	002092	中泰化学	324,401.00	1.26
4	300033	同花顺	297,880.00	1.16

5	000820	神雾节能	271,497.00	1.06
6	002407	多氟多	268,238.00	1.04
7	002217	合力泰	257,745.00	1.00
8	002558	巨人网络	257,508.00	1.00
9	002352	顺丰控股	245,549.00	0.96
10	002366	台海核电	243,670.00	0.95
11	300244	迪安诊断	222,550.00	0.87
12	002027	分众传媒	211,889.02	0.82
13	002477	雏鹰农牧	193,545.00	0.75
14	300014	亿纬锂能	176,561.00	0.69
15	002043	兔宝宝	175,752.00	0.68
16	002468	申通快递	167,693.00	0.65
17	002002	鸿达兴业	160,211.00	0.62
18	000687	华讯方舟	155,390.00	0.60
19	600076	康欣新材	152,953.00	0.60
20	300294	博雅生物	146,644.00	0.57

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	002415	海康威视	1,975,167.95	7.69
2	002450	康得新	1,187,720.50	4.62
3	300059	东方财富	754,559.53	2.94
4	002594	比亚迪	639,737.52	2.49
5	002202	金风科技	569,496.38	2.22
6	002475	立讯精密	544,653.10	2.12
7	002508	老板电器	485,331.70	1.89
8	002085	万丰奥威	380,140.29	1.48
9	002179	中航光电	273,291.39	1.06
10	002602	世纪华通	254,925.09	0.99
11	002400	省广股份	247,842.00	0.96
12	002174	游族网络	245,675.61	0.96
13	300324	旋极信息	240,011.16	0.93
14	000048	康达尔	230,826.60	0.90
15	002221	东华能源	200,158.78	0.78

16	002373	千方科技	183,705.10	0.71
17	300199	翰宇药业	164,811.95	0.64
18	002643	万润股份	154,953.56	0.60
19	600273	嘉化能源	141,662.24	0.55
20	300431	暴风集团	132,333.59	0.51

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	9,326,307.15
卖出股票收入（成交）总额	12,371,171.30

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,除美年健康外,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。**

2017 年 4 月 28 日,美年大健康产业控股股份有限公司(以下简称“美年健康”)的子公司美年大健康产业(集团)有限公司(以下简称“美年大健康”)收到了商务部出具的《商务部行政处罚决定书》,被处以 30 万元罚款。其原因是美年大健康收购慈铭体检股权,没有依法申报,因此被商务部行政处罚。

截止本报告期末,美年健康(002044)为本基金持有的前十大重仓股之一。本基金持有美年健康,是指数化投资,并非主动投资。商务部对美年大健康的处罚已经结束,不影响公司申请发行股份募集资金和收购慈铭体检股权,更不影响公司的长期竞争力。因此本基金继续持有美年健康。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司内部制度。

**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	988.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	254.27
5	应收申购款	9,987.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,229.61

### 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****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五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	300104	乐视网	678,653.44	2.90	重大事项
2	002252	上海莱士	444,369.20	1.90	重大事项
3	002426	胜利精密	308,904.96	1.32	重大事项
4	300367	东方网力	215,500.00	0.92	重大事项
5	000836	鑫茂科技	155,079.65	0.66	重大事项

**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

份额级别	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
诺安中创	2,287	6,169.42	68,108.00	0.48%	14,041,352.73	99.52%
诺安稳健	193	12,779.70	969,126.00	39.29%	1,497,356.00	60.71%
诺安进取	951	3,890.35	10,006.00	0.27%	3,689,717.00	99.73%
合计	3,431	5,909.55	1,047,240.00	5.17%	19,228,425.73	94.83%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

诺安稳健

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	黄松友	638,917.00	25.90%
2	上海明沚投资管理有限公司—明沚CTA一号基金	401,511.00	16.28%
3	王宏	316,300.00	12.82%
4	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时2号基金	263,700.00	10.69%
5	上海明沚投资管理有限公司—明沚多策略对冲1号基金	154,694.00	6.27%
6	陶玲	82,454.00	3.34%
7	张殿刚	67,007.00	2.72%
8	方春娣	58,597.00	2.38%
9	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时6号私募证券投资基金	45,792.00	1.86%
10	北京天演资本管理有限公司—天演教源投资基金	43,168.00	1.75%

诺安进取

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈惠芬	817,205.00	22.09%
2	陈建均	104,000.00	2.81%
3	金栋	78,165.00	2.11%
4	李传勇	70,000.00	1.89%
5	王爱林	61,200.00	1.65%
6	丁慧	55,832.00	1.51%

7	张春杰	49,800.00	1.35%
8	吴毅辉	47,476.00	1.28%
9	鲍林圆	47,022.00	1.27%
10	谢丽敏	43,028.00	1.16%

注：以上信息中，持有人名称及持有份额由中国证券登记结算有限公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	诺安中创	164,118.58	1.1632%
	诺安稳健	-	-
	诺安进取	-	-
	合计	164,118.58	0.8094%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 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	份额级别	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	诺安中创	10~50
	诺安稳健	0
	诺安进取	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安中创	10~50
	诺安稳健	0
	诺安进取	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
基金合同生效日（2012年3月29日） 基金份额总额	1,118,193,253.92	36,393,352.00	54,590,029.00
本报告期初基金份额总额	14,941,687.67	3,128,782.00	4,693,173.00
本报告期基金总申购份额	768,209.96	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	3,666,593.68	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,066,156.78	-662,300.00	-993,450.00
本报告期末基金份额总额	14,109,460.73	2,466,482.00	3,699,723.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额、定期折算调整份额以及上拆折算调整份额。



## § 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、基金托管人的托管业务部门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	
东北证券	1	20,472,380.44	94.35%	19,065.85	94.35%	-

方正证券	1	1,225,098.01	5.65%	1,140.99	5.65%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

## 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无进行其他证券投资的情况。

## 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	关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金定期折算停复牌的公告	《中国证券报》	2017 年 1 月 4 日
3	关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之诺安稳健份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	《中国证券报》	2017 年 1 月 4 日
4	关于诺安稳健定期份额折算前收盘价调整的公告	《中国证券报》	2017 年 1 月 5 日
5	关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告	《中国证券报》	2017 年 1 月 5 日
6	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》	2017 年 1 月 19 日
7	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
8	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交	《证券时报》、	2017 年 2 月 23 日

	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》	
9	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
10	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
11	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人网站	2017 年 3 月 30 日
12	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《中国证券报》	2017 年 3 月 30 日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 22 日
14	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》	2017 年 4 月 24 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风险提示公告	《中国证券报》	2017 年 4 月 25 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风险提示公告	《中国证券报》	2017 年 4 月 26 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风险提示公告	《中国证券报》	2017 年 4 月 27 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风险提示公告	《中国证券报》	2017 年 4 月 28 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风险提示公告	《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
21	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票省广股份估值调整的公告	《中国证券报》	2017 年 5 月 9 日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票乐视网估值调整的公告	《中国证券报》	2017 年 5 月 12 日
23	诺安中证创业成长指数分级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 5 月 13 日
24	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书（更新）2017 年第 1 期-摘要	《中国证券报》	2017 年 5 月 13 日
25	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
26	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	《证券时报》、 《上海证券报》、	2017 年 6 月 15 日

	展费率优惠活动的公告	《中国证券报》	
27	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 6 月 30 日

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证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安中证创业成长指数分级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