

诺安创新驱动灵活配置混合型
证券投资基金
2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2017 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称 | 诺安创新驱动混合 | |
| 基金主代码 | 001411 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年6月18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 | 819,123,518.08份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 诺安创新驱动混合 A | 诺安创新驱动混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 001411 | 002051 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 103,695,993.33份 | 715,427,524.75份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采取大类资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、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，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 创新驱动型相关主题上市公司的界定</p> <p>创新型相关企业是指拥有自主知识产权的核心技术、知名品牌，具有良好的创新管理和文化，整体技术水平在同行业居于先进地位，在市场竞争中具有优势和持续发展能力的企业。创新驱动型公司可以简单的理解为传统行业在技术、品牌、管理文化等方面往新兴行业、朝阳行业转型的公司，也可以是部分新兴行业类公司在原有技术、文化的基础上进一步的突破。</p> <p>创新驱动型企业往往具备一定的特征：如以研究开发为企业的核心职能之一；集研发、生产、销售三位一体；较早且富于想象地确定一个潜在市场；关注潜在市场，努力培养、帮助用户；有着高效的协调研究与开发、生产和销售的企业家精神；与客户和保持密切联系，紧且市场需求；结合国家新兴发展战略、拓展产业布局；通过外延或内部激励，实现效率的提高等等。</p> <p>符合上述特征的企业，我们可以看成是创新驱动型企业。创新驱动型企业大多分布在高科技行业、消费品行业、知识密集型服务或国家政策倡导的新行业：如新能源汽车、工业机器人、智能建筑等。创新驱动型企业是一个国家最有活力的企业，应该成为政府重点扶植的对象，也是本基金未来重点的投资对象。</p> <p>(2) 公司基本面评价</p> <p>在创新驱动型公司中，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的</p> |

公司。

1) 公司所处行业市场空间相对于公司目前收入体量足够大

本基金主要通过行业数据以及公司披露等信息，对公司所处行业未来的市场容量判断，重点投资于行业处于蓝海阶段的公司。但在红海类行业里，如公司具备相关优势且有足够能力抢占竞争对手份额的，也是本基金投资的方向。

2) 公司所在行业景气度较高，最好具备一定的政策扶持

本基金主要通过密切关注国家相关产业政策、规划动态，同时深入进行上、下游产业链调研，适时对各行业景气度变化情况进行研判，重点投资于行业景气度较高且、有政策支持、未来成长具有可持续性的公司。

3) 公司所在行业竞争格局良好，有竞争优势

本基金主要通过密切跟踪行业集中度、行业内主要竞争对手策略及各公司产品（或服务）的市场份额、以及公司自身的竞争优势，判断公司所处行业格局，重点投资于处于行业龙头地位或具备成为龙头潜力的优势公司。

4) 公司自身具备一定的壁垒或者优势

通过密切跟踪、调研相关公司以及竞争对手，了解公司在技术、管理、销售、资金等方面是否有对手不可复制的壁垒，以该特点出发评估公司的竞争力以及长期成长性，对具备壁垒的公司会给予重点投资。

5) 公司管理层素质较高

选择管理层素质较高的公司，如高管管理团队具备较强的研发能力或者营销能力；公司已建立起完善的法人治理结构；激励与利益分配机制设置合理；公司长期愿景清晰；企业文化积极向上，具备大的蓝图和发展战略。

(3) 估值水平分析

本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF, FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。

通过估值水平分析，基金管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。

(4) 股票组合的构建与调整

在估值分析的基础上，本基金将建立投资组合。当行业或公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行调整。

3、债券投资策略方面，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、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。

4、权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

5、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎的原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

在预判市场风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在面临市场下跌时择机卖出股指期货合约进行套期保值，当股市好转之后再将其指合约空单平仓。

| | |
|--------|---|
| | <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数与中证全债指数的混合指数，即：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40% |
| 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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.lionfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间 数据 和指 标 | 2017 年 | | 2016 年 | | 2015 年 6 月 18 日(基金合同生效日)- 2015 年 12 月 31 日 | |
|----------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---|------------------|
| | 诺安创新驱动混 合 A | 诺安创新驱动混 合 C | 诺安创新驱动混 合 A | 诺安创新驱动混 合 C | 诺安创新驱动混合 A | 诺安创新驱动混合 C |
| 本期 已实 现收 益 | 6,092,782.10 | 33,575,128.65 | 11,145,196.34 | 31,534,924.43 | 5,455,315.43 | -686,171.90 |
| 本期 利润 | 4,794,974.18 | 26,481,913.77 | 12,533,095.24 | 25,631,976.00 | 9,678,947.95 | 9,578,768.34 |
| 加权 平均 基金 份额 本期 利润 | 0.0361 | 0.0354 | 0.0263 | 0.0224 | 0.0039 | 0.0029 |
| 本期 基金 份额 净值 增长 率 | 3.78% | 3.59% | 2.67% | 2.47% | 1.30% | 0.30% |
| 3.1.2 期末 数据 和指 标 | 2017 年末 | | 2016 年末 | | 2015 年末 | |
| 期末 可供 分配 基金 份额 利润 | 0.0207 | 0.0172 | 0.0374 | 0.0351 | 0.0048 | 0.0049 |
| 期末 基金 资产 净值 | 105,841,966.70 | 727,698,677.28 | 175,950,491.83 | 815,062,692.42 | 1,232,097,499.78 | 3,469,412,255.47 |

| | | | | | | |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 期末 基金 份额 净值 | 1.021 | 1.017 | 1.040 | 1.038 | 1.013 | 1.013 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

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

诺安创新驱动混合 A

| 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 | 1.28% | 0.13% | 2.77% | 0.49% | -1.49% | -0.36% |
| 过去六个月 | 2.38% | 0.13% | 5.86% | 0.42% | -3.48% | -0.29% |
| 过去一年 | 3.78% | 0.12% | 12.53% | 0.39% | -8.75% | -0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.93% | 0.10% | -9.22% | 0.98% | 17.15% | -0.88% |

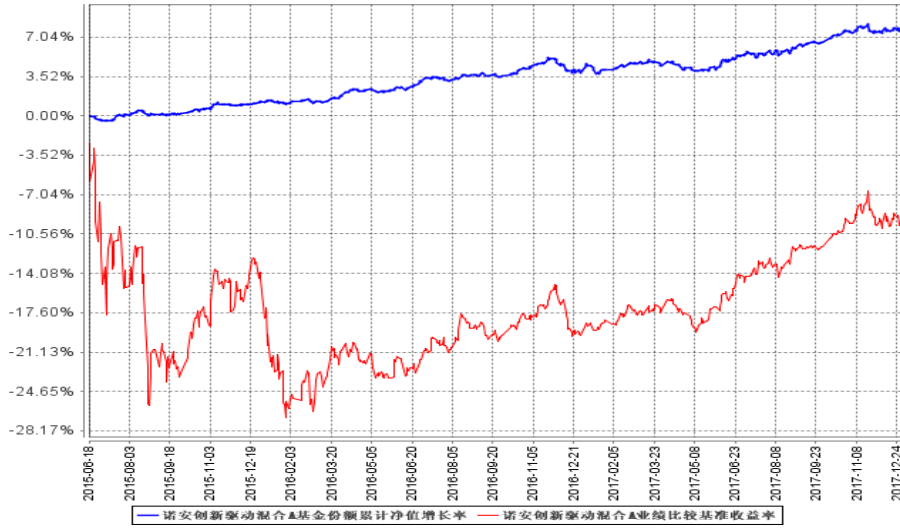
诺安创新驱动混合 C

| 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 | 1.18% | 0.13% | 2.77% | 0.49% | -1.59% | -0.36% |
| 过去六个月 | 2.29% | 0.13% | 5.86% | 0.42% | -3.57% | -0.29% |
| 过去一年 | 3.59% | 0.12% | 12.53% | 0.39% | -8.94% | -0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.46% | 0.11% | 7.36% | 0.68% | -0.90% | -0.57% |

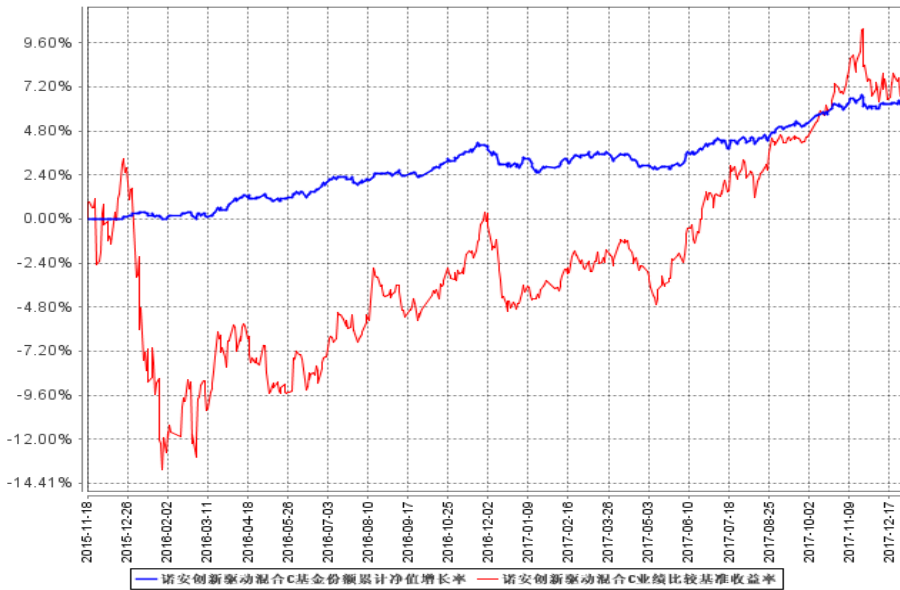
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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

诺安创新驱动混合 A



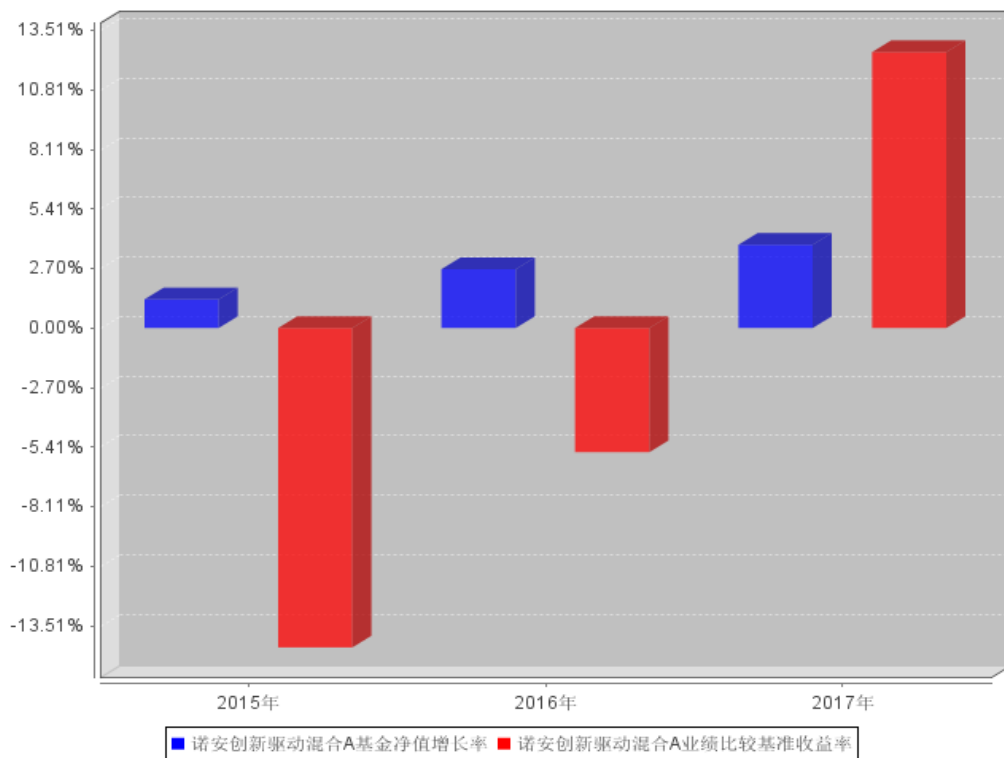
诺安创新驱动混合 C



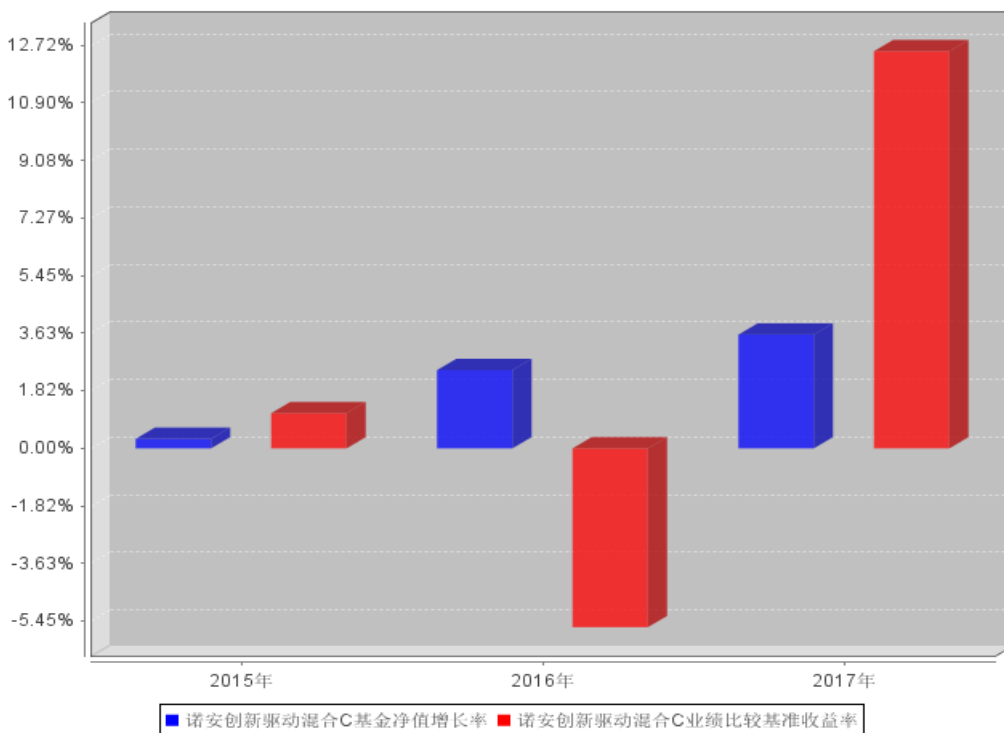
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安创新驱动混合 A

Comment [helz]: 格式不对



诺安创新驱动混合 C



注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 18 日生效, 2015 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

单位：人民币元

| 诺安创新驱动混合 A | | | | | |
|------------|-------------|--------------|--------------|--------------|----|
| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2017 | 0.5700 | 5,009,891.56 | 2,903,271.10 | 7,913,162.66 | |
| 2016 | - | - | - | - | |
| 2015 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.5700 | 5,009,891.56 | 2,903,271.10 | 7,913,162.66 | |

单位：人民币元

| 诺安创新驱动混合 C | | | | | |
|------------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2017 | 0.5700 | 43,847,048.91 | - | 43,847,048.91 | |
| 2016 | - | - | - | - | |
| 2015 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.5700 | 43,847,048.91 | - | 43,847,048.91 | |

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 53 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|----|--|
| 吴博俊 | 诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015年6月18日 | - | 10 | 硕士，2008年加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014年6月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年6月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺安创新驱动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基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安创新驱动灵活配置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《诺安创新驱动灵活配置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

2017 年中国实体经济表现良好，全年 GDP 同比增长 6.9%，是七年来的首次增速回升；剔除金融业后全年 GDP 同比增长 7.1%，规模以上工业同比增长 6.6%，快于 2016 年 0.6 个百分点。全年 CPI 同比增长 1.6%，PPI 走出通缩，企业利润显著恢复，且信贷与社融平稳增长，M2 增速创历史新低，经济增长对货币增长依赖降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安创新驱动混合 A 的基金份额净值为 1.021 元。本报告期基金份额净值增长率为 3.78%，同期业绩比较基准收益率为 12.53%。

截至报告期末，诺安创新驱动混合 C 的基金份额净值为 1.017 元。本报告期基金份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准收益率为 12.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我国经济仍面临一定挑战。2017 年 12 月基建与房地产投资减速，预示 2018 年投资可能继续下降；同时通胀预期有所上升，在全球货币收紧背景下，预计我国货币政策易紧难松。金融监管力度进一步加强，有助于防控系统性风险，但实体经济融资成本也有所上升。中央经济工作会议“稳中求进”工作总基调更为强调“进”和改革。经济增长等短期目标略有淡化，更为关注供给侧改革等长期性目标。这一背景下，财政与货币政策侧重点会有所调整。财政政策稳增长任务弱化，未来强调服务于供给侧改革，更多向民生、教育、医疗等公共服务领域倾斜；货币政策“数量”目标弱化。

股票投资方面，优质蓝筹股以及低估值业绩增长的成长股都会是我们 2018 投资的主要方向。另外，结合政策方面，国企改革、十三五规划等政策主题投资依然值得跟踪关注。同时，静待注册制推出的契机。债券配置方面，震荡市中，我们会适当加大在高等级、短期限的债券的配置比例以获取稳定的收益。

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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期共进行利润分配两次。2017 年 3 月 22 日（权益登记日）进行第一次利润分配，诺安创新驱动 A 共分配利润 6,565,114.51 元，每 10 份基金份额分红 0.4400 元；诺安创新驱动 C 共分配利润 34,546,491.09 元，每 10 份基金份额分红 0.4400 元。2017 年 12 月 29 日（权益登记日）进行第二次利润分配，诺安创新驱动 A 共分配利润 1,348,048.15 元，每 10 份基金份额分红 0.1300 元；诺安创新驱动 C 共分配利润 9,300,557.82 元，每 10 份基金份额分红 0.1300 元。符合本基金合同约定。

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创新驱动灵活配置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，诺安创新驱动灵活配置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创新驱动灵活配置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，诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额为 51,760,211.57 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师左艳霞、张品于 2017 年 3 月 28 日出具了毕马威华振审字第 1801609 号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 54,199,936.31 | 139,958,796.70 |
| 结算备付金 | 1,074,913.81 | 301,028.07 |
| 存出保证金 | 161,965.95 | 55,771.50 |
| 交易性金融资产 | 744,965,726.19 | 647,007,783.13 |
| 其中：股票投资 | 91,141,726.19 | 118,103,414.39 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 653,824,000.00 | 528,904,368.74 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 36,140,485.13 | 199,500,419.25 |
| 应收证券清算款 | 2,482,448.95 | 210,238.77 |
| 应收利息 | 6,596,719.63 | 5,862,363.16 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 845,622,195.97 | 992,896,400.58 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | 79,099.94 | 394,605.46 |
| 应付管理人报酬 | 429,595.85 | 804,909.31 |
| 应付托管费 | 178,998.29 | 211,589.68 |
| 应付销售服务费 | 62,415.74 | 69,198.38 |
| 应付交易费用 | 532,826.15 | 222,171.75 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | 10,648,605.97 | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 150,010.05 | 180,741.75 |
| 负债合计 | 12,081,551.99 | 1,883,216.33 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 819,123,518.08 | 954,270,687.97 |
| 未分配利润 | 14,417,125.90 | 36,742,496.28 |
| 所有者权益合计 | 833,540,643.98 | 991,013,184.25 |
| 负债和所有者权益总计 | 845,622,195.97 | 992,896,400.58 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 819,123,518.08 份，其中，诺安创新驱动混合 A 类基金份额净值人民币 1.021 元，基金份额 103,695,993.33 份；诺安创新驱动混合 C 类基金份额净值人民币 1.017 元，基金份额 715,427,524.75 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------|---|--|
| 一、收入 | 43,184,542.09 | 70,132,696.15 |
| 1.利息收入 | 25,466,549.23 | 35,721,938.99 |
| 其中：存款利息收入 | 1,023,120.50 | 1,517,065.44 |
| 债券利息收入 | 19,068,148.27 | 21,490,223.52 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 5,375,280.46 | 12,714,650.03 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 26,084,632.30 | 37,905,302.40 |
| 其中：股票投资收益 | 26,099,219.20 | 28,330,644.19 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -1,475,499.01 | 9,321,854.31 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |

| | | |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,460,912.11 | 252,803.90 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -8,391,022.80 | -4,515,049.53 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 24,383.36 | 1,020,504.29 |
| 减：二、费用 | 11,907,654.14 | 31,967,624.91 |
| 1. 管理人报酬 | 5,397,041.72 | 24,735,077.06 |
| 2. 托管费 | 2,248,767.38 | 4,199,950.96 |
| 3. 销售服务费 | 763,121.01 | 1,185,841.17 |
| 4. 交易费用 | 3,164,103.53 | 1,198,592.19 |
| 5. 利息支出 | 3,646.65 | 234,979.45 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 3,646.65 | 234,979.45 |
| 6. 其他费用 | 330,973.85 | 413,184.08 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 31,276,887.95 | 38,165,071.24 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 31,276,887.95 | 38,165,071.24 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | |
|-----------------------------------|-----------------------------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 954,270,687.97 | 36,742,496.28 | 991,013,184.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 31,276,887.95 | 31,276,887.95 |
| 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） | -135,147,169.89 | -1,842,046.76 | -136,989,216.65 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,404,694.65 | 9,618.54 | 2,414,313.19 |
| 2. 基金赎回款 | -137,551,864.54 | -1,851,665.30 | -139,403,529.84 |
| 四、本期向基金份额持 | - | -51,760,211.57 | -51,760,211.57 |

| | | | |
|--|----------------------------------|----------------|-------------------|
| 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） | 819,123,518.08 | 14,417,125.90 | 833,540,643.98 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 4,642,465,782.23 | 59,043,973.02 | 4,701,509,755.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 38,165,071.24 | 38,165,071.24 |
| 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） | -3,688,195,094.26 | -60,466,547.98 | -3,748,661,642.24 |
| 其中：1. 基金申购款 | 147,136,084.16 | 1,765,633.01 | 148,901,717.17 |
| 2. 基金赎回款 | -3,835,331,178.42 | -62,232,180.99 | -3,897,563,359.41 |
| 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） | 954,270,687.97 | 36,742,496.28 | 991,013,184.25 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <u> 奥成文 </u> | <u> 薛有为 </u> | <u> 薛有为 </u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕1026号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年6月18日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为

6,170,337,782.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 313,936.26 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2015 年 11 月 18 日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金新增基金份额类别并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》，自 2015 年 11 月 18 日起，本基金将设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额的基金代码为 001411（与分级前基金代码相同）。新设 C 类基金份额代码为 002051。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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）、权证、股指期货等权益类金融工具，国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含分离交易债）、可交换债、央票、中期票据、资产支持证券等固定收益类品种，短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具，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。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。本基金的资产配置比例范围为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于创新驱动型相关主题上市公司的证券比例不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的财务报表于 2018 年 3 月 28 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.5 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。

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2015〕125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2017〕56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，

建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

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

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

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

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

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

7.4.7 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2016年1月1日至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,397,041.72 | 24,735,077.06 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,605,823.68 | 9,151,724.87 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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 2-5 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,248,767.38 | 4,199,950.96 |

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|---------------------|----------------------------------|---------------|--------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 诺安创新驱动混合 A | 诺安创新驱动混合 C | 合计 |
| 诺安基金管理有限公司 (管理人) | - | 763,121.01 | 763,121.01 |
| 中国工商银行股份有限公司(托管人) | - | - | - |
| 合计 | - | 763,121.01 | 763,121.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 诺安创新驱动混合 A | 诺安创新驱动混合 C | 合计 |
| 诺安基金管理有限公司 (管理人) | - | 1,185,822.00 | 1,185,822.00 |
| 中国工商银行股份有限公司(托管人) | - | - | - |
| 合计 | - | 1,185,822.00 | 1,185,822.00 |

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%，按

前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 级基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 12 月 31 日 | | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 54,199,936.31 | 1,006,414.11 | 139,958,796.70 | 1,179,988.30 |

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------------|-----------------|--------|-------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300713 | 英可瑞 | 2017 年 10 月 23 日 | 2018 年 11 月 1 日 | 新股流通受限 | 40.29 | 74.87 | 7,008 | 282,352.32 | 524,688.96 | - |

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.9.2 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 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 300383 | 光环新网 | 2017 年 11 月 7 日 | 重大事项 | 13.19 | 2018 年 3 月 19 日 | 14.51 | 63,300 | 999,687.00 | 834,927.00 | - |
| 300730 | 科创信息 | 2017 年 12 月 25 日 | 临时停牌 | 41.55 | 2018 年 1 月 2 日 | 45.71 | 821 | 6,863.56 | 34,112.55 | - |
| 002919 | 名臣健康 | 2017 年 12 月 28 日 | 临时停牌 | 35.26 | 2018 年 1 月 2 日 | 38.79 | 821 | 10,311.76 | 28,948.46 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

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

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

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 89,719,049.22 元，属于第二层次的余额为 655,246,676.97 元，无属于第三层次余额。

(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次的余额为 112,983,681.97 元，属于第二层次的余额为 533,786,406.15 元，属于第三层次的余额为 237,695.01 元，其中列入属于第三层次的金融工具为未上市交易的股票和债券)。

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

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

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

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 91,141,726.19 | 10.78 |
| | 其中：股票 | 91,141,726.19 | 10.78 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 653,824,000.00 | 77.32 |
| | 其中：债券 | 653,824,000.00 | 77.32 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 36,140,485.13 | 4.27 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 55,274,850.12 | 6.54 |
| 8 | 其他各项资产 | 9,241,134.53 | 1.09 |
| 9 | 合计 | 845,622,195.97 | 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 | 3,270,355.00 | 0.39 |
| C | 制造业 | 54,683,215.44 | 6.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 501,978.90 | 0.06 |
| E | 建筑业 | 7,059,279.00 | 0.85 |
| F | 批发和零售业 | 3,469,792.00 | 0.42 |
| 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 | 5,778,591.31 | 0.69 |
| J | 金融业 | 10,645,824.00 | 1.28 |
| K | 房地产业 | 1,528,219.52 | 0.18 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,400,432.64 | 0.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,956.04 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 800,088.00 | 0.10 |
| 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 | 1,994.34 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 91,141,726.19 | 10.93 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 300033 | 同花顺 | 78,400 | 3,918,432.00 | 0.47 |
| 2 | 002027 | 分众传媒 | 241,508 | 3,400,432.64 | 0.41 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 142,900 | 3,299,561.00 | 0.40 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 533,500 | 3,270,355.00 | 0.39 |
| 5 | 600705 | 中航资本 | 480,400 | 2,651,808.00 | 0.32 |
| 6 | 600176 | 中国巨石 | 160,079 | 2,607,686.91 | 0.31 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 131,800 | 2,385,580.00 | 0.29 |
| 8 | 600217 | 中再资环 | 366,200 | 2,380,300.00 | 0.29 |
| 9 | 002543 | 万和电气 | 100,000 | 2,288,000.00 | 0.27 |
| 10 | 000498 | 山东路桥 | 335,100 | 2,238,468.00 | 0.27 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.lionfund.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 002027 | 分众传媒 | 20,515,804.20 | 2.07 |
| 2 | 601231 | 环旭电子 | 19,542,733.31 | 1.97 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 14,314,981.00 | 1.44 |
| 4 | 601336 | 新华保险 | 13,731,624.49 | 1.39 |
| 5 | 000928 | 中钢国际 | 12,521,991.40 | 1.26 |
| 6 | 001979 | 招商蛇口 | 12,491,323.82 | 1.26 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 11,999,169.00 | 1.21 |
| 8 | 600690 | 青岛海尔 | 10,030,727.00 | 1.01 |
| 9 | 000065 | 北方国际 | 10,019,936.49 | 1.01 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 9,995,976.00 | 1.01 |
| 11 | 600729 | 重庆百货 | 9,986,405.42 | 1.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 600176 | 中国巨石 | 9,915,731.80 | 1.00 |
| 13 | 300197 | 铁汉生态 | 8,946,454.84 | 0.90 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 8,703,165.02 | 0.88 |
| 15 | 600068 | 葛洲坝 | 8,497,036.08 | 0.86 |
| 16 | 000671 | 阳光城 | 8,071,362.00 | 0.81 |
| 17 | 601818 | 光大银行 | 7,998,832.00 | 0.81 |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 7,997,875.00 | 0.81 |
| 19 | 000498 | 山东路桥 | 7,497,413.20 | 0.76 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 7,368,254.64 | 0.74 |

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601231 | 环旭电子 | 20,210,018.38 | 2.04 |
| 2 | 002027 | 分众传媒 | 18,609,327.78 | 1.88 |
| 3 | 600209 | 罗顿发展 | 14,924,460.34 | 1.51 |
| 4 | 000928 | 中钢国际 | 12,671,362.40 | 1.28 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 12,234,493.28 | 1.23 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 11,972,146.56 | 1.21 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 11,901,874.00 | 1.20 |
| 8 | 001979 | 招商蛇口 | 10,841,945.55 | 1.09 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 10,382,693.45 | 1.05 |
| 10 | 600690 | 青岛海尔 | 10,341,152.02 | 1.04 |
| 11 | 000858 | 五粮液 | 9,457,467.52 | 0.95 |
| 12 | 000065 | 北方国际 | 9,387,330.63 | 0.95 |
| 13 | 600729 | 重庆百货 | 9,291,447.41 | 0.94 |
| 14 | 600068 | 葛洲坝 | 8,837,151.92 | 0.89 |
| 15 | 000671 | 阳光城 | 8,545,618.76 | 0.86 |
| 16 | 600176 | 中国巨石 | 8,382,969.89 | 0.85 |
| 17 | 601601 | 中国太保 | 8,195,606.88 | 0.83 |
| 18 | 601628 | 中国人寿 | 8,194,351.08 | 0.83 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 8,115,298.90 | 0.82 |
| 20 | 601818 | 光大银行 | 7,951,063.00 | 0.80 |

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 | 1,011,023,910.05 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,055,102,141.12 |

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 | 19,960,000.00 | 2.39 |
| | 其中：政策性金融债 | 19,960,000.00 | 2.39 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 289,511,000.00 | 34.73 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 344,353,000.00 | 41.31 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 653,824,000.00 | 78.44 |

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 | 041762027 | 17 盐城市政 CP001 | 500,000 | 49,840,000.00 | 5.98 |
| 2 | 011762052 | 17 东莞发展 SCP002 | 300,000 | 30,006,000.00 | 3.60 |
| 3 | 011754126 | 17 广物控股 SCP001 | 300,000 | 29,994,000.00 | 3.60 |
| 4 | 011755049 | 17 嘉公路 SCP001 | 300,000 | 29,976,000.00 | 3.60 |
| 5 | 011763022 | 17 漳州交运 SCP001 | 300,000 | 29,964,000.00 | 3.59 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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,除分众传媒、中信证券和同花顺外,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。

(1)2017年7月7日,分众传媒信息技术股份有限公司收到广东监管局警示函的整改报告,主要是因为:(一)公司2015年年报财务报表附注“货币资金—使用有限制的货币资金”中未披露上海分众德峰广告传播有限公司银行账户被有权机关冻结的情况。(二)公司披露与方源资本成立体育基金暨关联交易进展情况的时间晚于相关媒体发布会的时间。(三)公司披露下属子公司与WME/IMG中国签订商业合作协议的公告,公告中关于协议的主要内容的表述过于简单,未将协议中主要条款进行充分披露。(四)2016年,经公司股东大会审议通过的相关《关于使用自有闲置资金购买银行理财产品的议案》均同意公司可以使用不超过一定额度的人民币的自有闲置资金购买安全性高、流动性好的、由商业银行发行的保证收益型的保本型理财产品,并授权公司总裁、财务负责人根据上述原则行使具体理财产品的购买决策权,并由财务部负责具体购买事宜。但公司实际购买的属于非保本型浮动收益银行理财产品,公司未在股东大会授权范围内购买银行理财产品。

截至本报告期末,分众传媒(002027)为本基金前十大重仓股。此事件发生后,公司第一时间向全体董事、监事和高级管理人员传达本次现场检查的结果,及时组织证券部、财务部、审

计部等相关部门对《警示函》所关注的事项进行深入分析，制定出相应的整改措施。从投资角度，公司历史经营稳健，估值合理，因此本基金才继续持有该股票，本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

(2)2017 年 7 月 7 日，中信证券股份有限公司收到中国证监会行政处罚事先告知书，主要是因为此前 2015 年公司曾公告收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），该次调查的范围是公司在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌。截至近日，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：一、责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处人民币 308,279,248.90 元罚款。

截至本报告期末，中信证券（600030）为本基金前十大重仓股。此事件发生以来的近两年间，在监管机构的指导下，中信证券持续完善相关内控机制，进一步加强日常经营管理，依法合规地开展各项业务，目前该公司的经营情况正常。因此本基金才继续持有中信证券（600030），本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

(3)2017 年 7 月 14 日，浙江核新同花顺网络信息股份有限公司（以下简称“同花顺”）控股子公司浙江同花顺网络科技有限公司（以下简称“网络科技”）因涉嫌违反《证券法》等法律法规的有关规定，被中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）立案调查。2017 年 7 月 21 日，网络科技收到中国证监会浙江监管局下发的《行政处罚事先告知书》（浙处罚字[2017]6 号）。2017 年 8 月 4 日，网络科技收到中国证监会浙江监管局下发的[2017]4 号《行政处罚决定书》，中国证监会浙江监管局决定对网络科技责令整改，并处以 20 万元罚款。主要是因为网络科技运营管理的同花顺财经网站债券子站点传播误导性信息。目前网络科技生产经营状况正常。

截至本报告期末，同花顺（300033）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司估值较低，成长潜力较大。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同花顺。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 | 161,965.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,482,448.95 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,596,719.63 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,241,134.53 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 诺安创新驱动混合 A | 2,334 | 44,428.45 | 51,572.36 | 0.50% | 103,644,420.97 | 99.95% |
| 诺安创新驱动混合 C | 1 | 715,427,524.75 | 715,427,524.75 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 2,335 | 350,802.36 | 715,479,097.11 | 87.35% | 103,644,420.97 | 12.65% |

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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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 | 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 | 诺安创新驱动混合 A | 0 |
| | 诺安创新驱动混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 诺安创新驱动混合 A | 0 |
| | 诺安创新驱动混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 诺安创新驱动混 合 A | 诺安创新驱动混 合 C |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 18 日）基金 份额总额 | 6,170,337,782.74 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 169,123,163.22 | 785,147,524.75 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,404,694.65 | - |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 67,831,864.54 | 69,720,000.00 |
| 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 | 103,695,993.33 | 715,427,524.75 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 5 万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 招商证券 | 1 | 982,574,831.36 | 47.67% | 915,074.28 | 47.67% | - |
| 中信建投 | 1 | 1,078,738,300.58 | 52.33% | 1,004,640.33 | 52.33% | - |

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变更情况：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，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》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | 38,410,908.88 | 88.91% | - | - | - | - |
| 中信建投 | 4,789,743.40 | 11.09% | 300,000,000.00 | 100.00% | - | - |

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|---------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017.01.03-2017.12.29 | 785,147,524.75 | - | 69,720,000.00 | 715,427,524.75 | 87.34% |
| 个 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|
| 人 | | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | |
| <p>本报告期内，本基金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，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。</p> | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

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 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2018 年 3 月 29 日