

诺安先锋混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 23 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 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	37
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.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安先锋混合型证券投资基金
基金简称	诺安先锋混合
基金主代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 19 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,337,683,583.74 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安股票证券投资基金”变更为“诺安先锋混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角,发掘最具投资价值的企业,获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担和控制市场风险的情况下,取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产的配置比例;在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资;在个股选择层面,本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析,挖掘具有中长期投资价值的股票;在债券投资方面,本基金将运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	郭明
	联系电话	0755-83026688	(010) 66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-888-8998	95588
传真	0755-83026677	(010) 66105798
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	秦维舟	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	370,876,829.18
本期利润	509,223,130.43
加权平均基金份额本期利润	0.2115
本期加权平均净值利润率	16.29%
本期基金份额净值增长率	18.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	780,776,958.07
期末可供分配基金份额利润	0.3340
期末基金资产净值	3,118,460,541.81
期末基金份额净值	1.3340
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	403.40%

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

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

③期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

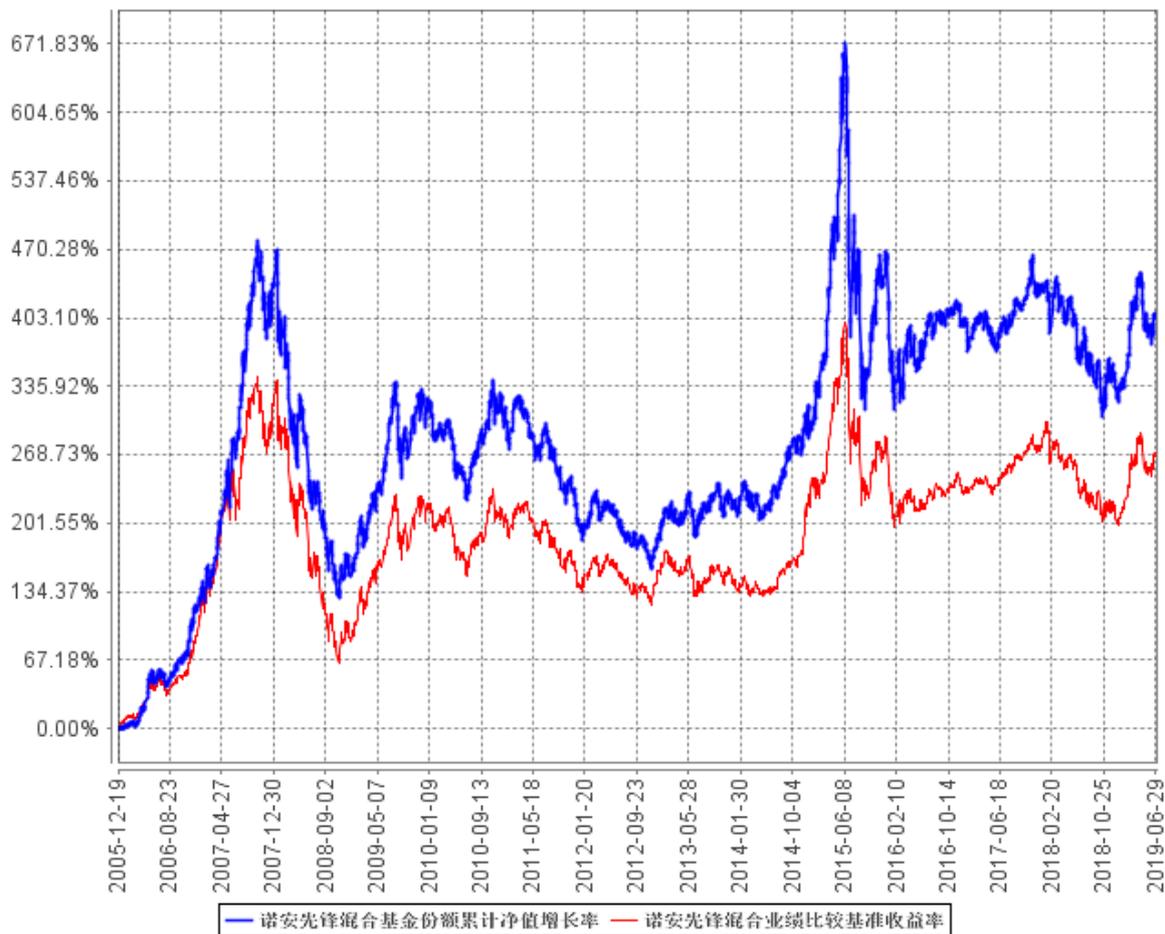
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.32%	1.09%	4.43%	0.93%	-2.11%	0.16%
过去三个月	-3.54%	1.35%	-0.72%	1.22%	-2.82%	0.13%
过去六个月	18.11%	1.33%	21.91%	1.24%	-3.80%	0.09%
过去一年	6.19%	1.38%	8.97%	1.22%	-2.78%	0.16%
过去三年	3.07%	1.06%	14.70%	0.89%	-11.63%	0.17%
自基金合同生效起至今	403.40%	1.52%	268.80%	1.41%	134.60%	0.11%

注：自2018年1月22日起，本基金的业绩比较基准由原“80%×富时中国A600指数+20%×富时

中国国债全价指数”变更为“80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率”。

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



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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 2019 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 62 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、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金 (LOF)、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金等。

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		
杨谷	本基金基金经理	2006 年 6 月 22 日	-	22	经济学硕士, CFA, 具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部;2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司, 现任公司副总经理、权益投资事业部总经理、投资一部总监。曾于 2006 年 11 月至 2007 年 11 月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理, 2010 年 9 月至 2015 年 1 月任诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理, 2013 年 4 月至 2015 年 1 月任诺安多策略股票型证券投资基金基金经理, 2006 年 2 月起任诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，主要原因在于投资组合采用不同的投资策略。经检查未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，A 股市场前半场与后半场表现大相径庭。

一季度，在以下几方面因素的共振下，A 股市场出现了普涨行情：①全球宏观风险预期转向，出于对中美贸易谈判前景的乐观预期以及美联储的鸽派转向预期，市场修复了 2018 年 4 季度的悲观预期；②国内货币宽松向信贷宽松的传导效应逐渐显现，社融等指标出现拐点；③优质蓝筹的估值中枢出现较好的吸引力，外资不断买入。

二季度，A 股市场较之一季度而言出现明显回落，主要原因包括：①4 月份担忧货币政策边际收紧；②5 月份中美贸易谈判进程出现转折；③6 月担忧金融供给侧改革对流动性的影响。尽管市场的某些担忧有所证伪（或者说这些担忧目前仍在政府管理部门可控范围内），但总体而言，投资

者的风险偏好相对于一季度显著下降。

回顾本基金的投资策略，上半年基本上紧密跟随了市场节奏，即在一季度市场启动时对仓位进行了显著上调，持仓结构也更为积极；同时，在一季度末做出了相对准确的市场预测，二季度时，对高弹性的主题投资板块的配置做了调整。

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 1.3340 元。本报告期基金份额净值增长率为 18.11%，同期业绩比较基准收益率为 21.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，我们认为市场震荡的概率较大，短期尚难以出现趋势性的行情，理由在于：①宏观经济周期性回落的趋势尚未改变，周期板块中的部分行业因为供给侧改革影响，盈利处于高位，有出现拐点的风险。②货币政策短期进一步宽松的概率有所下降，金融供给侧改革尽管会讲究艺术，但大概率会持续推进，市场风险偏好受压制。③短期市场需要寻找新的做多逻辑，但海外国内市场环境暂时都不支持。

基于上述判断，我们在未来一段时间倾向于均衡策略，在仓位和标的弹性选择上相较于上半年会有所调整。

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

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 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少一次，最多为六次；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

4.8 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先锋混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，诺安先锋混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安先锋混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，诺安先锋混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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先锋混合型证券投资基金 2019 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：诺安先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	641,947,426.89	338,428,917.73
结算备付金		33,545,165.51	28,188,056.98
存出保证金		1,527,357.61	1,122,327.68
交易性金融资产	6.4.7.2	2,432,387,488.24	2,456,609,015.79
其中：股票投资		2,309,297,486.38	2,190,004,018.19
基金投资		-	-
债券投资		123,090,001.86	266,604,997.60
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		24,384,634.43	12,903,806.15
应收利息	6.4.7.5	412,763.71	624,723.61
应收股利		-	-
应收申购款		32,140.50	77,442.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,134,236,976.89	2,837,954,290.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	27,271,586.86
应付赎回款		1,959,463.44	849,262.70
应付管理人报酬		3,774,157.57	3,682,057.61
应付托管费		629,026.26	613,676.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,188,454.55	9,323,579.11
应交税费		26,704.03	30,628.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,629.23	270,151.68
负债合计		15,776,435.08	42,040,943.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,337,683,583.74	2,475,430,594.22
未分配利润	6.4.7.10	780,776,958.07	320,482,752.97
所有者权益合计		3,118,460,541.81	2,795,913,347.19
负债和所有者权益总计		3,134,236,976.89	2,837,954,290.21

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3340 元，基金份额总额 2,337,683,583.74 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安先锋混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		571,347,412.16	-310,671,307.40
1.利息收入		2,228,117.84	2,923,604.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,708,262.32	1,980,106.63
债券利息收入		519,855.52	552,433.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	391,064.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		430,738,986.59	111,016,494.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	389,991,559.94	93,032,106.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,951,666.13	339,589.51
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	18,795,760.52	17,644,798.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	138,346,301.25	-424,630,776.45
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	34,006.48	19,369.84
减：二、费用		62,124,281.73	75,971,953.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,185,556.81	26,180,076.38

2. 托管费	6.4.10.2.2	3,864,259.49	4,363,346.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	34,884,666.32	45,208,342.92
5. 利息支出		80,065.35	-
其中：卖出回购金融资产支出		80,065.35	-
6. 税金及附加		1,739.75	1,973.83
7. 其他费用	6.4.7.20	107,994.01	218,213.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		509,223,130.43	-386,643,260.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		509,223,130.43	-386,643,260.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安先锋混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	2,475,430,594.22	320,482,752.97	2,795,913,347.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	509,223,130.43	509,223,130.43
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）	-137,747,010.48	-48,928,925.33	-186,675,935.81
其中：1.基金申购款	17,407,701.85	5,232,246.70	22,639,948.55
2.基金赎回款	-155,154,712.33	-54,161,172.03	-209,315,884.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,337,683,583.74	780,776,958.07	3,118,460,541.81
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

合同》和《诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为界定为股票、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的 A 股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债。现金资产主要投资于各类银行存款。本基金组合投资比例是：股票资产 60-95%；债券的比例为 0-35%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 22 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。

6.4.3 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 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、

国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红

利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	641,947,426.89
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	641,947,426.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,300,761,931.85	2,309,297,486.38	8,535,554.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	124,385,726.26	123,090,001.86
	银行间市场	-	-
	合计	124,385,726.26	123,090,001.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,425,147,658.11	2,432,387,488.24	7,239,830.13

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	109,941.64
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	13,585.77
应收债券利息	288,617.73
应收资产支持证券利息	-
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	618.57
合计	412,763.71

注：此处其他列示的是应收存出保证金利息。

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	9,188,454.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,188,454.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付赎回费	250.09

预提费用	198,379.14
合计	198,629.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,475,430,594.22	2,475,430,594.22
本期申购	17,407,701.85	17,407,701.85
本期赎回(以“-”号填列)	-155,154,712.33	-155,154,712.33
本期末	2,337,683,583.74	2,337,683,583.74

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	1,567,380,701.23	-1,246,897,948.26	320,482,752.97
本期利润	370,876,829.18	138,346,301.25	509,223,130.43
本期基金份额交易产生的变动数	-105,143,261.44	56,214,336.11	-48,928,925.33
其中：基金申购款	12,771,023.89	-7,538,777.19	5,232,246.70
基金赎回款	-117,914,285.33	63,753,113.30	-54,161,172.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,833,114,268.97	-1,052,337,310.90	780,776,958.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
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	216,896.35
其他	10,886.52
合计	1,708,262.32

注：此处其他列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,794,740,403.95
减：卖出股票成本总额	16,404,748,844.01
买卖股票差价收入	389,991,559.94

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	226,289,209.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	203,914,222.63
减：应收利息总额	423,321.15
买卖债券差价收入	21,951,666.13

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,795,760.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,795,760.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	138,346,301.25
——股票投资	121,597,933.12
——债券投资	16,748,368.13
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	138,346,301.25

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	32,543.90
基金转换费收入	1,462.58
合计	34,006.48

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	34,884,666.32
银行间市场交易费用	-
合计	34,884,666.32

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	63,666.96
汇划费	614.87
账户维护费	9,000.00
合计	107,994.01

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,185,556.81	26,180,076.38
其中：支付销售机构的客户维护费	4,043,701.80	4,571,166.10

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,864,259.49	4,363,346.01

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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。

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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	641,947,426.89	1,480,479.45	199,173,493.38	1,758,816.87
--------------	----------------	--------------	----------------	--------------

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（2019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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注：截至本报告期末 2019 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2019 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 2019 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险, 主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因; 风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡, 以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标, 本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险, 设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 在董事会下设立合规审查与风险控制委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等; 在管理层层面设立风险控制办公会, 实施董事会合规审查与风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险控制部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金管理人建立了以合规审查与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司, 与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 本基金投资于具有良好信用等级的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券, 不得超过该证券的 10%。

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

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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	30,029,541.60	43,798,274.36
AAA 以下	93,060,460.26	222,806,723.24
未评级	-	-
合计	123,090,001.86	266,604,997.60

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险控制部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，

对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法規规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率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 2019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	641,947,426.89	-	-	-	-	641,947,426.89
结算备付金	33,545,165.51	-	-	-	-	33,545,165.51
存出保证金	1,527,357.61	-	-	-	-	1,527,357.61
交易性金融资产	50,850,407.04	72,239,594.82	-	-	-2,309,297,486.38	2,432,387,488.24
应收证券清算款	-	-	-	-	24,384,634.43	24,384,634.43
应收利息	-	-	-	-	412,763.71	412,763.71
应收申购款	1,318.21	-	-	-	30,822.29	32,140.50
资产总计	727,871,675.26	72,239,594.82	-	-	-2,334,125,706.81	3,134,236,976.89
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,959,463.44	1,959,463.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,774,157.57	3,774,157.57
应付托管费	-	-	-	-	629,026.26	629,026.26
应付交易费用	-	-	-	-	9,188,454.55	9,188,454.55
应交税费	-	-	-	-	26,704.03	26,704.03
其他负债	-	-	-	-	198,629.23	198,629.23
负债总计	-	-	-	-	15,776,435.08	15,776,435.08
利率敏感度缺口	727,871,675.26	72,239,594.82	-	-	-2,318,349,271.73	3,118,460,541.81
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	338,428,917.73	-	-	-	-	338,428,917.73
结算备付金	28,188,056.98	-	-	-	-	28,188,056.98
存出保证金	1,122,327.68	-	-	-	-	1,122,327.68
交易性金融资产	117,915,687.36	137,206,223.74	11,483,086.50	-	-2,190,004,018.19	2,456,609,015.79

应收证券清算款	-	-	-	-	12,903,806.15	12,903,806.15
应收利息	-	-	-	-	624,723.61	624,723.61
应收申购款	298.21	-	-	-	77,144.06	77,442.27
资产总计	485,655,287.96	137,206,223.74	11,483,086.50	-	-2,203,609,692.01	2,837,954,290.21
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	27,271,586.86	27,271,586.86
应付赎回款	-	-	-	-	849,262.70	849,262.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,682,057.61	3,682,057.61
应付托管费	-	-	-	-	613,676.28	613,676.28
应付交易费用	-	-	-	-	9,323,579.11	9,323,579.11
应交税费	-	-	-	-	30,628.78	30,628.78
其他负债	-	-	-	-	270,151.68	270,151.68
负债总计	-	-	-	-	42,040,943.02	42,040,943.02
利率敏感度缺口	485,655,287.96	137,206,223.74	11,483,086.50	-	-2,161,568,748.99	2,795,913,347.19

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末及上年度末，本基金均未持有对利率敏感的交易性债券资产。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,309,297,486.38	74.05	2,190,004,018.19	78.33

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	123,090,001.86	3.95	266,604,997.60	9.54
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,432,387,488.24	78.00	2,456,609,015.79	87.86

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	124,785,198.58	138,579,445.05
	2. 业绩比较基准下降 5%	-124,785,198.58	-138,579,445.05

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

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. 置信区间: 95%		
	2. 观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	71,753,268.47	59,850,842.84
	合计	71,753,268.47	59,850,842.84

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) 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 2019 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次的余额为

2,432,330,511.70 元，无属于第二层级的余额，属于第三层次的余额为 56,976.54 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。(2018 年 12 月 31 日：第一层次 2,436,385,029.21 元，第二层次 20,173,840.78 元，第三层次 50,145.80 元)。

(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 2019 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2018 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。

§ 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	2,309,297,486.38	73.68
	其中：股票	2,309,297,486.38	73.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,090,001.86	3.93
	其中：债券	123,090,001.86	3.93
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	675,492,592.40	21.55
8	其他各项资产	26,356,896.25	0.84
9	合计	3,134,236,976.89	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	14,572,140.50	0.47
B	采矿业	242,646,356.33	7.78
C	制造业	1,081,127,177.36	34.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,610,807.23	3.07
E	建筑业	27,079,504.16	0.87
F	批发和零售业	44,742,475.42	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	86,190,340.00	2.76
H	住宿和餐饮业	4,291,907.20	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,541,681.68	3.96
J	金融业	484,845,998.65	15.55
K	房地产业	39,314,896.27	1.26
L	租赁和商务服务业	6,223,950.86	0.20
M	科学研究和技术服务业	5,755,407.93	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	6,985,078.03	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,684,671.00	0.05
Q	卫生和社会工作	7,158,462.36	0.23

R	文化、体育和娱乐业	34,212,993.16	1.10
S	综合	3,313,638.24	0.11
	合计	2,309,297,486.38	74.05

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	600352	浙江龙盛	9,189,144	144,912,800.88	4.65
2	601288	农业银行	35,228,000	126,820,800.00	4.07
3	002124	天邦股份	5,864,837	76,477,474.48	2.45
4	600036	招商银行	2,083,971	74,981,276.58	2.40
5	600276	恒瑞医药	1,060,948	70,022,568.00	2.25
6	601939	建设银行	8,676,700	64,554,648.00	2.07
7	600016	民生银行	8,876,956	56,368,670.60	1.81
8	600489	中金黄金	5,175,738	53,154,829.26	1.70
9	600547	山东黄金	1,228,152	50,563,017.84	1.62
10	601988	中国银行	12,120,900	45,332,166.00	1.45
11	600900	长江电力	2,319,416	41,517,546.40	1.33
12	600585	海螺水泥	945,795	39,250,492.50	1.26
13	601088	中国神华	1,876,707	38,247,288.66	1.23
14	002237	恒邦股份	2,025,900	33,852,789.00	1.09
15	600583	海油工程	5,348,458	29,951,364.80	0.96
16	600018	上港集团	4,347,043	29,646,833.26	0.95
17	600000	浦发银行	2,497,066	29,165,730.88	0.94
18	000830	鲁西化工	2,599,782	28,285,628.16	0.91
19	000990	诚志股份	1,689,100	27,718,131.00	0.89
20	002007	华兰生物	819,578	24,988,933.22	0.80
21	601006	大秦铁路	3,081,000	24,925,290.00	0.80
22	601225	陕西煤业	2,367,018	21,871,246.32	0.70
23	300144	宋城演艺	929,681	21,512,818.34	0.69
24	601818	光大银行	5,457,600	20,793,456.00	0.67
25	600535	天士力	1,218,908	20,172,927.40	0.65
26	600804	鹏博士	2,483,456	18,675,589.12	0.60
27	002475	立讯精密	739,918	18,342,567.22	0.59
28	600298	安琪酵母	545,653	17,259,004.39	0.55
29	601009	南京银行	1,926,500	15,912,890.00	0.51
30	002271	东方雨虹	688,560	15,602,769.60	0.50

31	002268	卫士通	636,100	15,552,645.00	0.50
32	600572	康恩贝	2,399,100	15,354,240.00	0.49
33	002155	湖南黄金	1,483,226	14,936,085.82	0.48
34	603979	金诚信	1,761,634	14,832,958.28	0.48
35	002716	金贵银业	1,800,000	14,040,000.00	0.45
36	600177	雅戈尔	2,172,832	13,797,483.20	0.44
37	600011	华能国际	2,128,100	13,258,063.00	0.43
38	600816	安信信托	2,409,290	12,166,914.50	0.39
39	300725	药石科技	193,594	12,066,714.02	0.39
40	300098	高新兴	1,269,800	10,133,004.00	0.32
41	603026	石大胜华	333,600	10,094,736.00	0.32
42	002572	索菲亚	542,716	10,072,808.96	0.32
43	600674	川投能源	1,062,200	9,453,580.00	0.30
44	000550	江铃汽车	469,600	9,105,544.00	0.29
45	600072	中船科技	702,100	9,085,174.00	0.29
46	603108	润达医疗	851,017	9,003,759.86	0.29
47	600967	内蒙一机	800,000	8,960,000.00	0.29
48	002353	杰瑞股份	380,593	8,791,698.30	0.28
49	601998	中信银行	1,460,700	8,720,379.00	0.28
50	600557	康缘药业	575,405	8,550,518.30	0.27
51	600337	美克家居	2,050,800	8,449,296.00	0.27
52	000786	北新建材	463,939	8,411,214.07	0.27
53	002526	山东矿机	3,656,200	8,372,698.00	0.27
54	002157	正邦科技	500,000	8,330,000.00	0.27
55	000813	德展健康	1,070,475	8,157,019.50	0.26
56	603368	柳药股份	242,166	7,962,418.08	0.26
57	600088	中视传媒	580,380	7,887,364.20	0.25
58	000958	东方能源	1,225,300	7,841,920.00	0.25
59	002129	中环股份	800,000	7,808,000.00	0.25
60	300099	精准信息	1,087,100	7,805,378.00	0.25
61	600781	辅仁药业	692,500	7,638,275.00	0.24
62	600226	瀚叶股份	2,375,326	7,553,536.68	0.24
63	300003	乐普医疗	327,464	7,538,221.28	0.24
64	600884	杉杉股份	704,662	7,504,650.30	0.24
65	600640	号百控股	560,800	7,503,504.00	0.24
66	002925	盈趣科技	189,000	7,372,890.00	0.24
67	300113	顺网科技	462,600	7,253,568.00	0.23
68	600926	杭州银行	869,400	7,242,102.00	0.23
69	002358	森源电气	711,600	7,222,740.00	0.23

70	600822	上海物贸	578,400	7,177,944.00	0.23
71	300244	迪安诊断	421,582	7,158,462.36	0.23
72	601229	上海银行	602,700	7,141,995.00	0.23
73	002714	牧原股份	121,423	7,138,458.17	0.23
74	603421	鼎信通讯	364,409	7,105,975.50	0.23
75	002025	航天电器	291,144	7,098,090.72	0.23
76	300569	天能重工	600,017	6,996,198.22	0.22
77	603866	桃李面包	165,081	6,875,623.65	0.22
78	600377	宁沪高速	639,934	6,872,891.16	0.22
79	600642	申能股份	1,124,617	6,758,948.17	0.22
80	002192	融捷股份	329,100	6,680,730.00	0.21
81	600602	云赛智联	867,460	6,653,418.20	0.21
82	002422	科伦药业	222,875	6,626,073.75	0.21
83	002074	国轩高科	491,530	6,443,958.30	0.21
84	603507	振江股份	300,143	6,357,028.74	0.20
85	002679	福建金森	347,730	6,266,094.60	0.20
86	601699	潞安环能	784,700	6,230,518.00	0.20
87	600081	东风科技	520,400	6,192,760.00	0.20
88	002179	中航光电	183,231	6,130,909.26	0.20
89	002815	崇达技术	389,900	6,078,541.00	0.19
90	601668	中国建筑	1,044,500	6,005,875.00	0.19
91	600028	中国石化	1,083,400	5,926,198.00	0.19
92	300616	尚品宅配	78,100	5,905,922.00	0.19
93	601231	环旭电子	481,800	5,805,690.00	0.19
94	300026	红日药业	1,658,300	5,721,135.00	0.18
95	300296	利亚德	716,950	5,613,718.50	0.18
96	600478	科力远	1,000,000	5,590,000.00	0.18
97	000598	兴蓉环境	1,225,100	5,574,205.00	0.18
98	600648	外高桥	263,266	5,523,320.68	0.18
99	601021	春秋航空	122,511	5,512,995.00	0.18
100	000852	石化机械	599,950	5,399,550.00	0.17
101	002385	大北农	999,955	5,289,761.95	0.17
102	603888	新华网	262,700	5,243,492.00	0.17
103	002373	千方科技	300,000	5,130,000.00	0.16
104	300110	华仁药业	1,116,100	5,111,738.00	0.16
105	600919	江苏银行	700,919	5,088,671.94	0.16
106	300146	汤臣倍健	256,400	4,974,160.00	0.16
107	300168	万达信息	377,800	4,900,066.00	0.16
108	002035	华帝股份	399,400	4,864,692.00	0.16

109	300108	吉药控股	855,971	4,836,236.15	0.16
110	000403	振兴生化	179,935	4,804,264.50	0.15
111	002412	汉森制药	376,290	4,778,883.00	0.15
112	000921	海信家电	377,683	4,713,483.84	0.15
113	000815	美利云	504,000	4,672,080.00	0.15
114	002918	蒙娜丽莎	398,536	4,666,856.56	0.15
115	300536	农尚环境	436,650	4,632,856.50	0.15
116	300266	兴源环境	1,018,000	4,621,720.00	0.15
117	000859	国风塑业	928,800	4,560,408.00	0.15
118	000885	城发环境	396,000	4,423,320.00	0.14
119	002142	宁波银行	181,811	4,407,098.64	0.14
120	000999	华润三九	147,490	4,327,356.60	0.14
121	600675	中华企业	832,634	4,321,370.46	0.14
122	600612	老凤祥	95,900	4,286,730.00	0.14
123	000727	华东科技	2,038,900	4,261,301.00	0.14
124	600448	华纺股份	726,800	4,251,780.00	0.14
125	603033	三维股份	244,769	4,227,160.63	0.14
126	300558	贝达药业	99,200	4,116,800.00	0.13
127	002262	恩华药业	381,100	4,112,069.00	0.13
128	000560	我爱我家	858,800	4,105,064.00	0.13
129	300041	回天新材	423,400	4,064,640.00	0.13
130	600664	哈药股份	981,400	4,062,996.00	0.13
131	603848	好太太	273,339	3,993,482.79	0.13
132	603000	人民网	223,500	3,985,005.00	0.13
133	300203	聚光科技	166,700	3,984,130.00	0.13
134	002831	裕同科技	206,201	3,952,873.17	0.13
135	300446	乐凯新材	184,781	3,939,530.92	0.13
136	300122	智飞生物	90,800	3,913,480.00	0.13
137	000910	大亚圣象	349,214	3,890,243.96	0.12
138	600055	万东医疗	373,130	3,873,089.40	0.12
139	000968	蓝焰控股	332,155	3,856,319.55	0.12
140	601997	贵阳银行	440,900	3,813,785.00	0.12
141	300012	华测检测	350,300	3,783,240.00	0.12
142	002822	中装建设	598,200	3,756,696.00	0.12
143	300496	中科创达	127,098	3,696,009.84	0.12
144	300400	劲拓股份	248,500	3,680,285.00	0.12
145	600236	桂冠电力	599,050	3,630,243.00	0.12
146	600446	金证股份	180,391	3,542,879.24	0.11
147	002250	联化科技	315,200	3,495,568.00	0.11

148	000513	丽珠集团	104,890	3,485,494.70	0.11
149	002530	金财互联	356,300	3,477,488.00	0.11
150	600771	广誉远	174,969	3,394,398.60	0.11
151	300409	道氏技术	266,500	3,365,895.00	0.11
152	600258	首旅酒店	185,140	3,328,817.20	0.11
153	601008	连云港	676,300	3,225,951.00	0.10
154	300482	万孚生物	85,200	3,212,040.00	0.10
155	300457	赢合科技	124,700	3,108,771.00	0.10
156	300467	迅游科技	166,900	3,074,298.00	0.10
157	000667	美好置业	1,166,050	3,066,711.50	0.10
158	002555	三七互娱	224,800	3,046,040.00	0.10
159	600897	厦门空港	122,600	2,955,886.00	0.09
160	000156	华数传媒	263,700	2,903,337.00	0.09
161	002668	奥马电器	557,600	2,888,368.00	0.09
162	300552	万集科技	100,000	2,879,000.00	0.09
163	300145	中金环境	658,300	2,857,022.00	0.09
164	002859	洁美科技	107,100	2,816,730.00	0.09
165	300006	莱美药业	601,600	2,809,472.00	0.09
166	600620	天宸股份	367,600	2,760,676.00	0.09
167	002036	联创电子	301,180	2,755,797.00	0.09
168	603086	先达股份	95,800	2,740,838.00	0.09
169	600395	盘江股份	457,400	2,703,234.00	0.09
170	603501	韦尔股份	48,800	2,679,608.00	0.09
171	000682	东方电子	551,500	2,592,050.00	0.08
172	300596	利安隆	84,850	2,579,440.00	0.08
173	300430	诚益通	282,129	2,556,088.74	0.08
174	601888	中国国旅	28,458	2,522,801.70	0.08
175	601139	深圳燃气	426,500	2,426,785.00	0.08
176	002522	浙江众成	322,500	2,421,975.00	0.08
177	600093	易见股份	211,200	2,418,240.00	0.08
178	002328	新朋股份	562,470	2,356,749.30	0.08
179	000883	湖北能源	538,300	2,336,222.00	0.07
180	000926	福星股份	337,366	2,334,572.72	0.07
181	600094	大名城	368,800	2,319,752.00	0.07
182	300527	中国应急	203,400	2,247,570.00	0.07
183	002354	天神娱乐	642,500	2,242,325.00	0.07
184	600367	红星发展	253,500	2,175,030.00	0.07
185	603806	福斯特	59,100	2,170,743.00	0.07
186	603156	养元饮品	57,707	2,139,775.56	0.07

187	000790	泰合健康	491,429	2,088,573.25	0.07
188	601838	成都银行	236,512	2,088,400.96	0.07
189	300406	九强生物	134,463	2,027,702.04	0.07
190	600671	天目药业	163,200	1,986,144.00	0.06
191	300420	五洋停车	357,700	1,963,773.00	0.06
192	002916	深南电路	19,183	1,955,131.36	0.06
193	603506	南都物业	78,800	1,919,568.00	0.06
194	603416	信捷电气	77,580	1,903,813.20	0.06
195	300685	艾德生物	36,200	1,895,794.00	0.06
196	300447	全信股份	171,290	1,891,041.60	0.06
197	002241	歌尔股份	211,808	1,882,973.12	0.06
198	002367	康力电梯	250,300	1,847,214.00	0.06
199	300250	初灵信息	128,000	1,807,360.00	0.06
200	600739	辽宁成大	122,900	1,786,966.00	0.06
201	000951	中国重汽	109,400	1,755,870.00	0.06
202	600269	赣粤高速	394,400	1,751,136.00	0.06
203	603367	辰欣药业	116,900	1,689,205.00	0.05
204	002607	中公教育	122,700	1,684,671.00	0.05
205	002773	康弘药业	51,050	1,680,566.00	0.05
206	600963	岳阳林纸	344,400	1,666,896.00	0.05
207	601890	亚星锚链	265,600	1,657,344.00	0.05
208	002912	中新赛克	17,390	1,632,399.30	0.05
209	603896	寿仙谷	43,100	1,603,320.00	0.05
210	002634	棒杰股份	269,000	1,576,340.00	0.05
211	300262	巴安水务	232,400	1,564,052.00	0.05
212	002667	鞍重股份	192,600	1,554,282.00	0.05
213	300509	新美星	182,567	1,539,039.81	0.05
214	300204	舒泰神	122,565	1,517,354.70	0.05
215	600748	上实发展	177,100	1,468,159.00	0.05
216	000590	启迪古汉	127,300	1,465,223.00	0.05
217	002876	三利谱	53,750	1,431,900.00	0.05
218	300423	鲁亿通	107,223	1,427,138.13	0.05
219	002592	八菱科技	90,400	1,396,680.00	0.04
220	002270	华明装备	240,400	1,391,916.00	0.04
221	603131	上海沪工	92,300	1,377,116.00	0.04
222	600230	沧州大化	100,400	1,370,460.00	0.04
223	002120	韵达股份	44,045	1,357,466.90	0.04
224	000514	渝开发	280,400	1,351,528.00	0.04
225	603839	安正时尚	109,800	1,350,540.00	0.04

226	603871	嘉友国际	44,500	1,335,000.00	0.04
227	600966	博汇纸业	347,000	1,322,070.00	0.04
228	600007	中国国贸	90,324	1,317,827.16	0.04
229	300451	创业慧康	87,749	1,311,847.55	0.04
230	603289	泰瑞机器	147,600	1,306,260.00	0.04
231	002020	京新药业	112,500	1,296,000.00	0.04
232	600284	浦东建设	166,600	1,282,820.00	0.04
233	002798	帝欧家居	67,700	1,239,587.00	0.04
234	002402	和而泰	128,000	1,212,160.00	0.04
235	600649	城投控股	187,100	1,210,537.00	0.04
236	600208	新湖中宝	381,100	1,196,654.00	0.04
237	300492	山鼎设计	48,000	1,188,480.00	0.04
238	600981	汇鸿集团	242,800	1,167,868.00	0.04
239	002321	华英农业	178,300	1,158,950.00	0.04
240	600165	新日恒力	282,500	1,118,700.00	0.04
241	603198	迎驾贡酒	62,100	1,112,211.00	0.04
242	002563	森马服饰	98,000	1,083,880.00	0.03
243	002293	罗莱生活	109,371	1,083,866.61	0.03
244	600461	洪城水业	170,300	1,072,890.00	0.03
245	300013	新宁物流	69,900	1,061,781.00	0.03
246	600033	福建高速	324,480	1,061,049.60	0.03
247	000759	中百集团	151,001	1,060,027.02	0.03
248	002019	亿帆医药	86,449	1,059,000.25	0.03
249	603878	武进不锈	96,400	1,036,300.00	0.03
250	002678	珠江钢琴	136,514	1,034,776.12	0.03
251	002275	桂林三金	75,903	1,023,931.47	0.03
252	002322	理工环科	79,400	998,852.00	0.03
253	002265	西仪股份	92,100	990,075.00	0.03
254	001965	招商公路	117,900	982,107.00	0.03
255	601007	金陵饭店	87,000	963,090.00	0.03
256	300567	精测电子	18,042	947,565.84	0.03
257	002063	远光软件	106,226	925,228.46	0.03
258	603039	泛微网络	12,244	908,504.80	0.03
259	601588	北辰实业	238,900	895,875.00	0.03
260	600279	重庆港九	190,800	892,944.00	0.03
261	600580	卧龙电驱	104,900	882,209.00	0.03
262	002341	新纶科技	150,970	881,664.80	0.03
263	002731	萃华珠宝	49,600	872,464.00	0.03
264	601900	南方传媒	91,000	864,500.00	0.03

265	000869	张裕A	26,500	851,180.00	0.03
266	000058	深赛格	151,300	847,280.00	0.03
267	002758	华通医药	91,700	837,221.00	0.03
268	000761	本钢板材	193,118	830,407.40	0.03
269	603199	九华旅游	35,800	795,834.00	0.03
270	002663	普邦股份	258,300	782,649.00	0.03
271	300047	天源迪科	93,341	781,264.17	0.03
272	000779	三毛派神	72,800	772,408.00	0.02
273	002833	弘亚数控	20,200	735,482.00	0.02
274	300175	朗源股份	124,500	727,080.00	0.02
275	002728	特一药业	41,800	695,552.00	0.02
276	600211	西藏药业	21,700	687,022.00	0.02
277	300633	开立医疗	24,000	685,440.00	0.02
278	601177	杭齿前进	73,410	680,510.70	0.02
279	000768	中航飞机	41,818	658,633.50	0.02
280	300408	三环集团	33,038	642,589.10	0.02
281	600199	金种子酒	84,900	631,656.00	0.02
282	603030	全筑股份	99,000	618,750.00	0.02
283	002366	台海核电	66,100	618,696.00	0.02
284	000065	北方国际	70,300	613,719.00	0.02
285	603987	康德莱	85,100	613,571.00	0.02
286	603043	广州酒家	18,900	611,037.00	0.02
287	000915	山大华特	29,630	605,933.50	0.02
288	002709	天赐材料	24,598	595,271.60	0.02
289	002287	奇正藏药	20,302	589,976.12	0.02
290	300151	昌红科技	88,900	576,072.00	0.02
291	600987	航民股份	86,700	573,087.00	0.02
292	000533	顺钠股份	199,000	569,140.00	0.02
293	300444	双杰电气	76,323	553,341.75	0.02
294	600805	悦达投资	91,000	552,370.00	0.02
295	601158	重庆水务	98,300	550,480.00	0.02
296	002447	晨鑫科技	161,000	549,010.00	0.02
297	000068	华控赛格	130,700	548,940.00	0.02
298	300298	三诺生物	45,800	539,524.00	0.02
299	600863	内蒙华电	170,200	534,428.00	0.02
300	002212	南洋股份	38,500	527,450.00	0.02
301	600861	北京城乡	61,800	525,300.00	0.02
302	600984	建设机械	76,700	502,385.00	0.02
303	002082	万邦德	52,460	490,501.00	0.02

304	300396	迪瑞医疗	27,900	484,902.00	0.02
305	002851	麦格米特	24,275	479,916.75	0.02
306	002461	珠江啤酒	75,300	478,155.00	0.02
307	002071	长城影视	121,800	471,366.00	0.02
308	002381	双箭股份	58,801	467,467.95	0.01
309	000678	襄阳轴承	58,932	454,955.04	0.01
310	000788	北大医药	66,900	443,547.00	0.01
311	002653	海思科	29,600	420,320.00	0.01
312	600578	京能电力	128,300	415,692.00	0.01
313	002462	嘉事堂	26,800	402,000.00	0.01
314	300307	慈星股份	57,500	400,200.00	0.01
315	603300	华铁科技	49,979	398,832.42	0.01
316	603819	神力股份	29,480	392,084.00	0.01
317	002858	力盛赛车	19,200	372,288.00	0.01
318	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
319	600723	首商股份	50,449	346,080.14	0.01
320	603586	金麒麟	19,600	313,600.00	0.01
321	603737	三棵树	6,880	299,555.20	0.01
322	600989	宝丰能源	24,356	287,644.36	0.01
323	002578	闽发铝业	79,000	285,190.00	0.01
324	603101	汇嘉时代	40,900	284,664.00	0.01
325	603655	朗博科技	16,400	262,892.00	0.01
326	603990	麦迪科技	7,900	244,900.00	0.01
327	603986	兆易创新	2,816	244,147.20	0.01
328	002039	黔源电力	17,400	238,380.00	0.01
329	002901	大博医疗	7,200	236,736.00	0.01
330	300639	凯普生物	14,400	207,360.00	0.01
331	603881	数据港	6,300	200,466.00	0.01
332	600386	北巴传媒	48,500	197,395.00	0.01
333	603326	我乐家居	15,500	183,675.00	0.01
334	601019	山东出版	22,800	177,384.00	0.01
335	002053	云南能投	21,800	172,220.00	0.01
336	601318	中国平安	1,928	170,840.08	0.01
337	603098	森特股份	13,000	166,140.00	0.01
338	603811	诚意药业	8,100	162,000.00	0.01
339	603779	威龙股份	10,600	147,870.00	0.00
340	002324	普利特	13,099	133,609.80	0.00
341	002374	丽鹏股份	40,800	132,192.00	0.00
342	300294	博雅生物	4,700	127,605.00	0.00

343	600548	深高速	10,351	97,195.89	0.00
344	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
345	000429	粤高速 A	10,348	78,127.40	0.00
346	300316	晶盛机电	6,100	77,409.00	0.00
347	600609	金杯汽车	17,200	71,208.00	0.00
348	600760	中航沈飞	2,430	70,542.90	0.00
349	603278	大业股份	5,880	64,386.00	0.00
350	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.00
351	300530	达志科技	1,465	55,670.00	0.00
352	002397	梦洁股份	9,800	53,410.00	0.00
353	300677	英科医疗	3,261	52,371.66	0.00
354	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
355	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
356	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
357	603327	福蓉科技	1,323	34,014.33	0.00
358	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
359	603105	芯能科技	3,010	33,350.80	0.00
360	300781	因赛集团	727	33,165.74	0.00
361	601211	国泰君安	1,778	32,626.30	0.00
362	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
363	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
364	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
365	600809	山西汾酒	237	16,364.85	0.00
366	000597	东北制药	1,477	16,350.39	0.00
367	603666	亿嘉和	220	12,049.40	0.00
368	603444	吉比特	55	11,547.80	0.00
369	300483	沃施股份	200	7,344.00	0.00
370	603858	步长制药	270	6,957.90	0.00
371	603259	药明康德	73	6,327.64	0.00
372	300770	新媒股份	71	6,141.50	0.00
373	600713	南京医药	1,352	6,138.08	0.00
374	600436	片仔癀	52	5,990.40	0.00
375	603338	浙江鼎力	100	5,871.00	0.00
376	300699	光威复材	160	5,232.00	0.00
377	000028	国药一致	122	5,103.26	0.00
378	300761	立华股份	91	4,876.69	0.00
379	000718	苏宁环球	1,405	4,861.30	0.00
380	600004	白云机场	260	4,732.00	0.00
381	600196	复星医药	186	4,705.80	0.00

382	002001	新和成	243	4,687.47	0.00
383	000596	古井贡酒	39	4,621.89	0.00
384	300638	广和通	79	4,340.26	0.00
385	000860	顺鑫农业	90	4,198.50	0.00
386	002013	中航机电	592	4,072.96	0.00
387	603203	快克股份	181	4,023.63	0.00
388	002294	信立泰	176	3,938.88	0.00
389	001979	招商蛇口	188	3,929.20	0.00
390	300766	每日互动	93	3,765.57	0.00
391	603889	新澳股份	550	3,740.00	0.00
392	603685	晨丰科技	303	3,714.78	0.00
393	300678	中科信息	162	3,565.62	0.00
394	603699	纽威股份	281	3,372.00	0.00
395	600893	航发动力	145	3,292.95	0.00
396	002812	恩捷股份	70	3,272.50	0.00
397	600132	重庆啤酒	69	3,254.04	0.00
398	002230	科大讯飞	95	3,157.80	0.00
399	603580	艾艾精工	160	3,107.20	0.00
400	601100	恒立液压	92	2,886.96	0.00
401	603595	东尼电子	130	2,835.30	0.00
402	603801	志邦家居	135	2,667.60	0.00
403	002947	恒铭达	64	2,606.72	0.00
404	300773	拉卡拉	50	2,589.00	0.00
405	300644	南京聚隆	89	2,516.03	0.00
406	603267	鸿远电子	51	2,506.14	0.00
407	603660	苏州科达	157	2,447.63	0.00
408	300779	惠城环保	47	2,445.88	0.00
409	600536	中国软件	45	2,415.15	0.00
410	300497	富祥股份	160	2,401.60	0.00
411	600372	中航电子	161	2,389.24	0.00
412	603317	天味食品	56	2,349.20	0.00
413	603776	永安行	125	2,283.75	0.00
414	600009	上海机场	27	2,262.06	0.00
415	002415	海康威视	82	2,261.56	0.00
416	601601	中国太保	61	2,227.11	0.00
417	002952	亚世光电	61	2,191.12	0.00
418	603336	宏辉果蔬	117	2,130.57	0.00
419	603922	金鸿顺	127	2,075.18	0.00
420	300543	朗科智能	98	2,072.70	0.00

421	300777	中简科技	56	2,060.80	0.00
422	600588	用友网络	74	1,989.12	0.00
423	000333	美的集团	38	1,970.68	0.00
424	002927	泰永长征	98	1,967.84	0.00
425	002850	科达利	99	1,957.23	0.00
426	300170	汉得信息	144	1,956.96	0.00
427	603379	三美股份	52	1,941.68	0.00
428	300669	沪宁股份	92	1,920.96	0.00
429	300762	上海瀚讯	33	1,914.00	0.00
430	603657	春光科技	75	1,899.75	0.00
431	300688	创业黑马	50	1,890.50	0.00
432	603121	华培动力	104	1,884.48	0.00
433	300775	三角防务	64	1,881.60	0.00
434	300508	维宏股份	60	1,877.40	0.00
435	300059	东方财富	138	1,869.90	0.00
436	600872	中炬高新	43	1,841.69	0.00
437	002951	金时科技	75	1,802.25	0.00
438	603068	博通集成	31	1,797.38	0.00
439	002953	日丰股份	72	1,779.84	0.00
440	300046	台基股份	88	1,772.32	0.00
441	603185	上机数控	45	1,770.75	0.00
442	603639	海利尔	68	1,770.04	0.00
443	300473	德尔股份	61	1,761.68	0.00
444	002881	美格智能	82	1,720.36	0.00
445	002949	华阳国际	75	1,711.50	0.00
446	002090	金智科技	144	1,699.20	0.00
447	601869	长飞光纤	45	1,687.50	0.00
448	002299	圣农发展	66	1,671.12	0.00
449	002818	富森美	130	1,667.90	0.00
450	300637	扬帆新材	127	1,633.22	0.00
451	300694	蠡湖股份	85	1,632.00	0.00
452	603629	利通电子	51	1,631.49	0.00
453	002945	华林证券	88	1,628.00	0.00
454	000623	吉林敖东	99	1,622.61	0.00
455	300365	恒华科技	100	1,621.00	0.00
456	603697	有友食品	83	1,570.36	0.00
457	603266	天龙股份	132	1,566.84	0.00
458	002144	宏达高科	145	1,547.15	0.00
459	300620	光库科技	42	1,541.82	0.00

460	603297	永新光学	47	1,541.13	0.00
461	603681	永冠新材	67	1,541.00	0.00
462	000938	紫光股份	56	1,526.00	0.00
463	603700	宁波水表	62	1,489.24	0.00
464	002745	木林森	125	1,465.00	0.00
465	300771	智莱科技	26	1,452.10	0.00
466	300648	星云股份	70	1,449.70	0.00
467	300679	电连技术	52	1,448.72	0.00
468	002937	兴瑞科技	82	1,415.32	0.00
469	002950	奥美医疗	54	1,380.24	0.00
470	300667	必创科技	50	1,376.00	0.00
471	603960	克来机电	50	1,364.50	0.00
472	603985	恒润股份	86	1,344.18	0.00
473	300547	川环科技	120	1,330.80	0.00
474	600309	万华化学	31	1,326.49	0.00
475	300522	世名科技	80	1,324.80	0.00
476	601336	新华保险	24	1,320.72	0.00
477	000826	启迪桑德	108	1,273.32	0.00
478	002042	华孚时尚	175	1,270.50	0.00
479	600378	天科股份	80	1,232.00	0.00
480	603938	三孚股份	66	1,222.98	0.00
481	300097	智云股份	121	1,219.68	0.00
482	603578	三星新材	61	1,191.94	0.00
483	603899	晨光文具	27	1,187.19	0.00
484	600993	马应龙	67	1,182.55	0.00
485	601933	永辉超市	115	1,174.15	0.00
486	601128	常熟银行	147	1,134.84	0.00
487	002677	浙江美大	86	1,131.76	0.00
488	600327	大东方	293	1,110.47	0.00
489	300308	中际旭创	32	1,087.68	0.00
490	300632	光莆股份	60	1,072.20	0.00
491	300227	光韵达	99	1,071.18	0.00
492	300768	迪普科技	28	1,053.64	0.00
493	002717	岭南股份	209	1,053.36	0.00
494	300691	联合光电	64	1,052.16	0.00
495	600690	青岛海尔	60	1,037.40	0.00
496	002466	天齐锂业	41	1,036.48	0.00
497	300780	德恩精工	35	1,036.00	0.00
498	603600	永艺股份	105	1,033.20	0.00

499	603668	天马科技	119	1,029.35	0.00
500	603982	泉峰汽车	45	1,027.35	0.00
501	002507	涪陵榨菜	33	1,006.50	0.00
502	002614	奥佳华	61	995.52	0.00
503	600120	浙江东方	78	993.72	0.00
504	002891	中宠股份	55	984.50	0.00
505	601186	中国铁建	98	975.10	0.00
506	600273	嘉化能源	83	959.48	0.00
507	601788	光大证券	84	959.28	0.00
508	300759	康龙化成	28	957.04	0.00
509	600422	昆药集团	83	956.99	0.00
510	603587	地素时尚	42	955.08	0.00
511	002810	山东赫达	67	944.70	0.00
512	601766	中国中车	112	906.08	0.00
513	603713	密尔克卫	26	905.58	0.00
514	300507	苏奥传感	88	885.28	0.00
515	603306	华懋科技	66	871.86	0.00
516	000628	高新发展	83	869.01	0.00
517	300498	温氏股份	24	860.64	0.00
518	300758	七彩化学	26	852.80	0.00
519	002236	大华股份	58	842.16	0.00
520	600971	恒源煤电	140	819.00	0.00
521	603037	凯众股份	43	818.29	0.00
522	000582	北部湾港	90	810.00	0.00
523	300659	中孚信息	22	799.70	0.00
524	002363	隆基机械	134	787.92	0.00
525	002095	生意宝	33	787.38	0.00
526	000402	金融街	100	784.00	0.00
527	000998	隆平高科	54	781.92	0.00
528	002753	永东股份	88	760.32	0.00
529	603813	原尚股份	41	749.89	0.00
530	002096	南岭民爆	117	731.25	0.00
531	603500	祥和实业	58	729.64	0.00
532	600329	中新药业	50	714.50	0.00
533	002685	华东重机	120	699.60	0.00
534	002828	贝肯能源	50	696.00	0.00
535	300326	凯利泰	76	687.80	0.00
536	300180	华峰超纤	49	686.98	0.00
537	002686	亿利达	97	680.94	0.00

538	600995	文山电力	83	667.32	0.00
539	000576	广东甘化	72	658.80	0.00
540	603089	正裕工业	45	653.85	0.00
541	300716	国立科技	50	642.50	0.00
542	600114	东睦股份	101	635.29	0.00
543	000906	浙商中拓	98	631.12	0.00
544	600718	东软集团	49	628.18	0.00
545	600928	西安银行	77	620.62	0.00
546	603956	威派格	35	614.60	0.00
547	300324	旋极信息	106	613.74	0.00
548	002180	纳思达	27	610.20	0.00
549	000551	创元科技	88	592.24	0.00
550	601138	工业富联	49	590.45	0.00
551	002557	洽洽食品	23	580.75	0.00
552	002741	光华科技	48	572.64	0.00
553	002609	捷顺科技	71	570.84	0.00
554	002748	世龙实业	67	568.16	0.00
555	002919	名臣健康	36	568.08	0.00
556	300719	安达维尔	46	561.20	0.00
557	000523	广州浪奇	102	556.92	0.00
558	603118	共进股份	60	555.60	0.00
559	002566	益盛药业	79	546.68	0.00
560	002203	海亮股份	50	541.00	0.00
561	002202	金风科技	43	534.49	0.00
562	600061	国投资本	38	532.38	0.00
563	601958	金钼股份	79	529.30	0.00
564	601860	紫金银行	70	527.80	0.00
565	002391	长青股份	67	515.23	0.00
566	300137	先河环保	60	499.80	0.00
567	603823	百合花	27	497.34	0.00
568	300402	宝色股份	49	480.20	0.00
569	000301	东方盛虹	86	472.14	0.00
570	002955	鸿合科技	8	470.72	0.00
571	300202	聚龙股份	60	467.40	0.00
572	000983	西山煤电	77	466.62	0.00
573	002521	齐峰新材	90	466.20	0.00
574	300232	洲明科技	48	464.64	0.00
575	600369	西南证券	93	459.42	0.00
576	600089	特变电工	63	456.75	0.00

577	600477	杭萧钢构	139	455.92	0.00
578	300422	博世科	41	455.51	0.00
579	000898	鞍钢股份	120	454.80	0.00
580	002734	利民股份	30	448.80	0.00
581	600826	兰生股份	40	447.20	0.00
582	300765	新诺威	12	440.04	0.00
583	300431	暴风集团	59	428.93	0.00
584	600075	新疆天业	80	424.80	0.00
585	603085	天成自控	40	422.00	0.00
586	601298	青岛港	50	419.50	0.00
587	002033	丽江旅游	70	418.60	0.00
588	603220	贝通信	15	414.75	0.00
589	603601	再升科技	52	413.92	0.00
590	601678	滨化股份	60	405.60	0.00
591	000919	金陵药业	51	398.31	0.00
592	300251	光线传媒	58	394.40	0.00
593	600821	津劝业	95	392.35	0.00
594	600969	郴电国际	53	380.54	0.00
595	600315	上海家化	12	373.80	0.00
596	000157	中联重科	60	360.60	0.00
597	603967	中创物流	18	357.84	0.00
598	002419	天虹股份	27	352.62	0.00
599	002946	新乳业	23	348.22	0.00
600	002746	仙坛股份	22	340.34	0.00
601	300211	亿通科技	50	338.00	0.00
602	002051	中工国际	29	332.63	0.00
603	601615	明阳智能	30	325.20	0.00
604	002806	华锋股份	20	323.60	0.00
605	603963	大理药业	30	323.10	0.00
606	603110	东方材料	20	311.00	0.00
607	002343	慈文传媒	40	302.40	0.00
608	603877	太平鸟	19	294.88	0.00
609	603020	爱普股份	36	294.12	0.00
610	600071	凤凰光学	27	291.60	0.00
611	002528	英飞拓	70	286.30	0.00
612	600742	一汽富维	26	277.42	0.00
613	002436	兴森科技	42	275.10	0.00
614	600031	三一重工	20	261.60	0.00
615	600062	华润双鹤	20	252.20	0.00

616	002529	海源复材	31	250.17	0.00
617	600365	通葡股份	42	239.82	0.00
618	603111	康尼机电	48	236.64	0.00
619	000036	华联控股	43	219.73	0.00
620	601238	广汽集团	20	218.60	0.00
621	002003	伟星股份	32	216.32	0.00
622	002489	浙江永强	62	207.08	0.00
623	600644	乐山电力	32	203.20	0.00
624	600695	绿庭投资	30	189.90	0.00
625	002780	三夫户外	9	186.30	0.00
626	300177	中海达	21	183.12	0.00
627	601865	福莱特	18	182.88	0.00
628	600292	远达环保	28	181.16	0.00
629	600021	上海电力	20	173.60	0.00
630	002334	英威腾	31	172.36	0.00
631	601010	文峰股份	50	172.00	0.00
632	300626	华瑞股份	20	168.20	0.00
633	002561	徐家汇	19	167.01	0.00
634	300713	英可瑞	12	163.92	0.00
635	600819	耀皮玻璃	32	161.92	0.00
636	300684	中石科技	8	161.60	0.00
637	002153	石基信息	4	144.76	0.00
638	601801	皖新传媒	22	132.22	0.00
639	600575	皖江物流	44	128.92	0.00
640	002863	今飞凯达	20	123.40	0.00
641	300200	高盟新材	13	122.85	0.00
642	002551	尚荣医疗	23	116.84	0.00
643	603225	新风鸣	9	112.41	0.00
644	600824	益民集团	28	108.92	0.00
645	002909	集泰股份	11	106.37	0.00
646	600257	大湖股份	21	94.92	0.00
647	601777	力帆股份	22	94.38	0.00
648	002150	通润装备	17	94.18	0.00
649	000930	中粮生化	12	90.24	0.00
650	000430	张家界	16	90.08	0.00
651	300171	东富龙	10	86.70	0.00
652	600166	福田汽车	36	85.32	0.00
653	300342	天银机电	8	79.36	0.00
654	002948	青岛银行	12	77.16	0.00

655	600400	红豆股份	20	73.00	0.00
656	600790	轻纺城	20	72.60	0.00
657	600888	新疆众和	13	63.57	0.00
658	002170	芭田股份	16	57.12	0.00
659	300456	耐威科技	2	54.60	0.00
660	600237	铜峰电子	10	41.40	0.00
661	600590	泰豪科技	6	38.82	0.00
662	000338	潍柴动力	3	36.87	0.00
663	300755	华致酒行	1	35.21	0.00
664	600586	金晶科技	9	29.07	0.00
665	600693	东百集团	4	20.68	0.00
666	300179	四方达	4	17.68	0.00
667	000798	中水渔业	2	12.10	0.00
668	601808	中海油服	1	9.63	0.00
669	000700	模塑科技	2	7.56	0.00
670	300086	康芝药业	1	6.02	0.00
671	002650	加加食品	1	3.74	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	601318	中国平安	391,708,272.88	14.01
2	600036	招商银行	368,674,665.86	13.19
3	600276	恒瑞医药	230,214,440.46	8.23
4	000001	平安银行	213,859,670.43	7.65
5	600016	民生银行	201,159,797.31	7.19
6	601939	建设银行	198,278,314.85	7.09
7	600547	山东黄金	195,308,127.04	6.99
8	601988	中国银行	179,091,069.58	6.41
9	600352	浙江龙盛	172,513,424.33	6.17
10	002008	大族激光	169,172,114.91	6.05
11	601166	兴业银行	157,646,753.61	5.64
12	601288	农业银行	134,744,686.00	4.82
13	601668	中国建筑	126,825,069.39	4.54
14	600000	浦发银行	125,745,353.64	4.50
15	601390	中国中铁	125,313,488.48	4.48

16	000651	格力电器	123,389,333.34	4.41
17	601009	南京银行	121,085,545.69	4.33
18	600028	中国石化	119,998,344.16	4.29
19	601888	中国国旅	115,907,246.21	4.15
20	002142	宁波银行	114,543,117.21	4.10
21	002124	天邦股份	111,257,945.33	3.98
22	600585	海螺水泥	106,158,356.02	3.80
23	002007	华兰生物	104,915,635.80	3.75
24	601766	中国中车	102,864,702.69	3.68
25	601328	交通银行	100,744,547.83	3.60
26	601899	紫金矿业	96,350,277.50	3.45
27	000333	美的集团	95,776,992.83	3.43
28	600489	中金黄金	95,620,733.17	3.42
29	601225	陕西煤业	91,477,702.82	3.27
30	002236	大华股份	88,037,223.74	3.15
31	600572	康恩贝	81,431,601.47	2.91
32	600570	恒生电子	81,338,593.14	2.91
33	002475	立讯精密	80,049,150.26	2.86
34	601818	光大银行	78,120,310.04	2.79
35	001979	招商蛇口	75,115,679.56	2.69
36	002415	海康威视	74,864,871.95	2.68
37	601088	中国神华	74,707,385.28	2.67
38	002001	新和成	71,151,083.66	2.54
39	600900	长江电力	68,168,830.79	2.44
40	601169	北京银行	67,118,684.37	2.40
41	600015	华夏银行	66,869,147.08	2.39
42	601006	大秦铁路	66,570,906.14	2.38
43	300059	东方财富	66,279,051.66	2.37
44	601933	永辉超市	66,182,163.45	2.37
45	000768	中航飞机	66,095,944.23	2.36
46	600809	山西汾酒	61,486,003.07	2.20
47	002237	恒邦股份	60,504,321.00	2.16
48	002230	科大讯飞	58,426,401.87	2.09
49	002027	分众传媒	58,086,397.76	2.08

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	601318	中国平安	436,280,352.85	15.60
2	600036	招商银行	341,422,141.50	12.21
3	000001	平安银行	242,685,906.27	8.68
4	600276	恒瑞医药	218,255,932.62	7.81
5	601166	兴业银行	191,074,578.26	6.83
6	002008	大族激光	165,281,898.21	5.91
7	600547	山东黄金	156,902,783.01	5.61
8	000651	格力电器	152,176,987.00	5.44
9	600016	民生银行	145,867,387.90	5.22
10	601988	中国银行	144,898,523.00	5.18
11	601939	建设银行	138,835,337.60	4.97
12	601668	中国建筑	126,373,857.78	4.52
13	601888	中国国旅	120,540,667.01	4.31
14	601390	中国中铁	120,148,272.09	4.30
15	601766	中国中车	118,769,922.63	4.25
16	600028	中国石化	116,659,915.25	4.17
17	601328	交通银行	116,151,696.88	4.15
18	600000	浦发银行	111,919,279.99	4.00
19	002142	宁波银行	110,787,527.89	3.96
20	601009	南京银行	109,537,446.15	3.92
21	000333	美的集团	106,617,186.88	3.81
22	601899	紫金矿业	92,463,403.08	3.31
23	600031	三一重工	91,815,678.52	3.28
24	002456	欧菲光	87,457,847.16	3.13
25	002475	立讯精密	86,956,007.62	3.11
26	002007	华兰生物	82,848,452.14	2.96
27	002236	大华股份	81,332,894.96	2.91
28	600570	恒生电子	80,587,589.19	2.88
29	002230	科大讯飞	77,667,081.47	2.78
30	600585	海螺水泥	75,150,130.98	2.69
31	603799	华友钴业	74,101,529.60	2.65
32	300498	温氏股份	73,982,599.27	2.65
33	601933	永辉超市	71,873,412.23	2.57

34	601225	陕西煤业	71,712,547.66	2.56
35	601818	光大银行	71,084,682.07	2.54
36	001979	招商蛇口	70,668,444.65	2.53
37	601169	北京银行	68,117,531.21	2.44
38	002001	新和成	66,966,939.73	2.40
39	002415	海康威视	66,621,715.79	2.38
40	600809	山西汾酒	66,443,656.29	2.38
41	300676	华大基因	66,283,710.19	2.37
42	300059	东方财富	66,003,112.03	2.36
43	002027	分众传媒	65,239,930.05	2.33
44	300003	乐普医疗	65,018,069.47	2.33
45	600015	华夏银行	64,674,220.46	2.31
46	600196	复星医药	62,832,945.58	2.25
47	000768	中航飞机	62,757,966.23	2.24
48	601229	上海银行	61,936,410.97	2.22
49	300136	信维通信	61,267,065.93	2.19
50	600572	康恩贝	61,208,926.76	2.19
51	600900	长江电力	60,752,276.74	2.17
52	603986	兆易创新	58,865,537.77	2.11
53	603993	洛阳钼业	57,190,992.58	2.05

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	16,402,209,871.67
卖出股票收入（成交）总额	16,794,740,403.95

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	123,090,001.86	3.95

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,090,001.86	3.95

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127005	长证转债	258,920	30,029,541.60	0.96
2	123011	德尔转债	268,187	26,276,962.26	0.84
3	127006	敖东转债	154,987	15,649,037.39	0.50
4	128037	岩土转债	112,391	10,572,621.37	0.34
5	128013	洪涛转债	109,809	10,506,525.12	0.34

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，除天邦股份、民生银行外，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) 2019 年 3 月 1 日，天邦食品股份有限公司收到中国证券监督管理委员会宁波监管局出具的《行政监管措施决定书》，主要是因为以下几方面问题：①未持续披露投资事项的重大风险情况；②资产减值准备的依据披露不完整，减值测试程序不够充分；③董事会会议记录不完整。宁波证监局对天邦食品股份有限公司采取了责令改正的监管措施，并要求公司进一步提升规范意识，做好信息披露工作。

截至本报告期末，天邦股份（002124）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司养殖业务弹性高，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天邦股份。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

(2) 中国银保监会 2018 年 12 月 7 日在网站公布，根据银保监银罚决字[2018]8 号文显示，民生银行被罚 3160 万元，违法违规事实为（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。根据银保监银罚决字[2018]5 号文显示，民生银行被罚 200 万元，违法违规事实为贷款业务严重违反审慎经营规则。目前民生银行经营状况正常。

截至本报告期末，民生银行（600016）为本基金前十大重仓。从投资的角度看，我们认为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天邦股份。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	1,527,357.61
2	应收证券清算款	24,384,634.43
3	应收股利	-
4	应收利息	412,763.71

5	应收申购款	32,140.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,356,896.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127005	长证转债	30,029,541.60	0.96
2	123011	德尔转债	26,276,962.26	0.84
3	127006	敖东转债	15,649,037.39	0.50
4	128037	岩土转债	10,572,621.37	0.34
5	128013	洪涛转债	10,506,525.12	0.34
6	128023	亚太转债	10,293,811.02	0.33
7	127004	模塑转债	10,155,968.22	0.33
8	128026	众兴转债	3,773,108.64	0.12

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
146,281	15,980.77	3,526,549.40	0.15%	2,334,157,034.34	99.85%

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	1,030,346.15	0.0441%

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	50~100
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（ 2005 年 12 月 19 日 ）基金份额总额	379,177,416.36
本报告期期初基金份额总额	2,475,430,594.22
本报告期基金总申购份额	17,407,701.85
减：本报告期基金总赎回份额	155,154,712.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,337,683,583.74

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，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

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	
山西证券	1	5,324,566,585.92	16.05%	2,190,033.98	14.46%	-
华福证券	1	4,990,570,355.86	15.04%	3,549,782.60	23.44%	-
太平洋证券	1	3,677,179,014.53	11.08%	1,512,377.60	9.99%	-
国信证券	1	3,670,452,374.91	11.06%	1,509,598.91	9.97%	-
广发证券	1	2,987,278,124.78	9.00%	1,228,611.56	8.11%	-
华泰证券	1	2,399,916,547.00	7.23%	987,105.81	6.52%	-
招商证券	1	1,813,472,192.33	5.47%	745,895.17	4.93%	-
安信证券	2	1,747,852,776.91	5.27%	718,846.25	4.75%	-
平安证券	1	1,468,894,044.43	4.43%	604,177.49	3.99%	-

东吴证券	1	1,419,816,227.66	4.28%	583,979.83	3.86%	-
国泰君安	1	1,124,965,374.16	3.39%	462,705.87	3.06%	-
国都证券	1	961,482,625.79	2.90%	395,439.66	2.61%	-
申万宏源	2	943,106,234.25	2.84%	387,911.56	2.56%	-
中投证券	2	651,881,620.97	1.96%	268,124.50	1.77%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期减少 3 家证券公司的 3 个交易单元：广发证券股份有限公司（1 个交易单元）、广州证券股份有限公司（1 个交易单元）、中信建投证券股份有限公司（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

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
山西证券	96,645,779.00	35.80%	15,000,000.00	33.33%	-	-
华福证券	81,148,595.40	30.06%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	5,059,860.48	1.87%	-	-	-	-
招商证券	725,474.00	0.27%	-	-	-	-
安信证券	4,357,738.10	1.61%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	67,050,619.41	24.84%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	16,000,000.00	35.56%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	14,000,000.00	31.11%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	14,985,300.00	5.55%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

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	2019年1月2日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国信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》	2019年1月14日
3	诺安基金管理有限公司关于提醒投资	《中国证券报》	2019年1月17日

	者注意防范不法分子冒用诺安基金名义进行诈骗活动的提示性公告		
4	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过东海证券定投申购起点金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 1 月 21 日
5	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《上海证券报》	2019 年 1 月 21 日
6	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2018 年第 2 期-摘要	《上海证券报》	2019 年 2 月 2 日
7	诺安先锋混合型证券投资基金招募说明书（更新）2018 年第 2 期-正文	基金管理人网站	2019 年 2 月 2 日
8	诺安基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 2 月 27 日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在桂林银行停止办理申（认）购、定投申购、转换的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 3 月 1 日
10	诺安基金管理有限公司关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 3 月 15 日
11	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 27 日
12	诺安先锋混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《上海证券报》	2019 年 3 月 27 日
13	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过华夏财富办理申购、定投业务起点金额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 3 月 28 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中投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》	2019 年 3 月 29 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 3 月 30 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加昆仑银行基金费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 4 月 1 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下基金	《证券时报》、	2019 年 4 月 13 日

	所持停牌股票华友钴业估值调整的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	
18	诺安先锋混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《上海证券报》	2019 年 4 月 19 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京植信基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 4 月 19 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在嘉实财富开通定投业务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》、 《证券日报》	2019 年 4 月 23 日
21	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过肯特瑞办理申购、定投业务起点金额、最低赎回（保有）份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 4 月 26 日
22	诺安基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 4 月 30 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐商银行基金费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 5 月 6 日
24	诺安基金管理有限公司关于增加华瑞保险销售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》、 《证券日报》	2019 年 5 月 20 日
25	诺安基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 5 月 21 日
26	诺安基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 5 月 29 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 6 月 21 日
28	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金定投业务费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 6 月 27 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股票证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安先锋混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安先锋混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安股票证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥诺安先锋混合型证券投资基金 2019 年半年度报告正文。
- ⑦报告期内诺安先锋混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

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 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日