诺安股票证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015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:2015年8月25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2015年8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安股票
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	3,925,715,370.59份
基金合同存续期	不定期

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	80%×富时A600 指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效地规避风险并相应地获得较高的投资收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	蒋松云
	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

§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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	5,494,948,968.27
本期利润	5,346,846,496.85
加权平均基金份额本期利润	0.7015
本期基金份额净值增长率	52.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.5117
期末基金资产净值	6,240,243,226.98
期末基金份额净值	1.5896

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。

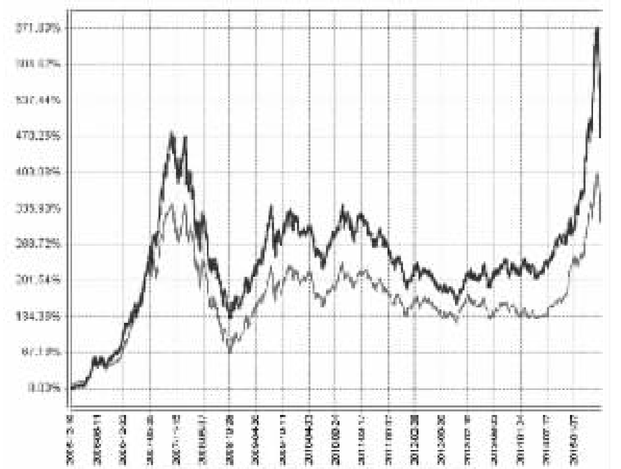
3.2 基金净值表现

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	-14.76%	3.65%	-6.38%	2.76%	-8.38%	0.89%
过去三个月	11.60%	2.80%	10.63%	2.08%	0.97%	0.72%
过去六个月	52.39%	2.23%	27.22%	1.77%	25.17%	0.46%
过去一年	81.13%	1.77%	81.20%	1.42%	-0.07%	0.35%
过去三年	98.87%	1.36%	69.80%	1.17%	29.07%	0.19%
自基金合同生效起至今	499.86%	1.52%	328.95%	1.48%	170.91%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A600 指数+20%×富时中国国债全价指数。

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2015年6月,本基金管理人共管理42只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、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、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金。

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	副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理	2006年6月22日	-	18	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、投资总监。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月起任诺安股票证券投资基金基金经理。
邹翔	诺安股票证券投资基金基金经理	2010年10月14日	2015年2月14日	22	经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于中信实业银行、华夏证券有限公司、华夏基金管理有限公司、大通证券有限公司、中国国际金融有限公司、诺德基金管理有限公司、申万巴黎基金管理有限公司。邹翔先生曾于1999年7月至2000年6月任兴和证券投资基金基金经理、2000年7月至2001年11月任兴安证券投资基金基金经理、2007年4月至2008年5月任诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理。2010年3月加入诺安基金管理有限公司,历任公司成长基金组投资总监兼价值基金组投资总监。于2010年10月至2015年2月任诺安股票证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期和离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遵规守信情况的说明

报告期间,诺安股票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《诺安股票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,同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,沪深300指数上涨了26.58%,本基金基准上涨了26.4%,本基金上涨52.39%,大幅跑赢比较基准。

上半年全球经济亮点不多。美国经济数据实际情况一般,但市场依然看好其未来表现,美元一直有加息预期,美元指数坚挺。欧元区受希腊问题影响,依然在泥潭中挣扎。中国经济保持7%的增速,但消费、投资依然亮点不多。受此影响,全球主要资本市场均出现不同幅度调整,国际大宗商品也经历了一轮下跌。总体来看,全球经济短期仍会在底部徘徊,没有找到新的经济增长点。

A股市场在上半年最后阶段经历宽幅震荡。上半年A股在牛市氛围内完成了大幅而全面的上涨,6月中旬开始了历史罕见的急速调整。在低利率环境下,国内流动性充裕,大类资产没有更好的配置方向的背景下,流入股市的资金量快速增加。叠加上财富效应,使得上半年的股票呈现全民参与、板块普涨、主题活跃的格局。但随着市场估值的过快上升,以及资金去杠杆开始发生,市场开始调整。随着调整的深入,市场出现流动性不足的现象,很多投资者损失较多。我们在投资过程中,紧密跟踪市场最活跃板块,也及时调整仓位和持仓结构应对市场变化,这是我们上半年跑赢基准的主要原因。

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1.5896元。本报告期基金份额净值增长率为52.39%,同期业绩比较基准收益率为27.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,预计全球经济依然会在底部徘徊。中国经济继续保持稳健,改革持续推进,十三五规划的思路也会逐渐清晰。

A股市场还在深幅调整中,很多投资者依然惊魂未定,但我们认为牛市的大背景没有变:国家努力推动经济转型的决心没有变,国家希望发展好资本市场反哺实体经济促进转型升级的态度没有变,资金价格维持低位在相当长一段时期内可能都不会变化,这是我们的长期观点。因此市场在经过一段时间的休整后,依然具备牛市潜力。

我们继续看好以互联网为首的创新经济在未来的成长性,继续看好改革带来的中国存量经济的价值重估。下半年,仓位将会在上述领域重点配置,继续寻找有安全边际,成长性较好,未来空间较大的公司进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同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、合规与风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

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。

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

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股票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,诺安股票证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安股票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,诺安股票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股票证券投资基金2015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:诺安股票证券投资基金

报告截止日: 2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	353,160,806.49	1,240,668,478.13
结算备付金	9,216,025.12	17,854,699.64
存出保证金	3,267,262.28	2,402,403.81
交易性金融资产	5,888,698,895.74	8,910,702,280.94
其中:股票投资	5,878,410,392.54	8,891,909,260.44
基金投资	-	-
债券投资	10,288,503.20	18,793,020.50
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	-	498,201,547.30
应收证券清算款	244,491,979.92	48,798,526.86
应收利息	82,545.50	1,158,354.95
应收股利	-	-
应收申购款	3,997,485.70	484,802.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,502,915,000.75	10,720,271,093.89
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	-	40,694,751.74
应付赎回款	235,683,970.26	40,799,755.29
应付管理人报酬	10,226,417.41	14,220,487.91
应付托管费	1,704,402.91	2,370,081.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	14,794,316.08	8,509,347.85
应交税费	25,000.00	25,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	237,667.11	143,915.57
负债合计	262,671,773.77	106,763,339.66
所有者权益:		
实收基金	3,925,715,370.59	10,175,180,640.18
未分配利润	2,314,527,856.39	438,327,114.05
所有者权益合计	6,240,243,226.98	10,613,507,754.23
负债和所有者权益总计	6,502,915,000.75	10,720,271,093.89

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.5896元,基金份额总3,925,715,370.59份。

6.2 利润表

会计主体:诺安股票证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	5,490,895,142.63	390,672,912.33
1.利息收入	4,760,854.17	19,142,947.55
其中:存款利息收入	4,392,461.66	12,442,777.01
债券利息收入	7,780.68	1,492.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	360,611.83	6,698,678.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,633,859,721.44	-371,161,778.00
其中:股票投资收益	5,605,832,376.87	-412,478,195.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,096,937.62	21,811.40
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	20,930,406.95	41,294,606.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-148,102,471.42	742,647,217.46
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	377,038.44	44,525.32
减:二、费用	144,048,645.78	115,608,739.44
1.管理人报酬	78,634,113.98	81,879,210.82
2.托管费	13,105,685.72	13,646,535.18
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	52,110,525.43	19,880,774.48
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	198,320.65	202,218.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,346,846,496.85	275,064,172.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,346,846,496.85	275,064,172.89

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安股票证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	10,175,180,640.18	438,327,114.05	10,613,507,754.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,346,846,496.85	5,346,846,496.85
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)	-6,249,465,269.59	-3,470,645,754.51	-9,720,111,024.10
其中:1.基金申购款	215,323,476.84	121,113,621.67	336,437,098.51
2.基金赎回款	-6,464,788,746.43	-3,591,759,376.18	-10,056,548,122.61
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)	3,925,715,370.59	2,314,527,856.39	6,240,243,226.98
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	13,354,695,636.69	-1,926,100,251.89	11,428,595,384.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	275,064,172.89	275,064,172.89
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)	-891,794,719.66	125,883,132.84	-765,911,586.82
其中:1.基金申购款	40,019,926.05	-5,944,368.83	34,075,557.22
2.基金赎回款	-931,814,645.71	131,827,501.67	-799,987,144.04
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)	12,462,900,917.03	-1,525,152,946.16	10,937,747,970.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

______奥成文______　　______薛有为______　　____薛有为____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

除6.4.2.2所述会计估计变更外,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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),本基金自2015年3月26日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月26 日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

6.4.2.3 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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。

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	78,634,113.98	81,879,210.82
其中:支付销售机构的客户维护费	13,663,754.46	13,997,338.56

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×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,105,685.72	13,646,535.18

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×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	353,160,806.49	4,200,665.10	2,000,523,617.24	9,500,937.66

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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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

6.4.5.1.1 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
300463	迈克生物	2015年5月21日	2016年5月28日	新股流通受限	27.96	87.76	233,343	6,524,270.28	20,478,181.68	-
300406	九强生物	2014年10月27日	2015年10月30日	新股流通受限	14.32	46.82	432,682	3,098,003.12	20,258,171.24	-
300443	金雷风电	2015年4月16日	2016年4月22日	新股流通受限	31.94	145.98	65,586	2,094,816.84	9,574,244.28	-
300436	广生堂	2015年4月16日	2016年4月22日	新股流通受限	21.47	149.39	47,297	1,015,466.59	7,065,698.83	-
603606	东方电缆	2014年9月29日	2015年10月15日	新股流通受限	8.20	20.36	227,366	847,453.80	4,629,171.76	-
300488	恒锋工具	2015年6月25日	2016年7月1日	新股流通受限	20.11	20.11	71,341	1,434,667.51	1,434,667.51	-
300477	合纵科技	2015年6月4日	2016年6月10日	新股流通受限	10.61	39.57	32,153	341,143.33	1,272,294.21	-

注:截至本报告期末2015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。

6.4.5.2 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
002183	怡亚通	2015年6月1日	重大事项	65.78	-	-	1,293,584	24,941,000.46	85,091,955.52	-
002303	美盈森	2015年6月9日	重大事项	37.78	2015年7月13日	21.43	1,635,528	25,313,442.99	61,790,247.84	-
000566	海南海药	2015年6月18日	重大事项	40.75	-	-	1,383,821	17,521,659.75	56,390,705.75	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大事项	37.29	-	-	1,468,466	26,638,334.06	54,759,097.14	-
300113	顺网科技	2015年5月5日	重大事项	57.70	2015年8月6日	51.93	905,207	25,698,307.94	52,230,443.90	-
300195	长荣股份	2015年6月23日	重大事项	31.96	-	-	1,566,466	25,269,145.56	50,064,253.36	-
300212	易华录	2015年6月30日	重大事项	64.12	2015年7月13日	54.00	734,809	30,817,276.47	47,115,953.08	-
002589	瑞康医药	2015年5月21日	重大事项	104.25	-	-	405,303	29,999,235.00	42,252,837.75	-
000716	黑芝麻	2015年6月8日	重大事项	23.69	2015年8月3日	21.32	1,729,798	22,270,637.86	40,978,914.62	-
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大事项	22.64	2015年7月20日	20.35	1,774,480	23,912,838.75	40,174,227.20	-
000887	中鼎股份	2015年6月30日	重大事项	25.96	-	-	1,504,202	29,704,896.30	39,049,083.92	-
002020	京新药业	2015年4月16日	重大事项	27.21	2015年8月10日	26.10	1,354,397	26,409,391.91	36,853,142.37	-
600226	升华拜克	2015年3月25日	重大事项	14.37	-	-	2,405,402	23,252,309.21	34,565,626.74	-
601021	春秋航空	2015年6月26日	非公开发行	126.09	2015年7月21日	113.48	272,430	29,854,255.00	34,350,698.70	-
300184	力源信息	2015年6月8日	重大资产重组	25.94	-	-	600,000	3,791,967.00	15,564,000.00	-
300197	铁汉生态	2015年6月16日	重大事项	36.03	-	-	386,100	13,378,852.82	13,911,183.00	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项	36.50	-	-	357,600	9,711,975.00	13,052,400.00	-
002712	思美传媒	2015年3月19日	重大事项	72.86	2015年7月31日	66.10	152,154	10,676,963.91	11,085,940.44	-
300155	安居宝	2015年6月15日	重大事项	54.37	2015年7月20日	32.54	199,964	8,749,868.26	10,872,042.68	-
600258	首旅酒店	2015年3月17日	重大资产重组	18.55	-	-	364,120	5,670,594.16	6,754,426.00	-
300228	富瑞特装	2015年6月24日	非公开发行	90.91	2015年7月30日	81.82	39,300	2,346,258.24	3,572,763.00	-
300196	长海股份	2015年5月18日	重大资产重组	35.41	2015年8月18日	31.87	66,000	1,747,848.34	2,337,060.00	-
600872	中炬高新	2015年5月4日	重大资产重组	21.62	-	-	103,631	1,103,611.30	2,240,502.22	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项	52.73	-	-	141,000	5,499,987.99	7,434,930.00	-
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	62.50	2015年8月5日	69.20	48,600	2,684,578.40	3,037,500.00	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(1)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

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

②各层级金融工具公允价值

于2015年6月30日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为5,121,734,293.00元, 属于第二层级的余额为766,964,602.74元,无属于第三层级的余额(2014年12月31日,第一层级的余额为8,543,713,440.33元,第二层级的余额为366,988,840.61元,无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于本基金投资的证券,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,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据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应属第二层次或第三层次。如附注6.4.2.2所述,本基金自2015年3月26日起,对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易 所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值层级归入第二层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,878,410,392.54	90.40
	其中:股票	5,878,410,392.54	90.40
2	固定收益投资	10,288,503.20	0.16
	其中:债券	10,288,503.20	0.16
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	362,376,831.61	5.57
7	其他各项资产	251,839,273.40	3.87
8	合计	6,502,915,000.75	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	34,895,789.28	0.56
B	采矿业	33,956,757.51	0.54
C	制造业	3,257,305,406.35	52.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,763,537.04	0.46
E	建筑业	57,778,249.14	0.93
F	批发和零售业	202,887,673.55	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	41,921,535.70	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	525,592,769.39	8.42
J	金融业	1,263,053,846.97	20.24
K	房地产业	189,753,064.94	3.04
L	租赁和商务服务业	178,914,853.83	2.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	63,586,908.84	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,878,410,392.54	94.20

7.3 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	601318	中国平安	6,714,848	550,214,645.12	8.82
2	601628	中国人寿	8,882,223	278,191,224.36	4.46
3	601601	中国太保	7,971,100	240,567,798.00	3.86
4	300220	金运激光	3,421,665	186,138,576.00	2.98
5	002197	证通电子	5,012,206	139,439,570.92	2.23
6	002183	怡 亚 通	1,293,584	85,091,955.52	1.36
7	300049	福瑞股份	925,566	83,291,684.34	1.33
8	300348	长亮科技	657,500	72,325,000.00	1.16
9	300238	冠昊生物	1,733,200	70,662,564.00	1.13
10	000626	如意集团	800,700	63,815,790.00	1.02

提示: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网站的半年度报告正文。

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	465,393,806.50	4.38
2	601628	中国人寿	279,625,660.97	2.63
3	000623	吉林敖东	275,077,866.25	2.59
4	601601	中国太保	210,864,695.09	1.99
5	002024	苏宁云商	196,876,347.19	1.85
6	000712	锦龙股份	125,632,409.40	1.18
7	300070	碧水源	124,469,481.05	1.17
8	000002	万 科A	108,978,756.60	1.03
9	000685	中山公用	103,146,726.77	0.97
10	600547	山东黄金	101,718,425.86	0.96
11	600489	中金黄金	100,053,217.48	0.94
12	600392	盛和资源	93,843,419.93	0.88
13	002197	证通电子	90,249,301.16	0.85
14	600196	复星医药	81,951,936.44	0.77
15	000826	桑德环境	77,845,147.71	0.73
16	600048	保利地产	70,215,413.16	0.66
17	600000	浦发银行	69,933,613.85	0.66
18	600161	天坛生物	68,695,867.91	0.65
19	600703	三安光电	64,262,547.91	0.61
20	000060	中金岭南	60,778,998.86	0.57

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600879	航天电子	573,184,206.02	5.40
2	600271	航天信息	537,877,053.43	5.07
3	600571	信雅达	409,512,716.59	3.86
4	600705	中航资本	395,424,980.95	3.73
5	000503	海虹控股	377,484,215.32	3.56
6	000623	吉林敖东	350,937,255.17	3.31
7	000948	南天信息	343,686,825.35	3.24
8	002024	苏宁云商	338,426,199.86	3.19
9	000748	长城信息	333,186,982.97	3.14
10	300238	冠昊生物	332,696,107.42	3.13
11	000566	海南海药	307,154,315.91	2.89
12	600812	华北制药	267,829,035.04	2.52
13	600185	格力地产	235,946,791.46	2.22
14	600990	四创电子	222,106,017.42	2.09
15	600118	中国卫星	212,706,641.09	2.00
16	300010	立思辰	212,291,272.11	2.00
17	600776	东方通信	206,788,499.40	1.95
18	000712	锦龙股份	200,400,659.93	1.89
19	300070	碧水源	182,399,372.85	1.72
20	002280	联络互动	177,560,825.93	1.67

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	11,494,675,970.19
卖出股票收入(成交)总额	19,963,656,280.14

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	10,288,503.20	0.16
8	其他	-	-
9	合计	10,288,503.20	0.16

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	113008	电气转债	56,830	10,288,503.20	0.16

7.7 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。

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,除中国平安外,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。

2014年12月8日,中国平安保险(集团)股份有限公司(下称"中国平安",股票代码:601318)控股子公司平安证券收到中国证监会开出《行政处罚决定书》,因其推荐海联讯IPO的过程中,出具的保荐书存在虚假记载以及未审慎审查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性,被中国证监会给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。

截至本报告期末,中国平安(601318)为本基金前十大重仓股。从投资的角度看,由于平安证券的利润占整个平安保险的比例较低,而我们看好的是平安保险一直以来形成的竞争力,平安证券受处罚不影响中国平安作为保险集团的价值。我们认为该公司估值较低,有恢复增长的潜力,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中国平安。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	3,267,262.28
2	应收证券清算款	244,491,979.92
3	应收股利	-
4	应收利息	82,545.50
5	应收申购款	3,997,485.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	251,839,273.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	85,091,955.52	1.36	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
234,323	16,753.44	5,613,728.10	0.14%	3,920,101,642.49	99.86%

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	449,051.49	0.0114%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§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	10,175,180,640.18
本报告期基金总申购份额	215,323,476.84
减:本报告期基金总赎回份额	6,464,788,746.43
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	3,925,715,370.59

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,基金管理人在2015年3月28日发布了《诺安基金管理有限公司关于董事会成员任职的公告》和2015年4月4日《诺安基金管理有限公司关于董事会成员任职的公告》的公告,自2015年3月28日起,增选齐斌先生、李清章先生、奥成文先生担任诺安基金管理有限公司董事会董事。自2015年4月4日起,选举汤小青先生、史其禄先生、赵玲华女士担任诺安基金管理有限公司董事会独立董事。原董事会成员欧阳文安先生、朱秉刚先生、陆南屏先生不再担任公司独立董事职务。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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,无涉及基金管理人、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

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,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	
中信建投	1	1,272,446,100.67	4.05%	1,158,432.02	4.05%	-
招商证券	1	6,871,145,900.96	21.86%	6,255,502.03	21.86%	-
长城证券	1	590,538,184.39	1.88%	537,626.52	1.88%	-
德邦证券	2	2,712,849,836.42	8.63%	2,469,780.78	8.63%	-
东吴证券	1	1,203,039,787.49	3.83%	1,095,248.32	3.83%	-
银河证券	1	2,301,860,933.17	7.32%	2,095,617.88	7.32%	-
中信证券	1	5,335,428,648.05	16.97%	4,857,373.63	16.97%	-
中投证券	2	7,091,855,558.97	22.56%	6,456,432.63	22.56%	-
国都证券	1	4,057,211,126.16	12.91%	3,693,678.82	12.91%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注:本报告期租用证券公司交易单元的变更情况:

本报告期新增1家证券公司的1个交易单元:德邦证券有限责任公司(1个交易单元)。减少1家证券公司的1个交易单元:金元证券股份有限公司(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要,并能为本基金提供全面的信息服务。
(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	23,553,993.80	100.00%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年8月6日发布了《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》的公告,自2015年8月6日起,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。

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
2015年8月25日