诺安灵活配置混合型证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

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

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

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

本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2017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	诺安灵活配置混合
基金主代码	320006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月20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	1,145,796,875.51份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极调整,稳健投资,力图在将风险控制在一定水平的基础上获得超过比较基准的投资收益。
投资策略	本基金实施积极主动的投资策略,具体由资产配置策略,股票投资策略,债券投资策略和权证投资策略四部分组成。 (1)在资产配置方面,本基金自上而下进行,具体由类别资产配置和行业资产配置组成。 (2)在股票投资方面,本基金综合运用优势企业增长策略、内在价值低估策略、景气回归上升策略这三种策略构建股票组合。 (3)在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略、收益率曲线模拟、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。 (4)在权证投资方面,本基金主要运用的策略包括:价值发现策略、价差策略、对敲策略、卖出有担保的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。作为辅助性投资工具,本基金会结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	较高风险,较高收益。

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	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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	188,477,619.28
本期利润	137,996,914.83
加权平均基金份额本期利润	0.0896
本期基金份额净值增长率	3.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.2691
期末基金资产净值	2,599,979,256.35
期末基金份额净值	2.269

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

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

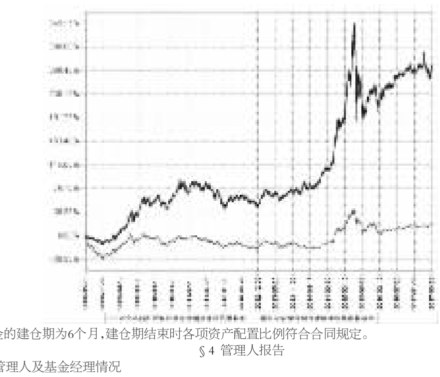
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.53%	0.84%	3.04%	0.40%	2.49%	0.44%
过去三个月	1.84%	0.87%	3.70%	0.37%	-1.86%	0.50%
过去六个月	3.51%	0.71%	6.55%	0.34%	-3.04%	0.37%
过去一年	8.77%	0.59%	10.36%	0.40%	-1.59%	0.19%
过去三年	103.32%	1.41%	48.03%	1.05%	55.29%	0.36%
自基金合同生效起至今	279.20%	1.15%	20.00%	1.05%	259.20%	0.10%

注:本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。

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2017年6月30日,本基金管理人共管理52只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张强	诺安灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年3月4日	-	6	硕士,具有基金从业资格。曾就职于中化招标有限责任公司,任项目经理,后就职于齐鲁证券资产管理公司、民生加银基金管理有限公司,任研究员。2015年6月加入诺安基金管理有限公司,任基金经理助理。2017年3月起任诺安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
夏俊杰	无	2010年3月12日	2017年3月11日	11	硕士,具有基金从业资格。曾任嘉实基金行业研究员;2008年9月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、机构理财部投资经理、投资三部总监。2011年4月至2016年7月任诺安平衡证券投资基金基金经理,2012年11月至2016年8月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理,2014年5月至2016年8月任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2010年3月至2017年3月任诺安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和离职日期均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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来,从宏观上看,经济的韧性比预期要强的判断开始逐步形成市场共识,金融去杠杆基本确定将稳步开展而不是一蹴而就也缓解了市场之前忧虑。从微观上看,随着经济惯性以及供给侧改革的持续深入,企业盈利仍然处于上升期,以上因素导致周期股、银行、新能源汽车等板块表现相对出色,市场彻底摆脱了之前"漂亮50"的虹吸效应,市场对于之前经济悲观预期继续进行纠正,无论有色煤炭,还是银行的上涨都体现了这种悲观预期的修复。

本基金二季度以来加仓的新能源汽车、有色、农业、一些成长股均有所表现,为基金净值做出了一定贡献。

偏见是人性的弱点之一,可能体现于我们工作和生活的很多方面,对投资而言,客观公正地判断公允价值是投资成功的必要条件之一,这也天然上需要抛弃偏见。比如周期性行业和公司,在经历了长达五六年的自然出清之后,在全球性经济复苏阶段,供给和需求格局得到了很大改善,在企业盈利上也得到了明显改善,这种变化也必然反映在股价上。从另外一个角度讲,上游资源、中游制造、下游消费,相辅相成,在一定周期内也必然出现盈利能力在各个链条上的均值回归和分配,否则,全市场如果只有下游消费、中游制造业赚取利润,长此以往,作为更加具备垄断属性的上游资源品将面临投资萎绝的情况,巧妇难为无米之炊,没有食盐和调味品,水平再高的厨师也做不出好菜。与周期性行业回归价值的过程类似,之前"漂亮50"实际上也是经济发展到一定阶段市场对于强者恒强的估值再定价,也是对前几年市场偏爱小而美的纠正。写下这段话,既是与各位投资者分享,也是对自己的一份时时警诫。抛弃偏见,允正执中,相信均值回归的力量,相信价值才是称重器,它只是偶尔迟到但不会缺席,不仅对于寻找投资机会是重要的,而且对于规避执念上的风险也是重要的。与大家共勉之。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.269元。本报告期基金份额净值增长率为3.51%,同期业绩比较基准收益率为6.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年的展望,当前观点与二季度时并无太多变化,经济复苏的韧性、通胀预期、金融收缩去杠杆可能将是未来影响市场的一些主要因素,并反映在企业整体盈利上。

下半年本基金将更加密切关注通胀的变化、固定资产投资变化、全球宏观金融形势等对市场趋势的影响,坚持寻找价值、成长与估值能够良好匹配的行业和公司,在更加规避风险的同时,追求稳定持续的投资收益。

最后,还是衷心感谢基金持有人对本基金的信任和支持。本基金将会继续坚持勤勉谨慎的原则,注重安全边际,力争为基金持有人创造稳健优异持续的业绩回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,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六次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%, 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,本报告期末有收益分配事项。

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,诺安灵活配置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灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:诺安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2017年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	375,519,195.83	445,753,425.77
结算备付金	13,433,385.16	21,157,778.82
存出保证金	1,347,957.53	882,017.33
交易性金融资产	2,030,757,165.95	2,830,846,165.83
其中:股票投资	2,030,757,165.95	2,817,353,881.33
基金投资	-	-
债券投资	-	13,492,284.50
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	199,739,939.87	1,290,841,650.06
应收证券清算款	-	-
应收利息	127,836.44	1,712,896.45
应收股利	-	-
应收申购款	1,832,528.76	63,613,919.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,622,758,009.54	4,654,807,854.09
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30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	7,958,599.30	52,317,699.40
应付赎回款	6,545,774.96	6,688,555.15
应付管理人报酬	3,168,574.59	6,237,283.32
应付托管费	528,095.76	1,039,547.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,371,673.52	2,706,085.95
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	206,035.06	202,871.73
负债合计	22,778,753.19	69,192,042.78
所有者权益:		
实收基金	1,145,796,875.51	2,091,611,960.80
未分配利润	1,454,182,380.84	2,494,003,850.51
所有者权益合计	2,599,979,256.35	4,585,615,811.31
负债和所有者权益总计	2,622,758,009.54	4,654,807,854.09

注:报告截止日2017年6月30日,基金份额净值2.269元,基金份额总额1,145,796,875.51份。

6.2 利润表

会计主体:诺安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6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	182,585,256.09	112,311,092.82
1.利息收入	9,058,748.60	11,148,722.05
其中:存款利息收入	3,396,870.92	6,766,613.23
债券利息收入	30,409.27	25,984.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,631,468.41	4,356,124.54
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	220,945,530.41	176,396,488.71
其中:股票投资收益	217,355,435.92	154,766,549.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	138,081.12	3,641,994.08
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	3,452,013.37	17,987,944.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-50,480,704.45	-76,805,120.15
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,061,681.53	1,571,002.21
减:二、费用	44,588,341.26	45,059,123.00
1. 管理人报酬	25,739,693.59	31,508,076.87
2. 托管费	4,289,948.93	5,251,346.15
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	14,359,882.31	8,097,945.86
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	198,816.43	201,754.12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	137,996,914.83	67,251,969.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	137,996,914.83	67,251,969.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安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6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,091,611,960.80	2,494,003,850.51	4,585,615,811.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	137,996,914.83	137,996,914.83
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)	-945,815,085.29	-1,177,818,384.50	-2,123,633,469.79
其中:1.基金申购款	279,055,673.28	342,759,224.03	621,814,897.31
2.基金赎回款	-1,224,870,758.57	-1,520,577,608.53	-2,745,448,367.10
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)	1,145,796,875.51	1,454,182,380.84	2,599,979,256.35
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,105,571,402.32	2,206,852,062.87	4,312,423,465.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,251,969.82	67,251,969.82
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)	165,123,305.59	191,587,253.33	356,710,558.92
其中:1.基金申购款	826,034,128.42	824,359,395.72	1,650,393,524.14
2.基金赎回款	-660,910,822.83	-632,772,142.39	-1,293,682,965.22
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)	2,270,694,707.91	2,465,691,286.02	4,736,385,993.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安灵活配置混合型证券投资基金(简称"本基金"),经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")证监许可[2008]376号文《关于核准诺安灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准,于2008年4月15日至2008年5月16日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,募集的有效认购金额为人民币863,296,406.51元,其中净认购额为人民币857,166,302.98元,折合857,166,302.98份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币124,544.07元,折合124,544.07份基金份额于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2008年5月20日,合同生效日基金份额为857,290,847.05份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《诺安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年7月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税。

(3)证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(4)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税 (以下简称"营改增") 试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。证券投资基金 (封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。自2018年1月1日起,资产管理产品管理人运营资产管理产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资产管理产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(6)对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内 (含1个月) 的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年 (含1年) 的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股权登记日为自2013年1月1日起至2016年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2016年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,739,693.59	31,508,076.87
其中:支付销售机构的客户维护费	2,670,291.18	2,874,030.85

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

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,289,948.93	5,251,346.15

注:本基金的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	65,725,991.19	65,725,991.19
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	65,725,991.19	65,725,991.19
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.74%	2.89%

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

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
深圳市捷隆投资有限公司	16,611,295.68	1.4500%	16,611,295.68	0.7900%

注:投资本基金费率按照本基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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	375,519,195.83	3,273,295.31	786,798,392.36	6,642,498.52

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

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
002821	凯莱英	2016年11月11日	2017年11月20日	新股流通受限	30.53	72.97	42,818	653,616.77	3,124,429.46	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月18日	新股流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年4月9日	新股流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017年3月31日	2018年4月11日	新股流通受限	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注:①截至本报告期末2017年6月30日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

②本基金持有的流通受限股票"凯莱英"于2017年6月14日实施转增股本方案,转增股本后"凯莱英"的单位成本为15.27元/股。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(1)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

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

②各层级金融工具公允价值

于2017年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中第一层级的余额为2,030,633,482.85元,无属于第二层级的余额,属于第三层级的余额为123,683.10元,其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票。(2016年12月31日:第一层级2,733,221,490.03元,第二层级97,134,991.29元,第三层级489,684.51元,其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;除证券交易所上市的可转换债券外,其他固定收益品种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次归入第二层级。

2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,030,757,165.95	77.43
	其中:股票	2,030,757,165.95	77.43
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	199,739,939.87	7.62
	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	388,952,580.99	14.83
7	其他各项资产	3,308,322.73	0.13
8	合计	2,622,758,009.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	19,197,696.00	0.74
B	采矿业	207,073,561.66	7.96
C	制造业	1,156,883,966.32	44.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	183,120,000.00	7.04
F	批发和零售业	21,635,405.01	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	4,593,600.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	181,373,286.76	6.98
J	金融业	256,879,650.20	9.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,030,757,165.95	78.11

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	600030	中信证券	10,999,950	187,219,149.00	7.20
2	600477	杭萧钢构	12,000,000	183,120,000.00	7.04
3	000876	新 希 望	20,000,000	164,400,000.00	6.32
4	600038	中直股份	3,570,798	163,435,424.46	6.29
5	600584	长电科技	10,016,618	160,766,718.90	6.18
6	603993	洛阳钼业	30,999,861	156,859,296.66	6.03
7	000800	一汽轿车	15,200,060	154,584,610.20	5.95
8	600637	东方明珠	4,699,915	101,847,158.05	3.92
9	600498	烽火通信	3,762,557	95,380,819.95	3.67
10	000997	新 大 陆	3,504,561	79,518,489.09	3.06

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	000800	一汽轿车	202,489,570.52	4.42
2	600030	中信证券	174,116,020.68	3.80
3	600584	长电科技	173,118,869.74	3.78
4	600038	中直股份	157,385,204.18	3.43
5	603993	洛阳钼业	145,721,876.72	3.18
6	601000	唐山港	131,533,296.37	2.87
7	600755	厦门国贸	127,232,520.42	2.77
8	000997	新 大 陆	104,388,820.84	2.28
9	600637	东方明珠	101,192,575.55	2.21
10	601881	中国银河	93,610,237.52	2.04
11	600259	广晟有色	92,694,664.41	2.02
12	600498	烽火通信	89,985,133.63	1.96
13	601688	华泰证券	86,875,775.77	1.89
14	600316	洪都航空	72,005,185.01	1.57
15	002024	苏宁云商	69,290,051.75	1.51
16	600549	厦门钨业	68,871,266.00	1.50
17	600479	千金药业	62,403,626.90	1.36
18	300059	东方财富	62,393,226.98	1.36
19	600717	天津港	62,164,910.89	1.36
20	600477	杭萧钢构	59,151,212.67	1.29

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	002353	杰瑞股份	268,973,289.31	5.87
2	601000	唐山港	182,405,800.74	3.98
3	600900	长江电力	182,048,865.77	3.97
4	002241	歌尔股份	176,215,660.31	3.84
5	002267	陕天然气	156,014,230.89	3.40
6	300003	乐普医疗	149,280,074.80	3.26
7	600256	广汇能源	148,208,661.18	3.23
8	600897	厦门空港	144,869,703.51	3.16
9	600009	上海机场	133,078,292.12	2.90
10	601899	紫金矿业	123,991,886.23	2.70
11	600755	厦门国贸	117,180,429.40	2.56
12	600305	恒顺醋业	104,769,148.28	2.28
13	600717	天津港	102,228,044.11	2.23
14	000975	银泰资源	98,452,158.70	2.15
15	601881	中国银河	96,530,002.05	2.11
16	600259	广晟有色	90,699,526.24	1.98
17	000876	新 希 望	87,628,014.84	1.91
18	601872	招商轮船	73,272,104.66	1.60
19	300059	东方财富	69,931,636.53	1.53
20	600685	中船防务	68,878,180.95	1.50

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	4,102,643,090.82
卖出股票收入(成交)总额	5,056,880,473.92

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金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	1,347,957.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	127,836.44
5	应收申购款	1,832,528.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,308,322.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
91,673	12,498.74	226,790,881.36	19.79%	919,005,994.15	80.21%

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	3,095,057.88	0.2701%

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	>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(2008年5月20日)基金份额总额	857,290,847.05
本报告期期初基金份额总额	2,091,611,960.80
本报告期基金总申购份额	279,055,673.28
减:本报告期基金总赎回份额	1,224,870,758.57
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	1,145,796,875.51

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	4,186,845,255.88	45.73%	3,898,534.09	45.91%	-
平安证券	2	2,387,351,765.52	26.08%	2,189,137.36	25.78%	-
长江证券	1	1,559,978,968.35	17.04%	1,452,811.10	17.11%	-
中投证券	1	982,696,473.50	10.73%	915,183.45	10.78%	-
中银国际	1	37,745,411.00	0.41%	35,152.27	0.41%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注:1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况:本报告期增加1家证券公司的1个交易单元: 光大证券股份有限公司(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
光大证券	-	-	5,017,200,000.00	62.44%	-	-
平安证券	10,611,323.25	42.66%	1,118,400,000.00	13.92%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	14,259,950.67	57.34%	1,900,000,000.00	23.64%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

§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。

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
2017年8月28日