

诺安中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18

6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	65
8.7 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.....	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
§9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
§10 开放式基金份额变动.....	69
§ 11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§13 备查文件目录.....	74
13.1 备查文件目录.....	74
13.2 存放地点.....	74
13.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	诺安中证 500ETF
场内简称	诺安 500
基金主代码	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 7 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	81,090,964.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 3 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	王永民
	联系电话	0755-83026688	010-66594896
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95566
传真		0755-83026677	010-66594942
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	518048	100818
法定代表人	秦维舟	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	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	-5,762,099.48	-12,462,688.78	6,109,841.28
本期利润	-630,287.58	-34,275,336.60	945,501.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.3261	0.0146
本期加权平均净值利润率	-0.41%	-20.18%	0.82%
本期基金份额净值增长率	-1.09%	-16.99%	46.75%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	49,635,834.90	63,679,088.90	101,253,185.55
期末可供分配基金份额利润	0.6121	0.6299	0.9635
期末基金资产净值	130,726,798.90	164,770,052.90	206,344,149.55
期末基金份额净值	1.6121	1.6299	1.9635
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	61.21%	62.99%	96.35%

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 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

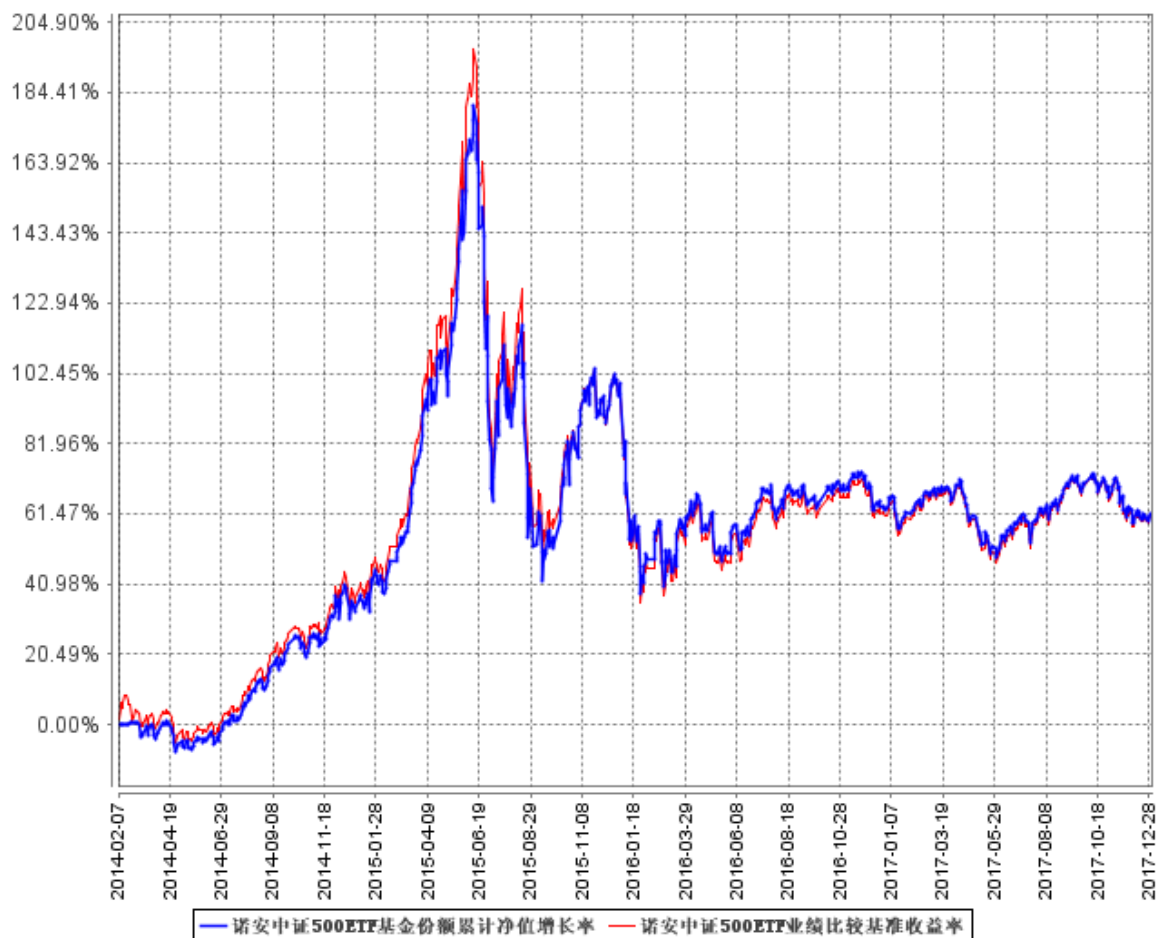
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.37%	0.94%	-5.34%	0.98%	-0.03%	-0.04%
过去六个月	1.11%	0.92%	1.84%	0.96%	-0.73%	-0.04%
过去一年	-1.09%	0.89%	-0.20%	0.93%	-0.89%	-0.04%
过去三年	20.49%	1.96%	17.44%	2.03%	3.05%	-0.07%
自基金合同生效起至今	61.21%	1.80%	60.88%	1.88%	0.33%	-0.08%

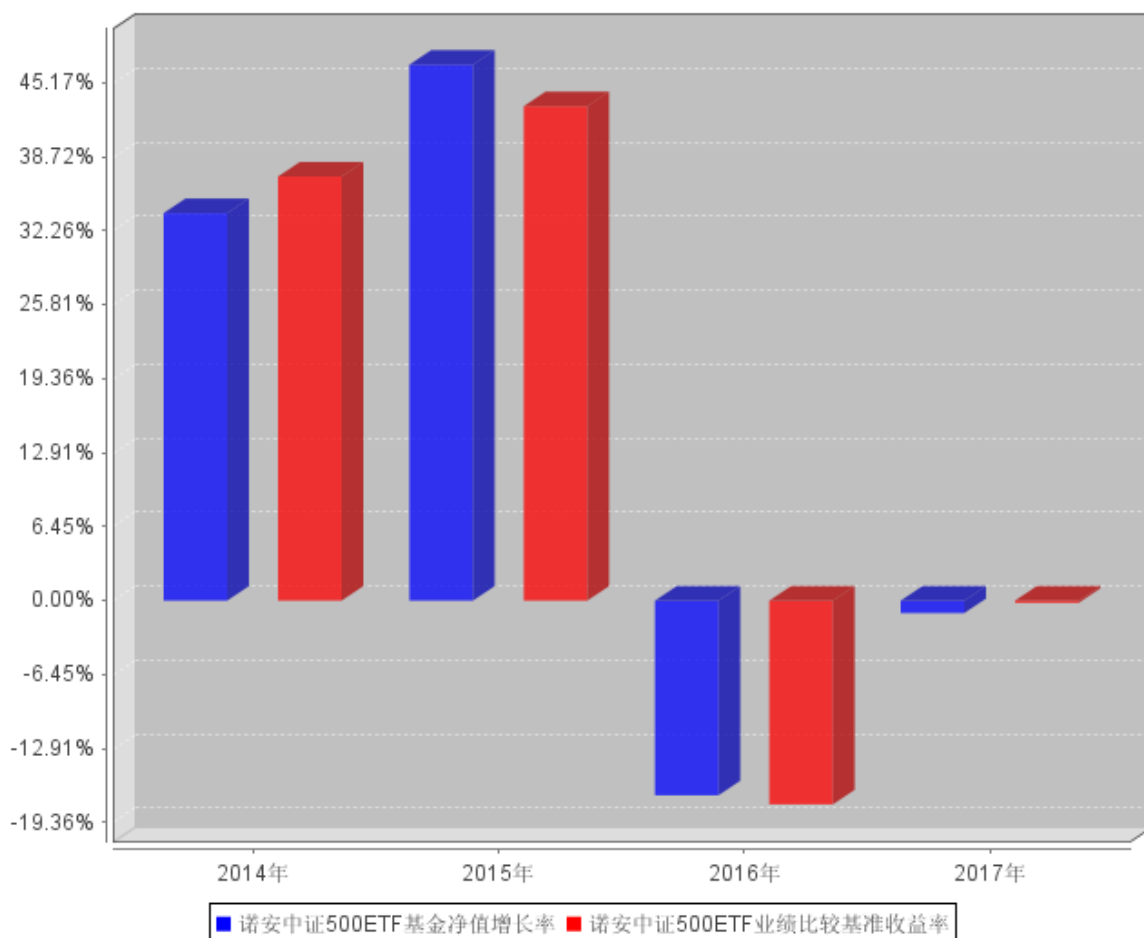
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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



注：本基金基金合同于 2014 年 2 月 7 日生效，2014 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

梅律吾	指数组负责人, 诺安中证 100 指数证券投资基金基金经理、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理、诺安上证新兴产业 ETF 基金经理、诺安上证新兴产业 ETF 联接基金经理	2014 年 2 月 7 日	-	20 硕士, 具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司; 2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司, 历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监, 现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理, 2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理, 2011 年 1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理, 2011 年 9 月至 2012 年 11 月担任诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 8 月至 2017 年 10 月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理, 2014 年 2 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2015 年 6 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2017 年 8 月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金和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经理。
-----	--	----------------	---	---

注: ①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间, 诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和

国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3 日内、5 日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与

的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内，本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整和申购赎回。本基金管理人完全遵循被动投资，尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

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 1.6121 元。本报告期基金份额净值增长率为-1.09%，同期业绩比较基准收益率为-0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一年，从时点来看，所有的不确定，都是事前的，所有的确定，都是事后的；从时期来看，时期是由一个个时点构成，因此，时期的不确定性也是事前的。投资收益意味着，把不确定变成确定，这从理论上来说是矛盾的，也就是说，投资收益也是事前的，也是不确定的；那么，研究的作用既然不能消除事件本身的不确定，那就应该帮助投资者认识到这种不确定，消除投资损益给投资者带来的情绪波动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内本基金管理人共管理了五十三只开放式基金——诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基

金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金等。

在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以监察、稽核为主导的工作体系和流程。内部监察稽核人员依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度公司合法合规运作和内部风险控制的具体情况如下：

1、根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，监察稽核部在报告期内对公司各个部门进行了四次全面的监察稽核和多次临时性监察稽核。内容涉及公司及员工遵纪守法情况，内部控制制度、业务操作流程执行情况；涵盖基金销售、投资运作、后台保障等公司所有业务环节和工作岗位。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由监察稽核部跟踪问题的处理情况，确保了公司在各方面规范运作，切实地保障了基金份额持有人的利益。

2、对公司基金销售活动进行监督、指导，确保基金销售活动严格按照《销售管理办法》的规定处理基金代销机构、基金宣传推介材料、基金销售费用等方面的问题，不出现违法违规的情况。同时，督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。

3、公司所有对外发布的文件、资料及宣传材料，都事先由监察稽核部进行合规性审查，确保其内容真实、准确、合规，符合中国证监会对信息披露的相关要求。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定,本基金的收益分配原则为:每份基金份额享有同等分配权;基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,基金管理人有权进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配 12 次,每次基金收益分配数额的确定原则为:使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;本基金收益分配采取现金方式;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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。

4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1801629 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则、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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和</p>

	<p>维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>该基金管理人诺安基金管理有限公司治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人诺安基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳霞 张品
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2018年3月28日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,363,341.66	6,098,597.82
结算备付金		71.56	90.82
存出保证金		6,582.48	8,433.68
交易性金融资产	7.4.7.2	126,667,181.04	159,020,449.43
其中：股票投资		126,667,181.04	159,020,449.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	946.36	1,426.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		131,038,123.10	165,128,997.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,412.62	70,534.13
应付托管费		11,282.52	14,106.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	40,679.16	70,090.73
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	202,949.90	204,213.36
负债合计		311,324.20	358,945.04
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	81,090,964.00	101,090,964.00
未分配利润	7.4.7.10	49,635,834.90	63,679,088.90
所有者权益合计		130,726,798.90	164,770,052.90
负债和所有者权益总计		131,038,123.10	165,128,997.94

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6121 元，基金份额总额 81,090,964.00 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		947,780.20	-32,503,629.43
1.利息收入		44,643.90	53,254.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	44,643.90	53,254.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,313,968.12	-10,758,676.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,498,670.55	-11,920,945.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,184,702.43	1,162,268.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,131,811.90	-21,812,647.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	85,292.52	14,440.94
减：二、费用		1,578,067.78	1,771,707.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	768,339.88	848,898.55

2. 托管费	7.4.10.2.2	153,668.03	169,779.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	159,364.18	250,904.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	496,695.69	502,124.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-630,287.58	-34,275,336.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-630,287.58	-34,275,336.60

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	101,090,964.00	63,679,088.90	164,770,052.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-630,287.58	-630,287.58
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)	-20,000,000.00	-13,412,966.42	-33,412,966.42
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	1,178,915.67	3,178,915.67
2.基金赎回款	-22,000,000.00	-14,591,882.09	-36,591,882.09
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)	81,090,964.00	49,635,834.90	130,726,798.90
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	105,090,964.00	101,253,185.55	206,344,149.55

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,275,336.60	-34,275,336.60
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）	-4,000,000.00	-3,298,760.05	-7,298,760.05
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	4,510,467.51	12,510,467.51
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-7,809,227.56	-19,809,227.56
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）	101,090,964.00	63,679,088.90	164,770,052.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可[2013]1513 号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2014 年 2 月 7 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 879,090,964.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称：上交所）上证债字[2014]64 号文核准同意，本基金于 2014 年 3 月 10 日在上交所挂牌交易。上市交易前，本基金未进行份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股

指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益 /（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见基金招募说明书；

(b) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(c) 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 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(d) 每一基金份额享有同等分配权；

(e) 本基金收益分配采取现金分红方式；

(f) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益

品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

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

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

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,363,341.66	6,098,597.82
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,363,341.66	6,098,597.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	140,818,989.81	126,667,181.04	-14,151,808.77
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	140,818,989.81	126,667,181.04	-14,151,808.77
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	178,304,070.10	159,020,449.43	-19,283,620.67
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	178,304,070.10	159,020,449.43	-19,283,620.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	943.35	1,422.39
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	0.01	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	3.00	3.80
合计	946.36	1,426.19

注：本基金本报告期末及上年度末“其他”为应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	40,679.16	70,090.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	40,679.16	70,090.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	135,000.00	140,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退替代款	16,794.10	12,999.50
应付替代款	1,155.80	1,213.86
合计	202,949.90	204,213.36

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,090,964.00	101,090,964.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-22,000,000.00	-22,000,000.00
本期末	81,090,964.00	81,090,964.00

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。

7.4.7.10 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	99,430,345.79	-35,751,256.89	63,679,088.90
本期利润	-5,762,099.48	5,131,811.90	-630,287.58
本期基金份额交易产生的变动数	-18,710,474.48	5,297,508.06	-13,412,966.42
其中：基金申购款	1,865,595.01	-686,679.34	1,178,915.67
基金赎回款	-20,576,069.49	5,984,187.40	-14,591,882.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,957,771.83	-25,321,936.93	49,635,834.90

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	43,789.07	51,333.42
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	773.38	1,247.62
其他	81.45	672.99
合计	44,643.90	53,254.03

注：本报告期内及上年度可比期间内“其他”为保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,233,166.94	-10,354,397.71
股票投资收益——赎回差价收入	-1,265,503.61	-1,566,547.48

股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-5,498,670.55	-11,920,945.19

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出股票成交总额	58,546,245.67	82,955,537.94
减：卖出股票成本总额	62,779,412.61	93,309,935.65
买卖股票差价收入	-4,233,166.94	-10,354,397.71

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
赎回基金份额对价总额	36,591,882.09	19,809,227.56
减：现金支付赎回款总额	19,741,415.09	10,468,324.56
减：赎回股票成本总额	18,115,970.61	10,907,450.48
赎回差价收入	-1,265,503.61	-1,566,547.48

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
股票投资产生的股利收益	1,184,702.43	1,162,268.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,184,702.43	1,162,268.61

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
1. 交易性金融资产	5,131,811.90	-21,812,647.82
——股票投资	5,131,811.90	-21,812,647.82
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	5,131,811.90	-21,812,647.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	85,292.52	14,440.94
合计	85,292.52	14,440.94

注：替代损益是指投资者采用现金替代股票方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或未补票强制退款的替代股票在强制退款日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
交易所市场交易费用	159,364.18	250,904.55
银行间市场交易费用	-	-
合计	159,364.18	250,904.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12
----	--------------------------	------------------------------

	31 日	月 31 日
审计费用	35,000.00	40,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	1,695.69	2,124.42
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	496,695.69	502,124.42

注：(1) “上市费”为上交所向本基金征收的上市年费，上市年费为每年 60,000 元。

(2) 指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、直销机构
中国银行股份有限公司	托管人
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	768,339.88	848,898.55
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	153,668.03	169,779.65

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对

一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 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
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	74,000,000.00	91.26%	94,000,000.00	92.99%

7.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,363,341.66	43,789.07	6,098,597.82	51,333.42

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

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	39,500	603,427.48	623,705.00	-
300156	神雾环保	2017 年 7 月 17 日	重大事项	24.16	2018 年 1 月 17 日	21.74	23,100	592,900.78	558,096.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 12 月 19 日	重大事项	13.76	-	-	33,500	386,508.81	460,960.00	-
000930	中粮生化	2017 年 10 月 24 日	重大事项	13.34	-	-	34,100	616,281.61	454,894.00	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	重大事项	26.45	-	-	15,800	415,982.35	417,910.00	-
300383	光环新网	2017 年 11 月 7 日	重大事项	13.19	2018 年 3 月 19 日	14.51	28,600	355,198.72	377,234.00	-
000547	航天发展	2017 年 10 月 30 日	重大事项	10.83	-	-	33,500	693,406.06	362,805.00	-
002745	木林森	2017 年 12 月 28 日	重大事项	45.50	2018 年 1 月 5 日	46.50	7,900	366,831.14	359,450.00	-

000979	中弘股份	2017年9月7日	重大事项	1.94	2018年2月14日	1.75	178,176	439,086.32	345,661.44	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大事项	9.85	2018年3月8日	8.87	34,700	406,747.67	341,795.00	-
000031	中粮地产	2017年7月24日	重大事项	8.00	-	-	42,200	627,482.71	337,600.00	-
000592	平潭发展	2017年8月9日	重大事项	5.75	2018年1月29日	5.70	54,800	507,161.30	315,100.00	-
600614	鹏起科技	2017年12月26日	重大事项	10.16	-	-	30,900	345,311.42	313,944.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	-	-	23,400	444,477.00	301,626.00	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大事项	6.73	2018年3月14日	7.30	43,800	493,367.03	294,774.00	-
002512	达华智能	2017年12月6日	重大事项	18.07	2018年3月6日	16.26	15,900	303,906.82	287,313.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大事项	5.81	2018年2月27日	6.00	46,660	428,804.92	271,094.60	-
000401	冀东水泥	2017年11月21日	重大事项	13.79	2018年1月15日	15.17	19,600	233,278.51	270,284.00	-
000806	银河生物	2017年7月18日	重大事项	10.76	2018年1月18日	10.01	23,300	401,248.95	250,708.00	-
000926	福星股份	2017年12月26日	重大事项	10.89	2018年1月10日	11.98	22,900	277,470.35	249,381.00	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大事项	10.40	2018年3月22日	9.36	23,800	395,063.11	247,520.00	-

300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事件	7.62	-	-	32,300	303,470.17	246,126.00	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事件	4.99	-	-	47,000	284,903.82	234,530.00	-
600645	中源协和	2017年10月9日	重大事件	28.40	2018年1月19日	25.56	7,700	303,974.13	218,680.00	-
002122	天马股份	2017年12月19日	重大事件	8.49	-	-	24,000	217,727.22	203,760.00	-
600187	国中水务	2017年11月10日	重大事件	4.68	2018年3月20日	4.21	42,900	275,078.24	200,772.00	-
300134	大富科技	2017年12月18日	重大事件	16.45	2018年3月19日	14.81	12,120	344,495.46	199,374.00	-
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事件	12.50	2018年3月21日	11.88	15,000	252,883.18	187,500.00	-
000156	华数传媒	2017年12月26日	重大事件	11.40	-	-	15,800	204,595.37	180,120.00	-
000766	通化金马	2017年11月24日	重大事件	13.60	-	-	12,900	220,196.18	175,440.00	-
002358	森源电气	2017年12月7日	重大事件	14.86	2018年3月7日	15.05	11,412	197,029.59	169,582.32	-
300032	金龙机电	2017年11月27日	重大事件	13.89	-	-	11,900	207,670.54	165,291.00	-
002345	潮宏基	2017年12月20日	重大事件	10.75	-	-	12,220	163,507.50	131,365.00	-
300010	立思辰	2017年11月17日	重大事件	11.17	2018年2月22日	10.05	11,700	220,457.46	130,689.00	-

002344	海宁皮城	2017 年 11 月 1 日	重大事项	7.93	2018 年 1 月 31 日	7.44	16,300	256,441.19	129,259.00	-
--------	------	-----------------	------	------	-----------------	------	--------	------------	------------	---

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。监察稽核部和风险控制部向督察长负责,并向首席执行官汇报日常行政事务。

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。

7.4.13.2 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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本年末及上年末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本年末及上年末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 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，除附注 7.4.12 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；按照有关法律法规规定应对固定赎回，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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	4,363,341.66	-	-	-	-	4,363,341.66
结算备付金	71.56	-	-	-	-	71.56
存出保证金	6,582.48	-	-	-	-	6,582.48
交易性金融资产	-	-	-	-	126,667,181.04	126,667,181.04
应收利息	-	-	-	-	946.36	946.36
资产总计	4,369,995.70	-	-	-	126,668,127.40	131,038,123.10
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	56,412.62	56,412.62
应付托管费	-	-	-	-	11,282.52	11,282.52
应付交易费用	-	-	-	-	40,679.16	40,679.16
其他负债	-	-	-	-	202,949.90	202,949.90
负债总计	-	-	-	-	311,324.20	311,324.20
利率敏感度缺口	4,369,995.70	-	-	-	126,356,803.20	130,726,798.90
上年度末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,098,597.82	-	-	-	-	6,098,597.82
结算备付金	90.82	-	-	-	-	90.82
存出保证金	8,433.68	-	-	-	-	8,433.68
交易性金融资产	-	-	-	-	159,020,449.43	159,020,449.43
应收利息	-	-	-	-	1,426.19	1,426.19
资产总计	6,107,122.32	-	-	-	159,021,875.62	165,128,997.94
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	70,534.13	70,534.13
应付托管费	-	-	-	-	14,106.82	14,106.82
应付交易费用	-	-	-	-	70,090.73	70,090.73
其他负债	-	-	-	-	204,213.36	204,213.36
负债总计	-	-	-	-	358,945.04	358,945.04
利率敏感度缺口	6,107,122.32	-	-	-	158,662,930.58	164,770,052.90

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大

影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	126,667,181.04	96.89	159,020,449.43	96.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	126,667,181.04	96.89	159,020,449.43	96.51

7.4.13.4.3.2 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		
	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）	
分析		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	6,219,632.96	7,775,379.54
	2. 业绩比较基准下降 5%	-6,219,632.96	-7,775,379.54

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

7.4.13.4.4 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%的置信度下的置信度下，使用过去一年的历史数据，按照 VaR 正态算法，计算未来一个交易日里，基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信度：95%		
	2. 观察期：一年		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	1,898,337.42	2,263,324.74
	合计	1,898,337.42	2,263,324.74

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 116,652,837.68 元，属于第二层次的余额为 10,014,343.36 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 146,855,558.22 元，第二层次的余额为 12,164,891.21 元，无属于第三层次的余额)。

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

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	126,667,181.04	96.66
	其中：股票	126,667,181.04	96.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,363,413.22	3.33
8	其他各项资产	7,528.84	0.01
9	合计	131,038,123.10	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,223,104.40	1.70
B	采矿业	4,200,053.92	3.21
C	制造业	74,385,730.70	56.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,990,347.33	3.05
E	建筑业	2,826,610.30	2.16
F	批发和零售业	6,727,906.32	5.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,088,116.12	3.13
H	住宿和餐饮业	122,702.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,833,237.78	8.29
J	金融业	2,195,458.20	1.68
K	房地产业	7,614,258.82	5.82
L	租赁和商务服务业	2,172,698.45	1.66
M	科学研究和技术服务业	218,680.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,453,491.30	1.11

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	151,924.00	0.12
Q	卫生和社会工作	269,268.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	1,627,835.40	1.25
S	综合	359,202.00	0.27
	合计	125,460,625.04	95.97

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	187,500.00	0.14
C	制造业	1,019,056.00	0.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,206,556.00	0.92

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600516	方大炭素	31,100	898,168.00	0.69
2	600176	中国巨石	53,400	869,886.00	0.67

3	600201	生物股份	26,607	844,506.18	0.65
4	002405	四维图新	31,779	838,647.81	0.64
5	000661	长春高新	3,830	700,890.00	0.54
6	603444	吉比特	3,800	698,934.00	0.53
7	002422	科伦药业	27,100	674,790.00	0.52
8	600525	长园集团	39,500	623,705.00	0.48
9	002271	东方雨虹	15,300	611,388.00	0.47
10	000786	北新建材	26,930	605,925.00	0.46
11	000998	隆平高科	23,210	596,961.20	0.46
12	600584	长电科技	27,859	594,232.47	0.45
13	300274	阳光电源	31,640	593,882.80	0.45
14	002001	新和成	15,400	586,124.00	0.45
15	002340	格林美	81,330	584,762.70	0.45
16	600521	华海药业	19,320	581,918.40	0.45
17	600438	通威股份	47,800	578,858.00	0.44
18	600315	上海家化	15,500	571,795.00	0.44
19	600426	华鲁恒升	34,969	556,706.48	0.43
20	300266	兴源环境	19,800	534,600.00	0.41
21	000050	深天马 A	27,100	534,141.00	0.41
22	000513	丽珠集团	7,906	525,353.70	0.40
23	000039	中集集团	22,800	520,980.00	0.40
24	002092	中泰化学	38,800	516,428.00	0.40
25	000418	小天鹅 A	7,600	515,660.00	0.39
26	600298	安琪酵母	15,700	513,704.00	0.39
27	002583	海能达	27,302	505,360.02	0.39
28	002050	三花智控	26,800	491,512.00	0.38
29	000830	鲁西化工	30,600	487,152.00	0.37
30	600642	申能股份	82,700	484,622.00	0.37
31	600256	广汇能源	95,200	481,712.00	0.37
32	600079	人福医药	26,800	478,112.00	0.37
33	600388	龙净环保	27,200	470,560.00	0.36
34	601168	西部矿业	57,300	469,860.00	0.36
35	000977	浪潮信息	23,400	465,192.00	0.36
36	002410	广联达	23,700	464,520.00	0.36
37	600879	航天电子	59,100	463,344.00	0.35
38	603019	中科曙光	11,500	462,760.00	0.35
39	600004	白云机场	31,200	458,640.00	0.35
40	000930	中粮生化	34,100	454,894.00	0.35
41	600600	青岛啤酒	11,553	454,379.49	0.35

42	002384	东山精密	15,932	453,424.72	0.35
43	000488	晨鸣纸业	27,200	453,424.00	0.35
44	002179	中航光电	11,502	452,948.76	0.35
45	002311	海大集团	19,258	450,637.20	0.34
46	600291	西水股份	19,100	449,232.00	0.34
47	601233	桐昆股份	19,700	443,053.00	0.34
48	002573	清新环境	19,260	437,779.80	0.33
49	600392	盛和资源	23,000	437,000.00	0.33
50	600499	科达洁能	39,100	433,619.00	0.33
51	000887	中鼎股份	23,800	432,446.00	0.33
52	002078	太阳纸业	46,500	431,520.00	0.33
53	300088	长信科技	55,100	431,433.00	0.33
54	600022	山东钢铁	200,840	429,797.60	0.33
55	002019	亿帆医药	19,200	427,200.00	0.33
56	002366	台海核电	15,800	417,910.00	0.32
57	000656	金科股份	83,800	414,810.00	0.32
58	000690	宝新能源	51,600	412,800.00	0.32
59	600811	东方集团	90,040	412,383.20	0.32
60	300055	万邦达	19,400	407,982.00	0.31
61	601699	潞安环能	35,400	402,852.00	0.31
62	600183	生益科技	23,300	402,158.00	0.31
63	600755	厦门国贸	39,800	401,980.00	0.31
64	600718	东软集团	27,300	400,218.00	0.31
65	600166	福田汽车	141,400	397,334.00	0.30
66	600643	爱建集团	35,740	395,999.20	0.30
67	600875	东方电气	35,100	394,173.00	0.30
68	000066	中国长城	53,982	393,528.78	0.30
69	002176	江特电机	34,600	391,672.00	0.30
70	002223	鱼跃医疗	19,910	390,236.00	0.30
71	002407	多氟多	19,000	387,980.00	0.30
72	600839	四川长虹	111,100	386,628.00	0.30
73	000878	云南铜业	27,200	385,968.00	0.30
74	000970	中科三环	26,800	385,384.00	0.29
75	002670	国盛金控	19,760	384,332.00	0.29
76	600787	中储股份	34,700	381,700.00	0.29
77	600872	中炬高新	15,365	380,437.40	0.29
78	600056	中国医药	15,200	378,328.00	0.29
79	600808	马钢股份	91,400	377,482.00	0.29
80	300383	光环新网	28,600	377,234.00	0.29

81	600418	江淮汽车	39,700	375,562.00	0.29
82	600325	华发股份	50,780	373,740.80	0.29
83	000581	威孚高科	15,300	367,200.00	0.28
84	600460	士兰微	23,650	364,919.50	0.28
85	002244	滨江集团	45,900	364,905.00	0.28
86	000547	航天发展	33,500	362,805.00	0.28
87	600266	北京城建	27,600	362,664.00	0.28
88	002273	水晶光电	15,350	362,106.50	0.28
89	600161	天坛生物	12,560	361,602.40	0.28
90	002745	木林森	7,900	359,450.00	0.27
91	002439	启明星辰	15,318	357,675.30	0.27
92	002359	北讯集团	15,800	356,290.00	0.27
93	002038	双鹭药业	11,500	356,155.00	0.27
94	603589	口子窖	7,700	354,585.00	0.27
95	600060	海信电器	23,600	354,472.00	0.27
96	000997	新大陆	19,760	354,296.80	0.27
97	002285	世联行	31,476	350,957.40	0.27
98	600346	恒力股份	28,300	348,939.00	0.27
99	600260	凯乐科技	11,900	346,409.00	0.26
100	002408	齐翔腾达	27,278	345,885.04	0.26
101	000979	中弘股份	178,176	345,661.44	0.26
102	300146	汤臣倍健	23,000	345,460.00	0.26
103	002195	二三四五	59,100	345,144.00	0.26
104	600673	东阳光科	51,092	344,871.00	0.26
105	002517	恺英网络	15,500	344,255.00	0.26
106	000006	深振业A	34,700	341,795.00	0.26
107	000825	太钢不锈	68,800	341,248.00	0.26
108	600655	豫园股份	31,600	339,384.00	0.26
109	000031	中粮地产	42,200	337,600.00	0.26
110	600160	巨化股份	31,667	336,620.21	0.26
111	300182	捷成股份	39,000	335,790.00	0.26
112	600094	大名城	47,700	333,423.00	0.26
113	300197	铁汉生态	27,300	331,695.00	0.25
114	600435	北方导航	26,900	331,677.00	0.25
115	600138	中青旅	15,838	330,539.06	0.25
116	000703	恒逸石化	15,300	330,021.00	0.25
117	600282	南钢股份	67,700	327,668.00	0.25
118	601000	唐山港	69,520	327,439.20	0.25
119	600143	金发科技	49,400	324,558.00	0.25

120	600885	宏发股份	7,800	322,686.00	0.25
121	000807	云铝股份	31,500	322,245.00	0.25
122	000988	华工科技	19,400	321,652.00	0.25
123	600978	宜华生活	34,900	318,986.00	0.24
124	002589	瑞康医药	23,700	318,765.00	0.24
125	000592	平潭发展	54,800	315,100.00	0.24
126	600614	鹏起科技	30,900	313,944.00	0.24
127	000981	银亿股份	35,500	313,465.00	0.24
128	000999	华润三九	11,500	312,800.00	0.24
129	000778	新兴铸管	59,800	312,156.00	0.24
130	000960	锡业股份	23,600	311,520.00	0.24
131	600503	华丽家族	47,500	311,125.00	0.24
132	300115	长盈精密	15,360	308,275.20	0.24
133	600970	中材国际	31,000	306,590.00	0.23
134	002183	怡亚通	43,400	305,970.00	0.23
135	601231	环旭电子	19,400	305,938.00	0.23
136	002440	闰土股份	15,500	305,195.00	0.23
137	600409	三友化工	31,800	304,962.00	0.23
138	002640	跨境通	15,900	304,326.00	0.23
139	000732	泰禾集团	15,200	304,304.00	0.23
140	000566	海南海药	23,400	301,626.00	0.23
141	002013	中航机电	27,932	301,386.28	0.23
142	600884	杉杉股份	15,460	299,614.80	0.23
143	601200	上海环境	11,900	296,786.00	0.23
144	600240	华业资本	34,500	296,010.00	0.23
145	000598	兴蓉环境	54,300	294,849.00	0.23
146	002004	华邦健康	43,800	294,774.00	0.23
147	600566	济川药业	7,700	293,755.00	0.22
148	600597	光明乳业	19,200	290,880.00	0.22
149	600125	铁龙物流	26,801	289,986.82	0.22
150	002491	通鼎互联	23,000	289,800.00	0.22
151	600062	华润双鹤	11,700	289,575.00	0.22
152	600179	安通控股	11,700	289,575.00	0.22
153	002030	达安基因	15,563	289,160.54	0.22
154	600835	上海机电	11,800	289,100.00	0.22
155	603868	飞科电器	3,800	287,850.00	0.22
156	002512	达华智能	15,900	287,313.00	0.22
157	002373	千方科技	19,600	287,140.00	0.22
158	000729	燕京啤酒	42,400	285,776.00	0.22

159	300324	旋极信息	19,300	282,359.00	0.22
160	002221	东华能源	23,100	282,051.00	0.22
161	002051	中工国际	15,272	281,462.96	0.22
162	600120	浙江东方	11,400	280,554.00	0.21
163	600410	华胜天成	26,600	279,832.00	0.21
164	000685	中山公用	27,275	279,568.75	0.21
165	000078	海王生物	47,350	279,365.00	0.21
166	002127	南极电商	22,900	279,151.00	0.21
167	000636	风华高科	23,300	276,804.00	0.21
168	600635	大众公用	57,661	275,619.58	0.21
169	600307	酒钢宏兴	95,900	274,274.00	0.21
170	002048	宁波华翔	11,500	273,700.00	0.21
171	600572	康恩贝	38,500	272,195.00	0.21
172	002506	协鑫集成	63,600	271,572.00	0.21
173	002131	利欧股份	104,324	271,242.40	0.21
174	600664	哈药股份	46,660	271,094.60	0.21
175	002400	省广股份	50,783	270,673.39	0.21
176	000401	冀东水泥	19,600	270,284.00	0.21
177	300244	迪安诊断	11,400	269,268.00	0.21
178	002431	棕榈股份	31,950	268,380.00	0.21
179	000089	深圳机场	30,800	267,960.00	0.20
180	601880	大连港	95,790	267,254.10	0.20
181	600881	亚泰集团	50,400	266,112.00	0.20
182	600863	内蒙华电	89,400	265,518.00	0.20
183	002354	天神娱乐	15,400	263,340.00	0.20
184	002268	卫士通	11,400	262,428.00	0.20
185	000012	南玻A	30,975	261,738.75	0.20
186	600122	宏图高科	27,000	261,630.00	0.20
187	002665	首航节能	39,280	261,604.80	0.20
188	002152	广电运通	35,100	261,144.00	0.20
189	600348	阳泉煤业	35,300	260,514.00	0.20
190	300058	蓝色光标	47,000	259,440.00	0.20
191	300002	神州泰岳	42,200	258,264.00	0.20
192	600026	中远海能	42,200	258,264.00	0.20
193	600598	北大荒	23,900	257,642.00	0.20
194	600380	健康元	23,000	257,370.00	0.20
195	600037	歌华有线	19,700	255,903.00	0.20
196	002477	雏鹰农牧	57,600	255,744.00	0.20
197	000975	银泰资源	19,100	255,176.00	0.20

198	002056	横店东磁	23,580	252,306.00	0.19
199	600466	蓝光发展	26,900	251,515.00	0.19
200	000806	银河生物	23,300	250,708.00	0.19
201	000400	许继电气	19,000	250,610.00	0.19
202	000596	古井贡酒	3,800	249,546.00	0.19
203	000926	福星股份	22,900	249,381.00	0.19
204	600171	上海贝岭	15,300	248,931.00	0.19
205	600737	中粮糖业	31,200	248,040.00	0.19
206	300159	新研股份	23,800	247,520.00	0.19
207	300199	翰宇药业	15,200	247,456.00	0.19
208	002249	大洋电机	35,500	247,435.00	0.19
209	600717	天津港	23,500	246,515.00	0.19
210	300116	坚瑞沃能	32,300	246,126.00	0.19
211	002191	劲嘉股份	26,600	246,050.00	0.19
212	002028	思源电气	15,520	245,992.00	0.19
213	603369	今世缘	15,800	245,058.00	0.19
214	600416	湘电股份	19,600	244,804.00	0.19
215	300166	东方国信	19,319	242,453.45	0.19
216	600936	广西广电	35,300	242,158.00	0.19
217	600575	皖江物流	59,500	240,975.00	0.18
218	002280	联络互动	31,400	240,524.00	0.18
219	002603	以岭药业	15,400	239,624.00	0.18
220	603883	老百姓	3,800	239,362.00	0.18
221	600151	航天机电	31,300	237,567.00	0.18
222	600751	天海投资	38,700	236,457.00	0.18
223	300287	飞利信	31,900	236,379.00	0.18
224	002505	大康农业	83,180	236,231.20	0.18
225	000667	美好置业	77,700	236,208.00	0.18
226	600267	海正药业	15,600	236,184.00	0.18
227	600633	浙数文化	15,500	235,600.00	0.18
228	000939	凯迪生态	47,000	234,530.00	0.18
229	002390	信邦制药	27,700	234,065.00	0.18
230	000028	国药一致	3,880	233,770.00	0.18
231	002281	光迅科技	7,916	232,730.40	0.18
232	600823	世茂股份	47,000	232,180.00	0.18
233	300253	卫宁健康	34,396	230,797.16	0.18
234	600967	内蒙一机	19,100	230,155.00	0.18
235	000681	视觉中国	11,800	230,100.00	0.18
236	600478	科力远	31,155	229,923.90	0.18

237	002299	圣农发展	15,800	227,520.00	0.17
238	300026	红日药业	53,400	227,484.00	0.17
239	000021	深科技	23,200	225,736.00	0.17
240	000612	焦作万方	23,980	225,412.00	0.17
241	603816	顾家家居	3,800	224,086.00	0.17
242	000758	中色股份	34,600	222,478.00	0.17
243	002701	奥瑞金	35,416	221,350.00	0.17
244	002155	湖南黄金	22,800	221,160.00	0.17
245	000860	顺鑫农业	11,500	220,915.00	0.17
246	600039	四川路桥	54,200	220,594.00	0.17
247	600645	中源协和	7,700	218,680.00	0.17
248	603766	隆鑫通用	31,130	218,532.60	0.17
249	600801	华新水泥	15,400	217,602.00	0.17
250	600064	南京高科	15,300	217,107.00	0.17
251	600648	外高桥	11,700	216,450.00	0.17
252	002128	露天煤业	19,500	216,060.00	0.17
253	603077	和邦生物	107,960	215,920.00	0.17
254	600908	无锡银行	27,400	215,638.00	0.16
255	600511	国药股份	7,754	215,561.20	0.16
256	000027	深圳能源	35,500	215,130.00	0.16
257	600017	日照港	55,400	214,952.00	0.16
258	300133	华策影视	19,800	214,632.00	0.16
259	002444	巨星科技	15,455	213,742.65	0.16
260	600216	浙江医药	15,900	213,696.00	0.16
261	002251	步步高	11,820	213,351.00	0.16
262	300113	顺网科技	11,600	212,164.00	0.16
263	002002	鸿达兴业	30,697	209,967.48	0.16
264	300001	特锐德	15,229	208,485.01	0.16
265	603658	安图生物	3,892	207,132.24	0.16
266	002266	浙富控股	47,500	205,675.00	0.16
267	000718	苏宁环球	47,300	204,809.00	0.16
268	600086	东方金钰	19,200	204,480.00	0.16
269	603228	景旺电子	3,800	204,326.00	0.16
270	002122	天马股份	24,000	203,760.00	0.16
271	300376	易事特	26,900	203,633.00	0.16
272	002353	杰瑞股份	15,500	203,360.00	0.16
273	002147	新光圆成	15,710	203,287.40	0.16
274	600393	粤泰股份	31,900	202,246.00	0.15
275	600187	国中水务	42,900	200,772.00	0.15

276	000877	天山股份	19,260	200,304.00	0.15
277	600366	宁波韵升	11,400	199,728.00	0.15
278	002635	安洁科技	7,650	199,588.50	0.15
279	600158	中体产业	19,400	199,432.00	0.15
280	300134	大富科技	12,120	199,374.00	0.15
281	000528	柳工	23,300	198,749.00	0.15
282	600270	外运发展	11,500	198,720.00	0.15
283	000712	锦龙股份	11,700	198,666.00	0.15
284	000563	陕国投 A	46,600	198,050.00	0.15
285	000727	华东科技	83,100	197,778.00	0.15
286	000090	天健集团	19,480	195,579.20	0.15
287	600594	益佰制药	19,100	195,202.00	0.15
288	600587	新华医疗	11,600	194,764.00	0.15
289	000587	金洲慈航	27,800	194,600.00	0.15
290	600312	平高电气	19,400	193,806.00	0.15
291	002672	东江环保	11,925	193,781.25	0.15
292	600317	营口港	57,000	193,230.00	0.15
293	600563	法拉电子	3,800	193,078.00	0.15
294	600611	大众交通	38,750	192,975.00	0.15
295	002368	太极股份	7,600	192,812.00	0.15
296	600141	兴发集团	11,400	192,660.00	0.15
297	603188	亚邦股份	11,600	192,444.00	0.15
298	601678	滨化股份	23,700	192,444.00	0.15
299	002489	浙江永强	31,884	191,622.84	0.15
300	601689	拓普集团	7,700	190,498.00	0.15
301	600729	重庆百货	7,600	190,456.00	0.15
302	002308	威创股份	15,600	190,320.00	0.15
303	002233	塔牌集团	15,900	189,369.00	0.14
304	601928	凤凰传媒	23,300	188,963.00	0.14
305	300297	蓝盾股份	19,800	188,892.00	0.14
306	002018	华信国际	26,700	188,769.00	0.14
307	600108	亚盛集团	45,600	187,416.00	0.14
308	603355	莱克电气	3,800	187,264.00	0.14
309	002277	友阿股份	31,900	187,253.00	0.14
310	600765	中航重机	15,500	186,310.00	0.14
311	002463	沪电股份	34,860	185,803.80	0.14
312	000501	鄂武商 A	11,620	185,455.20	0.14
313	002437	誉衡药业	26,900	185,341.00	0.14
314	002428	云南锗业	15,300	184,671.00	0.14

315	600582	天地科技	39,600	184,140.00	0.14
316	600169	太原重工	53,200	184,072.00	0.14
317	000009	中国宝安	25,400	183,642.00	0.14
318	000848	承德露露	19,312	182,691.52	0.14
319	601717	郑煤机	27,700	182,266.00	0.14
320	600651	飞乐音响	19,800	181,170.00	0.14
321	000062	深圳华强	7,700	180,873.00	0.14
322	000762	西藏矿业	11,475	180,157.50	0.14
323	000156	华数传媒	15,800	180,120.00	0.14
324	000600	建投能源	23,200	178,872.00	0.14
325	002709	天赐材料	3,886	178,717.14	0.14
326	002049	紫光国芯	3,700	177,563.00	0.14
327	000937	冀中能源	30,400	176,928.00	0.14
328	000541	佛山照明	19,200	176,640.00	0.14
329	002657	中科金财	7,700	175,714.00	0.13
330	600565	迪马股份	43,900	175,600.00	0.13
331	600770	综艺股份	23,100	175,560.00	0.13
332	000766	通化金马	12,900	175,440.00	0.13
333	600545	卓郎智能	15,900	174,582.00	0.13
334	002663	普邦股份	31,296	173,692.80	0.13
335	600848	上海临港	7,700	171,710.00	0.13
336	000969	安泰科技	19,300	171,577.00	0.13
337	002375	亚厦股份	22,800	171,456.00	0.13
338	002358	森源电气	11,412	169,582.32	0.13
339	000669	金鸿控股	11,568	169,471.20	0.13
340	600098	广州发展	23,900	168,973.00	0.13
341	002064	华峰氨纶	34,200	167,580.00	0.13
342	603000	人民网	15,400	166,782.00	0.13
343	601002	晋亿实业	15,500	166,315.00	0.13
344	002434	万里扬	15,800	165,900.00	0.13
345	300032	金龙机电	11,900	165,291.00	0.13
346	002276	万马股份	19,000	163,780.00	0.13
347	002250	联化科技	15,400	163,548.00	0.13
348	601016	节能风电	49,600	163,184.00	0.12
349	603515	欧普照明	3,800	162,792.00	0.12
350	002063	远光软件	15,263	162,245.69	0.12
351	600316	洪都航空	11,400	161,424.00	0.12
352	600155	宝硕股份	15,700	160,611.00	0.12
353	300257	开山股份	11,432	160,048.00	0.12

354	002106	莱宝高科	15,700	159,669.00	0.12
355	600971	恒源煤电	15,300	159,579.00	0.12
356	600859	王府井	7,770	158,508.00	0.12
357	002332	仙琚制药	19,400	158,498.00	0.12
358	002123	梦网集团	15,300	158,355.00	0.12
359	600338	西藏珠峰	3,800	158,270.00	0.12
360	600557	康缘药业	11,740	158,255.20	0.12
361	000158	常山北明	19,920	158,164.80	0.12
362	600869	智慧能源	27,502	157,861.48	0.12
363	000572	海马汽车	34,400	157,552.00	0.12
364	002032	苏泊尔	3,900	157,482.00	0.12
365	002371	北方华创	3,800	157,472.00	0.12
366	000543	皖能电力	31,340	157,326.80	0.12
367	002642	荣之联	11,972	156,952.92	0.12
368	002022	科华生物	11,503	156,555.83	0.12
369	600993	马应龙	7,614	155,934.72	0.12
370	000680	山推股份	30,400	154,736.00	0.12
371	002482	广田集团	19,277	154,601.54	0.12
372	600073	上海梅林	19,000	154,280.00	0.12
373	600580	卧龙电气	19,239	154,104.39	0.12
374	600289	ST 信通	15,500	154,070.00	0.12
375	002503	搜于特	27,740	153,679.60	0.12
376	600458	时代新材	15,200	153,064.00	0.12
377	601311	骆驼股份	11,549	153,024.25	0.12
378	002073	软控股份	19,100	152,800.00	0.12
379	600277	亿利洁能	23,700	152,628.00	0.12
380	600428	中远海特	27,200	152,592.00	0.12
381	000049	德赛电池	3,850	152,421.50	0.12
382	603377	东方时尚	3,800	151,924.00	0.12
383	000061	农产品	19,800	151,668.00	0.12
384	000829	天音控股	15,900	151,050.00	0.12
385	300039	上海凯宝	23,704	150,757.44	0.12
386	600300	维维股份	34,400	150,328.00	0.11
387	002690	美亚光电	7,799	150,286.73	0.11
388	000519	中兵红箭	15,210	149,818.50	0.11
389	600195	中牧股份	7,600	149,796.00	0.11
390	600874	创业环保	11,500	149,615.00	0.11
391	002479	富春环保	15,400	149,534.00	0.11
392	000426	兴业矿业	15,200	149,416.00	0.11

393	600259	广晟有色	3,800	149,302.00	0.11
394	002317	众生药业	11,700	148,356.00	0.11
395	600759	洲际油气	34,767	148,107.42	0.11
396	002261	拓维信息	19,100	147,834.00	0.11
397	600578	京能电力	39,900	147,630.00	0.11
398	002041	登海种业	11,400	146,490.00	0.11
399	000025	特力A	3,800	146,338.00	0.11
400	600059	古越龙山	15,558	146,089.62	0.11
401	601001	大同煤业	23,900	144,595.00	0.11
402	600284	浦东建设	15,500	144,150.00	0.11
403	300273	和佳股份	15,560	140,973.60	0.11
404	601777	力帆股份	19,400	140,844.00	0.11
405	001696	宗申动力	22,200	140,304.00	0.11
406	600184	光电股份	7,646	140,074.72	0.11
407	603225	新凤鸣	3,900	139,620.00	0.11
408	600687	刚泰控股	11,800	139,358.00	0.11
409	600422	昆药集团	15,228	139,336.20	0.11
410	300147	香雪制药	15,460	138,676.20	0.11
411	002699	美盛文化	7,640	138,360.40	0.11
412	603556	海兴电力	3,800	138,320.00	0.11
413	300202	聚龙股份	7,700	138,215.00	0.11
414	600058	五矿发展	11,400	137,712.00	0.11
415	000990	诚志股份	7,900	136,354.00	0.10
416	600006	东风汽车	23,200	135,720.00	0.10
417	603198	迎驾贡酒	7,700	135,443.00	0.10
418	000652	泰达股份	30,700	135,387.00	0.10
419	600773	西藏城投	11,567	135,102.56	0.10
420	002005	德豪润达	30,800	134,288.00	0.10
421	600757	长江传媒	19,200	133,440.00	0.10
422	600657	信达地产	23,894	133,328.52	0.10
423	002254	泰和新材	11,440	133,161.60	0.10
424	600623	华谊集团	15,600	133,068.00	0.10
425	300291	华录百纳	11,700	132,795.00	0.10
426	600639	浦东金桥	7,800	132,210.00	0.10
427	600335	国机汽车	11,700	131,508.00	0.10
428	002345	潮宏基	12,220	131,365.00	0.10
429	600395	盘江股份	19,100	131,217.00	0.10
430	300010	立思辰	11,700	130,689.00	0.10
431	000897	津滨发展	38,500	130,130.00	0.10

432	603806	福斯特	3,800	129,580.00	0.10
433	002344	海宁皮城	16,300	129,259.00	0.10
434	002242	九阳股份	7,600	128,972.00	0.10
435	002681	奋达科技	11,540	128,786.40	0.10
436	600694	大商股份	3,800	128,174.00	0.10
437	600536	中国软件	7,700	127,435.00	0.10
438	002269	美邦服饰	38,500	126,665.00	0.10
439	002707	众信旅游	11,600	126,324.00	0.10
440	000552	靖远煤电	35,700	125,664.00	0.10
441	600280	中央商场	15,900	125,133.00	0.10
442	600517	置信电气	19,100	123,577.00	0.09
443	002011	盾安环境	15,300	123,012.00	0.09
444	600880	博瑞传播	23,300	122,791.00	0.09
445	600754	锦江股份	3,800	122,702.00	0.09
446	002815	崇达技术	3,800	119,928.00	0.09
447	002544	杰赛科技	7,600	119,548.00	0.09
448	002392	北京利尔	23,500	118,440.00	0.09
449	300043	星辉娱乐	19,300	118,116.00	0.09
450	600628	新世界	11,500	116,955.00	0.09
451	000662	天夏智慧	7,800	115,986.00	0.09
452	002118	紫鑫药业	15,400	115,808.00	0.09
453	000777	中核科技	7,770	115,773.00	0.09
454	002818	富森美	3,800	115,178.00	0.09
455	600329	中新药业	7,741	115,108.67	0.09
456	002342	巨力索具	19,200	115,008.00	0.09
457	600640	号百控股	7,700	112,574.00	0.09
458	600862	中航高科	11,600	112,288.00	0.09
459	002325	洪涛股份	23,440	111,808.80	0.09
460	603025	大豪科技	3,800	111,796.00	0.09
461	600776	东方通信	15,400	111,342.00	0.09
462	000816	智慧农业	34,600	111,066.00	0.08
463	002093	国脉科技	11,525	109,372.25	0.08
464	603328	依顿电子	7,600	109,060.00	0.08
465	600894	广日股份	11,500	107,525.00	0.08
466	000099	中信海直	11,900	107,338.00	0.08
467	002588	史丹利	15,980	106,906.20	0.08
468	002551	尚荣医疗	11,500	105,340.00	0.08
469	603877	太平鸟	3,880	105,186.80	0.08
470	600292	远达环保	11,540	103,283.00	0.08

471	600826	兰生股份	7,600	100,092.00	0.08
472	600743	华远地产	27,180	99,478.80	0.08
473	600748	上实发展	15,490	99,290.90	0.08
474	600750	江中药业	3,800	96,824.00	0.07
475	600481	双良节能	23,600	94,636.00	0.07
476	603888	新华网	3,900	92,235.00	0.07
477	603569	长久物流	3,800	91,922.00	0.07
478	600053	九鼎投资	3,800	90,782.00	0.07
479	600618	氯碱化工	7,700	83,391.00	0.06
480	000761	本钢板材	15,900	82,680.00	0.06
481	002190	成飞集成	3,800	82,232.00	0.06
482	603568	伟明环保	3,850	81,042.50	0.06
483	601127	小康股份	3,900	78,429.00	0.06
484	600126	杭钢股份	11,400	78,318.00	0.06
485	600996	贵广网络	7,900	78,210.00	0.06
486	601020	华钰矿业	3,800	77,976.00	0.06
487	000987	越秀金控	7,900	77,815.00	0.06
488	000536	华映科技	15,500	76,570.00	0.06
489	002416	爱施德	7,700	72,919.00	0.06
490	603528	多伦科技	7,900	69,757.00	0.05
491	601969	海南矿业	7,800	69,030.00	0.05
492	002414	高德红外	3,900	65,559.00	0.05
493	603169	兰石重装	7,600	63,764.00	0.05
494	002807	江阴银行	7,100	58,788.00	0.04
495	600939	重庆建工	7,900	58,618.00	0.04
496	601128	常熟银行	7,900	56,327.00	0.04
497	603001	奥康国际	3,800	54,986.00	0.04
498	601811	新华文轩	3,800	51,034.00	0.04
499	600917	重庆燃气	3,800	42,332.00	0.03

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300156	神雾环保	23,100	558,096.00	0.43
2	002168	深圳惠程	33,500	460,960.00	0.35
3	000693	*ST 华泽	15,000	187,500.00	0.14

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	1,275,493.25	0.77
2	600642	申能股份	634,931.00	0.39
3	000066	中国长城	572,764.00	0.35
4	000778	新兴铸管	539,239.00	0.33
5	600438	通威股份	519,590.00	0.32
6	002583	海能达	512,446.26	0.31
7	600839	四川长虹	483,917.00	0.29
8	600256	广汇能源	480,064.00	0.29
9	000039	中集集团	478,018.00	0.29
10	000977	浪潮信息	459,986.00	0.28
11	600004	白云机场	445,155.00	0.27
12	300058	蓝色光标	439,319.00	0.27
13	300002	神州泰岳	434,264.00	0.26
14	600718	东软集团	429,171.00	0.26
15	603799	华友钴业	421,432.00	0.26
16	300383	光环新网	416,036.00	0.25
17	000887	中鼎股份	414,467.00	0.25
18	002670	国盛金控	406,358.60	0.25
19	603888	新华网	395,878.00	0.24
20	600936	广西广电	390,834.00	0.24

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	1,499,496.48	0.91
2	002460	赣锋锂业	1,344,956.00	0.82
3	601012	隆基股份	1,301,237.00	0.79
4	600487	亨通光电	1,090,178.50	0.66
5	002508	老板电器	822,803.50	0.50

6	600522	中天科技	813,038.00	0.49
7	002572	索菲亚	706,676.00	0.43
8	300296	利亚德	697,323.54	0.42
9	600682	南京新百	682,485.00	0.41
10	600436	片仔癀	680,982.51	0.41
11	600219	南山铝业	643,473.50	0.39
12	603799	华友钴业	643,156.00	0.39
13	000887	中鼎股份	570,636.00	0.35
14	300122	智飞生物	551,060.00	0.33
15	002217	合力泰	537,553.28	0.33
16	002602	世纪华通	501,320.00	0.30
17	600549	厦门钨业	444,122.00	0.27
18	000959	首钢股份	421,255.00	0.26
19	600699	均胜电子	417,178.90	0.25
20	000697	炼石有色	416,078.00	0.25

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	41,961,712.93
卖出股票收入（成交）总额	58,546,245.67

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,582.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	946.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,528.84

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	600525	长园集团	623,705.00	0.48	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300156	神雾环保	558,096.00	0.43	重大事项
2	002168	深圳惠程	460,960.00	0.35	重大事项
3	000693	*ST 华泽	187,500.00	0.14	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的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
214	378,929.74	75,296,043.00	92.85%	5,794,921.00	7.15%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	李光英	1,680,000.00	2.07%
2	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍盛稳进	1,288,520.00	1.59%
3	徐军	450,102.00	0.56%
4	肖小兰	335,500.00	0.41%
5	杨盾保	260,000.00	0.32%
6	许良	205,018.00	0.25%
7	林宏	193,543.00	0.24%
8	沈恺	150,000.00	0.18%
9	凌军	135,901.00	0.17%
10	文红梅	134,010.00	0.16%
	中国银行股份有限公司—诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资	74,000,000.00	91.26%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司从业人员未持有本基金份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 2 月 7 日）基金份额总额	879,090,964.00
本报告期期初基金份额总额	101,090,964.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	81,090,964.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 3.5 万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	99,386,846.60	100.00%	92,560.03	100.00%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 1 月 19 日
3	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2017 年 3 月 24 日

4	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 1 期-摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 24 日
5	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 3 月 30 日
6	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	基金管理人网站	2017 年 3 月 30 日
7	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 24 日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 4 月 29 日
9	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2017 年 7 月 1 日
10	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 7 月 20 日
11	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 8 月 28 日
12	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告	基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
13	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 2 期-正文	基金管理人网站	2017 年 9 月 21 日
14	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)2017 年第 2 期-摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 9 月 21 日
15	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2017 年 10 月 25 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 22 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下产品缴纳增值税的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2017 年 12 月 30 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站进行披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2017.01.03-2017.12.29	94,000,000.00	2,000,000.00	22,000,000.00	74,000,000.00	91.26%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。
- ②《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 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

2018 年 3 月 29 日