

诺安中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
7.7 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.....	55
7.8 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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62

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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
备查文件目录.....	63
11.3 备查文件目录.....	63
11.4 存放地点.....	63
11.5 查阅方式.....	63

§ 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	75,090,964.00 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	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
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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,967,443.60
本期利润	-19,461,257.30
加权平均基金份额本期利润	-0.2533
本期加权平均净值利润率	-16.48%
本期基金份额净值增长率	-16.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	26,458,305.72
期末可供分配基金份额利润	0.3524
期末基金资产净值	101,549,269.72
期末基金份额净值	1.3524
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.24%

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。

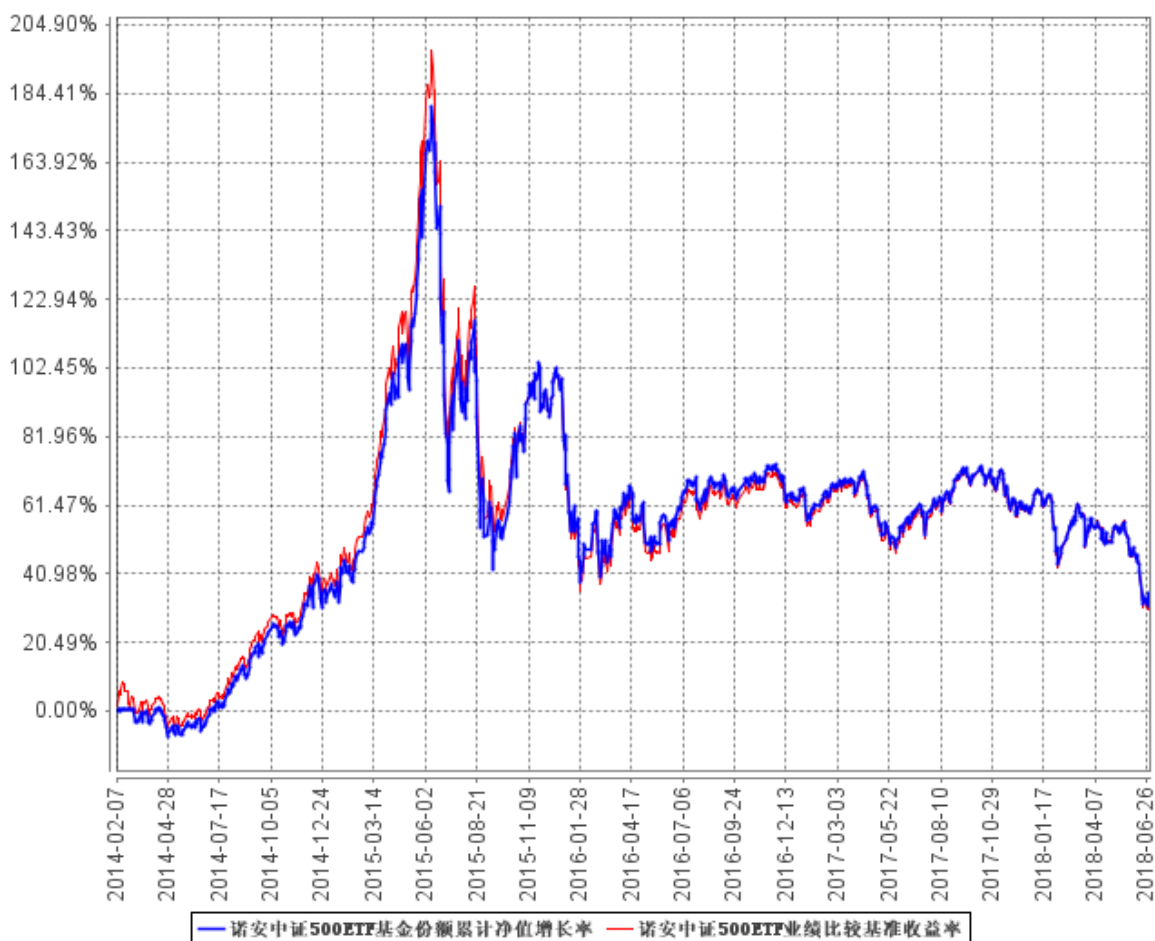
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-8.74%	1.78%	-9.33%	1.86%	0.59%	-0.08%
过去三个月	-13.94%	1.32%	-14.67%	1.38%	0.73%	-0.06%
过去六个月	-16.11%	1.38%	-16.53%	1.44%	0.42%	-0.06%
过去一年	-15.18%	1.16%	-14.99%	1.22%	-0.19%	-0.06%
过去三年	-38.26%	1.84%	-41.41%	1.90%	3.15%	-0.06%
自基金合同生效起至今	35.24%	1.76%	34.29%	1.83%	0.95%	-0.07%

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。

§ 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 2018 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 56 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、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫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、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金等。

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	本基金基金经理。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	-	21	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

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，本基金在合同规定的股票投资占比下，完全复制指数，因此，跟踪误差来自三个方面，第一，来自两次指数成份股定期调整，第二，股票投资不能满仓运作导致的偏离，第三，由于停牌股票不能同步调整。本基金管理人在基金合同规定的最低股票投资比例下，满足篮子赎回所需预估现金要求的情况下，尽可能完全同步指数，以最优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 1.3524 元。本报告期基金份额净值增长率为-16.11%，同期业绩比较基准收益率为-16.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一年，从技术角度，不要轻易看多大盘，也不应轻易看空小盘行情；从基本面角度，业绩的持续性确保了上市公司业绩大幅度变动的可能性很小，但是这不并意味行情没有大的波动。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躁动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定,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。

4.8 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诺安中证 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,224,569.80	4,363,341.66
结算备付金		53.82	71.56
存出保证金		3,668.32	6,582.48
交易性金融资产	6.4.7.2	97,599,052.57	126,667,181.04
其中：股票投资		97,599,052.57	126,667,181.04
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	840.57	946.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		101,828,185.08	131,038,123.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		43,537.67	56,412.62
应付托管费		8,707.53	11,282.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,384.15	40,679.16
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	196,286.01	202,949.90
负债合计		278,915.36	311,324.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	75,090,964.00	81,090,964.00
未分配利润	6.4.7.10	26,458,305.72	49,635,834.90
所有者权益合计		101,549,269.72	130,726,798.90
负债和所有者权益总计		101,828,185.08	131,038,123.10

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3524 元，基金份额总额 75,090,964.00 份。

6.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-18,799,359.21	-2,526,515.62
1.利息收入		15,580.84	23,752.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,580.84	23,752.32
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）		-2,349,249.35	-4,230,057.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,098,219.10	-5,063,875.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	748,969.75	833,818.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-16,493,813.70	1,659,267.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	28,123.00	20,522.02
减：二、费用		661,898.09	798,338.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	292,211.49	395,451.18

2. 托管费	6.4.10.2.2	58,442.31	79,090.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	59,362.69	74,345.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	251,881.60	249,451.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,461,257.30	-3,324,853.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,461,257.30	-3,324,853.85

6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	81,090,964.00	49,635,834.90	130,726,798.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,461,257.30	-19,461,257.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-3,716,271.88	-9,716,271.88
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-3,716,271.88	-9,716,271.88
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）	75,090,964.00	26,458,305.72	101,549,269.72
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		

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 8 月 24 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	活期存款	4,224,569.80
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计：	4,224,569.80	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,244,675.04	97,599,052.57	-30,645,622.47
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	128,244,675.04	97,599,052.57	-30,645,622.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	839.13
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.44
合计	840.57

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	30,384.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,384.15

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	146,286.01
指数使用费	50,000.00
合计	196,286.01

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,090,964.00	81,090,964.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	75,090,964.00	75,090,964.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	74,957,771.83	-25,321,936.93	49,635,834.90
本期利润	-2,967,443.60	-16,493,813.70	-19,461,257.30
本期基金份额交易产生的变动数	-5,492,171.82	1,775,899.94	-3,716,271.88
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-5,492,171.82	1,775,899.94	-3,716,271.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,498,156.41	-40,039,850.69	26,458,305.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,289.90
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	249.34
其他	41.60
合计	15,580.84

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,682,229.20
股票投资收益——赎回差价收入	-415,989.90
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,098,219.10

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,249,710.77
减：卖出股票成本总额	23,931,939.97
买卖股票差价收入	-2,682,229.20

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	9,716,271.88
减：现金支付赎回款总额	5,305,308.88
减：赎回股票成本总额	4,826,952.90
赎回差价收入	-415,989.90

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	748,969.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	748,969.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-16,493,813.70
——股票投资	-16,493,813.70
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-16,493,813.70

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	28,123.00
合计	28,123.00

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	59,362.69
银行间市场交易费用	-
合计	59,362.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	99,177.14
律师费	5,000.00
上市费	29,752.78
银行汇划费	595.59
指数使用费	100,000.00
合计	251,881.60

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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	292,211.49	395,451.18
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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,442.31	79,090.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	68,000,000.00	90.56%	74,000,000.00	91.26%

开放式指数证券投资 基金联接基金				
---------------------	--	--	--	--

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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
中国银行股份有限公司	4,224,569.80	15,289.90	5,605,383.39	23,207.61

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
000825	太钢不锈	2018年4月 16日	重大事项	6.00	-	-	65,200	271,603.57	391,200.00	-
300266	兴源环境	2018年2月 5日	重大事项	19.99	2018年7月 2日	17.99	18,800	502,863.93	375,812.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月 27日	重大事项	2.02	2018年8月 16日	1.83	185,540	377,387.15	374,790.80	-
300146	汤臣倍健	2018年1月 31日	重大事项	16.60	2018年7月 31日	16.50	21,800	255,457.52	361,880.00	-
600811	东方集团	2018年5月 30日	重大事项	4.30	-	-	83,140	461,964.43	357,502.00	-

002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大事项	12.28	-	-	25,178	202,346.78	309,185.84	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	2018年7月9日	11.60	23,400	444,477.00	301,626.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58	2018年8月21日	17.62	14,600	324,651.72	285,868.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	26,794	361,351.57	254,275.06	-
000939	*ST 凯迪	2017年11月16日	重大事项	4.99	2018年7月2日	4.74	47,000	284,903.82	234,530.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重大事项	6.49	-	-	35,700	337,292.00	231,693.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大事项	14.76	-	-	15,310	189,515.91	225,975.60	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大事项	15.27	-	-	14,472	246,251.61	220,987.44	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项	5.80	-	-	36,280	346,859.11	210,424.00	-
600158	中体产业	2018年3月27日	重大事项	11.64	2018年7月16日	11.61	17,900	439,771.95	208,356.00	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	57,100	230,695.00	205,560.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	17,760	344,881.74	205,128.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项	5.37	-	-	37,800	312,916.50	202,986.00	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项	6.71	-	-	29,550	277,967.29	198,280.50	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	重大事项	7.40	-	-	24,900	334,534.85	184,260.00	-
600086	东方金钰	2018年1月19日	重大事项	10.04	-	-	17,700	260,996.94	177,708.00	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项	9.70	-	-	17,900	318,975.00	173,630.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项	3.31	-	-	49,100	269,619.15	162,521.00	-
600848	上海临港	2018年6月15日	重大事项	21.67	-	-	7,100	148,360.36	153,857.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项	6.20	2018年8月13日	5.57	24,800	232,316.86	153,760.00	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项	7.21	-	-	21,200	151,781.14	152,852.00	-
002699	美盛文化	2018年2月	重大事项	18.76	2018年7月	16.88	7,240	146,560.98	135,822.40	-

		5 日			2 日						
002005	德豪润达	2018 年 1 月 2 日	重大事项	4.36	2018 年 7 月 2 日	3.92	30,800	256,318.29	134,288.00	-	
000587	金洲慈航	2018 年 6 月 15 日	重大事项	4.96	2018 年 7 月 2 日	4.46	25,700	237,476.71	127,472.00	-	
600759	洲际油气	2018 年 3 月 27 日	重大事项	3.94	-	-	32,067	307,885.46	126,343.98	-	
600335	国机汽车	2018 年 4 月 3 日	重大事项	10.43	-	-	10,800	144,559.43	112,644.00	-	
000669	金鸿控股	2018 年 5 月 18 日	重大事项	7.25	2018 年 8 月 6 日	6.53	14,935	224,756.85	108,278.75	-	
600687	刚泰控股	2018 年 6 月 11 日	重大事项	9.09	2018 年 8 月 20 日	8.18	10,900	176,730.54	99,081.00	-	
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大事项	6.40	-	-	14,500	178,220.74	92,800.00	-	
600750	江中药业	2018 年 5 月 2 日	重大事项	17.75	2018 年 8 月 1 日	16.12	4,900	137,698.92	86,975.00	-	
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大事项	3.31	-	-	15,000	252,883.18	49,650.00	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,224,569.80	-	-	-	-	4,224,569.80
结算备付金	53.82	-	-	-	-	53.82
存出保证金	3,668.32	-	-	-	-	3,668.32
交易性金融资产	-	-	-	-	97,599,052.57	97,599,052.57
应收利息	-	-	-	-	840.57	840.57
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,228,291.94	-	-	-	97,599,893.14	101,828,185.08

负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	43,537.67	43,537.67
应付托管费	-	-	-	-	8,707.53	8,707.53
应付交易费用	-	-	-	-	30,384.15	30,384.15
其他负债	-	-	-	-	196,286.01	196,286.01
负债总计	-	-	-	-	278,915.36	278,915.36
利率敏感度缺口	4,228,291.94	-	-	-	97,320,977.78	101,549,269.72
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	-	-
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

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险,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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	97,599,052.57	96.11	126,667,181.04	96.89
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	97,599,052.57	96.11	126,667,181.04	96.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,780,889.59	6,219,632.96
2. 业绩比较基准下降 5%	-4,780,889.59	-6,219,632.96	

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布，在 95%的置信度下，使用过去一年的历史数据，按照 VaR 正态算法，计算未来一个交易日里，基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信区间：95%		
	2. 观察期：一年		
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。			
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	1,847,384.31	1,898,337.42
	合计	1,847,384.31	1,898,337.42

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 90,211,049.20 元，属于第二层次的余额为 7,388,003.37 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 116,652,837.68 元，第二层次的余额为 10,014,343.36 元，无属于第三层次的余额)。

(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 2018 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017 年 12 月 31 日：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	97,599,052.57	95.85
	其中：股票	97,599,052.57	95.85
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	4,224,623.62	4.15
8	其他各项资产	4,508.89	0.00
9	合计	101,828,185.08	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,019,182.20	1.00
B	采矿业	3,029,894.63	2.98
C	制造业	57,065,584.03	56.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,763,360.07	2.72
E	建筑业	1,669,421.95	1.64
F	批发和零售业	5,402,491.14	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	3,563,131.17	3.51
H	住宿和餐饮业	509,740.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,591,623.40	8.46
J	金融业	2,317,448.08	2.28
K	房地产业	5,208,668.02	5.13
L	租赁和商务服务业	1,676,998.93	1.65
M	科学研究和技术服务业	136,746.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	902,592.80	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	48,475.00	0.05
Q	卫生和社会工作	134,971.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,945,599.40	1.92
S	综合	994,788.00	0.98
	合计	96,980,715.82	95.50

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	49,650.00	0.05
C	制造业	134,288.00	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	342,808.75	0.34
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	91,590.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	618,336.75	0.61

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	000661	长春高新	3,530	803,781.00	0.79
2	600521	华海药业	21,384	570,738.96	0.56
3	600426	华鲁恒升	32,269	567,611.71	0.56

4	600201	生物股份	31,859	544,470.31	0.54
5	600298	安琪酵母	14,100	503,088.00	0.50
6	000977	浪潮信息	21,000	500,850.00	0.49
7	002410	广联达	17,900	496,367.00	0.49
8	603019	中科曙光	10,600	486,222.00	0.48
9	000418	小天鹅 A	7,000	485,450.00	0.48
10	000830	鲁西化工	28,200	481,656.00	0.47
11	000703	恒逸石化	31,660	471,100.80	0.46
12	002049	紫光国微	10,600	467,672.00	0.46
13	600600	青岛啤酒	10,653	466,920.99	0.46
14	600256	广汇能源	111,320	455,298.80	0.45
15	603444	吉比特	3,500	447,265.00	0.44
16	603589	口子窖	7,100	436,295.00	0.43
17	002340	格林美	71,030	429,731.50	0.42
18	601233	桐昆股份	24,780	426,711.60	0.42
19	600584	长电科技	25,059	424,499.46	0.42
20	600315	上海家化	10,700	424,041.00	0.42
21	002078	太阳纸业	42,900	415,701.00	0.41
22	002179	中航光电	10,602	413,478.00	0.41
23	600673	东阳光科	39,492	407,952.36	0.40
24	000513	丽珠集团	9,238	406,010.10	0.40
25	002038	双鹭药业	10,600	402,694.00	0.40
26	000860	顺鑫农业	10,600	397,500.00	0.39
27	600872	中炬高新	14,165	396,620.00	0.39
28	600879	航天电子	56,200	395,086.00	0.39
29	300253	卫宁健康	31,696	392,713.44	0.39
30	000825	太钢不锈	65,200	391,200.00	0.39
31	002129	中环股份	49,700	389,151.00	0.38
32	002589	瑞康医药	28,300	386,012.00	0.38
33	600760	中航沈飞	10,700	385,628.00	0.38
34	300383	光环新网	28,600	383,526.00	0.38
35	600258	首旅酒店	14,000	380,380.00	0.37
36	300266	兴源环境	18,800	375,812.00	0.37
37	600525	长园集团	35,500	375,235.00	0.37
38	600022	山东钢铁	185,540	374,790.80	0.37
39	600642	申能股份	74,300	372,986.00	0.37
40	600004	白云机场	28,000	366,520.00	0.36
41	300146	汤臣倍健	21,800	361,880.00	0.36
42	600811	东方集团	83,140	357,502.00	0.35

43	600325	华发股份	45,580	352,333.40	0.35
44	002223	鱼跃医疗	17,910	349,065.90	0.34
45	002092	中泰化学	35,800	345,112.00	0.34
46	600392	盛和资源	21,200	344,076.00	0.34
47	002465	海格通信	42,800	343,684.00	0.34
48	000656	金科股份	71,500	343,200.00	0.34
49	600777	新潮能源	156,200	342,078.00	0.34
50	600079	人福医药	24,700	326,534.00	0.32
51	000066	中国长城	45,882	326,221.02	0.32
52	000039	中集集团	24,500	325,360.00	0.32
53	000488	晨鸣纸业	25,100	324,292.00	0.32
54	603369	今世缘	14,200	324,186.00	0.32
55	000690	宝新能源	46,400	322,944.00	0.32
56	600718	东软集团	24,500	319,970.00	0.32
57	603556	海兴电力	17,550	318,883.50	0.31
58	600884	杉杉股份	14,260	315,146.00	0.31
59	601168	西部矿业	50,000	314,000.00	0.31
60	002019	亿帆医药	17,700	312,405.00	0.31
61	000581	威孚高科	14,100	311,751.00	0.31
62	300166	东方国信	21,119	311,082.87	0.31
63	000596	古井贡酒	3,500	310,730.00	0.31
64	300315	掌趣科技	74,238	310,314.84	0.31
65	002176	江特电机	31,900	310,068.00	0.31
66	002408	齐翔腾达	25,178	309,185.84	0.30
67	000887	中鼎股份	21,400	308,374.00	0.30
68	002268	卫士通	14,100	307,803.00	0.30
69	000681	视觉中国	10,600	304,220.00	0.30
70	600643	爱建集团	32,140	302,116.00	0.30
71	000566	海南海药	23,400	301,626.00	0.30
72	002439	启明星辰	14,118	299,583.96	0.30
73	002127	南极电商	31,650	297,193.50	0.29
74	603658	安图生物	3,592	296,196.32	0.29
75	002195	二三四五	69,030	295,448.40	0.29
76	600808	马钢股份	82,200	295,098.00	0.29
77	000999	华润三九	10,600	294,998.00	0.29
78	600885	宏发股份	9,800	293,216.00	0.29
79	002013	中航机电	38,698	292,943.86	0.29
80	600528	中铁工业	28,500	291,270.00	0.29
81	603883	老百姓	3,500	291,060.00	0.29

82	600260	凯乐科技	10,700	287,188.00	0.28
83	300088	长信科技	49,500	287,100.00	0.28
84	002359	北讯集团	14,600	285,868.00	0.28
85	600839	四川长虹	99,900	285,714.00	0.28
86	600060	海信电器	21,200	283,868.00	0.28
87	600138	中青旅	14,238	283,763.34	0.28
88	002110	三钢闽光	17,600	282,128.00	0.28
89	600428	中远海特	79,000	280,450.00	0.28
90	000009	中国宝安	57,100	279,790.00	0.28
91	000997	新大陆	17,760	279,720.00	0.28
92	000636	风华高科	17,500	277,900.00	0.27
93	000750	国海证券	77,800	277,746.00	0.27
94	000778	新兴铸管	64,300	275,204.00	0.27
95	600388	龙净环保	21,500	274,770.00	0.27
96	002373	千方科技	21,000	274,050.00	0.27
97	000732	泰禾集团	14,000	272,300.00	0.27
98	600161	天坛生物	13,988	270,667.80	0.27
99	600967	内蒙一机	21,200	270,088.00	0.27
100	600282	南钢股份	60,900	269,178.00	0.27
101	600655	豫园股份	28,400	268,380.00	0.26
102	300418	昆仑万维	14,100	266,208.00	0.26
103	300182	捷成股份	35,000	265,300.00	0.26
104	002640	跨境通	17,600	264,352.00	0.26
105	600183	生益科技	28,775	263,579.00	0.26
106	000729	燕京啤酒	39,100	263,143.00	0.26
107	600755	厦门国贸	35,800	260,982.00	0.26
108	600143	金发科技	49,700	259,434.00	0.26
109	002183	怡亚通	39,000	259,350.00	0.26
110	600460	士兰微	21,250	259,250.00	0.26
111	000988	华工科技	17,900	258,655.00	0.25
112	600062	华润双鹤	10,500	257,775.00	0.25
113	000930	中粮生化	25,000	257,500.00	0.25
114	603816	顾家家居	3,500	257,285.00	0.25
115	600160	巨化股份	35,047	256,544.04	0.25
116	600056	中国医药	14,000	255,780.00	0.25
117	002384	东山精密	10,632	255,168.00	0.25
118	300274	阳光电源	28,440	255,106.80	0.25
119	000960	锡业股份	21,200	254,612.00	0.25
120	600572	康恩贝	35,500	254,535.00	0.25

121	300324	旋极信息	26,794	254,275.06	0.25
122	600380	健康元	21,200	251,432.00	0.25
123	600166	福田汽车	123,600	250,908.00	0.25
124	000975	银泰资源	24,640	249,849.60	0.25
125	600410	华胜天成	28,500	249,375.00	0.25
126	603077	和邦生物	143,860	248,877.80	0.25
127	002670	国盛金控	23,104	248,830.08	0.25
128	000686	东北证券	38,800	248,708.00	0.24
129	002603	以岭药业	17,700	247,446.00	0.24
130	600895	张江高科	21,500	247,250.00	0.24
131	600094	大名城	42,900	247,104.00	0.24
132	002506	协鑫集成	52,800	247,104.00	0.24
133	600409	三友化工	28,600	246,246.00	0.24
134	002407	多氟多	17,500	245,350.00	0.24
135	002030	达安基因	15,799	243,620.58	0.24
136	002221	东华能源	24,800	242,296.00	0.24
137	600499	科达洁能	35,100	240,786.00	0.24
138	002028	思源电气	14,320	240,432.80	0.24
139	600291	西水股份	17,600	235,136.00	0.23
140	002399	海普瑞	10,600	234,684.00	0.23
141	002491	通鼎互联	21,200	234,684.00	0.23
142	600875	东方电气	31,500	233,415.00	0.23
143	600266	北京城建	24,800	233,120.00	0.23
144	600240	华业资本	31,800	233,094.00	0.23
145	600418	江淮汽车	35,700	232,407.00	0.23
146	002353	杰瑞股份	14,300	232,375.00	0.23
147	600751	天海投资	35,700	231,693.00	0.23
148	300287	飞利信	32,200	231,518.00	0.23
149	600729	重庆百货	7,000	230,650.00	0.23
150	002273	水晶光电	17,895	230,308.65	0.23
151	000528	柳工	21,500	230,265.00	0.23
152	600348	阳泉煤业	31,700	226,655.00	0.22
153	002147	新光圆成	15,310	225,975.60	0.22
154	002281	光迅科技	10,616	225,059.20	0.22
155	603899	晨光文具	7,100	224,999.00	0.22
156	000547	航天发展	28,700	224,147.00	0.22
157	601966	玲珑轮胎	14,200	223,934.00	0.22
158	603659	璞泰来	3,500	223,615.00	0.22
159	002916	深南电路	3,500	222,285.00	0.22

160	600270	外运发展	10,600	222,176.00	0.22
161	601098	中南传媒	17,500	221,200.00	0.22
162	002051	中工国际	14,472	220,987.44	0.22
163	002244	滨江集团	42,300	219,960.00	0.22
164	002299	圣农发展	14,200	219,958.00	0.22
165	600978	宜华生活	32,200	219,926.00	0.22
166	000807	云铝股份	42,300	219,114.00	0.22
167	600787	中储股份	28,300	219,042.00	0.22
168	600827	百联股份	21,400	218,280.00	0.21
169	000401	冀东水泥	24,500	217,315.00	0.21
170	000089	深圳机场	28,400	217,260.00	0.21
171	600649	城投控股	35,400	216,648.00	0.21
172	300010	立思辰	17,700	216,648.00	0.21
173	603885	吉祥航空	14,000	215,740.00	0.21
174	600179	安通控股	21,220	214,958.60	0.21
175	002358	森源电气	14,212	213,890.60	0.21
176	600801	华新水泥	14,200	213,426.00	0.21
177	002174	游族网络	10,700	212,930.00	0.21
178	600737	中粮糖业	28,000	211,120.00	0.21
179	002665	首航节能	36,280	210,424.00	0.21
180	300308	中际旭创	3,500	210,140.00	0.21
181	600158	中体产业	17,900	208,356.00	0.21
182	000813	德展健康	25,150	207,236.00	0.20
183	600125	铁龙物流	24,701	206,747.37	0.20
184	600267	海正药业	14,200	206,468.00	0.20
185	601872	招商轮船	57,100	206,131.00	0.20
186	300055	万邦达	17,900	205,671.00	0.20
187	002426	胜利精密	57,100	205,560.00	0.20
188	002573	清新环境	17,760	205,128.00	0.20
189	000878	云南铜业	21,500	205,110.00	0.20
190	000078	海王生物	42,550	204,665.50	0.20
191	002583	海能达	24,502	204,591.70	0.20
192	002368	太极股份	7,000	203,490.00	0.20
193	000598	兴蓉环境	50,100	203,406.00	0.20
194	300197	铁汉生态	37,800	202,986.00	0.20
195	002366	台海核电	14,200	202,492.00	0.20
196	600435	北方导航	24,800	202,368.00	0.20
197	300058	蓝色光标	35,400	201,780.00	0.20
198	000685	中山公用	25,175	200,644.75	0.20

199	002280	联络互动	35,000	200,200.00	0.20
200	002563	森马服饰	14,000	200,200.00	0.20
201	002004	华邦健康	39,400	200,152.00	0.20
202	300199	翰宇药业	14,000	199,920.00	0.20
203	600575	皖江物流	53,500	198,485.00	0.20
204	002431	棕榈股份	29,550	198,280.50	0.20
205	600635	大众公用	53,161	197,758.92	0.19
206	000970	中科三环	21,100	197,285.00	0.19
207	600338	西藏珠峰	9,500	196,840.00	0.19
208	002180	纳思达	7,100	194,966.00	0.19
209	600511	国药股份	7,154	192,800.30	0.19
210	600648	外高桥	10,500	191,940.00	0.19
211	600970	中材国际	28,600	191,048.00	0.19
212	002517	恺英网络	26,400	189,816.00	0.19
213	300133	华策影视	17,800	189,570.00	0.19
214	600277	亿利洁能	35,900	188,116.00	0.19
215	002440	闰土股份	16,050	187,624.50	0.18
216	002841	视源股份	3,500	186,935.00	0.18
217	002745	木林森	10,500	186,795.00	0.18
218	002131	利欧股份	88,924	186,740.40	0.18
219	300113	顺网科技	10,700	186,287.00	0.18
220	002672	东江环保	14,225	186,205.25	0.18
221	601000	唐山港	78,956	185,546.60	0.18
222	002600	领益智造	35,700	185,283.00	0.18
223	002152	广电运通	31,500	185,220.00	0.18
224	600120	浙江东方	13,650	184,957.50	0.18
225	000979	中弘股份	183,076	184,906.76	0.18
226	600122	宏图高科	24,900	184,260.00	0.18
227	600466	蓝光发展	29,680	184,016.00	0.18
228	300115	长盈精密	14,160	183,655.20	0.18
229	002191	劲嘉股份	24,500	183,015.00	0.18
230	600037	歌华有线	17,700	182,664.00	0.18
231	600216	浙江医药	14,300	182,611.00	0.18
232	600307	酒钢宏兴	86,300	181,230.00	0.18
233	600064	南京高科	24,660	181,004.40	0.18
234	601179	中国西电	52,700	180,234.00	0.18
235	300026	红日药业	49,200	179,580.00	0.18
236	000028	国药一致	3,580	178,642.00	0.18
237	600863	内蒙华电	78,400	177,968.00	0.18

238	600086	东方金钰	17,700	177,708.00	0.17
239	002285	世联行	28,276	177,290.52	0.17
240	601678	滨化股份	28,450	175,821.00	0.17
241	002831	裕同科技	3,500	175,000.00	0.17
242	600597	光明乳业	17,700	174,699.00	0.17
243	002371	北方华创	3,500	173,845.00	0.17
244	002701	奥瑞金	31,816	173,715.36	0.17
245	002512	达华智能	17,900	173,630.00	0.17
246	300159	新研股份	24,500	173,460.00	0.17
247	600563	法拉电子	3,500	173,215.00	0.17
248	603228	景旺电子	3,500	173,040.00	0.17
249	002690	美亚光电	7,199	171,624.16	0.17
250	600664	哈药股份	43,060	170,948.20	0.17
251	601200	上海环境	10,700	169,381.00	0.17
252	603868	飞科电器	3,500	169,295.00	0.17
253	600021	上海电力	25,100	169,174.00	0.17
254	600582	天地科技	45,700	167,719.00	0.17
255	000553	沙隆达 A	10,600	167,586.00	0.17
256	600503	华丽家族	42,700	166,957.00	0.16
257	000031	中粮地产	28,600	165,308.00	0.16
258	600039	四川路桥	50,000	164,000.00	0.16
259	002233	塔牌集团	14,300	163,592.00	0.16
260	603515	欧普照明	3,500	163,590.00	0.16
261	600171	上海贝岭	14,100	163,278.00	0.16
262	600823	世茂股份	39,000	163,020.00	0.16
263	600614	鹏起科技	28,500	162,735.00	0.16
264	002477	雏鹰农牧	49,100	162,521.00	0.16
265	600598	北大荒	17,700	162,132.00	0.16
266	000758	中色股份	35,900	161,550.00	0.16
267	300257	开山股份	10,532	161,034.28	0.16
268	601128	常熟银行	28,100	160,732.00	0.16
269	600881	亚泰集团	43,000	160,390.00	0.16
270	002266	浙富控股	42,700	160,125.00	0.16
271	002505	大康农业	74,780	160,029.20	0.16
272	600017	日照港	49,800	159,858.00	0.16
273	300001	特锐德	14,029	159,369.44	0.16
274	600717	天津港	21,100	158,883.00	0.16
275	002128	露天煤业	17,500	158,550.00	0.16
276	601880	大连港	81,690	158,478.60	0.16

277	600594	益佰制药	17,600	157,696.00	0.16
278	000027	深圳能源	31,900	157,586.00	0.16
279	002444	巨星科技	14,255	156,947.55	0.15
280	002390	信邦制药	21,400	156,648.00	0.15
281	002332	仙琚制药	17,900	156,625.00	0.15
282	002250	联化科技	17,700	156,114.00	0.15
283	603766	隆鑫通用	28,730	156,003.90	0.15
284	600848	上海临港	7,100	153,857.00	0.15
285	002437	誉衡药业	24,800	153,760.00	0.15
286	600536	中国软件	7,100	153,573.00	0.15
287	000766	通化金马	12,900	153,252.00	0.15
288	002839	张家港行	25,100	152,859.00	0.15
289	000426	兴业矿业	21,200	152,852.00	0.15
290	600859	王府井	7,170	152,505.90	0.15
291	000156	华数传媒	15,800	152,312.00	0.15
292	600026	中远海能	35,900	152,216.00	0.15
293	000926	福星股份	21,100	151,709.00	0.15
294	600936	广西广电	31,700	150,892.00	0.15
295	000848	承德露露	14,212	150,505.08	0.15
296	300002	神州泰岳	35,900	149,703.00	0.15
297	002056	横店东磁	21,180	148,471.80	0.15
298	600633	浙数文化	17,800	148,452.00	0.15
299	002317	众生药业	14,000	147,980.00	0.15
300	002400	省广集团	45,583	147,233.09	0.14
301	600141	兴发集团	12,600	146,790.00	0.14
302	600478	科力远	28,755	146,650.50	0.14
303	000563	陕国投 A	43,000	146,200.00	0.14
304	000021	深科技	21,400	145,948.00	0.14
305	000006	深振业 A	24,900	145,914.00	0.14
306	002544	杰赛科技	10,600	145,114.00	0.14
307	600908	无锡银行	24,600	144,894.00	0.14
308	601717	郑煤机	24,900	144,669.00	0.14
309	000667	美好置业	67,900	144,627.00	0.14
310	000718	苏宁环球	39,300	144,231.00	0.14
311	002155	湖南黄金	21,000	143,640.00	0.14
312	000738	航发控制	10,600	141,298.00	0.14
313	000012	南玻 A	28,376	140,461.20	0.14
314	600623	华谊集团	14,000	139,720.00	0.14
315	000062	深圳华强	7,100	139,160.00	0.14

316	600098	广州发展	21,500	138,675.00	0.14
317	002807	江阴银行	24,600	138,252.00	0.14
318	002709	天赐材料	3,586	138,204.44	0.14
319	601689	拓普集团	7,100	138,024.00	0.14
320	002249	大洋电机	31,900	137,489.00	0.14
321	600645	中源协和	7,100	136,746.00	0.13
322	000400	许继电气	17,500	136,675.00	0.13
323	600195	中牧股份	7,000	136,150.00	0.13
324	000519	中兵红箭	17,510	136,052.70	0.13
325	002699	美盛文化	7,240	135,822.40	0.13
326	600329	中新药业	7,141	135,679.00	0.13
327	600580	卧龙电气	17,739	135,171.18	0.13
328	300244	迪安诊断	7,100	134,971.00	0.13
329	002002	鸿达兴业	29,097	134,137.17	0.13
330	600835	上海机电	7,100	133,906.00	0.13
331	000090	天健集团	21,576	133,771.20	0.13
332	300376	易事特	24,800	133,176.00	0.13
333	601801	皖新传媒	17,500	133,175.00	0.13
334	000727	华东科技	70,800	133,104.00	0.13
335	002277	友阿股份	28,700	132,307.00	0.13
336	000501	鄂武商 A	10,720	131,748.80	0.13
337	002354	天神娱乐	14,200	131,492.00	0.13
338	601016	节能风电	45,700	131,159.00	0.13
339	000612	焦作万方	24,980	131,145.00	0.13
340	601928	凤凰传媒	21,500	130,720.00	0.13
341	002048	宁波华翔	10,600	130,698.00	0.13
342	603198	迎驾贡酒	7,100	130,427.00	0.13
343	600557	康缘药业	10,540	130,169.00	0.13
344	002064	华峰氨纶	31,500	130,095.00	0.13
345	600754	锦江股份	3,500	129,360.00	0.13
346	000587	金洲慈航	25,700	127,472.00	0.13
347	600416	湘电股份	17,600	126,544.00	0.12
348	600759	洲际油气	32,067	126,343.98	0.12
349	000980	众泰汽车	17,700	125,847.00	0.12
350	600770	综艺股份	21,300	125,670.00	0.12
351	002022	科华生物	10,603	125,645.55	0.12
352	002212	南洋股份	10,500	124,845.00	0.12
353	600280	中央商场	14,300	124,696.00	0.12
354	002434	万里扬	14,200	124,676.00	0.12

355	000543	皖能电力	28,140	124,097.40	0.12
356	002242	九阳股份	7,000	123,830.00	0.12
357	000158	常山北明	17,920	123,110.40	0.12
358	601311	骆驼股份	10,649	122,144.03	0.12
359	002073	软控股份	21,200	121,900.00	0.12
360	000592	平潭发展	42,800	121,552.00	0.12
361	600108	亚盛集团	42,000	121,380.00	0.12
362	600312	平高电气	21,500	121,260.00	0.12
363	002635	安洁科技	7,050	121,260.00	0.12
364	002251	步步高	10,620	120,855.60	0.12
365	002463	沪电股份	32,160	120,278.40	0.12
366	002254	泰和新材	10,540	119,945.20	0.12
367	000877	天山股份	17,760	119,880.00	0.12
368	300156	神雾环保	17,900	119,393.00	0.12
369	603877	太平鸟	3,580	119,321.40	0.12
370	600993	马应龙	7,014	119,308.14	0.12
371	002424	贵州百灵	10,500	119,280.00	0.12
372	601608	中信重工	45,700	118,820.00	0.12
373	600317	营口港	52,500	118,650.00	0.12
374	603000	人民网	14,200	117,860.00	0.12
375	603888	新华网	6,950	117,177.00	0.12
376	600869	智慧能源	24,702	116,593.44	0.11
377	600565	迪马股份	39,500	116,525.00	0.11
378	600073	上海梅林	17,500	116,200.00	0.11
379	002308	威创股份	14,000	116,200.00	0.11
380	300297	蓝盾股份	14,300	115,973.00	0.11
381	000937	冀中能源	28,000	115,080.00	0.11
382	600169	太原重工	49,000	114,660.00	0.11
383	002815	崇达技术	7,100	114,310.00	0.11
384	002302	西部建设	10,600	114,162.00	0.11
385	600151	航天机电	28,100	114,086.00	0.11
386	600694	大商股份	3,500	113,785.00	0.11
387	600611	大众交通	28,550	113,629.00	0.11
388	600545	卓郎智能	14,300	113,542.00	0.11
389	002509	天广中茂	39,000	113,490.00	0.11
390	600335	国机汽车	10,800	112,644.00	0.11
391	000025	特力A	3,500	112,595.00	0.11
392	002657	中科金财	7,100	112,464.00	0.11
393	600578	京能电力	35,900	112,008.00	0.11

394	002503	搜于特	31,940	111,790.00	0.11
395	000969	安泰科技	17,800	111,250.00	0.11
396	002093	国脉科技	14,225	109,674.75	0.11
397	600366	宁波韵升	17,900	109,190.00	0.11
398	603188	亚邦股份	10,700	109,140.00	0.11
399	002428	云南锗业	14,100	108,852.00	0.11
400	000572	海马汽车	31,700	108,731.00	0.11
401	600422	昆药集团	14,028	108,717.00	0.11
402	000541	佛山照明	17,970	107,640.30	0.11
403	600395	盘江股份	17,600	106,832.00	0.11
404	601001	大同煤业	21,500	106,640.00	0.11
405	600765	中航重机	14,300	106,392.00	0.10
406	002482	广田集团	17,777	106,128.69	0.10
407	002707	众信旅游	11,000	105,600.00	0.10
408	603355	莱克电气	3,500	105,175.00	0.10
409	000552	靖远煤电	32,100	104,967.00	0.10
410	000829	天音控股	14,300	104,819.00	0.10
411	000712	锦龙股份	10,500	104,790.00	0.10
412	002920	德赛西威	3,500	104,650.00	0.10
413	002489	浙江永强	28,684	104,409.76	0.10
414	600393	粤泰股份	28,700	103,894.00	0.10
415	300039	上海凯宝	17,904	103,843.20	0.10
416	600300	维维股份	31,700	103,342.00	0.10
417	600259	广晟有色	3,500	102,480.00	0.10
418	002276	万马股份	17,500	102,200.00	0.10
419	600187	国中水务	35,900	101,956.00	0.10
420	000762	西藏矿业	10,575	101,837.25	0.10
421	002118	紫鑫药业	14,200	101,530.00	0.10
422	600155	宝硕股份	14,100	101,379.00	0.10
423	600757	长江传媒	17,700	100,713.00	0.10
424	600971	恒源煤电	14,100	100,674.00	0.10
425	000049	德赛电池	3,550	100,181.00	0.10
426	000600	建投能源	17,900	99,703.00	0.10
427	000990	诚志股份	7,100	99,400.00	0.10
428	600687	刚泰控股	10,900	99,081.00	0.10
429	600874	创业环保	10,600	99,004.00	0.10
430	002642	荣之联	10,772	98,994.68	0.10
431	600773	西藏城投	14,167	98,035.64	0.10
432	600316	洪都航空	10,500	97,860.00	0.10

433	300273	和佳股份	14,360	97,360.80	0.10
434	000536	华映科技	35,300	97,075.00	0.10
435	000061	农产品	17,800	96,120.00	0.09
436	603056	德邦股份	3,500	95,865.00	0.09
437	300134	大富科技	10,620	94,942.80	0.09
438	002414	高德红外	7,000	94,080.00	0.09
439	601777	力帆股份	17,900	93,617.00	0.09
440	002375	亚厦股份	17,500	93,450.00	0.09
441	002011	盾安环境	14,500	92,800.00	0.09
442	002818	富森美	3,500	92,330.00	0.09
443	002681	奋达科技	10,640	92,142.40	0.09
444	600657	信达地产	21,494	91,349.50	0.09
445	002345	潮宏基	10,620	91,332.00	0.09
446	603568	伟明环保	3,550	89,815.00	0.09
447	600006	东风汽车	21,400	87,526.00	0.09
448	600639	浦东金桥	7,000	87,360.00	0.09
449	600184	光电股份	7,046	87,299.94	0.09
450	600058	五矿发展	10,500	87,255.00	0.09
451	600750	江中药业	4,900	86,975.00	0.09
452	001696	宗申动力	17,700	86,730.00	0.09
453	002663	普邦股份	28,096	83,445.12	0.08
454	002261	拓维信息	17,600	80,960.00	0.08
455	300032	金龙机电	14,300	80,223.00	0.08
456	600458	时代新材	10,700	78,752.00	0.08
457	603806	福斯特	3,550	78,135.50	0.08
458	000806	银河生物	17,800	77,074.00	0.08
459	603328	依顿电子	7,000	75,950.00	0.07
460	002588	史丹利	14,380	74,488.40	0.07
461	300202	聚龙股份	7,100	74,053.00	0.07
462	300291	华录百纳	10,500	74,025.00	0.07
463	600350	山东高速	17,900	72,495.00	0.07
464	600640	号百控股	7,100	72,207.00	0.07
465	600748	上实发展	14,290	72,021.60	0.07
466	002041	登海种业	10,500	71,610.00	0.07
467	603225	新凤鸣	3,580	71,492.60	0.07
468	002344	海宁皮城	14,700	71,442.00	0.07
469	300043	星辉娱乐	17,800	71,200.00	0.07
470	600167	联美控股	7,000	70,000.00	0.07
471	600939	重庆建工	14,100	69,654.00	0.07

472	600651	飞乐音响	17,800	69,420.00	0.07
473	300116	坚瑞沃能	24,600	67,896.00	0.07
474	603025	大豪科技	3,500	67,690.00	0.07
475	002342	巨力索具	17,700	67,083.00	0.07
476	600862	中航高科	10,700	65,805.00	0.06
477	600517	置信电气	17,600	65,120.00	0.06
478	600481	双良节能	21,200	64,872.00	0.06
479	600743	华远地产	25,080	64,455.60	0.06
480	600126	杭钢股份	10,500	62,685.00	0.06
481	600292	远达环保	10,640	62,456.80	0.06
482	002416	爱施德	10,620	62,339.40	0.06
483	601127	小康股份	3,500	60,515.00	0.06
484	002479	富春环保	10,700	60,455.00	0.06
485	600618	氯碱化工	7,100	60,421.00	0.06
486	600053	九鼎投资	3,500	60,095.00	0.06
487	002190	成飞集成	3,500	59,815.00	0.06
488	601969	海南矿业	10,500	57,540.00	0.06
489	601019	山东出版	7,000	56,070.00	0.06
490	000987	越秀金控	7,100	55,806.00	0.05
491	603169	兰石重装	10,600	53,106.00	0.05
492	600996	贵广网络	7,100	52,682.00	0.05
493	603569	长久物流	3,500	49,980.00	0.05
494	603377	东方时尚	3,500	48,475.00	0.05
495	601020	华钰矿业	3,500	48,265.00	0.05
496	000761	本钢板材	10,600	42,824.00	0.04
497	601811	新华文轩	3,500	34,020.00	0.03
498	600917	重庆燃气	3,500	23,835.00	0.02

7.3.2 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	000939	*ST 凯迪	47,000	234,530.00	0.23
2	002005	德豪润达	30,800	134,288.00	0.13
3	000669	金鸿控股	14,935	108,278.75	0.11
4	600880	博瑞传播	21,500	91,590.00	0.09
5	000693	*ST 华泽	15,000	49,650.00	0.05

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	002129	中环股份	405,783.00	0.31
2	600760	中航沈飞	403,088.00	0.31
3	600777	新潮能源	399,041.00	0.31
4	600258	首旅酒店	384,994.40	0.29
5	002465	海格通信	379,611.00	0.29
6	300315	掌趣科技	344,577.88	0.26
7	002049	紫光国微	332,789.09	0.25
8	600528	中铁工业	312,698.00	0.24
9	000750	国海证券	301,322.00	0.23
10	300418	昆仑万维	289,702.00	0.22
11	002110	三钢闽光	286,378.00	0.22
12	600895	张江高科	277,392.00	0.21
13	000686	东北证券	276,692.00	0.21
14	002399	海普瑞	269,909.00	0.21
15	300308	中际旭创	249,972.00	0.19
16	601098	中南传媒	247,975.00	0.19
17	000813	德展健康	247,243.50	0.19
18	600827	百联股份	247,093.00	0.19
19	600649	城投控股	246,368.00	0.19
20	601966	玲珑轮胎	246,154.00	0.19

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	002422	科伦药业	894,294.00	0.68
2	600516	方大炭素	780,096.00	0.60
3	002405	四维图新	723,334.76	0.55
4	600176	中国巨石	707,627.00	0.54
5	000786	北新建材	594,534.20	0.45

6	002271	东方雨虹	551,680.00	0.42
7	000998	隆平高科	504,620.20	0.39
8	002001	新 和 成	499,695.60	0.38
9	002050	三花智控	487,613.00	0.37
10	300156	神雾环保	464,466.00	0.36
11	000050	深天马 A	458,520.00	0.35
12	002311	海大集团	454,189.80	0.35
13	600346	恒力股份	423,752.00	0.32
14	600566	济川药业	360,163.00	0.28
15	600438	通威股份	349,190.00	0.27
16	002168	深圳惠程	341,207.00	0.26
17	601699	潞安环能	321,685.00	0.25
18	000981	银亿股份	316,275.00	0.24
19	002032	苏 泊 尔	208,551.44	0.16
20	601231	环旭电子	195,346.00	0.15

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,184,578.10
卖出股票收入（成交）总额	21,249,710.77

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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,668.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	840.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,508.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 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	000939	*ST 凯迪	234,530.00	0.23	重大事项
2	002005	德豪润达	134,288.00	0.13	重大事项
3	000669	金鸿控股	108,278.75	0.11	重大事项
4	000693	*ST 华泽	49,650.00	0.05	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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
206	364,519.24	69,293,243.00	92.28%	5,797,721.00	7.72%

8.2 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	2.24%
2	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍 盛稳进	1,285,720.00	1.71%
3	徐军	450,102.00	0.60%
4	肖小兰	351,500.00	0.47%
5	杨盾保	234,460.00	0.31%
6	许良	205,018.00	0.27%
7	林宏	193,543.00	0.26%
8	沈恺	150,000.00	0.20%
9	凌军	135,901.00	0.18%
10	文红梅	134,010.00	0.18%
	诺安中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	68,000,000.00	90.56%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 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

§ 9 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	81,090,964.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
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	75,090,964.00

§ 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，经诺安基金管理有限公司 2018 年度股东会决议通过，同意选举赵照先生、孙晓刚先生担任诺安基金管理有限公司的董事，原董事会成员齐斌先生、李清章先生不再担任公司董事职务。同意选举秦江卫先生担任诺安基金管理有限公司的监事，原监事会成员李京先生不再担任公司监事职务。上述董事、监事变更事项已报深圳证监局备案并在各基金的《招募说明书》中披露。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	37,365,132.87	100.00%	34,798.53	100.00%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	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》。

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

本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2018 年 1 月 2 日
2	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《证券时报》、《中国证券报》	2018 年 1 月 22 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)2018 年第 1 期-摘要	《证券时报》、《中国证券报》	2018 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)2018 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2018 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 2017 年度报告-摘要	《证券时报》、《中国证券报》	2018 年 3 月 29 日
6	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年度报告	基金管理人网站	2018 年 3 月 29 日
7	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 (2018 年 3 月修订)	基金管理人网站	2018 年 3 月 31 日
8	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 (2018 年 3 月修订)	基金管理人网站	2018 年 3 月 31 日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下基金根据流动性规定修改基金合	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券	2018 年 3 月 31 日

	同和托管协议的公告	报》	
10	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	《证券时报》、《中国证券报》	2018 年 4 月 21 日
11	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	2018 年 6 月 30 日

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2018.01.02-2018.06.29	74,000,000.00	-	6,000,000.00	68,000,000.00	90.56%
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，我司于 2018 年 3 月 31 日在公司网站和指定媒体发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金根据流动性规定修改基金合同和托管协议的公告》的公告，对旗下部分基金的《基金合同》、《托管协议》的相关条款进行修订。

备查文件目录

11.3 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 2018 年半年度报告正文。
- 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。

11.4 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.5 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 8 月 27 日