

诺安中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 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 2019 年 3 月 26 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 2018 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 2018 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.....	13
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.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
§10 开放式基金份额变动.....	68
§11 重大事件揭示.....	69
11.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
11.4 基金投资策略的改变.....	69

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录.....	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 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	79,090,964.00 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》
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-11,615,564.39	-5,762,099.48	-12,462,688.78
本期利润	-39,648,747.19	-630,287.58	-34,275,336.60
加权平均基金份额本期利润	-0.5136	-0.0067	-0.3261
本期加权平均净值利润率	-37.42%	-0.41%	-20.18%
本期基金份额净值增长率	-32.41%	-1.09%	-16.99%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	7,082,824.62	49,635,834.90	63,679,088.90
期末可供分配基金份额利润	0.0896	0.6121	0.6299
期末基金资产净值	86,173,788.62	130,726,798.90	164,770,052.90
期末基金份额净值	1.0896	1.6121	1.6299
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	8.96%	61.21%	62.99%

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。

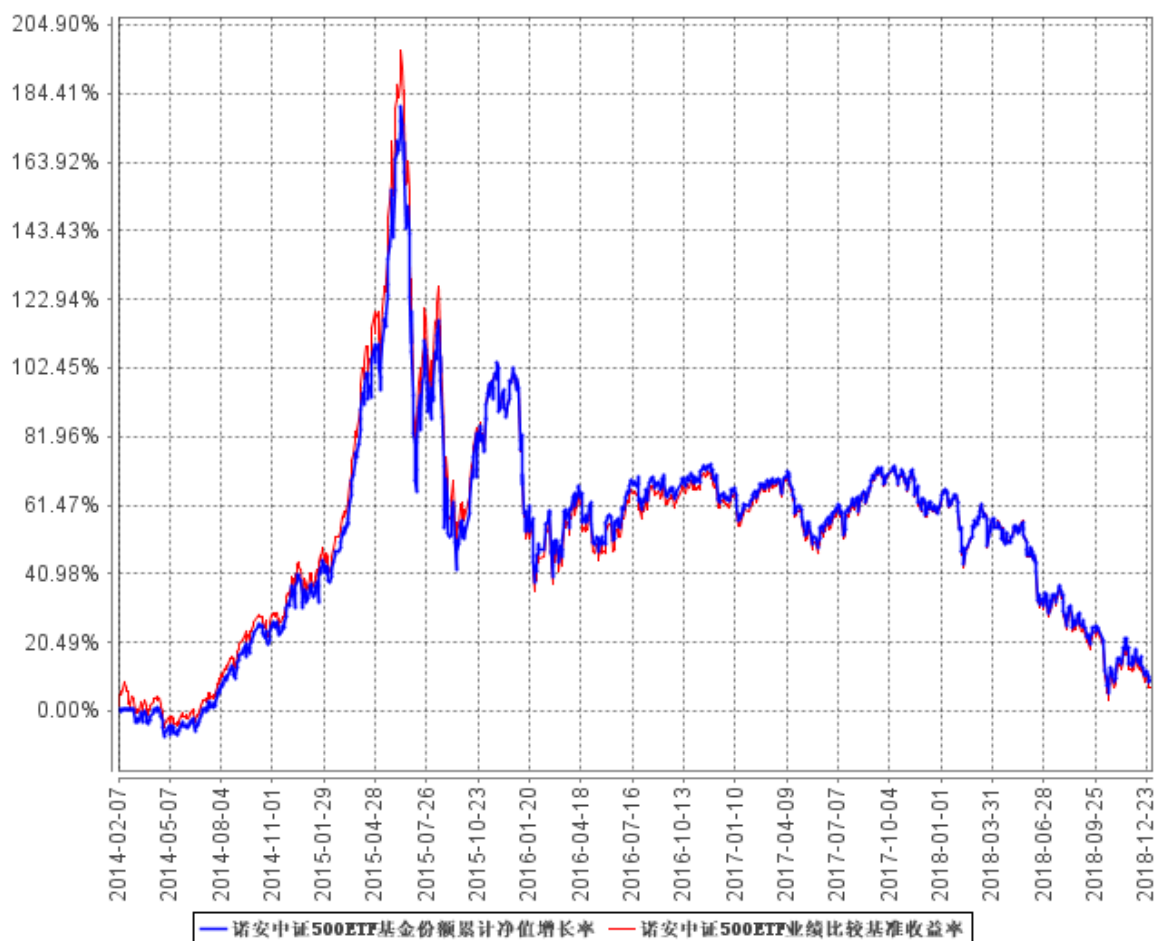
3.2 基金净值表现

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	-12.70%	1.76%	-13.18%	1.84%	0.48%	-0.08%
过去六个月	-19.43%	1.51%	-20.12%	1.58%	0.69%	-0.07%
过去一年	-32.41%	1.45%	-33.32%	1.51%	0.91%	-0.06%
过去三年	-44.51%	1.44%	-45.28%	1.50%	0.77%	-0.06%
自基金合同生效起至今	8.96%	1.74%	7.27%	1.81%	1.69%	-0.07%

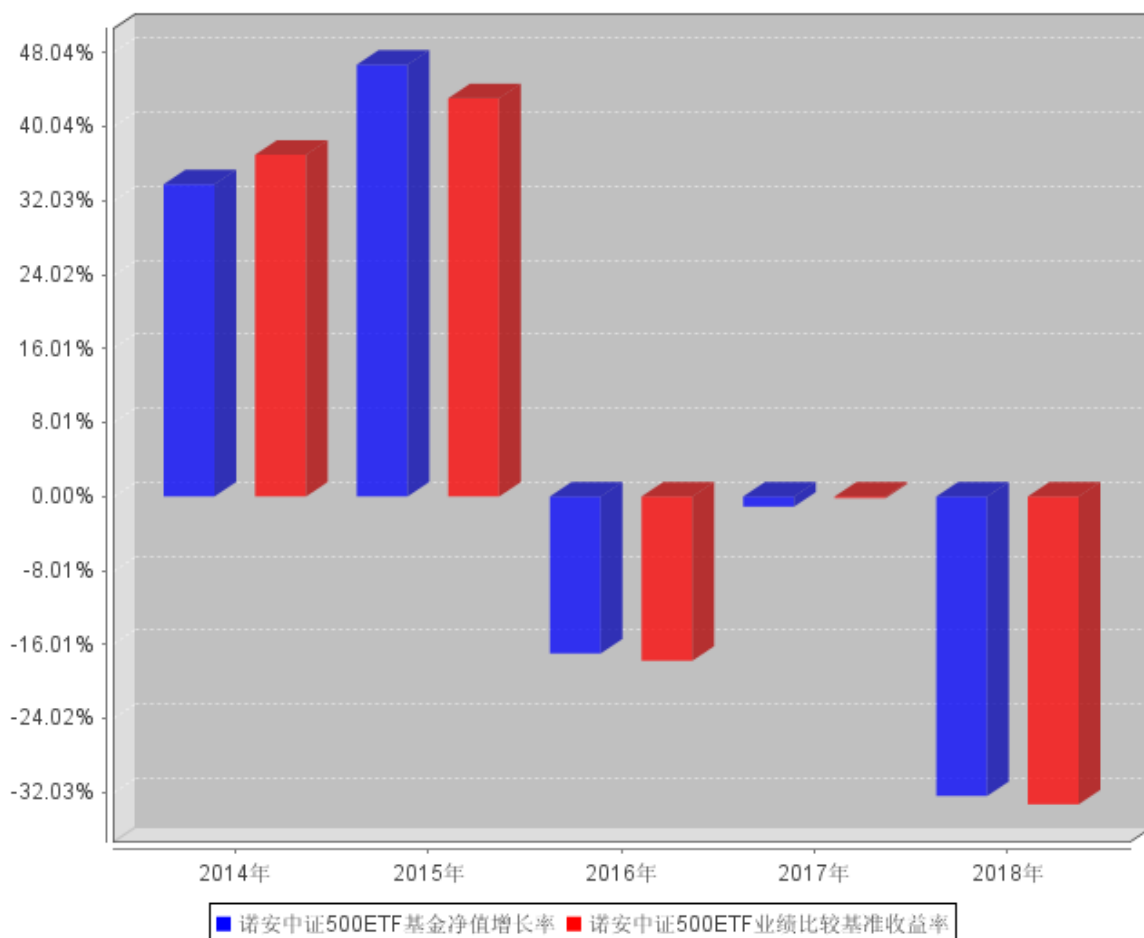
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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。

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 2018 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 59 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、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安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、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金等。

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	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, 2017年8月至2018年8月任诺安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。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基金经理, 2018年8月起任诺安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

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合规守信情况的说明

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

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，主要原因分别为采用量化策略的投资组合调仓导致、投资组合采用的投资策略导致。经检查未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 1.0896 元。本报告期基金份额净值增长率为-32.41%，同期业绩比较基准收益率为-33.32%。

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五十九只开放式基金——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、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安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、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金等。

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

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 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 1901479 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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</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、在财务报表附注 7.4.2 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人诺安基金管理有限公司对其他信息负责。其他信息包括该基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人诺安基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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</p>

表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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：

(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。

(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。

(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。

(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。

(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。

	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。	
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	2019 年 3 月 26 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,837,200.21	4,363,341.66
结算备付金		3,922.53	71.56
存出保证金		2,058.22	6,582.48
交易性金融资产	7.4.7.2	82,591,775.27	126,667,181.04
其中：股票投资		82,591,775.27	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	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	770.68	946.36
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		86,435,726.91	131,038,123.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,258.46	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,978.97	56,412.62
应付托管费		7,595.80	11,282.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	26,105.06	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	7.4.7.8	185,000.00	202,949.90
负债合计		261,938.29	311,324.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	79,090,964.00	81,090,964.00
未分配利润	7.4.7.10	7,082,824.62	49,635,834.90
所有者权益合计		86,173,788.62	130,726,798.90
负债和所有者权益总计		86,435,726.91	131,038,123.10

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0896 元，基金份额总额 79,090,964.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-38,408,174.62	947,780.20
1.利息收入		32,055.67	44,643.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	32,055.67	44,643.90
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）		-10,379,815.93	-4,313,968.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-11,575,299.25	-5,498,670.55
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	1,195,483.32	1,184,702.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-28,033,182.80	5,131,811.90
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	-27,231.56	85,292.52
减：二、费用		1,240,572.57	1,578,067.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	529,932.72	768,339.88

2. 托管费	7.4.10.2.2	105,986.58	153,668.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	103,549.84	159,364.18
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	7.4.7.20	501,103.43	496,695.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-39,648,747.19	-630,287.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-39,648,747.19	-630,287.58

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	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）	-	-39,648,747.19	-39,648,747.19
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）	-2,000,000.00	-2,904,263.09	-4,904,263.09
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	812,008.79	4,812,008.79
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）	79,090,964.00	7,082,824.62	86,173,788.62
项目	上年度可比期间 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	101,090,964.00	63,679,088.90	164,770,052.90

金净值)			
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

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

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 2019 年 3 月 26 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，同时亦按照中国证券监督管理委员会（以下简称“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 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 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，在资金实际占用期间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，在资金实际占用期间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。基金管理人对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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

本基金本报告期间无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,837,200.21	4,363,341.66
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：	3,837,200.21	4,363,341.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	124,776,766.84	82,591,775.27	-42,184,991.57

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	124,776,766.84	82,591,775.27	-42,184,991.57
项目	上年度末 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

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	768.08	943.35
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	1.70	0.01

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	0.90	3.00
合计	770.68	946.36

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	26,105.06	40,679.16
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	26,105.06	40,679.16

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付赎回费	-	-
预提费用	135,000.00	135,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退替代款	-	16,794.10
应付替代款	-	1,155.80
合计	185,000.00	202,949.90

7.4.7.9 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12月31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	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	79,090,964.00	79,090,964.00

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	74,957,771.83	-25,321,936.93	49,635,834.90
本期利润	-11,615,564.39	-28,033,182.80	-39,648,747.19
本期基金份额交易产生的变动数	-1,975,848.64	-928,414.45	-2,904,263.09
其中：基金申购款	3,516,323.18	-2,704,314.39	812,008.79
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	61,366,358.80	-54,283,534.18	7,082,824.62

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	31,491.95	43,789.07
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	504.61	773.38
其他	59.11	81.45
合计	32,055.67	44,643.90

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,159,309.35	-4,233,166.94
股票投资收益——赎回差价收入	-415,989.90	-1,265,503.61
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-11,575,299.25	-5,498,670.55

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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	34,856,387.86	58,546,245.67
减：卖出股票成本总额	46,015,697.21	62,779,412.61
买卖股票差价收入	-11,159,309.35	-4,233,166.94

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 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
赎回基金份额对价总额	9,716,271.88	36,591,882.09
减：现金支付赎回款总额	5,305,308.88	19,741,415.09
减：赎回股票成本总额	4,826,952.90	18,115,970.61
赎回差价收入	-415,989.90	-1,265,503.61

7.4.7.13 债券投资收益

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 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资产生的股利收益	1,195,483.32	1,184,702.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,195,483.32	1,184,702.43

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
1. 交易性金融资产	-28,033,182.80	5,131,811.90

——股票投资	-28,033,182.80	5,131,811.90
——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	-28,033,182.80	5,131,811.90

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-27,231.56	85,292.52
合计	-27,231.56	85,292.52

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 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
交易所市场交易费用	103,549.84	159,364.18
银行间市场交易费用	-	-
合计	103,549.84	159,364.18

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
律师费	5,000.00	-

上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	1,103.43	1,695.69
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	501,103.43	496,695.69

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。

7.4.7.21 分部报告

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	529,932.72	768,339.88
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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	105,986.58	153,668.03

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

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 2018 年 12 月 31 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	72,000,000.00	91.03%	74,000,000.00	91.26%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	3,837,200.21	31,491.95	4,363,341.66	43,789.07

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（2018 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 2018 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
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	重大事项	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	41,200	300,948.75	206,412.00	-
000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大事项	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	7,500	77,627.33	59,775.00	-
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大事项	0.55	-	-	15,000	252,883.18	8,250.00	-

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 2018 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 2018 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。

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

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

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 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	3,837,200.21	-	-	-	-	3,837,200.21
结算备付金	3,922.53	-	-	-	-	3,922.53
存出保证金	2,058.22	-	-	-	-	2,058.22
交易性金融资产	-	-	-	-	82,591,775.27	82,591,775.27
应收利息	-	-	-	-	770.68	770.68
资产总计	3,843,180.96	-	-	-	82,592,545.95	86,435,726.91
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	5,258.46	5,258.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	37,978.97	37,978.97
应付托管费	-	-	-	-	7,595.80	7,595.80
应付交易费用	-	-	-	-	26,105.06	26,105.06
其他负债	-	-	-	-	185,000.00	185,000.00
负债总计	-	-	-	-	261,938.29	261,938.29
利率敏感度缺口	3,843,180.96	-	-	-	82,330,607.66	86,173,788.62
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

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2018年12月31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	82,591,775.27	95.84	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	82,591,775.27	95.84	126,667,181.04	96.89

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（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,074,296.73	6,219,632.96
	2. 业绩比较基准下降 5%	-4,074,296.73	-6,219,632.96

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，使用过去一年的历史数据，按照 VaR 正态算法，计算未来一个交易日里，基金持仓资产组合可能的最大损失值。

假设	1. 置信区间:95%		
	2. 观察期:一年		
分析	风险价值 (单位:人民币元)	本期末(2018年12月31日)	上年度末(2017年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	2,072,498.24	1,898,337.42
	合计	2,072,498.24	1,898,337.42

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 2018 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级的余额为 82,317,338.27 元, 属于第二层级的余额为 274,437.00 元, 无属于第三层级的余额(2017 年 12 月 31 日: 第一层级的余额为 116,652,837.68 元, 第二层级的余额为 10,014,343.36 元, 无属于第三层级的余额)。

2018 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 2018 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(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。

§ 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	82,591,775.27	95.55
	其中：股票	82,591,775.27	95.55
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	3,841,122.74	4.44
8	其他各项资产	2,828.90	0.00
9	合计	86,435,726.91	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	860,591.00	1.00
B	采矿业	2,533,261.92	2.94
C	制造业	46,656,494.19	54.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,625,591.60	3.05
E	建筑业	1,535,196.81	1.78
F	批发和零售业	4,482,954.38	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,689,297.28	3.12
H	住宿和餐饮业	315,018.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,761,047.87	9.01
J	金融业	2,736,727.92	3.18
K	房地产业	4,607,517.90	5.35
L	租赁和商务服务业	1,328,872.50	1.54
M	科学研究和技术服务业	121,800.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	606,480.70	0.70

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,020.00	0.06
Q	卫生和社会工作	596,850.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	2,259,610.20	2.62
S	综合	812,193.00	0.94
	合计	82,583,525.27	95.83

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	8,250.00	0.01
C	制造业	-	-
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	8,250.00	0.01

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	603444	吉比特	3,700	547,600.00	0.64
2	600201	生物股份	29,659	492,339.40	0.57

3	300347	泰格医药	11,300	483,075.00	0.56
4	000656	金科股份	71,700	443,823.00	0.52
5	600872	中炬高新	14,965	440,868.90	0.51
6	600256	广汇能源	108,820	409,163.20	0.47
7	002410	广联达	18,900	393,309.00	0.46
8	600600	青岛啤酒	11,253	392,279.58	0.46
9	300146	汤臣倍健	22,600	383,974.00	0.45
10	300253	卫宁健康	30,296	377,488.16	0.44
11	600298	安琪酵母	14,900	375,927.00	0.44
12	000623	吉林敖东	25,900	373,737.00	0.43
13	600642	申能股份	74,500	363,560.00	0.42
14	600426	华鲁恒升	30,069	362,932.83	0.42
15	000860	顺鑫农业	11,200	357,168.00	0.41
16	601005	重庆钢铁	183,300	355,602.00	0.41
17	002465	海格通信	45,200	352,560.00	0.41
18	600699	均胜电子	14,800	345,728.00	0.40
19	000750	国海证券	78,100	340,516.00	0.40
20	600895	张江高科	22,700	339,365.00	0.39
21	000998	隆平高科	22,300	330,040.00	0.38
22	000690	宝新能源	49,000	329,770.00	0.38
23	300383	光环新网	26,000	329,420.00	0.38
24	000778	新兴铸管	75,900	327,129.00	0.38
25	002129	中环股份	45,200	326,796.00	0.38
26	600820	隧道股份	52,000	325,520.00	0.38
27	300450	先导智能	11,200	324,128.00	0.38
28	002049	紫光国微	11,200	323,680.00	0.38
29	600879	航天电子	59,800	323,518.00	0.38
30	000401	冀东水泥	25,900	320,642.00	0.37
31	002195	二三四五	86,830	320,402.70	0.37
32	000418	小天鹅 A	7,400	320,050.00	0.37
33	600528	中铁工业	29,800	312,900.00	0.36
34	002439	启明星辰	14,918	306,714.08	0.36
35	600183	生益科技	30,375	305,572.50	0.35
36	002340	格林美	79,430	305,011.20	0.35
37	600811	东方集团	83,240	304,658.40	0.35
38	601168	西部矿业	51,800	301,476.00	0.35
39	002281	光迅科技	11,216	301,261.76	0.35
40	600881	亚泰集团	91,000	301,210.00	0.35
41	600673	东阳光科	40,992	298,421.76	0.35

42	002916	深南电路	3,700	296,629.00	0.34
43	002384	东山精密	25,998	293,517.42	0.34
44	002223	鱼跃医疗	14,910	292,385.10	0.34
45	002092	中泰化学	41,100	289,755.00	0.34
46	002470	金正大	45,400	286,928.00	0.33
47	600808	马钢股份	82,400	285,104.00	0.33
48	600022	山东钢铁	181,140	284,389.80	0.33
49	002506	协鑫集成	55,900	279,500.00	0.32
50	000999	华润三九	11,200	278,432.00	0.32
51	002038	双鹭药业	11,200	277,872.00	0.32
52	300413	芒果超媒	7,500	277,575.00	0.32
53	002174	游族网络	14,900	276,991.00	0.32
54	600325	华发股份	44,580	276,396.00	0.32
55	000997	新大陆	18,760	274,646.40	0.32
56	300168	万达信息	22,700	272,173.00	0.32
57	600567	山鹰纸业	86,300	269,256.00	0.31
58	000060	中金岭南	67,600	267,696.00	0.31
59	000975	银泰资源	26,240	267,385.60	0.31
60	002358	森源电气	15,012	267,213.60	0.31
61	002268	卫士通	14,900	266,114.00	0.31
62	002500	山西证券	44,900	265,808.00	0.31
63	600572	康恩贝	44,700	265,071.00	0.31
64	600079	人福医药	26,100	264,654.00	0.31
65	600804	鹏博士	37,500	263,625.00	0.31
66	000581	威孚高科	14,900	263,134.00	0.31
67	300315	掌趣科技	74,438	262,766.14	0.30
68	600143	金发科技	52,800	261,360.00	0.30
69	000681	视觉中国	11,200	261,184.00	0.30
70	300001	特锐德	14,829	259,952.37	0.30
71	000009	中国宝安	60,300	259,893.00	0.30
72	002399	海普瑞	11,200	258,160.00	0.30
73	600392	盛和资源	29,960	257,955.60	0.30
74	000830	鲁西化工	26,300	257,740.00	0.30
75	600718	东软集团	22,300	257,565.00	0.30
76	600885	宏发股份	11,300	254,928.00	0.30
77	600260	凯乐科技	14,900	252,853.00	0.29
78	002127	南极电商	33,450	251,544.00	0.29
79	600801	华新水泥	15,000	250,800.00	0.29
80	601866	中远海发	109,900	250,572.00	0.29

81	600160	巨化股份	37,547	248,936.61	0.29
82	300027	华谊兄弟	53,000	248,570.00	0.29
83	002299	圣农发展	15,000	248,100.00	0.29
84	601872	招商轮船	67,200	247,968.00	0.29
85	000960	锡业股份	25,900	247,086.00	0.29
86	002013	中航机电	37,898	246,715.98	0.29
87	600282	南钢股份	71,900	245,898.00	0.29
88	000813	德展健康	26,550	243,729.00	0.28
89	002463	沪电股份	33,960	243,493.20	0.28
90	600376	首开股份	33,800	243,022.00	0.28
91	002176	江特电机	41,400	243,018.00	0.28
92	600021	上海电力	29,800	241,380.00	0.28
93	600161	天坛生物	11,288	239,870.00	0.28
94	002507	涪陵榨菜	11,100	239,760.00	0.28
95	002221	东华能源	29,600	238,576.00	0.28
96	002110	三钢闽光	18,600	237,894.00	0.28
97	600779	水井坊	7,500	237,525.00	0.28
98	300274	阳光电源	26,540	236,736.80	0.27
99	600258	首旅酒店	14,800	236,208.00	0.27
100	000039	中集集团	22,300	235,934.00	0.27
101	600875	东方电气	29,900	235,911.00	0.27
102	601098	中南传媒	18,700	233,750.00	0.27
103	603077	和邦生物	144,260	233,701.20	0.27
104	002078	太阳纸业	40,900	233,130.00	0.27
105	600967	内蒙一机	22,400	232,960.00	0.27
106	600755	厦门国贸	33,300	232,434.00	0.27
107	600166	福田汽车	127,600	232,232.00	0.27
108	002372	伟星新材	14,947	231,827.97	0.27
109	000686	东北证券	37,000	231,620.00	0.27
110	600839	四川长虹	100,100	231,231.00	0.27
111	000008	神州高铁	59,200	230,288.00	0.27
112	000066	中国长城	48,582	230,278.68	0.27
113	000547	航天发展	30,300	229,068.00	0.27
114	603899	晨光文具	7,500	226,875.00	0.26
115	002670	国盛金控	22,504	226,840.32	0.26
116	600655	豫园股份	30,200	223,480.00	0.26
117	600643	爱建集团	26,240	222,777.60	0.26
118	600466	蓝光发展	40,780	219,396.40	0.25
119	600008	首创股份	63,900	219,177.00	0.25

120	002074	国轩高科	18,900	218,484.00	0.25
121	600584	长电科技	26,459	218,022.16	0.25
122	600959	江苏有线	52,800	217,536.00	0.25
123	603369	今世缘	15,000	217,350.00	0.25
124	600277	亿利洁能	37,900	214,514.00	0.25
125	000488	晨鸣纸业	37,700	211,497.00	0.25
126	000729	燕京啤酒	37,300	210,372.00	0.24
127	600729	重庆百货	7,400	209,420.00	0.24
128	002589	瑞康医药	29,900	208,403.00	0.24
129	002373	千方科技	18,700	207,944.00	0.24
130	600266	北京城建	26,200	207,504.00	0.24
131	000732	泰禾集团	14,800	207,496.00	0.24
132	000089	深圳机场	26,500	206,435.00	0.24
133	002183	怡亚通	41,200	206,412.00	0.24
134	600315	上海家化	7,500	204,750.00	0.24
135	002583	海能达	25,902	204,366.78	0.24
136	000932	华菱钢铁	33,700	204,222.00	0.24
137	601718	际华集团	60,100	201,335.00	0.23
138	601106	中国一重	75,300	201,051.00	0.23
139	002640	跨境通	18,600	200,880.00	0.23
140	300088	长信科技	48,400	200,860.00	0.23
141	002019	亿帆医药	18,700	200,090.00	0.23
142	000596	古井贡酒	3,700	199,652.00	0.23
143	000636	风华高科	18,500	198,690.00	0.23
144	000598	兴蓉环境	49,000	197,470.00	0.23
145	000930	中粮生化	26,400	195,888.00	0.23
146	300166	东方国信	18,819	194,964.84	0.23
147	601000	唐山港	81,756	194,579.28	0.23
148	600884	杉杉股份	15,060	194,575.20	0.23
149	600060	海信电器	22,400	194,432.00	0.23
150	600039	四川路桥	59,200	194,176.00	0.23
151	000559	万向钱潮	37,900	194,048.00	0.23
152	600138	中青旅	15,038	193,839.82	0.22
153	600409	三友化工	33,800	193,336.00	0.22
154	600373	中文传媒	14,800	192,548.00	0.22
155	600737	中粮糖业	26,100	192,096.00	0.22
156	300418	昆仑万维	14,900	191,614.00	0.22
157	600827	百联股份	22,600	190,970.00	0.22
158	600388	龙净环保	18,700	189,805.00	0.22

159	300113	顺网科技	14,900	189,379.00	0.22
160	300316	晶盛机电	18,900	189,378.00	0.22
161	601179	中国西电	56,200	188,832.00	0.22
162	000887	中鼎股份	18,600	188,232.00	0.22
163	600507	方大特钢	18,800	187,812.00	0.22
164	000513	丽珠集团	7,438	187,065.70	0.22
165	002152	广电运通	33,300	186,813.00	0.22
166	600056	中国医药	14,800	186,036.00	0.22
167	603885	吉祥航空	14,800	185,444.00	0.22
168	601128	常熟银行	30,200	185,428.00	0.22
169	603658	安图生物	3,792	185,390.88	0.22
170	603228	景旺电子	3,700	184,963.00	0.21
171	600649	城投控股	33,800	184,886.00	0.21
172	600312	平高电气	22,700	183,416.00	0.21
173	600125	铁龙物流	26,101	182,707.00	0.21
174	600460	士兰微	22,450	182,294.00	0.21
175	600863	内蒙华电	78,600	181,566.00	0.21
176	600418	江淮汽车	37,700	181,337.00	0.21
177	600062	华润双鹤	14,960	180,866.40	0.21
178	002273	水晶光电	18,895	180,636.20	0.21
179	002385	大北农	56,400	180,480.00	0.21
180	601928	凤凰传媒	22,700	180,238.00	0.21
181	000667	美好置业	71,900	179,750.00	0.21
182	000738	航发控制	14,900	179,694.00	0.21
183	000988	华工科技	14,900	177,906.00	0.21
184	300182	捷成股份	41,400	177,606.00	0.21
185	600064	南京高科	22,460	176,984.80	0.21
186	000027	深圳能源	33,700	176,925.00	0.21
187	600410	华胜天成	30,100	176,386.00	0.20
188	002250	联化科技	18,700	176,341.00	0.20
189	000878	云南铜业	22,200	176,046.00	0.20
190	600380	健康元	26,332	175,634.44	0.20
191	600511	国药股份	7,554	175,630.50	0.20
192	603659	璞泰来	3,700	175,380.00	0.20
193	603883	老百姓	3,700	174,677.00	0.20
194	002155	湖南黄金	22,200	174,270.00	0.20
195	002191	劲嘉股份	22,300	174,163.00	0.20
196	002004	华邦健康	37,600	173,336.00	0.20
197	002368	太极股份	7,400	171,680.00	0.20

198	600782	新钢股份	33,700	171,533.00	0.20
199	600167	联美控股	18,900	170,856.00	0.20
200	603486	科沃斯	3,700	170,311.00	0.20
201	002701	奥瑞金	33,616	170,096.96	0.20
202	002285	世联行	33,476	170,058.08	0.20
203	600348	阳泉煤业	33,500	168,840.00	0.20
204	300133	华策影视	18,800	168,448.00	0.20
205	600026	中远海能	37,900	168,276.00	0.20
206	300324	旋极信息	29,994	168,266.34	0.20
207	600158	中体产业	18,900	168,021.00	0.19
208	002353	杰瑞股份	11,200	168,000.00	0.19
209	600435	北方导航	22,600	167,466.00	0.19
210	601231	环旭电子	18,600	167,400.00	0.19
211	603866	桃李面包	3,700	167,092.00	0.19
212	002440	闰土股份	18,550	166,950.00	0.19
213	603816	顾家家居	3,700	166,500.00	0.19
214	002266	浙富控股	40,700	165,649.00	0.19
215	002407	多氟多	15,100	165,496.00	0.19
216	600094	大名城	45,300	165,345.00	0.19
217	600307	酒钢宏兴	86,500	165,215.00	0.19
218	600970	中材国际	30,200	165,194.00	0.19
219	000970	中科三环	22,500	164,925.00	0.19
220	002051	中工国际	14,872	164,781.76	0.19
221	002244	滨江集团	41,400	164,772.00	0.19
222	600525	长园集团	37,500	164,250.00	0.19
223	300459	金科文化	22,300	163,905.00	0.19
224	600664	哈药股份	41,060	162,187.00	0.19
225	002690	美亚光电	7,599	161,706.72	0.19
226	600216	浙江医药	18,600	161,448.00	0.19
227	600037	歌华有线	18,700	160,633.00	0.19
228	000807	云铝股份	41,400	160,632.00	0.19
229	600598	北大荒	18,700	160,072.00	0.19
230	002414	高德红外	7,400	159,470.00	0.19
231	002603	以岭药业	15,100	157,946.00	0.18
232	000528	柳工	26,010	157,880.70	0.18
233	600717	天津港	22,300	157,661.00	0.18
234	002317	众生药业	18,800	156,980.00	0.18
235	600536	中国软件	7,500	156,975.00	0.18
236	000028	国药一致	3,780	156,643.20	0.18

237	000685	中山公用	22,375	156,625.00	0.18
238	601958	金铂股份	26,400	156,288.00	0.18
239	600563	法拉电子	3,700	155,918.00	0.18
240	002408	齐翔腾达	22,778	155,801.52	0.18
241	600848	上海临港	7,500	155,100.00	0.18
242	600823	世茂股份	41,200	154,912.00	0.18
243	600291	西水股份	15,000	154,350.00	0.18
244	600901	江苏租赁	26,100	154,251.00	0.18
245	600633	浙数文化	18,800	153,220.00	0.18
246	000717	韶钢松山	33,600	152,880.00	0.18
247	600582	天地科技	44,700	152,874.00	0.18
248	600648	外高桥	11,100	152,514.00	0.18
249	002030	达安基因	14,999	152,389.84	0.18
250	601880	大连港	82,290	152,236.50	0.18
251	601966	玲珑轮胎	11,100	151,515.00	0.18
252	300308	中际旭创	3,700	150,553.00	0.17
253	601200	上海环境	11,300	149,951.00	0.17
254	002491	通鼎互联	18,900	148,932.00	0.17
255	601100	恒立液压	7,500	148,575.00	0.17
256	002831	裕同科技	3,700	148,222.00	0.17
257	603233	大参林	3,700	147,482.00	0.17
258	000031	中粮地产	30,200	147,376.00	0.17
259	601869	长飞光纤	3,700	147,149.00	0.17
260	300026	红日药业	48,100	146,705.00	0.17
261	300058	蓝色光标	33,800	146,692.00	0.17
262	300055	万邦达	18,900	144,963.00	0.17
263	300197	铁汉生态	37,800	143,262.00	0.17
264	002444	巨星科技	15,055	142,721.40	0.17
265	002400	省广集团	48,183	142,621.68	0.17
266	000543	皖能电力	29,740	142,454.60	0.17
267	002839	张家港行	26,500	141,775.00	0.16
268	600120	浙江东方	11,250	141,300.00	0.16
269	603868	飞科电器	3,700	141,266.00	0.16
270	002366	台海核电	15,000	140,700.00	0.16
271	002371	北方华创	3,700	139,712.00	0.16
272	002064	华峰氨纶	33,300	139,527.00	0.16
273	600978	宜华生活	34,000	139,400.00	0.16
274	600171	上海贝岭	14,900	139,166.00	0.16
275	000563	陕国投 A	51,900	139,092.00	0.16

276	600073	上海梅林	18,500	137,825.00	0.16
277	600503	华丽家族	45,100	137,555.00	0.16
278	000926	福星股份	22,300	136,476.00	0.16
279	300002	神州泰岳	41,300	136,290.00	0.16
280	600908	无锡银行	26,000	136,240.00	0.16
281	000006	深振业 A	26,300	136,234.00	0.16
282	300010	立思辰	18,700	135,762.00	0.16
283	002573	清新环境	18,760	135,447.20	0.16
284	600499	科达洁能	33,500	135,340.00	0.16
285	000758	中色股份	37,000	135,050.00	0.16
286	600017	日照港	48,700	134,412.00	0.16
287	000877	天山股份	18,760	133,383.60	0.15
288	600751	海航科技	49,200	133,332.00	0.15
289	000718	苏宁环球	41,700	132,606.00	0.15
290	000400	许继电气	14,900	132,461.00	0.15
291	002128	露天煤业	18,500	132,460.00	0.15
292	002563	森马服饰	14,800	132,016.00	0.15
293	002131	利欧股份	89,324	131,306.28	0.15
294	002426	胜利精密	55,800	129,456.00	0.15
295	002280	联络互动	33,400	129,258.00	0.15
296	601127	小康股份	7,500	128,550.00	0.15
297	600098	广州发展	22,700	128,482.00	0.15
298	002672	东江环保	11,125	127,270.00	0.15
299	600750	江中药业	7,500	126,975.00	0.15
300	601678	滨化股份	30,050	126,811.00	0.15
301	600597	光明乳业	15,100	126,236.00	0.15
302	600267	海正药业	15,000	125,850.00	0.15
303	600179	安通控股	18,920	125,818.00	0.15
304	002212	南洋股份	11,300	125,656.00	0.15
305	601608	中信重工	48,300	125,580.00	0.15
306	601717	郑煤机	22,700	125,531.00	0.15
307	002745	木林森	11,100	125,319.00	0.15
308	000062	深圳华强	7,500	124,950.00	0.14
309	000078	海王生物	41,650	124,117.00	0.14
310	002056	横店东磁	22,380	123,761.40	0.14
311	002359	北讯集团	15,000	123,150.00	0.14
312	300115	长盈精密	14,960	122,522.40	0.14
313	000564	供销大集	48,400	122,452.00	0.14
314	600645	中源协和	7,500	121,800.00	0.14

315	002505	大康农业	74,980	121,467.60	0.14
316	002431	棕榈股份	33,850	120,844.50	0.14
317	002254	泰和新材	11,140	120,757.60	0.14
318	000848	承德露露	15,012	120,696.48	0.14
319	600611	大众交通	30,150	120,298.50	0.14
320	000012	南玻A	29,976	119,604.24	0.14
321	600623	华谊集团	14,800	119,584.00	0.14
322	000156	华数传媒	15,000	118,950.00	0.14
323	002242	九阳股份	7,400	118,474.00	0.14
324	600580	卧龙电气	18,739	118,055.70	0.14
325	000158	常山北明	22,520	117,554.40	0.14
326	601326	秦港股份	37,300	117,122.00	0.14
327	002048	宁波华翔	11,200	116,816.00	0.14
328	000519	中兵红箭	18,510	116,427.90	0.14
329	002332	仙琚制药	18,900	115,857.00	0.13
330	600557	康缘药业	11,140	114,519.20	0.13
331	000980	众泰汽车	26,400	114,312.00	0.13
332	600141	兴发集团	11,100	114,219.00	0.13
333	002807	江阴银行	22,400	113,792.00	0.13
334	300244	迪安诊断	7,500	113,775.00	0.13
335	600787	中储股份	22,700	113,500.00	0.13
336	300287	飞利信	30,000	113,400.00	0.13
337	000537	广宇发展	15,100	113,099.00	0.13
338	002233	塔牌集团	11,200	112,672.00	0.13
339	600765	中航重机	15,100	112,344.00	0.13
340	600155	华创阳安	14,900	112,197.00	0.13
341	600545	卓郎智能	15,100	111,740.00	0.13
342	000937	冀中能源	29,600	111,592.00	0.13
343	600575	皖江物流	52,300	111,399.00	0.13
344	002249	大洋电机	33,700	111,210.00	0.13
345	601689	拓普集团	7,500	110,850.00	0.13
346	002028	思源电气	11,220	110,741.40	0.13
347	300376	易事特	26,200	110,302.00	0.13
348	000727	华东科技	75,000	110,250.00	0.13
349	002517	恺英网络	29,600	109,816.00	0.13
350	600316	洪都航空	11,100	109,779.00	0.13
351	600169	太原重工	49,200	109,716.00	0.13
352	002815	崇达技术	7,500	109,575.00	0.13
353	002093	国脉科技	15,025	109,532.25	0.13

354	603000	人民网	15,000	109,500.00	0.13
355	600869	智慧能源	22,502	109,134.70	0.13
356	600835	上海机电	7,500	109,125.00	0.13
357	600614	鹏起科技	30,100	108,059.00	0.13
358	000049	德赛电池	3,750	107,550.00	0.12
359	000501	鄂武商 A	11,320	107,313.60	0.12
360	600777	新潮能源	56,000	106,960.00	0.12
361	000021	深科技	18,600	106,950.00	0.12
362	000723	美锦能源	33,300	106,893.00	0.12
363	603766	隆鑫通用	26,130	106,871.70	0.12
364	600770	综艺股份	22,500	105,975.00	0.12
365	603198	迎驾贡酒	7,500	105,825.00	0.12
366	300134	大富科技	11,220	105,468.00	0.12
367	603515	欧普照明	3,780	105,348.60	0.12
368	300199	翰宇药业	11,200	104,608.00	0.12
369	000612	焦作万方	26,380	104,464.80	0.12
370	600151	航天机电	26,200	103,752.00	0.12
371	601016	节能风电	44,700	103,704.00	0.12
372	000766	通化金马	15,100	103,586.00	0.12
373	300159	新研股份	22,300	102,803.00	0.12
374	600594	益佰制药	18,600	102,672.00	0.12
375	600859	王府井	7,570	102,649.20	0.12
376	600478	科力远	26,155	102,004.50	0.12
377	000712	锦龙股份	11,100	100,788.00	0.12
378	603806	福斯特	3,750	100,500.00	0.12
379	002512	达华智能	18,900	100,359.00	0.12
380	601801	皖新传媒	14,900	99,532.00	0.12
381	600993	马应龙	7,414	99,495.88	0.12
382	601311	骆驼股份	11,249	99,328.67	0.12
383	002302	西部建设	11,200	99,008.00	0.11
384	002434	万里扬	15,000	98,850.00	0.11
385	600757	长江传媒	15,100	98,452.00	0.11
386	000541	佛山照明	18,970	98,264.60	0.11
387	000025	特力 A	3,700	98,124.00	0.11
388	600565	迪马股份	37,700	98,020.00	0.11
389	002509	天广中茂	41,200	97,644.00	0.11
390	601003	柳钢股份	14,800	97,236.00	0.11
391	002424	贵州百灵	11,100	97,125.00	0.11
392	603888	新华网	7,550	96,942.00	0.11

393	601001	大同煤业	22,700	96,929.00	0.11
394	002002	鸿达兴业	33,397	96,183.36	0.11
395	600416	湘电股份	18,600	95,976.00	0.11
396	600122	宏图高科	26,300	95,469.00	0.11
397	000600	建投能源	18,900	94,878.00	0.11
398	002707	众信旅游	15,000	94,800.00	0.11
399	600366	宁波韵升	18,900	94,689.00	0.11
400	000426	兴业矿业	18,900	94,122.00	0.11
401	002665	首航节能	33,480	94,078.80	0.11
402	600329	中新药业	7,541	93,810.04	0.11
403	002375	亚厦股份	18,500	93,240.00	0.11
404	002276	万马股份	18,500	93,240.00	0.11
405	002390	信邦制药	22,600	92,434.00	0.11
406	600874	创业环保	11,200	92,400.00	0.11
407	300266	兴源环境	26,100	92,133.00	0.11
408	000061	农产品	18,800	91,180.00	0.11
409	000990	诚志股份	7,500	90,075.00	0.10
410	600773	西藏城投	14,967	89,802.00	0.10
411	600759	洲际油气	37,967	89,602.12	0.10
412	600657	信达地产	22,794	89,580.42	0.10
413	600694	大商股份	3,700	89,503.00	0.10
414	002482	广田集团	15,177	87,874.83	0.10
415	600053	九鼎投资	3,700	87,098.00	0.10
416	600086	东方金钰	18,700	86,207.00	0.10
417	600350	山东高速	18,900	86,184.00	0.10
418	603568	伟明环保	3,750	85,687.50	0.10
419	000090	天健集团	18,576	85,449.60	0.10
420	002344	海宁皮城	18,700	85,085.00	0.10
421	000829	天音控股	15,100	84,711.00	0.10
422	002663	普邦股份	34,196	84,464.12	0.10
423	002635	安洁科技	7,450	84,408.50	0.10
424	600971	恒源煤电	14,900	83,887.00	0.10
425	600639	浦东金桥	7,400	83,324.00	0.10
426	002251	步步高	11,220	83,252.40	0.10
427	600259	广晟有色	3,700	82,732.00	0.10
428	002277	友阿股份	26,100	82,476.00	0.10
429	002709	天赐材料	3,786	82,004.76	0.10
430	600006	东风汽车	22,600	81,360.00	0.09
431	600748	上实发展	15,090	80,580.60	0.09

432	002544	杰赛科技	7,400	80,068.00	0.09
433	002489	浙江永强	30,284	79,949.76	0.09
434	002503	搜于特	33,940	79,759.00	0.09
435	603355	莱克电气	3,700	79,550.00	0.09
436	600754	锦江股份	3,700	78,810.00	0.09
437	600195	中牧股份	7,400	78,736.00	0.09
438	002354	天神娱乐	15,000	78,600.00	0.09
439	002818	富森美	3,700	76,923.00	0.09
440	600240	华业资本	29,600	76,664.00	0.09
441	600458	时代新材	11,300	76,614.00	0.09
442	000552	靖远煤电	29,900	76,544.00	0.09
443	300297	蓝盾股份	15,100	75,500.00	0.09
444	300257	开山股份	7,532	75,244.68	0.09
445	600640	号百控股	7,500	73,575.00	0.09
446	600428	中远海特	22,600	73,450.00	0.09
447	603650	彤程新材	3,700	73,371.00	0.09
448	603328	依顿电子	7,400	73,260.00	0.09
449	002642	荣之联	11,372	73,235.68	0.08
450	600058	五矿发展	11,100	72,261.00	0.08
451	601777	力帆股份	18,900	72,009.00	0.08
452	600338	西藏珠峰	3,700	71,891.00	0.08
453	603877	太平鸟	3,780	71,026.20	0.08
454	603225	新凤鸣	3,780	70,875.00	0.08
455	000536	华映科技	37,500	70,125.00	0.08
456	000587	金洲慈航	29,700	69,795.00	0.08
457	600335	国机汽车	11,100	69,264.00	0.08
458	002681	奋达科技	18,872	69,071.52	0.08
459	600939	重庆建工	14,900	68,689.00	0.08
460	000969	安泰科技	14,800	67,340.00	0.08
461	600126	杭钢股份	14,850	66,973.50	0.08
462	002416	爱施德	11,220	65,973.60	0.08
463	603712	七一二	3,700	65,897.00	0.08
464	002308	威创股份	14,800	65,860.00	0.08
465	002118	紫鑫药业	15,000	65,400.00	0.08
466	601990	南京证券	7,400	64,380.00	0.07
467	002920	德赛西威	3,700	64,195.00	0.07
468	600743	华远地产	26,480	64,081.60	0.07
469	600862	中航高科	11,300	63,280.00	0.07
470	002437	誉衡药业	22,600	63,280.00	0.07

471	002477	雏鹰农牧	41,700	62,550.00	0.07
472	603056	德邦股份	3,700	61,235.00	0.07
473	002699	美盛文化	11,140	61,047.20	0.07
474	002041	登海种业	11,100	59,829.00	0.07
475	000987	越秀金控	7,500	59,775.00	0.07
476	002588	史丹利	15,180	59,050.20	0.07
477	601019	山东出版	7,400	57,868.00	0.07
478	600393	粤泰股份	26,100	55,332.00	0.06
479	300156	神雾环保	14,900	54,087.00	0.06
480	603377	东方时尚	3,700	54,020.00	0.06
481	002345	潮宏基	11,220	50,153.40	0.06
482	601969	海南矿业	11,100	49,728.00	0.06
483	300291	华录百纳	11,100	49,395.00	0.06
484	002147	新光圆成	15,910	49,321.00	0.06
485	600280	中央商场	15,100	49,075.00	0.06
486	603556	海兴电力	3,750	48,750.00	0.06
487	600618	氯碱化工	7,500	48,675.00	0.06
488	300202	聚龙股份	7,500	48,300.00	0.06
489	603169	兰石重装	11,200	47,824.00	0.06
490	600996	贵广网络	7,500	47,700.00	0.06
491	600687	刚泰控股	11,200	46,480.00	0.05
492	603025	大豪科技	3,720	41,478.00	0.05
493	603569	长久物流	3,700	39,775.00	0.05
494	000761	本钢板材	11,200	37,632.00	0.04
495	600184	光电股份	3,746	36,598.42	0.04
496	601811	新华文轩	3,700	34,447.00	0.04
497	601020	华钰矿业	3,700	31,302.00	0.04
498	600917	重庆燃气	3,700	26,344.00	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	000693	*ST 华泽	15,000	8,250.00	0.01

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	300347	泰格医药	523,002.00	0.40
2	002129	中环股份	423,541.00	0.32
3	600760	中航沈飞	403,088.00	0.31
4	600777	新潮能源	399,041.00	0.31
5	002465	海格通信	398,115.00	0.30
6	000623	吉林敖东	387,368.00	0.30
7	600258	首旅酒店	384,994.40	0.29
8	601005	重庆钢铁	380,814.00	0.29
9	600699	均胜电子	363,117.00	0.28
10	300315	掌趣科技	360,474.88	0.28
11	002049	紫光国微	355,301.09	0.27
12	600528	中铁工业	349,311.00	0.27
13	300450	先导智能	336,138.00	0.26
14	000998	隆平高科	327,917.00	0.25
15	000750	国海证券	315,360.00	0.24
16	600820	隧道股份	311,667.00	0.24
17	600167	联美控股	307,553.00	0.24
18	002110	三钢闽光	304,588.00	0.23
19	300413	芒果超媒	302,218.00	0.23
20	300418	昆仑万维	301,430.00	0.23

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	002422	科伦药业	894,294.00	0.68
2	600516	方大炭素	780,096.00	0.60
3	000661	长春高新	761,837.80	0.58
4	002405	四维图新	723,334.76	0.55
5	600176	中国巨石	707,627.00	0.54
6	000786	北新建材	594,534.20	0.45
7	002271	东方雨虹	551,680.00	0.42
8	000998	隆平高科	504,620.20	0.39
9	002001	新和成	499,695.60	0.38
10	002050	三花智控	487,613.00	0.37

11	300156	神雾环保	480,026.00	0.37
12	002179	中航光电	462,797.83	0.35
13	000050	深天马 A	458,520.00	0.35
14	002311	海大集团	454,189.80	0.35
15	000977	浪潮信息	447,498.00	0.34
16	603019	中科曙光	440,521.00	0.34
17	000703	恒逸石化	430,493.20	0.33
18	600346	恒力股份	423,752.00	0.32
19	600566	济川药业	360,163.00	0.28
20	600760	中航沈飞	349,645.00	0.27

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	32,615,822.14
卖出股票收入（成交）总额	34,856,387.86

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	2,058.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	770.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,828.90

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

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。

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	000693	*ST 华泽	8,250.00	0.01	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
209	378,425.67	73,291,643.00	92.67%	5,799,321.00	7.33%

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	2.12%
2	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍 盛稳进	1,283,520.00	1.62%
3	徐军	450,102.00	0.57%
4	肖小兰	351,500.00	0.44%
5	杨盾保	311,860.00	0.39%
6	许良	205,018.00	0.26%
7	林宏	193,543.00	0.24%
8	沈恺	150,000.00	0.19%
9	凌军	135,901.00	0.17%
10	文红梅	134,010.00	0.17%
	诺安中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	72,000,000.00	91.03%

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	81,090,964.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
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	79,090,964.00

§ 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，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。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。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，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

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：2 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	
中信证券		267,344,923.60	100.00%	62,718.54	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》。

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	2018年1月2日
2	诺安中证500交易型开放式指数证券投资	《证券时报》、	2018年1月22日

	资基金 2017 年第 4 季度报告	《中国证券报》	
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 年年度报告	基金管理人网站	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 年年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 3 月 29 日
7	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	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	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基金合同(2018 年 3 月修订)	基金管理人网站	2018 年 3 月 31 日
9	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
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
12	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 7 月 2 日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票 ST 华泽估值调整的公告	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 7 月 17 日
14	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 7 月 18 日
15	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	基金管理人网站	2018 年 8 月 27 日
16	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 8 月 27 日
17	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 2 期-正文	基金管理人网站	2018 年 9 月 21 日
18	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 2 期-摘要	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 9 月 21 日
19	诺安基金管理有限公司关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 10 月 24 日
20	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	《证券时报》、 《中国证券报》	2018 年 10 月 26 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	2018.01.02-2018.12.28	74,000,000.00	4,000,000.00	6,000,000.00	72,000,000.00	91.03%
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。							

12.2 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。

§ 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 2018 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

2019 年 3 月 27 日