

诺安中证 500 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2018 年年度报告摘要

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

### 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

### 2.4 信息披露方式

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
------------	---------------

### § 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

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。

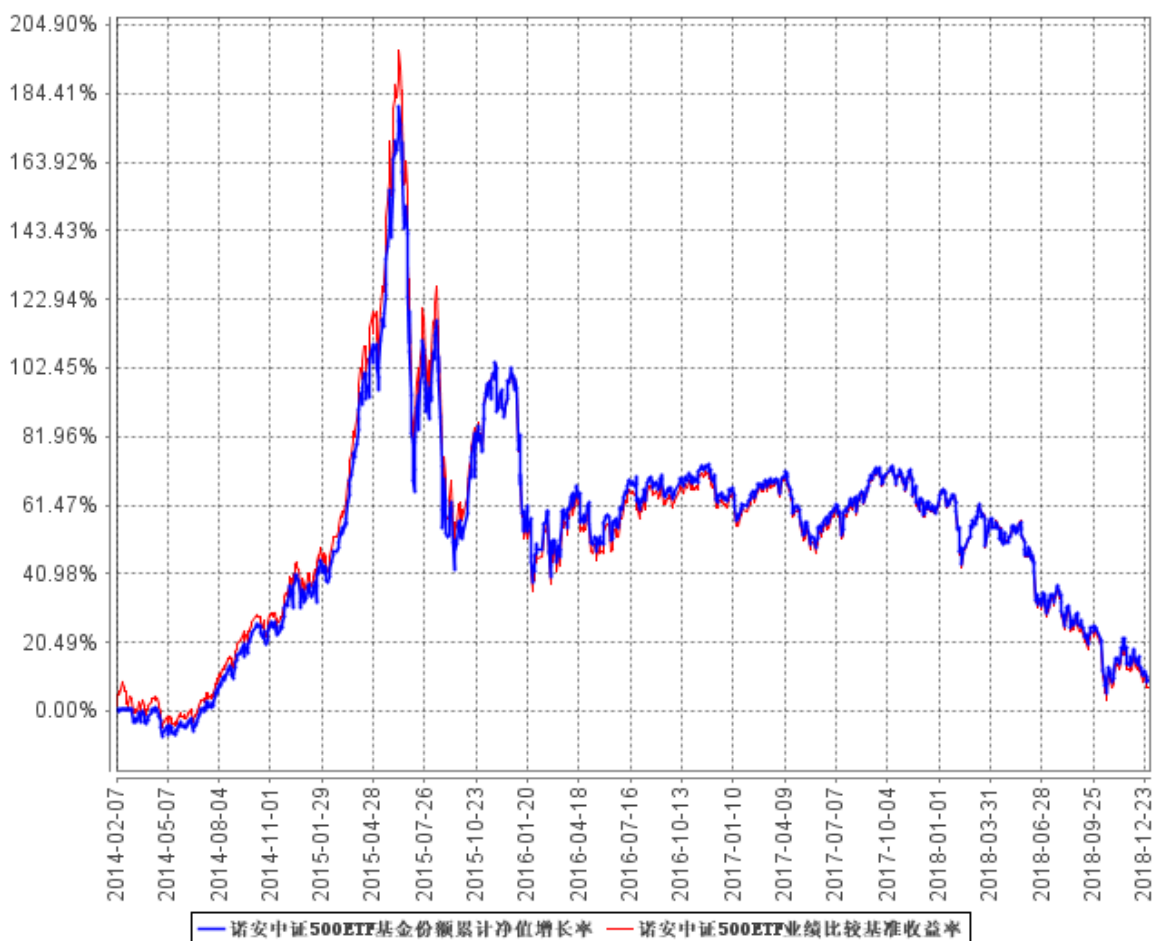
#### 3.2 基金净值表现

##### 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%

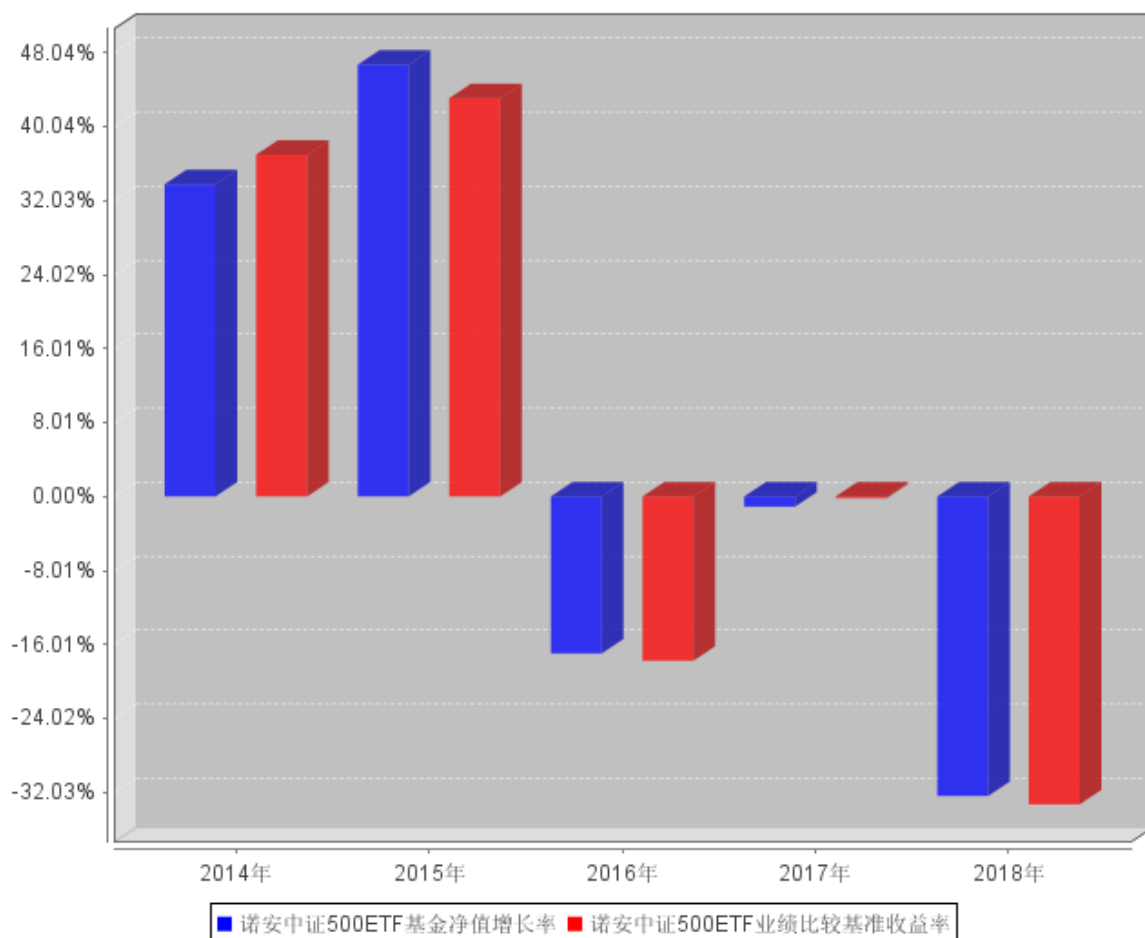
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

### 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。

#### **4.7 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

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师左艳霞、张品于 2019 年 3 月 26 日出具了毕马威华振审字第 1901479 号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 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	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	770.68	946.36
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	86,435,726.91	131,038,123.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	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	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	185,000.00	202,949.90
负债合计	261,938.29	311,324.20
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	79,090,964.00	81,090,964.00
未分配利润	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	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-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	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	-11,575,299.25	-5,498,670.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,195,483.32	1,184,702.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	-27,231.56	85,292.52
<b>减：二、费用</b>	<b>1,240,572.57</b>	<b>1,578,067.78</b>
1. 管理人报酬	529,932.72	768,339.88
2. 托管费	105,986.58	153,668.03
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	501,103.43	496,695.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-39,648,747.19</b>	<b>-630,287.58</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-39,648,747.19</b>	<b>-630,287.58</b>

### 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	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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	101,090,964.00	63,679,088.90	164,770,052.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-630,287.58	-630,287.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-20,000,000.00	-13,412,966.42	-33,412,966.42
其中：1. 基金申购款	2,000,000.00	1,178,915.67	3,178,915.67
2. 基金赎回款	-22,000,000.00	-14,591,882.09	-36,591,882.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	81,090,964.00	49,635,834.90	130,726,798.90

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

经上海证券交易所（以下简称：上交所）上证债字[2014]64 号文核准同意，本基金于 2014 年

3 月 10 日在上交所挂牌交易。上市交易前，本基金未进行份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的财务报表于 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 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。

#### **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 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 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。

### 7.4.8.1.3 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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 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 12 月 31 日	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。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	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。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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%

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

### 7.4.9.2 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	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

## 7.4.10 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 网站的年度报告正文。

#### 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	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。

## § 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。

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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日