

上证新兴产业交易型开放式指数 证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 28 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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。

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过了《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。自 2019 年 6 月 28 日起，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金持有人大会决议生效。自 2019 年 7 月 1 日起，本基金进入清算程序。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 28 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.....	12
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的真实、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.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47

§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	诺安上证新兴产业 ETF
场内简称	新兴 ETF
基金主代码	510260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 7 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,982,658.00 份
基金合同存续期	2011 年 4 月 7 日至 2019 年 6 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 6 月 8 日

注：本基金二级市场交易简称为“新兴 ETF”，基金的申购、赎回简称为“新兴申赎”，申购、赎回代码为“510261”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的标的指数是上证新兴产业指数。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金；本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	郭明
	联系电话	0755-83026688	(010) 66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588

传真	0755-83026677	(010) 66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
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	《证券日报》
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	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

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	北京市西城区太平桥大街 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(2019年1月1日 - 2019年6月28日)
本期已实现收益	330,837.88
本期利润	2,594,539.89
加权平均基金份额本期利润	0.1635
本期加权平均净值利润率	15.61%
本期基金份额净值增长率	14.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月28日)
期末可供分配利润	-1,662,146.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1189
期末基金资产净值	14,653,249.30
期末基金份额净值	1.048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月28日)
基金份额累计净值增长率	4.80%

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	1.35%	1.23%	2.31%	1.30%	-0.96%	-0.07%
过去三个月	-6.93%	1.64%	-7.39%	1.79%	0.46%	-0.15%
过去六个月	14.79%	1.58%	17.82%	1.74%	-3.03%	-0.16%
过去一年	-1.87%	1.48%	-1.03%	1.67%	-0.84%	-0.19%
过去三年	-1.69%	1.16%	1.92%	1.28%	-3.61%	-0.12%
自基金合同生效起至今	4.80%	1.64%	3.28%	1.76%	1.52%	-0.12%

注：本基金业绩比较基准：上证新兴产业指数收益率。

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约定。

§ 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 2019 年 6 月 30 日, 本基金管理人共管理 62 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、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、诺安创业板指数增强型证券投资基金 (LOF)、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 指数增强型证券投资基金、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、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠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	2017年8月8日	2019年6月28日	22	硕士，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、指数投资组副总监，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，2015年6月至2019年1月任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012年7月至2019年5月任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2017年8月至2019年6月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。2012年7月起任诺安中证100指数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，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，2019年1月起任诺安中证500指数增强

					型证券投资基金基金经理，2019年5月起任诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日，离任日期为本基金的最后运作之日；

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, 上证新兴产业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《上证新兴产业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

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 1 次，主要原因在于投资组合采用不同的投资策略。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 1.048 元。本报告期基金份额净值增长率为 14.79%，同期业绩比较基准收益率为 17.82%。

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:当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,本基金可进行收益分配;在符合有关基金收益分配条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例的确定原则: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。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,收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值;本基金收益分配方式为现金分红;若《基金合同》生效不满3个月,则不进行收益分配;每一基金份额享有同等分配权;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,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。经基金管理人与基金托管人协商一致,上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,大会审议通过了《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。自2019年6月28日起,上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金持有人大会决议生效。自2019年7月1日起,本基金进入清算程序。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019年6月28日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月28日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	322,997.25	647,361.28
结算备付金		30,647.56	108.18
存出保证金		995.95	1,798.48
交易性金融资产	6.4.7.2	14,484,704.05	14,045,884.37
其中：股票投资		14,484,704.05	14,045,884.37
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	53.15	130.30
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		14,839,397.96	14,695,282.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月28日	上年度末 2018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		52,596.67	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,946.57	6,425.41
应付托管费		1,189.29	1,285.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,515.03	6,935.56
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	118,901.10	85,000.00
负债合计		186,148.66	99,646.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,982,658.00	15,982,658.00
未分配利润	6.4.7.10	670,591.30	-1,387,021.47
所有者权益合计		14,653,249.30	14,595,636.53
负债和所有者权益总计		14,839,397.96	14,695,282.61

注：报告截止日2019年6月28日，基金份额净值1.048元，基金份额总额13,982,658.00份。

6.2 利润表

会计主体：上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月28日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月28日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
一、收入		2,833,486.59	-7,881,073.70
1.利息收入		2,127.30	16,008.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,127.30	16,008.84
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）		569,076.47	-7,182,537.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	471,227.08	-7,534,083.04
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	97,849.39	351,545.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,263,702.01	-714,545.46
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	-1,419.19	-
减：二、费用		238,946.70	456,737.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,936.78	162,480.13

2. 托管费	6.4.10.2.2	8,187.36	32,495.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,839.46	59,976.72
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	178,983.10	201,784.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,594,539.89	-8,337,810.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,594,539.89	-8,337,810.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月28日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月28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）	15,982,658.00	-1,387,021.47	14,595,636.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,594,539.89	2,594,539.89
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	-536,927.12	-2,536,927.12
其中：1. 基金申购款	19,000,000.00	462,062.70	19,462,062.70
2. 基金赎回款	-21,000,000.00	-998,989.82	-21,998,989.82
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）	13,982,658.00	670,591.30	14,653,249.30
项目	上年度可比期间 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）	56,982,658.00	11,075,488.46	68,058,146.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,337,810.98	-8,337,810.98
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）	-3,500,000.00	897,284.90	-2,602,715.10
其中：1. 基金申购款	45,500,000.00	4,485,373.45	49,985,373.45
2. 基金赎回款	-49,000,000.00	-3,588,088.55	-52,588,088.55
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）	53,482,658.00	3,634,962.38	57,117,620.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证新兴产业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”）《关于核准上证新兴产业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[2011]240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《上证新兴产业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2011年4月7日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为912,482,658.00份基金份额，其中认购资金利息折合16,800.00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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称：上交所）上证债字[2011]106号文核准同意，本基金于2011年6月8日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《上证新兴产业交易型开放式指数证

券投资基金基金合同》和《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。其中，本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，同时为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具，该部分资产比例不超过基金资产净值的 10%。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 6 月 28 日的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 28 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。

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 2019年6月28日
活期存款	322,997.25
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：	322,997.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月28日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,457,649.06	14,484,704.05	27,054.99
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	14,457,649.06	14,484,704.05	27,054.99

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 2019年6月28日
应收活期存款利息	43.21
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	9.66
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	0.28
合计	53.15

注：此处其他列示的是应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月28日
交易所市场应付交易费用	7,515.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,515.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月28日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
持有人大会律师费	40,000.00
预提费用	30,000.00
指数使用费	48,901.10
合计	118,901.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月28日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,982,658.00	15,982,658.00
本期申购	19,000,000.00	19,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-21,000,000.00	-21,000,000.00
本期末	13,982,658.00	13,982,658.00

注：此处申购含转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

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	-2,247,672.48	860,651.01	-1,387,021.47
本期利润	330,837.88	2,263,702.01	2,594,539.89
本期基金份额交易产生的变动数	254,688.53	-791,615.65	-536,927.12
其中：基金申购款	-2,668,512.78	3,130,575.48	462,062.70
基金赎回款	2,923,201.31	-3,922,191.13	-998,989.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,662,146.07	2,332,737.37	670,591.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月28日
活期存款利息收入	2,021.35
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	99.60
其他	6.35
合计	2,127.30

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

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 2019年1月1日至2019年6月28日
股票投资收益——买卖股票差价收入	248,336.06
股票投资收益——赎回差价收入	222,891.02
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	471,227.08

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 2019年1月1日至2019年6月28日
卖出股票成交总额	2,571,437.46
减：卖出股票成本总额	2,323,101.40
买卖股票差价收入	248,336.06

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 2019年1月1日至2019年6月28日
赎回基金份额对价总额	21,998,989.82
减：现金支付赎回款总额	275,571.82
减：赎回股票成本总额	21,500,526.98
赎回差价收入	222,891.02

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。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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 2019年1月1日至2019年6月28日
股票投资产生的股利收益	97,849.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	97,849.39

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月28日
1. 交易性金融资产	2,263,702.01
——股票投资	2,263,702.01
——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	-
合计	2,263,702.01

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月28日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,419.19
合计	-1,419.19

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 2019年1月1日至2019年6月28日
交易所市场交易费用	10,839.46
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	10,839.46

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月28日
审计费用	-
信息披露费	-
持有人大会费	10,000.00
汇划费	82.00
律师费	40,000.00
上市费	30,000.00
指数使用费	98,901.10
合计	178,983.10

注：①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。

②上市费为深圳证券交易所向本基金征收的上市年费。上市年费为人民币 60,000 元 / 年。

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

本报告期内，本基金管理人以通讯方式召开基金份额持有人大会，权益登记日为 2019 年 5 月 22 日，大会投票表决截止日为 2019 年 6 月 27 日。根据 2019 年 6 月 28 日的计票结果，大会审议通过了《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金持有人大会决议于 2019 年 6 月 28 日生效，基

金最后运作日为 2019 年 6 月 28 日。自 2019 年 7 月 1 日起，本基金进入清算程序。

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
中国工商银行股份有限公司	托管人

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 28 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,936.78	162,480.13
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 的年费率计提，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, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 28 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,187.36	32,495.99

注: 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。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, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

6.4.10.3 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基金管理人无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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2019年1月1日至2019年6月28日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	322,997.25	2,021.35	3,549,705.50	15,774.71

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

6.4.10.6 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（2019年6月28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 2019 年 6 月 28 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
600485	*ST 信威	2016年12月26日	重大事项	14.59	2019年7月12日	13.86	83,421	1,177,266.59	1,217,112.39	-

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

于 2019 年 6 月 28 日，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

于 2019 年 6 月 28 日，本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

本基金于本报告期末及上年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

本基金于本报告期末及上年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

本基金于本报告期末及上年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

本基金于本报告期末及上年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

本基金于本报告期末及上年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

本基金于本报告期末及上年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 2019年6月28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	322,997.25	-	-	-	-	322,997.25
结算备付金	30,647.56	-	-	-	-	30,647.56
存出保证金	995.95	-	-	-	-	995.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-14,484,704.05	14,484,704.05
应收利息	-	-	-	-	53.15	53.15
资产总计	354,640.76	-	-	-	-14,484,757.20	14,839,397.96
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	52,596.67	52,596.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,946.57	5,946.57
应付托管费	-	-	-	-	1,189.29	1,189.29
应付交易费用	-	-	-	-	7,515.03	7,515.03
其他负债	-	-	-	-	118,901.10	118,901.10
负债总计	-	-	-	-	186,148.66	186,148.66
利率敏感度缺口	354,640.76	-	-	-	-14,298,608.54	14,653,249.30
上年度末 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	647,361.28	-	-	-	-	647,361.28
结算备付金	108.18	-	-	-	-	108.18
存出保证金	1,798.48	-	-	-	-	1,798.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-14,045,884.37	14,045,884.37
应收利息	-	-	-	-	130.30	130.30
资产总计	649,267.94	-	-	-	-14,046,014.67	14,695,282.61
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	6,425.41	6,425.41
应付托管费	-	-	-	-	1,285.11	1,285.11
应付交易费用	-	-	-	-	6,935.56	6,935.56
其他负债	-	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	-	99,646.08	99,646.08
利率敏感度缺口	649,267.94	-	-	-	-13,946,368.59	14,595,636.53

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年末，本基金均未持有对利率敏感的交易性债券资产。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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。

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 2019年6月28日		上年度末 2018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	14,484,704.05	98.85	14,045,884.37	96.23
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	14,484,704.05	98.85	14,045,884.37	96.23

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（2019年6月28日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	734,494.12	702,123.10
	业绩比较基准下降5%	-734,494.12	-702,123.10

注：本基金的业绩比较基准为：上证新兴产业指数收益率。

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		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2019 年 6 月 28 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	基金投资组合的风险价值	360,981.98	325,770.62
	合计	360,981.98	325,770.62

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 2019 年 6 月 28 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 13,267,591.66 元, 属于第二层次的余额为 1,217,112.39 元, 无属于第三层次的余额 (2018 年 12 月 31 日: 属于第一层次的余额为 12,828,771.98 元, 属于第二层次的余额为 1,217,112.39 元, 无属于第三层次的余额)。

2019 年上半年, 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 2019 年 6 月 28 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2018 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	14,484,704.05	97.61
	其中：股票	14,484,704.05	97.61
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	353,644.81	2.38
8	其他各项资产	1,049.10	0.01
9	合计	14,839,397.96	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	-	-
B	采矿业	253,836.00	1.73
C	制造业	10,104,939.69	68.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	271,884.00	1.86
E	建筑业	757,560.00	5.17
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	1,662,671.97	11.35
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	216,700.00	1.48
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	13,267,591.66	90.54

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	-	-
C	制造业	1,217,112.39	8.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,217,112.39	8.31

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	600570	恒生电子	4,839	329,777.85	2.25
2	600276	恒瑞医药	4,807	317,262.00	2.17
3	600309	万华化学	7,200	308,088.00	2.10

4	600332	白云山	7,349	301,088.53	2.05
5	600867	通化东宝	19,200	295,680.00	2.02
6	600085	同仁堂	10,048	291,392.00	1.99
7	600436	片仔癀	2,500	288,000.00	1.97
8	600776	东方通信	12,500	287,250.00	1.96
9	601989	中国重工	50,400	280,224.00	1.91
10	600031	三一重工	21,326	278,944.08	1.90
11	600760	中航沈飞	9,600	278,688.00	1.90
12	600588	用友网络	10,300	276,864.00	1.89
13	600066	宇通客车	21,258	276,779.16	1.89
14	600271	航天信息	12,000	276,600.00	1.89
15	600893	航发动力	12,070	274,109.70	1.87
16	600536	中国软件	5,100	273,717.00	1.87
17	600660	福耀玻璃	12,000	272,760.00	1.86
18	601985	中国核电	48,900	271,884.00	1.86
19	600703	三安光电	24,027	271,024.56	1.85
20	601615	明阳智能	24,900	269,916.00	1.84
21	600406	国电南瑞	14,458	269,497.12	1.84
22	600498	烽火通信	9,622	268,068.92	1.83
23	600487	亨通光电	15,823	265,193.48	1.81
24	600572	康恩贝	41,400	264,960.00	1.81
25	600516	方大炭素	21,463	263,780.27	1.80
26	601186	中国铁建	26,400	262,680.00	1.79
27	600104	上汽集团	10,201	260,125.50	1.78
28	600019	宝钢股份	40,000	260,000.00	1.77
29	601600	中国铝业	66,100	259,112.00	1.77
30	600111	北方稀土	20,142	258,623.28	1.76
31	603799	华友钴业	12,070	257,211.70	1.76
32	601360	三六零	12,000	256,560.00	1.75
33	600050	中国联通	41,600	256,256.00	1.75
34	600522	中天科技	27,900	255,843.00	1.75
35	600884	杉杉股份	24,000	255,600.00	1.74
36	600196	复星医药	10,071	254,796.30	1.74
37	603993	洛阳钼业	64,100	253,836.00	1.73
38	603019	中科曙光	7,209	253,035.90	1.73
39	601766	中国中车	31,213	252,513.17	1.72
40	600392	盛和资源	22,820	252,389.20	1.72
41	600460	士兰微	15,200	252,320.00	1.72
42	600176	中国巨石	26,400	251,592.00	1.72

43	601390	中国中铁	38,400	250,368.00	1.71
44	601800	中国交建	21,600	244,512.00	1.67
45	600535	天士力	14,400	238,320.00	1.63
46	601877	正泰电器	10,300	237,827.00	1.62
47	601012	隆基股份	10,124	233,965.64	1.60
48	600584	长电科技	17,518	225,106.30	1.54
49	603986	兆易创新	2,500	216,750.00	1.48
50	603259	药明康德	2,500	216,700.00	1.48

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	600485	*ST 信威	83,421	1,217,112.39	8.31

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	600536	中国软件	301,143.00	2.06
2	601012	隆基股份	298,415.05	2.04
3	600776	东方通信	293,533.00	2.01
4	600111	北方稀土	292,520.00	2.00
5	600572	康恩贝	282,720.00	1.94
6	601615	明阳智能	282,133.00	1.93
7	600392	盛和资源	279,478.00	1.91
8	600436	片仔癀	276,144.00	1.89
9	603993	洛阳钼业	244,927.00	1.68
10	600893	航发动力	237,922.00	1.63
11	600884	杉杉股份	235,568.00	1.61
12	601186	中国铁建	229,500.00	1.57
13	600271	航天信息	226,530.00	1.55
14	600406	国电南瑞	217,889.00	1.49
15	603986	兆易创新	211,273.00	1.45
16	600498	烽火通信	108,629.00	0.74
17	600460	士兰微	98,709.00	0.68
18	601766	中国中车	97,179.00	0.67

19	601360	三六零	93,767.00	0.64
20	601390	中国中铁	88,705.00	0.61

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	600025	华能水电	341,530.00	2.34
2	603712	七一二	337,622.00	2.31
3	600549	厦门钨业	290,265.90	1.99
4	600089	特变电工	265,405.56	1.82
5	600460	士兰微	179,442.00	1.23
6	601012	隆基股份	150,568.00	1.03
7	600570	恒生电子	145,965.00	1.00
8	600031	三一重工	139,868.00	0.96
9	600584	长电科技	110,199.00	0.76
10	600276	恒瑞医药	103,559.00	0.71
11	600111	北方稀土	76,304.00	0.52
12	600588	用友网络	72,816.00	0.50
13	600050	中国联通	50,514.00	0.35
14	601989	中国重工	36,689.00	0.25
15	600522	中天科技	34,259.00	0.23
16	600392	盛和资源	33,938.00	0.23
17	600176	中国巨石	33,408.00	0.23
18	600572	康恩贝	21,012.00	0.14
19	601600	中国铝业	20,540.00	0.14
20	603019	中科曙光	19,755.00	0.14

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	5,552,727.05
卖出股票收入（成交）总额	2,571,437.46

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	995.95

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049.10

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	600485	*ST 信威	1,217,112.39	8.31	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
911	15,348.69	1,000.00	0.01%	13,981,658.00	99.99%

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	郭智勇	632,900.00	4.53%
2	潘忠文	400,000.00	2.86%
3	江治	200,000.00	1.43%
4	王弋	200,000.00	1.43%
5	韩红梅	180,000.00	1.29%
6	陈炳坤	169,400.00	1.21%
7	魏民	166,000.00	1.19%
8	邹高峭	164,500.00	1.18%
9	陈浩祥	160,000.00	1.14%
10	张藏珠	152,000.00	1.09%

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的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（2011年4月7日）基金份额总额	912,482,658.00
本报告期期初基金份额总额	15,982,658.00
本报告期基金总申购份额	19,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
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	13,982,658.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金管理人以通讯方式召开基金份额持有人大会，权益登记日为 2019 年 5 月 22 日，大会投票表决截止日为 2019 年 6 月 27 日。根据 2019 年 6 月 28 日的计票结果，大会审议通过了《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金持有人大会决议于 2019 年 6 月 28 日生效，基金最后运作日为 2019 年 6 月 28 日。自 2019 年 7 月 1 日起，本基金进入清算程序。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金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	
西部证券	1	8,105,359.91	100.00%	7,548.40	100.00%	-

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无进行其他证券投资的情况。

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	2019年1月2日
2	诺安基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用诺安基金名义进行诈骗活动的提示性公告	《中国证券报》	2019年1月17日
3	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《证券日报》	2019年1月21日
4	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告	基金管理人网站	2019年3月27日
5	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告摘要	《证券日报》	2019年3月27日
6	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《证券日报》	2019年4月19日
7	诺安基金管理有限公司关于增加太平洋证券为旗下部分 ETF 基金一级交易商的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2019年5月9日
8	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券日报》	2019年5月15日
9	关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金的停牌公告	《证券日报》	2019年5月15日
10	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券日报》	2019年5月16日
11	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券日报》	2019年5月17日

12	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）2019 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2019 年 5 月 22 日
13	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）2019 年第 1 期-摘要	《证券日报》	2019 年 5 月 22 日
14	诺安基金管理有限公司关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金暂停申购业务的公告	《证券日报》	2019 年 5 月 24 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票中科曙光估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019 年 6 月 26 日
16	关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金的停牌公告	《证券日报》	2019 年 6 月 28 日
17	诺安基金管理有限公司关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金暂停赎回等业务的公告	《证券日报》	2019 年 6 月 28 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。

§ 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	1	2019.05.17-2019.05.21	-	36,001,000.00	36,000,000.00	1,000.00	0.01%
个人	1	2019.05.17	-	5,000,000.00	5,000,000.00	-	-

产品特有风险

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

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件。
- ②《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- ③《上证新兴产业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上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内上证新兴产业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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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8月23日