

诺安中证 500 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 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：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。

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 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61

§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 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	7,090,964.00 份
基金合同存续期	2014 年 2 月 7 日至 2019 年 7 月 5 日
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	刘连舸

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-36,991,351.17
本期利润	5,407,303.02
加权平均基金份额本期利润	0.4184
本期加权平均净值利润率	34.66%
本期基金份额净值增长率	14.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-12,900,760.65
期末可供分配基金份额利润	-1.8193
期末基金资产净值	8,823,457.86
期末基金份额净值	1.2443
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.43%

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	0.26%	1.34%	0.78%	1.39%	-0.52%	-0.05%
过去三个月	-10.68%	1.75%	-10.76%	1.81%	0.08%	-0.06%
过去六个月	14.20%	1.69%	18.77%	1.79%	-4.57%	-0.10%
过去一年	-7.99%	1.61%	-5.12%	1.69%	-2.87%	-0.08%
过去三年	-22.50%	1.25%	-19.16%	1.31%	-3.34%	-0.06%
自基金合同生效起至今	24.43%	1.73%	27.41%	1.81%	-2.98%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的建仓期为 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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	2014年2月7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 1.2443 元。本报告期基金份额净值增长率为 14.20%，同期业绩比较基准收益率为 18.77%。

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

相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期末有收益分配事项。

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,本基金管理人以通讯方式召开诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会。根据 2019 年 7 月 5 日的计票结果,大会审议通过了《诺安中证 500 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 7 月 5 日起,诺安中证 500 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 8 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，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	368,561.74	3,837,200.21
结算备付金		63,416.79	3,922.53
存出保证金		32,033.28	2,058.22
交易性金融资产	6.4.7.2	8,476,412.67	82,591,775.27
其中：股票投资		8,476,412.67	82,591,775.27
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	103.88	770.68
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		8,940,528.36	86,435,726.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 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		-	5,258.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,587.74	37,978.97
应付托管费		717.54	7,595.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	15,656.35	26,105.06
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	97,108.87	185,000.00
负债合计		117,070.50	261,938.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,090,964.00	79,090,964.00
未分配利润	6.4.7.10	1,732,493.86	7,082,824.62
所有者权益合计		8,823,457.86	86,173,788.62
负债和所有者权益总计		8,940,528.36	86,435,726.91

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2443 元，基金份额总额 7,090,964.00 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		5,797,636.19	-18,799,359.21
1.利息收入		6,474.74	15,580.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,474.74	15,580.84
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）		-36,192,075.51	-2,349,249.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-36,273,722.30	-3,098,219.10
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	81,646.79	748,969.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,398,654.19	-16,493,813.70
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	-415,417.23	28,123.00
减：二、费用		390,333.17	661,898.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,368.02	292,211.49

2. 托管费	6.4.10.2.2	7, 673. 59	58, 442. 31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	185, 239. 34	59, 362. 69
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	159, 052. 22	251, 881. 60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 407, 303. 02	-19, 461, 257. 30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 407, 303. 02	-19, 461, 257. 30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	79, 090, 964. 00	7, 082, 824. 62	86, 173, 788. 62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5, 407, 303. 02	5, 407, 303. 02
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）	-72, 000, 000. 00	-10, 757, 633. 78	-82, 757, 633. 78
其中：1. 基金申购款	38, 000, 000. 00	6, 113, 798. 12	44, 113, 798. 12
2. 基金赎回款	-110, 000, 000. 00	-16, 871, 431. 90	-126, 871, 431. 90
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）	7, 090, 964. 00	1, 732, 493. 86	8, 823, 457. 86
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）	81,090,964.00	49,635,834.90	130,726,798.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,461,257.30	-19,461,257.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-3,716,271.88	-9,716,271.88
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-3,716,271.88	-9,716,271.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	75,090,964.00	26,458,305.72	101,549,269.72

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：

 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

6.4 报表附注

6.4.1 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 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 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、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 30 日
活期存款	368,561.74
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：	368,561.74

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 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,262,750.05	8,476,412.67	213,662.62
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	8,262,750.05	8,476,412.67	213,662.62

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30日
应收活期存款利息	65.27
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	25.65
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	12.96
合计	103.88

注：本报告期末“其他”为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	15,656.35
银行间市场应付交易费用	-

合计	15,656.35
----	-----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付赎回费	-
预提费用	47,108.87
指数使用费	50,000.00
合计	97,108.87

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30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,090,964.00	79,090,964.00
本期申购	38,000,000.00	38,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-110,000,000.00	-110,000,000.00
本期末	7,090,964.00	7,090,964.00

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。

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	61,366,358.80	-54,283,534.18	7,082,824.62
本期利润	-36,991,351.17	42,398,654.19	5,407,303.02
本期基金份额交易产生的变动数	-37,275,768.28	26,518,134.50	-10,757,633.78
其中：基金申购款	-71,766,390.94	77,880,189.06	6,113,798.12
基金赎回款	34,490,622.66	-51,362,054.56	-16,871,431.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,900,760.65	14,633,254.51	1,732,493.86

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30日
活期存款利息收入	5,556.87
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	727.64
其他	190.23
合计	6,474.74

注：本报告期内“其他”为保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-20,140,426.83
股票投资收益——赎回差价收入	-16,133,295.47
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-36,273,722.30

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30日
卖出股票成交总额	73,840,246.72
减：卖出股票成本总额	93,980,673.55
买卖股票差价收入	-20,140,426.83

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30日
赎回基金份额对价总额	126,871,431.90
减：现金支付赎回款总额	66,494,442.90
减：赎回股票成本总额	76,510,284.47
赎回差价收入	-16,133,295.47

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	81,646.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	81,646.79

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30日
1. 交易性金融资产	42,398,654.19
——股票投资	42,398,654.19
——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	42,398,654.19

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30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-415,417.23
合计	-415,417.23

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30日
交易所市场交易费用	185,239.34

银行间市场交易费用	-
合计	185,239.34

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30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	-
其他	10,000.00
上市费	29,752.78
银行汇划费	1,943.35
指数使用费	100,000.00
合计	159,052.22

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。

(3)“其他”为本基金召开持有人大会公证费。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等相关法律法规的有关规定，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”，基金代码“510520”）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 28 日，大会投票表决时间于 2019 年 7 月 4 日 17:00 截止。大会审议并于 2019 年 7 月 5 日通过了《关于诺安中证 500 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》及《诺安中证 500 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方案说明书》。本基金于 2019 年 7 月 8 日进入基金财产清算程序。

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
中国银行股份有限公司	托管人
诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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管理费	38,368.02	292,211.49
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	7,673.59	58,442.31

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	持有的	持有的基金	持有的	持有的基金

	基金份额	份额 占基金总份 额的比例	基金份额	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%

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30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
中国银行股份有限公司	368,561.74	5,556.87	4,224,569.80	15,289.90

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌的流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变

现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合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。

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30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	368,561.74	-	-	-	-	368,561.74
结算备付金	63,416.79	-	-	-	-	63,416.79
存出保证金	32,033.28	-	-	-	-	32,033.28
交易性金融资产	-	-	-	-	8,476,412.67	8,476,412.67
应收利息	-	-	-	-	103.88	103.88
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	464,011.81	-	-	-	8,476,516.55	8,940,528.36
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,587.74	3,587.74
应付托管费	-	-	-	-	717.54	717.54
应付交易费用	-	-	-	-	15,656.35	15,656.35
其他负债	-	-	-	-	97,108.87	97,108.87
负债总计	-	-	-	-	117,070.50	117,070.50
利率敏感度缺口	464,011.81	-	-	-	8,359,446.05	8,823,457.86
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	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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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30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	8,476,412.67	96.07	82,591,775.27	95.84
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	8,476,412.67	96.07	82,591,775.27	95.84

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30日)	上年度末(2018年12月31日)

	1. 业绩比较基准上升 5%	421, 231. 88	4, 074, 296. 73
	2. 业绩比较基准下降 5%	-421, 231. 88	-4, 074, 296. 73

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布, 在 95%的置信度下, 使用过去一年的历史数据, 按照 VaR 正态算法, 计算未来一个交易日里, 基金持仓资产组合可能的最大损失值。			
假设	1. 置信区间: 95%		
	2. 观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	基金投资组合的风险价值	235, 505. 61	2, 072, 498. 24
	合计	235, 505. 61	2, 072, 498. 24

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 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 8, 476, 412. 67 元, 无属于第二层次和第三层次的余额 (2018 年 12 月 31 日: 第一层次的余额为 82, 317, 338. 27 元, 第二层次的余额为 274, 437. 00 元, 无属于第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (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、买入返售金融资产和其他金融负债, 其账面价值与公允价

值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,476,412.67	94.81
	其中：股票	8,476,412.67	94.81
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	431,978.53	4.83
8	其他各项资产	32,137.16	0.36
9	合计	8,940,528.36	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	87,456.00	0.99
B	采矿业	307,088.82	3.48
C	制造业	4,667,574.79	52.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	278,041.90	3.15
E	建筑业	159,091.22	1.80
F	批发和零售业	459,042.88	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	290,156.25	3.29
H	住宿和餐饮业	30,966.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	832,185.55	9.43
J	金融业	373,612.40	4.23
K	房地产业	400,277.34	4.54
L	租赁和商务服务业	122,331.52	1.39
M	科学研究和技术服务业	10,386.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	77,419.54	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	25,644.00	0.29
Q	卫生和社会工作	36,765.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	170,941.00	1.94
S	综合	111,597.20	1.26
	合计	8,440,577.41	95.66

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	35,835.26	0.41
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	35,835.26	0.41

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	603444	吉比特	300	62,988.00	0.71
2	600872	中炬高新	1,265	54,179.95	0.61
3	002405	四维图新	3,300	53,130.00	0.60

4	300253	卫宁健康	3,096	43,901.28	0.50
5	000860	顺鑫农业	930	43,384.50	0.49
6	002157	正邦科技	2,600	43,316.00	0.49
7	000066	中国长城	4,082	41,962.96	0.48
8	600201	生物股份	2,659	41,719.71	0.47
9	002049	紫光国微	900	39,699.00	0.45
10	002195	二三四五	10,079	39,207.31	0.44
11	600739	辽宁成大	2,600	37,804.00	0.43
12	002127	南极电商	3,350	37,654.00	0.43
13	002506	协鑫集成	5,600	37,408.00	0.42
14	002916	深南电路	360	36,691.20	0.42
15	002507	涪陵榨菜	1,200	36,600.00	0.41
16	002463	沪电股份	2,660	36,229.20	0.41
17	600642	申能股份	6,000	36,060.00	0.41
18	000333	美的集团	691	35,835.26	0.41
19	600183	生益科技	2,375	35,743.75	0.41
20	000401	冀东水泥	2,000	35,220.00	0.40
21	600426	华鲁恒升	2,369	35,203.34	0.40
22	002129	中环股份	3,600	35,136.00	0.40
23	000975	银泰资源	2,640	34,821.60	0.39
24	002340	格林美	7,330	34,524.30	0.39
25	002465	海格通信	3,600	34,344.00	0.39
26	300383	光环新网	2,000	33,540.00	0.38
27	600895	张江高科	1,600	32,832.00	0.37
28	000623	吉林敖东	2,000	32,780.00	0.37
29	002439	启明星辰	1,218	32,764.20	0.37
30	600536	中国软件	600	32,202.00	0.37
31	000750	国海证券	6,300	31,689.00	0.36
32	002926	华西证券	3,000	31,500.00	0.36
33	002075	沙钢股份	4,000	31,360.00	0.36
34	002384	东山精密	2,098	30,567.86	0.35
35	600779	水井坊	600	30,492.00	0.35
36	300450	先导智能	900	30,240.00	0.34
37	600745	闻泰科技	900	29,898.00	0.34
38	002223	鱼跃医疗	1,210	29,790.20	0.34
39	002385	大北农	5,600	29,624.00	0.34
40	002821	凯莱英	300	29,424.00	0.33
41	002268	卫士通	1,200	29,340.00	0.33
42	002797	第一创业	4,600	29,164.00	0.33

43	002500	山西证券	3,600	29,160.00	0.33
44	000998	隆平高科	2,000	28,960.00	0.33
45	600325	华发股份	3,680	28,740.80	0.33
46	600549	厦门钨业	2,000	28,620.00	0.32
47	600298	安琪酵母	900	28,467.00	0.32
48	600497	驰宏锌锗	5,600	28,448.00	0.32
49	600879	航天电子	4,600	28,336.00	0.32
50	000997	新大陆	1,660	28,037.40	0.32
51	600848	上海临港	900	28,017.00	0.32
52	601128	常熟银行	3,600	27,792.00	0.32
53	601168	西部矿业	4,300	27,434.00	0.31
54	600161	天坛生物	1,086	27,421.50	0.31
55	600460	士兰微	1,650	27,390.00	0.31
56	002373	千方科技	1,600	27,360.00	0.31
57	000723	美锦能源	2,600	27,170.00	0.31
58	000778	新兴铸管	6,000	26,640.00	0.30
59	600673	东阳光	3,392	26,627.20	0.30
60	600528	中铁工业	2,300	26,611.00	0.30
61	600763	通策医疗	300	26,577.00	0.30
62	600584	长电科技	2,059	26,458.15	0.30
63	000686	东北证券	3,000	26,430.00	0.30
64	000999	华润三九	900	26,406.00	0.30
65	002092	中泰化学	3,300	26,268.00	0.30
66	000009	中国宝安	4,600	26,266.00	0.30
67	600909	华安证券	4,000	26,160.00	0.30
68	600392	盛和资源	2,360	26,101.60	0.30
69	000960	锡业股份	2,300	25,691.00	0.29
70	600718	东软集团	2,000	25,640.00	0.29
71	600699	均胜电子	1,200	25,632.00	0.29
72	000039	中集集团	2,400	25,632.00	0.29
73	600572	康恩贝	4,000	25,600.00	0.29
74	601005	重庆钢铁	12,700	25,527.00	0.29
75	600801	华新水泥	1,260	25,515.00	0.29
76	000988	华工科技	1,600	25,312.00	0.29
77	600820	隧道股份	4,000	25,240.00	0.29
78	603369	今世缘	900	25,101.00	0.28
79	600811	东方集团	6,740	25,072.80	0.28
80	000830	鲁西化工	2,300	25,024.00	0.28
81	000060	中金岭南	5,300	24,857.00	0.28

82	002191	劲嘉股份	2,000	24,820.00	0.28
83	600410	华胜天成	2,300	24,679.00	0.28
84	600875	东方电气	2,300	24,426.00	0.28
85	600166	福田汽车	10,300	24,411.00	0.28
86	002372	伟星新材	1,396	24,290.40	0.28
87	002273	水晶光电	2,095	24,260.10	0.28
88	002281	光迅科技	916	24,255.68	0.27
89	600022	山东钢铁	14,440	24,114.80	0.27
90	601866	中远海发	8,700	23,664.00	0.27
91	600839	四川长虹	8,000	23,600.00	0.27
92	600567	山鹰纸业	7,000	23,590.00	0.27
93	600959	江苏有线	5,300	23,585.00	0.27
94	601333	广深铁路	7,300	23,579.00	0.27
95	603517	绝味食品	600	23,346.00	0.26
96	600376	首开股份	2,600	23,218.00	0.26
97	000690	宝新能源	3,600	23,184.00	0.26
98	601872	招商轮船	5,300	23,108.00	0.26
99	600808	马钢股份	6,700	22,847.00	0.26
100	002299	圣农发展	900	22,788.00	0.26
101	002690	美亚光电	699	22,787.40	0.26
102	600881	亚泰集团	7,000	22,750.00	0.26
103	000970	中科三环	2,000	22,700.00	0.26
104	600804	鹏博士	3,000	22,560.00	0.26
105	600521	华海药业	1,600	22,560.00	0.26
106	002078	太阳纸业	3,300	22,473.00	0.25
107	600755	厦门国贸	2,600	22,438.00	0.25
108	600967	内蒙一机	2,000	22,400.00	0.25
109	002221	东华能源	2,600	22,386.00	0.25
110	603077	和邦生物	11,760	22,344.00	0.25
111	000581	威孚高科	1,200	22,272.00	0.25
112	002572	索菲亚	1,200	22,272.00	0.25
113	600845	宝信软件	780	22,214.40	0.25
114	002217	合力泰	4,000	22,120.00	0.25
115	600064	南京高科	2,060	22,062.60	0.25
116	000547	航天发展	2,300	21,988.00	0.25
117	300274	阳光电源	2,340	21,879.00	0.25
118	600885	宏发股份	900	21,870.00	0.25
119	002085	万丰奥威	3,000	21,840.00	0.25
120	600737	中粮糖业	2,500	21,700.00	0.25

121	600160	巨化股份	3,047	21,664.17	0.25
122	603000	人民网	1,200	21,396.00	0.24
123	000878	云南铜业	2,000	21,260.00	0.24
124	002038	双鹭药业	900	21,204.00	0.24
125	000513	丽珠集团	638	21,200.74	0.24
126	600266	北京城建	2,620	21,117.20	0.24
127	300027	华谊兄弟	4,300	21,113.00	0.24
128	600143	金发科技	4,300	21,070.00	0.24
129	002002	鸿达兴业	3,397	21,027.43	0.24
130	600466	蓝光发展	3,380	21,023.60	0.24
131	600079	人福医药	2,000	21,000.00	0.24
132	603939	益丰药房	300	20,997.00	0.24
133	002074	国轩高科	1,600	20,976.00	0.24
134	002387	维信诺	1,600	20,880.00	0.24
135	300315	掌趣科技	6,038	20,831.10	0.24
136	002353	杰瑞股份	900	20,790.00	0.24
137	002371	北方华创	300	20,775.00	0.24
138	600094	大名城	3,300	20,757.00	0.24
139	600435	北方导航	2,300	20,677.00	0.23
140	601699	潞安环能	2,600	20,644.00	0.23
141	002440	闰土股份	1,650	20,559.00	0.23
142	600037	歌华有线	2,000	20,500.00	0.23
143	000089	深圳机场	2,300	20,447.00	0.23
144	002174	游族网络	1,200	20,256.00	0.23
145	300088	长信科技	4,000	20,240.00	0.23
146	601098	中南传媒	1,600	20,224.00	0.23
147	002670	国盛金控	1,604	20,210.40	0.23
148	002155	湖南黄金	2,000	20,140.00	0.23
149	600373	中文传媒	1,600	20,096.00	0.23
150	000983	西山煤电	3,300	19,998.00	0.23
151	600021	上海电力	2,300	19,964.00	0.23
152	000729	燕京啤酒	3,000	19,920.00	0.23
153	300166	东方国信	1,619	19,897.51	0.23
154	600388	龙净环保	1,600	19,824.00	0.22
155	600863	内蒙华电	6,300	19,782.00	0.22
156	002589	瑞康医药	2,600	19,734.00	0.22
157	002131	利欧股份	10,324	19,718.84	0.22
158	002019	亿帆医药	1,600	19,600.00	0.22
159	600282	南钢股份	5,600	19,600.00	0.22

160	600643	爱建集团	2,040	19,543.20	0.22
161	600171	上海贝岭	1,200	19,500.00	0.22
162	600026	中远海能	3,000	19,470.00	0.22
163	000636	风华高科	1,600	19,360.00	0.22
164	000563	陕国投 A	4,300	19,092.00	0.22
165	300009	安科生物	1,200	19,080.00	0.22
166	002110	三钢闽光	2,050	19,065.00	0.22
167	000826	启迪桑德	1,600	18,864.00	0.21
168	601106	中国一重	6,000	18,840.00	0.21
169	601100	恒立液压	600	18,828.00	0.21
170	600315	上海家化	600	18,690.00	0.21
171	002233	塔牌集团	1,600	18,688.00	0.21
172	000883	湖北能源	4,300	18,662.00	0.21
173	601118	海南橡胶	3,600	18,540.00	0.21
174	600167	联美控股	1,750	18,515.00	0.21
175	600380	健康元	2,132	18,441.80	0.21
176	300207	欣旺达	1,600	18,432.00	0.21
177	000932	华菱钢铁	3,840	18,316.80	0.21
178	600008	首创股份	5,200	18,304.00	0.21
179	000598	兴蓉环境	4,000	18,200.00	0.21
180	002368	太极股份	600	18,180.00	0.21
181	002128	露天煤业	2,100	18,165.00	0.21
182	600729	重庆百货	600	18,144.00	0.21
183	000877	天山股份	1,560	18,127.20	0.21
184	601231	环旭电子	1,500	18,075.00	0.20
185	601718	际华集团	4,600	17,986.00	0.20
186	600260	凯乐科技	900	17,982.00	0.20
187	000027	深圳能源	2,900	17,980.00	0.20
188	000559	万向钱潮	3,000	17,940.00	0.20
189	300324	旋极信息	3,094	17,914.26	0.20
190	601678	滨化股份	2,650	17,914.00	0.20
191	002152	广电运通	2,600	17,810.00	0.20
192	300316	晶盛机电	1,400	17,766.00	0.20
193	002250	联化科技	1,600	17,744.00	0.20
194	000685	中山公用	2,075	17,720.50	0.20
195	000488	晨鸣纸业	3,300	17,688.00	0.20
196	600827	百联股份	1,800	17,658.00	0.20
197	300182	捷成股份	4,000	17,640.00	0.20
198	002583	海能达	2,102	17,635.78	0.20

199	300026	红日药业	5,100	17,595.00	0.20
200	002266	浙富控股	3,700	17,575.00	0.20
201	603233	大参林	390	17,550.00	0.20
202	603883	老百姓	300	17,544.00	0.20
203	601000	唐山港	6,356	17,479.00	0.20
204	600039	四川路桥	4,800	17,472.00	0.20
205	000681	视觉中国	900	17,442.00	0.20
206	002244	滨江集团	4,200	17,430.00	0.20
207	300115	长盈精密	1,660	17,413.40	0.20
208	600748	上实发展	2,090	17,326.10	0.20
209	000930	中粮生化	2,300	17,296.00	0.20
210	600060	海信电器	2,000	17,240.00	0.20
211	002183	怡亚通	3,600	17,172.00	0.19
212	600598	北大荒	1,600	17,168.00	0.19
213	002030	达安基因	1,599	17,157.27	0.19
214	300002	神州泰岳	4,300	17,114.00	0.19
215	300058	蓝色光标	4,000	17,080.00	0.19
216	601179	中国西电	4,600	17,020.00	0.19
217	002004	华邦健康	3,500	17,010.00	0.19
218	600409	三友化工	3,000	16,980.00	0.19
219	000008	神州高铁	4,500	16,965.00	0.19
220	000807	云铝股份	3,600	16,884.00	0.19
221	002408	齐翔腾达	2,178	16,879.50	0.19
222	300168	万达信息	1,300	16,861.00	0.19
223	600649	城投控股	2,600	16,822.00	0.19
224	300001	特锐德	929	16,740.58	0.19
225	000031	大悦城	2,600	16,692.00	0.19
226	600823	世茂股份	3,600	16,596.00	0.19
227	002064	华峰氨纶	3,300	16,566.00	0.19
228	002176	江特电机	3,400	16,558.00	0.19
229	002444	巨星科技	1,655	16,516.90	0.19
230	000732	泰禾集团	1,000	16,500.00	0.19
231	600782	新钢股份	3,300	16,500.00	0.19
232	002607	中公教育	1,200	16,476.00	0.19
233	603501	韦尔股份	300	16,473.00	0.19
234	000758	中色股份	3,000	16,470.00	0.19
235	600525	长园集团	2,600	16,432.00	0.19
236	600216	浙江医药	1,600	16,384.00	0.19
237	600158	中体产业	1,600	16,368.00	0.19

238	600515	海航基础	3,300	16,335.00	0.19
239	600056	中国医药	1,200	16,188.00	0.18
240	600258	首旅酒店	900	16,182.00	0.18
241	000738	航发控制	1,200	16,080.00	0.18
242	600277	亿利洁能	3,300	16,071.00	0.18
243	000028	国药一致	380	15,895.40	0.18
244	002056	横店东磁	2,080	15,808.00	0.18
245	601880	大连港	7,390	15,740.70	0.18
246	600120	浙江东方	1,235	15,733.90	0.18
247	603885	吉祥航空	1,200	15,720.00	0.18
248	600138	中青旅	1,238	15,710.22	0.18
249	300113	顺网科技	1,000	15,680.00	0.18
250	002470	金正大	4,300	15,652.00	0.18
251	600507	方大特钢	1,600	15,648.00	0.18
252	000813	德展健康	2,050	15,621.00	0.18
253	601611	中国核建	2,000	15,560.00	0.18
254	601608	中信重工	3,600	15,552.00	0.18
255	000078	海王生物	4,450	15,486.00	0.18
256	600418	江淮汽车	3,000	15,480.00	0.18
257	300133	华策影视	2,300	15,479.00	0.18
258	300418	昆仑万维	1,200	15,444.00	0.18
259	601958	金铂股份	2,300	15,410.00	0.17
260	600717	天津港	2,400	15,408.00	0.17
261	000528	柳工	2,310	15,384.60	0.17
262	600312	平高电气	2,000	15,380.00	0.17
263	000887	中鼎股份	1,600	15,344.00	0.17
264	601966	玲珑轮胎	900	15,300.00	0.17
265	000090	天健集团	3,089	15,259.66	0.17
266	002285	世联行	3,376	15,225.76	0.17
267	600777	新潮能源	7,300	15,184.00	0.17
268	600664	哈药股份	3,660	15,152.40	0.17
269	600348	阳泉煤业	2,600	15,106.00	0.17
270	300010	立思辰	1,600	15,024.00	0.17
271	600511	国药股份	654	15,022.38	0.17
272	600633	浙数文化	1,600	14,960.00	0.17
273	600759	洲际油气	3,867	14,926.62	0.17
274	600478	科力远	2,655	14,841.45	0.17
275	000301	东方盛虹	2,700	14,823.00	0.17
276	600307	酒钢宏兴	7,300	14,819.00	0.17

277	600970	中材国际	2,300	14,789.00	0.17
278	600754	锦江股份	600	14,784.00	0.17
279	600155	华创阳安	1,100	14,773.00	0.17
280	600859	王府井	970	14,734.30	0.17
281	600073	上海梅林	1,600	14,720.00	0.17
282	002419	天虹股份	1,100	14,366.00	0.16
283	300197	铁汉生态	4,000	14,360.00	0.16
284	002249	大洋电机	3,300	14,322.00	0.16
285	300134	大富科技	920	14,287.60	0.16
286	002407	多氟多	1,200	14,208.00	0.16
287	002332	仙琚制药	2,100	14,196.00	0.16
288	603659	璞泰来	300	14,106.00	0.16
289	002701	奥瑞金	3,016	14,084.72	0.16
290	002426	胜利精密	5,500	14,080.00	0.16
291	000012	南玻A	3,384	14,077.44	0.16
292	002812	恩捷股份	300	14,025.00	0.16
293	600557	康缘药业	940	13,968.40	0.16
294	002603	以岭药业	1,200	13,896.00	0.16
295	002665	首航节能	4,080	13,831.20	0.16
296	600582	天地科技	4,000	13,800.00	0.16
297	600580	卧龙电驱	1,639	13,783.99	0.16
298	600751	海航科技	4,300	13,674.00	0.15
299	002317	众生药业	1,600	13,616.00	0.15
300	600017	日照港	4,300	13,545.00	0.15
301	600575	皖江物流	4,600	13,478.00	0.15
302	002414	高德红外	700	13,440.00	0.15
303	600884	杉杉股份	1,260	13,419.00	0.15
304	002573	清新环境	1,660	13,363.00	0.15
305	002640	跨境通	1,600	13,328.00	0.15
306	603866	桃李面包	320	13,328.00	0.15
307	000564	供销大集	5,100	13,311.00	0.15
308	000717	韶钢松山	3,000	13,290.00	0.15
309	000156	华数传媒	1,200	13,212.00	0.15
310	000727	华东科技	6,300	13,167.00	0.15
311	600499	科达洁能	3,000	13,140.00	0.15
312	601717	郑煤机	2,300	13,133.00	0.15
313	000158	常山北明	2,420	13,116.40	0.15
314	000021	深科技	1,600	13,008.00	0.15
315	002491	通鼎互联	1,600	12,944.00	0.15

316	601928	凤凰传媒	1,600	12,912.00	0.15
317	600125	铁龙物流	2,001	12,906.45	0.15
318	600597	光明乳业	1,200	12,900.00	0.15
319	600316	洪都航空	900	12,879.00	0.15
320	603806	福斯特	350	12,855.50	0.15
321	603228	景旺电子	320	12,803.20	0.15
322	002505	大康农业	6,480	12,765.60	0.14
323	603712	七一二	600	12,738.00	0.14
324	002831	裕同科技	660	12,652.20	0.14
325	002399	海普瑞	600	12,594.00	0.14
326	600648	外高桥	600	12,588.00	0.14
327	600338	西藏珠峰	720	12,585.60	0.14
328	000006	深振业 A	2,300	12,535.00	0.14
329	002242	九阳股份	600	12,486.00	0.14
330	000926	福星股份	1,800	12,456.00	0.14
331	000519	中兵红箭	1,610	12,445.30	0.14
332	000543	皖能电力	2,640	12,434.40	0.14
333	601200	上海环境	910	12,385.10	0.14
334	600563	法拉电子	300	12,351.00	0.14
335	002212	南洋股份	900	12,330.00	0.14
336	600611	大众交通	2,650	12,322.50	0.14
337	600565	迪马股份	3,300	12,309.00	0.14
338	002358	森源电气	1,212	12,301.80	0.14
339	002051	中工国际	1,072	12,295.84	0.14
340	603515	欧普照明	380	12,255.00	0.14
341	600901	江苏租赁	2,000	12,180.00	0.14
342	002028	思源电气	1,220	12,151.20	0.14
343	002390	信邦制药	2,300	12,121.00	0.14
344	600062	华润双鹤	960	12,105.60	0.14
345	600259	广晟有色	300	12,090.00	0.14
346	002280	联络互动	3,300	12,078.00	0.14
347	600291	西水股份	1,200	12,072.00	0.14
348	600267	海正药业	1,200	12,000.00	0.14
349	601326	秦港股份	3,300	11,979.00	0.14
350	000959	首钢股份	3,400	11,968.00	0.14
351	600317	营口港	4,300	11,868.00	0.13
352	002424	贵州百灵	1,200	11,856.00	0.13
353	600151	航天机电	2,300	11,845.00	0.13
354	002839	张家港行	2,100	11,823.00	0.13

355	603868	飞科电器	300	11,745.00	0.13
356	002431	棕榈股份	2,950	11,652.50	0.13
357	000712	锦龙股份	900	11,556.00	0.13
358	600169	太原重工	4,300	11,481.00	0.13
359	600787	中储股份	2,000	11,460.00	0.13
360	000718	苏宁环球	3,300	11,418.00	0.13
361	300055	万邦达	1,600	11,408.00	0.13
362	600908	无锡银行	2,000	11,280.00	0.13
363	601869	长飞光纤	300	11,250.00	0.13
364	002302	西部建设	1,000	11,140.00	0.13
365	600765	中航重机	1,200	11,076.00	0.13
366	002807	江阴银行	2,360	11,044.80	0.13
367	000501	鄂武商 A	1,020	10,965.00	0.12
368	000980	众泰汽车	2,600	10,946.00	0.12
369	300308	中际旭创	320	10,876.80	0.12
370	000400	许继电气	1,200	10,872.00	0.12
371	600993	马应龙	614	10,837.10	0.12
372	002048	宁波华翔	1,000	10,820.00	0.12
373	600862	中航高科	1,200	10,788.00	0.12
374	603198	迎驾贡酒	600	10,746.00	0.12
375	000600	建投能源	1,600	10,720.00	0.12
376	600393	粤泰股份	2,300	10,695.00	0.12
377	600770	综艺股份	1,600	10,688.00	0.12
378	600006	东风汽车	2,000	10,660.00	0.12
379	601016	节能风电	4,000	10,640.00	0.12
380	002745	木林森	900	10,548.00	0.12
381	002672	东江环保	925	10,489.50	0.12
382	300266	兴源环境	2,300	10,442.00	0.12
383	600645	中源协和	600	10,386.00	0.12
384	300287	飞利信	2,600	10,322.00	0.12
385	002489	浙江永强	3,084	10,300.56	0.12
386	601311	骆驼股份	949	10,296.65	0.12
387	603816	顾家家居	320	10,214.40	0.12
388	300244	迪安诊断	600	10,188.00	0.12
389	000848	承德露露	1,212	10,095.96	0.11
390	300159	新研股份	2,000	9,960.00	0.11
391	600835	上海机电	600	9,960.00	0.11
392	002254	泰和新材	940	9,945.20	0.11
393	000990	诚志股份	600	9,846.00	0.11

394	600978	宜华生活	2,600	9,776.00	0.11
395	603766	隆鑫通用	2,330	9,762.70	0.11
396	600750	江中药业	750	9,757.50	0.11
397	600639	浦东金桥	600	9,702.00	0.11
398	603486	科沃斯	320	9,680.00	0.11
399	002382	蓝帆医疗	700	9,674.00	0.11
400	000937	冀中能源	2,500	9,650.00	0.11
401	300297	蓝盾股份	1,600	9,648.00	0.11
402	002948	青岛银行	1,500	9,645.00	0.11
403	000869	张裕A	300	9,636.00	0.11
404	600416	湘电股份	1,600	9,632.00	0.11
405	002375	亚厦股份	1,600	9,456.00	0.11
406	002815	崇达技术	600	9,354.00	0.11
407	600458	时代新材	900	9,351.00	0.11
408	002709	天赐材料	386	9,341.20	0.11
409	601019	山东出版	1,200	9,336.00	0.11
410	600141	兴发集团	900	9,252.00	0.10
411	600098	广州发展	1,500	9,240.00	0.10
412	601689	拓普集团	600	9,192.00	0.10
413	002503	搜于特	3,340	9,185.00	0.10
414	603377	东方时尚	600	9,168.00	0.10
415	600623	华谊集团	1,200	9,168.00	0.10
416	600329	中新药业	641	9,159.89	0.10
417	601001	大同煤业	2,000	9,140.00	0.10
418	600903	贵州燃气	700	9,121.00	0.10
419	002509	天广中茂	4,400	9,064.00	0.10
420	600869	智慧能源	2,002	9,049.04	0.10
421	600707	彩虹股份	1,800	9,018.00	0.10
422	000062	深圳华强	670	8,904.30	0.10
423	002635	安洁科技	650	8,768.50	0.10
424	000541	佛山照明	1,670	8,750.80	0.10
425	000061	农产品	1,600	8,672.00	0.10
426	600657	信达地产	2,094	8,627.28	0.10
427	002093	国脉科技	925	8,593.25	0.10
428	000426	兴业矿业	1,600	8,592.00	0.10
429	600971	恒源煤电	1,460	8,541.00	0.10
430	300459	金科文化	1,500	8,535.00	0.10
431	600545	卓郎智能	1,200	8,532.00	0.10
432	603056	德邦股份	600	8,448.00	0.10

433	002366	台海核电	900	8,424.00	0.10
434	600694	大商股份	300	8,373.00	0.09
435	000536	华映科技	3,300	8,316.00	0.09
436	600195	中牧股份	600	8,310.00	0.09
437	000537	广宇发展	1,200	8,304.00	0.09
438	300199	翰宇药业	900	8,253.00	0.09
439	600757	长江传媒	1,200	8,172.00	0.09
440	002482	广田集团	1,677	8,150.22	0.09
441	002434	万里扬	1,200	8,148.00	0.09
442	600640	号百控股	600	8,028.00	0.09
443	603568	伟明环保	372	8,005.44	0.09
444	601139	深圳燃气	1,400	7,966.00	0.09
445	002437	誉衡药业	2,000	7,900.00	0.09
446	601127	小康股份	600	7,860.00	0.09
447	002818	富森美	610	7,826.30	0.09
448	002544	杰赛科技	600	7,800.00	0.09
449	002941	新疆交建	300	7,800.00	0.09
450	000587	金洲慈航	3,000	7,740.00	0.09
451	600350	山东高速	1,600	7,680.00	0.09
452	600058	五矿发展	900	7,605.00	0.09
453	600874	创业环保	900	7,461.00	0.08
454	002344	海宁皮城	1,600	7,456.00	0.08
455	600428	中远海特	2,000	7,400.00	0.08
456	002517	恺英网络	2,300	7,337.00	0.08
457	002251	步步高	920	7,332.40	0.08
458	002707	众信旅游	1,200	7,284.00	0.08
459	002512	达华智能	1,600	7,232.00	0.08
460	601801	皖新传媒	1,200	7,212.00	0.08
461	002681	奋达科技	1,672	7,089.28	0.08
462	300257	开山股份	632	7,002.56	0.08
463	600053	九鼎投资	300	6,990.00	0.08
464	603888	新华网	350	6,986.00	0.08
465	000829	天音控股	1,200	6,984.00	0.08
466	601777	力帆股份	1,600	6,864.00	0.08
467	000766	通化金马	1,000	6,800.00	0.08
468	000025	特力A	335	6,773.70	0.08
469	002920	德赛西威	300	6,720.00	0.08
470	603650	彤程新材	300	6,552.00	0.07
471	601615	明阳智能	600	6,504.00	0.07

472	600996	贵广网络	600	6,468.00	0.07
473	603355	莱克电气	300	6,456.00	0.07
474	000552	靖远煤电	2,300	6,233.00	0.07
475	600335	国机汽车	900	6,228.00	0.07
476	603328	依顿电子	600	6,162.00	0.07
477	002936	郑州银行	1,200	6,096.00	0.07
478	002118	紫鑫药业	900	6,066.00	0.07
479	603877	太平鸟	380	5,897.60	0.07
480	600939	重庆建工	1,200	5,868.00	0.07
481	000987	越秀金控	600	5,412.00	0.06
482	601969	海南矿业	900	5,292.00	0.06
483	601003	柳钢股份	900	5,211.00	0.06
484	603556	海兴电力	350	4,837.00	0.05
485	002946	新乳业	300	4,542.00	0.05
486	002416	爱施德	720	4,500.00	0.05
487	600179	ST 安通	1,520	4,453.60	0.05
488	002699	美盛文化	740	4,440.00	0.05
489	600126	杭钢股份	950	4,332.00	0.05
490	600280	中央商场	1,200	4,308.00	0.05
491	603225	新凤鸣	332	4,146.68	0.05
492	601068	中铝国际	600	4,140.00	0.05
493	000761	本钢板材	900	3,870.00	0.04
494	601811	新华文轩	300	3,663.00	0.04
495	603569	长久物流	300	3,477.00	0.04
496	600985	淮北矿业	300	3,402.00	0.04
497	603025	大豪科技	320	3,276.80	0.04
498	600917	重庆燃气	300	2,088.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	691	35,835.26	0.41

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	300347	泰格医药	325,566.00	0.38
2	000860	顺鑫农业	310,825.00	0.36
3	002410	广联达	305,703.00	0.35
4	000656	金科股份	280,700.00	0.33
5	002129	中环股份	274,750.00	0.32
6	002049	紫光国微	272,282.00	0.32
7	000750	国海证券	251,509.00	0.29
8	300146	汤臣倍健	245,225.00	0.28
9	000623	吉林敖东	244,124.00	0.28
10	300383	光环新网	240,492.00	0.28
11	002465	海格通信	233,731.00	0.27
12	000401	冀东水泥	227,560.00	0.26
13	300253	卫宁健康	223,388.00	0.26
14	002916	深南电路	221,304.00	0.26
15	002439	启明星辰	220,788.00	0.26
16	002195	二三四五	218,512.00	0.25
17	300450	先导智能	209,629.00	0.24
18	002127	南极电商	208,454.00	0.24
19	002268	卫士通	208,311.00	0.24
20	002340	格林美	206,672.00	0.24

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

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	300347	泰格医药	819,631.00	0.95
2	002410	广联达	744,881.00	0.86
3	000656	金科股份	710,912.00	0.82
4	000860	顺鑫农业	681,630.00	0.79
5	000750	国海证券	648,862.00	0.75
6	300146	汤臣倍健	629,937.00	0.73
7	000623	吉林敖东	615,234.00	0.71
8	002129	中环股份	598,139.00	0.69
9	002465	海格通信	594,835.69	0.69
10	002049	紫光国微	590,161.48	0.68
11	300383	光环新网	576,703.00	0.67

12	300253	卫宁健康	556,115.00	0.65
13	002439	启明星辰	548,040.00	0.64
14	002195	二三四五	527,384.00	0.61
15	000401	冀东水泥	523,467.55	0.61
16	002916	深南电路	518,266.00	0.60
17	000778	新兴铸管	511,287.00	0.59
18	002340	格林美	510,641.00	0.59
19	000690	宝新能源	507,986.00	0.59
20	000418	小天鹅 A	500,289.85	0.58

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	35,436,378.23
卖出股票收入（成交）总额	73,840,246.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除正邦科技、中炬高新、紫光国微外，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。

(1) 2018 年 7 月 20 日，江西正邦科技股份有限公司（以下简称：“正邦科技”）披露下属子公司肇东正邦养殖有限公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》，公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》，处罚原因包括污水处理设施未运行，环保设施破损及其他环保措施不达标等。正邦科技得知上述情况后，专派项工作组驻点肇东进行整改，对相关责任人进行严肃处理，本次受处罚金额累计为 205 万元，占公司 2017 年度营业收入的 0.01%，上述对正邦科技环保负面影响因素已经消除，目前生产经营情况恢复正常。

截至本报告期末，正邦科技（002157）为本基金前十大重仓股。本基金属于完全复制的纯被动投资基金，本基金投资正邦科技的投资决策程序符合基金合同的规定。

(2) 2019 年 4 月 19 日，中炬高新技术实业（集团）股份有限公司收到了上海证券交易所发出的上证公监函（2019）0035 号：关于对中炬高新技术实业（集团）股份有限公司及时任董事会秘书彭海泓予以监管关注的决定。公司收购少数股东股权，达到了关联交易的披露标准，是对投资者决策具有重要影响的信息。但公司并未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务，也未及时召开董事会、股东大会进行审议，直至 2019 年 3 月 5 日才召开董事会、3 月 20 日才召开股东大会审议批准上述收购子公司股权的《协议》，并进行相应信息披露。公司未及时披露关联交易事项，损害了投资者的知情权。上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 2.1 条、第 2.3 条、第 7.3 条、第 10.2.5 条等相关规定。时任董事会秘书彭海泓作为公司信息披露事务的具体负责人，未能勤勉尽责，对公司的上述违规行为负有主要责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定及其在《高级管理人员声明及

承诺书》中做出的承诺。鉴于上述违规事实和情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，上海证券交易做出如下监管措施决定：对中炬高新技术实业（集团）股份有限公司和时任董事会秘书彭海泓予以监管关注。

截至本报告期末，本基金属于完全复制的纯被动投资基金，本基金投资中炬高新的投资决策程序符合基金合同的规定。

(3) 2018 年 8 月 24 日，深圳证券交易所对紫光国芯微电子股份有限公司（简称：紫光国微，A 股证券代码：002049）出具《关于对紫光国芯微电子股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2018】第 168 号），因为公司未按规定及时对关联交易履行审议程序和信息披露义务。

截至本报告期末，紫光国微为本基金前十大持仓股票。本基金属于完全复制的纯被动投资基金，本基金投资紫光国微的投资决策程序符合基金合同的规定。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,033.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,137.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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
208	34,091.17	1,289,943.00	18.19%	5,801,021.00	81.81%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	李光英	1,680,000.00	23.69%
2	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍 盛稳进	1,282,420.00	18.09%
3	徐军	450,102.00	6.35%
4	梁艳霞	398,752.00	5.62%
5	肖小兰	351,500.00	4.96%
6	许良	205,018.00	2.89%
7	林宏	193,543.00	2.73%
8	凌军	135,901.00	1.92%
9	文红梅	134,010.00	1.89%
10	唐静瑟	121,700.00	1.72%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 2 月 7 日）基金份额总额	879,090,964.00
本报告期期初基金份额总额	79,090,964.00
本报告期基金总申购份额	38,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	110,000,000.00
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	7,090,964.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金管理人以通讯方式召开诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会，权益登记日为 2019 年 5 月 28 日，大会投票表决截止日为 2019 年 7 月 4 日。根据 2019 年 7 月 5 日的计票结果，本次持有人大会通过了《关于诺安中证 500 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》及《诺安中证 500 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方案说明书》，决议于 2019 年 7 月 5 日生效，本基金最后运作日为 2019 年 7 月 5 日，并自 2019 年 7 月 8 日起进入清算程序。

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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	109,242,190.95	100.00%	101,739.01	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未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	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	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《中国证券报》	2019 年 1 月 21 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)2019 年第 1 期-摘要	《中国证券报》	2019 年 3 月 23 日
5	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)2019 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2019 年 3 月 23 日
6	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	基金管理人网站	2019 年 3 月 27 日
7	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	《中国证券报》	2019 年 3 月 27 日
8	诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《中国证券报》	2019 年 4 月 19 日
9	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

10	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺安中证 500 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	《中国证券报》	2019 年 5 月 22 日
11	关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的停牌公告	《中国证券报》	2019 年 5 月 22 日
12	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺安中证 500 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	《中国证券报》	2019 年 5 月 23 日
13	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暂停申购业务的公告	《中国证券报》	2019 年 5 月 24 日
14	诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺安中证 500 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	《中国证券报》	2019 年 5 月 24 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	2019.02.11-2019.02.13	-	6,016,000.00	6,016,000.00	-	-
	2	2019.02.11-2019.02.20	-	8,000,100.00	8,000,100.00	-	-
	3	2019.02.11-2019.02.20	-	14,000,400.00	14,000,400.00	-	-
个人	1	2019.01.10-2019.02.11, 2019.02.22-2019.05.24, 2019.05.30-2019.06.28	1,680,000.00	-	-	1,680,000.00	23.69%
	2	2019.05.24-2019.05.28	-	4,000,000.00	4,000,000.00	-	-
	3	2019.05.24-2019.05.28	-	4,000,000.00	4,000,000.00	-	-

中国银行股份有限公司—诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2019.01.02-2019.01.08	72,000,000.00	-	72,000,000.00	-	-
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。</p>							

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 2019 年半年度报告正文。
- ⑥报告期内诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

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