

**诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）**

**2021年第三季度报告**

**2021年09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

报告送出日期:2021年10月27日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2021年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	诺安创业板指数增强（LOF）
场内简称	创业板增强LOF
基金主代码	163209
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2019年05月31日
报告期末基金份额总额	76,488,138.22份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，以实现创业板指数的有效跟踪并力争实现超越，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数化投资作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理会对投资组合

	进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。	
业绩比较基准	创业板指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	诺安创业板指数增强（L OF）A	诺安创业板指数增强（L OF）C
下属分级基金场内简称	创业板增强LOF	-
下属分级基金的交易代码	163209	010356
报告期末下属分级基金的份额总额	56,205,367.90份	20,282,770.32份

注：①本基金由原诺安中证创业成长指数分级证券投资基金于2019年5月31日转型而来。  
②自2020年10月28日起，本基金增加基金份额类别，分设A类基金份额和C类基金份额；基金管理人可以申请本基金A类基金份额在深圳证券交易所上市交易，截至本报告期末，本基金A类基金份额暂未上市交易。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	诺安创业板指数增强（LOF）A	诺安创业板指数增强（LOF）C
1. 本期已实现收益	8,213,413.94	1,662,903.58
2. 本期利润	2,750,080.76	555,135.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0668	0.0539
4. 期末基金资产净值	121,334,869.35	43,619,558.31
5. 期末基金份额净值	2.1588	2.1506

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安创业板指数增强 (LOF) A 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.85%	2.11%	-6.30%	1.78%	11.15%	0.33%
过去六个月	31.39%	1.89%	16.82%	1.67%	14.57%	0.22%
过去一年	45.74%	1.94%	24.91%	1.76%	20.83%	0.18%
自基金合同生效起至今	117.95%	1.72%	111.39%	1.70%	6.56%	0.02%

诺安创业板指数增强 (LOF) C 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.76%	2.11%	-6.30%	1.78%	11.06%	0.33%
过去六个月	31.12%	1.89%	16.82%	1.67%	14.30%	0.22%
自基金合同生效起至今	39.45%	1.94%	20.63%	1.75%	18.82%	0.19%

注：本基金业绩比较基准：创业板指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

诺安创业板指数增强 (LOF) A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年05月31日-2021年09月30日)



诺安创业板指数增强 (LOF) C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年10月28日-2021年09月30日)



注：本基金的建仓期为 6 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2019年05月31日	-	24年	硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司。2005年3月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监、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，20

				<p>11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，2014年2月至2019年7月任诺安中证500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，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。</p>
--	--	--	--	--

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，诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）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《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，全球商品和能源价格持续大幅度上涨，通胀压力逐渐显现。

目前通胀追根溯源，当然有经济复苏、需求拉动的因素，但更主要是供给端冲击造成的。供给端冲击来自诸多方面，新冠疫情导致的供应链中断，极端天气和自然灾害导致产能受损，全球减碳导致产能收缩等等。

由于供给端冲击导致的通胀，对实体经济的负面影响非常显著，不仅提高了成本，更重要的是压低了经济增长。面对这样的经济困境，全球央行没有很好的货币政策加以应对。因此市场开始担忧“滞胀”来临。在此背景之下，全球利率上行可期，股市乏善可陈。

三季度国内经济面临同样的困境。由于煤炭价格飙升，电力供应紧缺，久违的“拉闸限电”现象再度归来。这不仅拖累了经济增长，还加剧了通胀压力。在此背景之下，A股市场回调在所难免，仅上游原材料和能源板块逆市上涨。

创业板指数主要由新能源、医药生物和TMT等行业构成。三季度医药和TMT板块都有较大幅度回撤，只有新能源板块逆市上涨。受此影响，创业板指数三季度跌幅超过6%。

本基金提高了新能源股票的配置比例，因此较好的控制了回撤，也取得了超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末诺安创业板指数增强 (LOF) A基金份额净值为2.1588元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.85%，同期业绩比较基准收益率为-6.30%；截至报告期末诺安创业板指数增强 (LOF) C基金份额净值为2.1506元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.76%，同期业绩比较基准收益率为-6.30%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	150,548,631.33	89.81
	其中：股票	150,548,631.33	89.81
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	12,787,235.49	7.63
8	其他资产	4,293,172.04	2.56
9	合计	167,629,038.86	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	3,475,200.00	2.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	104,421,080.00	63.30
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	192,200.00	0.12
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	10,050,628.00	6.09
J	金融业	13,743,950.00	8.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	449,600.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	8,897,692.00	5.39
N	水利、环境和公共设施管理业	543,900.00	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,050,550.00	3.67
R	文化、体育和娱乐业	2,408,500.00	1.46
S	综合	-	-
	合计	150,233,300.00	91.08

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	213,558.17	0.13
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	45,821.78	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,999.23	0.01
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	13,653.78	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,320.72	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,707.31	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	315,331.33	0.19

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	30,000	15,771,900.00	9.56
2	300059	东方财富	365,000	12,545,050.00	7.61
3	300760	迈瑞医疗	20,000	7,708,400.00	4.67
4	300274	阳光电源	45,000	6,677,100.00	4.05
5	300015	爱尔眼科	105,000	5,607,000.00	3.40
6	300014	亿纬锂能	55,200	5,466,456.00	3.31

7	300122	智飞生物	33,000	5,246,670.00	3.18
8	300124	汇川技术	76,000	4,788,000.00	2.90
9	300142	沃森生物	73,000	4,612,140.00	2.80
10	300347	泰格医药	23,500	4,089,000.00	2.48

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301078	孩子王	6,342	36,593.34	0.02
2	001218	丽臣实业	350	15,928.50	0.01
3	001217	华尔泰	779	12,908.03	0.01
4	301069	凯盛新材	539	12,413.17	0.01
5	301029	怡合达	146	8,449.02	0.01

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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投资贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体，除沃森生物外，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。

2021年7月1日，云南沃森生物技术股份有限公司（简称“沃森生物”）被中国证监会云南证监局出具《行政监管措施决定书》，主要是因为公司以自有资金1.5亿元对外投资，在投资决策和投后管理过程中，存在内部控制缺陷。因此被采取责令改正的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

截至本报告期末，沃森生物（300142）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，上述行政监管措施不影响公司的长期竞争力和投资价值，因此本基金继续持有该股票。沃森生物是创业板指数的前十大成份股，本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,454.28
2	应收证券清算款	997,490.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1,344.71
5	应收申购款	3,263,882.10
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,293,172.04

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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	301078	孩子王	36,593.34	0.02	新股未上市
2	001218	丽臣实业	15,928.50	0.01	新股未上市
3	301069	凯盛新材	12,413.17	0.01	新股锁定
4	301029	怡合达	8,449.02	0.01	新股锁定

### 5.11.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安创业板指数增强 (L OF) A	诺安创业板指数增强 (L OF) C
报告期期初基金份额总额	34,140,477.64	240,928.40
报告期期间基金总申购份额	50,858,934.09	36,774,255.55
减：报告期期间基金总赎回份额	28,794,043.83	16,732,413.63
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	56,205,367.90	20,282,770.32

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例 达到或者超过20% 的时间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金未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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2021年8月27日披露了《诺安基金管理有限公司关于董事长任职的公告》，自2021年8月26日起，李强先生担任公司董事长。

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。

②原诺安中证创业成长指数分级证券投资基金变更为诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）的批复及相关公告。

③《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》。

④《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》。

⑤《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑦诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）2021年第三季度报告正文。

⑧报告期内诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）在指定媒介上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 9.3 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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2021年10月27日