

诺安中证 500 指数增强型证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 06 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：2023 年 08 月 31 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。本中期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 2023 年 08 月 30 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告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	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12	投资组合报告附注 .....	56
§ 8	基金份额持有人信息 .....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.3	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情况 .....	58
§ 9	开放式基金份额变动 .....	58
§ 10	重大事件揭示 .....	58
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4	基金投资策略的改变 .....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8	其他重大事件 .....	60
§ 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 .....	62
§ 12	备查文件目录 .....	62
12.1	备查文件目录 .....	62
12.2	存放地点 .....	63
12.3	查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	诺安中证 500 增强	
基金主代码	001351	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 01 月 15 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	47,219,200.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	001351	010355
报告期末下属分级基金的份额总额	45,056,945.58 份	2,162,255.07 份

注：（1）本基金由原诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金于 2019 年 1 月 15 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。

### 2.2 基金产品说明

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%，以实现对中证 500 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	<p>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。为控制基金偏离业绩比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准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%。</p> <p>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。</p> <p>当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p>

业绩比较基准	中证 500 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，其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。

## 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	李学君
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
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	李强	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

## § 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（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）	
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
本期已实现收益	-2,005,882.08	-30,185.71
本期利润	783,201.96	540,222.06
加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.1116
本期加权平均净值利润率	1.75%	11.55%
本期基金份额净值增长率	1.87%	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	

	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
期末可供分配利润	-3,571,085.41	-192,626.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0793	-0.0891
期末基金资产净值	42,135,667.80	2,000,723.04
期末基金份额净值	0.9352	0.9253
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
基金份额累计净值增长率	58.05%	0.74%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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，采用期末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。

4、自 2020 年 10 月 28 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额，详情请参阅相关公告。

### 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

诺安中证 500 增强 A

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	-0.54%	0.86%	-0.76%	0.89%	0.22%	-0.03%
过去三个月	-5.88%	0.75%	-5.09%	0.78%	-0.79%	-0.03%
过去六个月	1.87%	0.81%	2.23%	0.75%	-0.36%	0.06%
过去一年	-7.19%	0.99%	-6.59%	0.91%	-0.60%	0.08%
过去三年	8.91%	1.26%	2.66%	1.13%	6.25%	0.13%
自基金合同生效起至今	58.05%	1.35%	38.72%	1.26%	19.33%	0.09%

诺安中证 500 增强 C

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	-0.58%	0.86%	-0.76%	0.89%	0.18%	-0.03%
过去三个月	-5.98%	0.74%	-5.09%	0.78%	-0.89%	-0.04%
过去六个月	1.66%	0.80%	2.23%	0.75%	-0.57%	0.05%
过去一年	-7.58%	0.98%	-6.59%	0.91%	-0.99%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.74%	1.20%	-1.36%	1.07%	2.10%	0.13%

注：1、2019 年 01 月 15 日（含当日）起，原“诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95% + 一年期银

行储蓄存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

2、自 2020 年 10 月 28 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额；其中 C 类基金份额自 2020 年 10 月 30 日开始有申购数据，C 类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2020 年 11 月 02 日）算起。

### 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



诺安中证 500 增强 C





注：2019 年 01 月 15 日（含当日）起，原“诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”转型为本基金。

## § 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、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、诺安优选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、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

#### 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		
王海畅	本基金基金经理	2023 年 03 月 21 日	-	6 年	硕士，具有基金从业资格。2017 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2022 年 7 月起任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月起任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。

孔宪政	本基金基金经理	2023 年 06 月 03 日	-	11 年	博士,具有基金从业资格。历任野村证券交易员、白湾基金投资经理、前海开源基金投资部副总监、兴证证券资产管理有限公司投资部投资经理、蜂巢基金管理有限公司基金经理。2021 年 10 月加入诺安基金管理有限公司,现任量化与创新投资部总经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2023 年 6 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金及诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
梅律吾	本基金基金经理	2019 年 01 月 15 日	2023 年 06 月 03 日	26 年	硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司,任研究员。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、研究部副总监、指数投资组副总监、指数组负责人。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

				<p>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，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，2018 年 8 月至 2023 年 6 月任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月至 2023 年 6 月任诺安中证 500 指数增强型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，2019 年 5 月起任诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）</p>
--	--	--	--	--

					基金经理。
路龙凯	本基金基金经理	2019 年 02 月 20 日	2023 年 03 月 31 日	11 年	硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国人民健康保险股份有限公司、泰达宏利基金管理有限公司、建信基金管理有限责任公司，从事投资管理工作。2017 年 11 月加入诺安基金管理有限公司，从事投资管理工作。2018 年 4 月至 2018 年 5 月任诺安和鑫保本混合型证券投资基金基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 11 月任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 2020 年 4 月任诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 2 月至 2023 年 3 月任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：①此处梅律吾先生的任职日期为基金合同生效之日，王海畅先生及孔宪政先生的任职日期、梅律吾先生的离任日期、路龙凯先生的任职日期及离任日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 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，本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

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 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

“行业归属”因素和“风格”因素在 2023 年上半年对于个股截面收益差距的解释能力保持在历史高分位水平，其中前者尤为突出（统计区间是自 2006 年以来）。出于对“严控偏离风险及力争适度超额收益间寻求较好的匹配”运作目标的考量，本基金在一季度末已经选择收紧持仓结构在行业 and 风格上相对基准指数的偏离程度，并在二季度延续了这一战术思路。从事后的角度看，该战术选择使得本基金的跟踪误差和超额收益最大回撤率得到了较好的控制，而超额收益则仍需时间逐渐显现。前述“解释能力”是一个定义在 0 ~ 100% 之间的统计学指标，因此“行业归属”因素和“风

格”因素的“解释能力双高”现象意味着留给选股因子发挥的空间被进一步挤压。关于选股因子，如果将因子根据原始数据来源的不同进行分类，那么本基金使用的策略所基于的因子储备可以大致分为“财报基本面”“价量”“公开股东信息”“分析师预期”等 4 大类。这 4 大类因子中，本报告期内有部分“财报基本面”类因子和“分析师预期”类因子出现了与经济学逻辑反向的情况，这也是所谓“选股因子发挥空间被挤压”的具体体现。尽管从时序的角度看，因子表现与经济学逻辑持续反向的概率并不高，我们依然重视这样的现象，并已经对有关因子的构造做出针对性的改进。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安中证 500 增强 A 份额净值为 0.9352 元，本报告期诺安中证 500 增强 A 份额净值增长率为 1.87%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%；截至本报告期末诺安中证 500 增强 C 份额净值为 0.9253 元，本报告期诺安中证 500 增强 C 份额净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，在几个重要的“风格”因素上，以市净率、市盈率衍生指标为代表的估值类风格因子和以残差波动率为代表的技术类风格因子的表现显著强于历史长期平均水平，而成长类风格因子的表现出现了比较明显的回调。经过干扰因素剥离后的成长类风格因子的历史长期表现是较为稳健的，因此从统计视角看，在展望下一阶段的市场时，我们倾向于认为成长类风格因子短期的低迷表现持续下去的可能性不高，但精确的切换时点无法预测。本基金的主要业绩基准是中证 500 指数，该指数由中国市场一批已经属于“中大型”且可能仍具有较大成长空间的上市公司股票构成，指数的行业权重分布也较为均匀。我们看好中国经济的韧性，而韧性有可能体现在任何一个或多个行业上。综上，“在风格或行业的配比上摇摆”与本基金所希望达到的运作目标并不相符，因此我们并不会轻易去尝试博取成长类风格因子的“颓势”反转，或是就“热门行业的动量持续还是困境行业的趋势扭转”做选择题，而是会继续在“中性”的思路下均衡配置多个具有长期稳健表现的选股因子，努力做出更好的超额收益风险比。

#### 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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指

定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 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

在 2023 年 04 月 21 日至 2023 年 06 月 30 日期间，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在诺安中证 500 指数增强型证券投资基金（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 托管人对本中期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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,179,713.80	3,195,677.44
结算备付金		189,212.38	156,155.75
存出保证金		8,613.29	13,057.69
交易性金融资产	6.4.7.2	41,296,506.09	46,638,544.03
其中：股票投资		41,296,506.09	46,638,544.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		224,889.53	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,279.66	22,328.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		45,921,214.75	50,025,762.99
<b>负债和净资产</b>			
	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023 年 06 月 30 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,483,042.65	121,935.17
应付赎回款		52,185.30	54,732.23
应付管理人报酬		37,000.33	43,472.71
应付托管费		5,550.05	6,520.91
应付销售服务费		651.40	2,820.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	206,394.18	175,113.81
负债合计		1,784,823.91	404,595.08
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	47,219,200.65	54,124,744.78
未分配利润	6.4.7.8	-3,082,809.81	-4,503,576.87
净资产合计		44,136,390.84	49,621,167.91
负债和净资产总计		45,921,214.75	50,025,762.99

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，诺安中证 500 增强 A 基金份额净值 0.9352 元，基金份额总额 45,056,945.58 份；诺安中证 500 增强 C 基金份额净值 0.9253 元，基金份额总额 2,162,255.07 份。诺安中证 500 增强份额总额合计为 47,219,200.65 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,755,918.44	-4,775,699.65
1. 利息收入		8,570.09	5,989.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,570.09	5,989.69
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,617,706.32	-608,884.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,149,262.13	-1,125,921.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	126.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	531,555.81	516,911.32
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	3,359,491.81	-4,180,152.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	5,562.86	7,347.33
<b>减：二、营业总支出</b>		432,494.42	451,353.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	245,050.68	247,839.33

2. 托管费	6.4.10.2.2	36,757.60	37,175.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,405.24	10,685.45
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	141,280.90	155,652.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,323,424.02	-5,227,052.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,323,424.02	-5,227,052.70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,323,424.02	-5,227,052.70

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	54,124,744.78	-	-4,503,576.87	49,621,167.91
二、本期期初净资产（基金净值）	54,124,744.78	-	-4,503,576.87	49,621,167.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,905,544.13	-	1,420,767.06	-5,484,777.07
（一）、综合收益总额	-	-	1,323,424.02	1,323,424.02
（二）、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）	-6,905,544.13	-	97,343.04	-6,808,201.09
其中：1. 基金申购款	8,204,855.57	-	-198,846.74	8,006,008.83
2. 基金赎回款	-15,110,399.70	-	296,189.78	-14,814,209.92
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	47,219,200.65	-	-3,082,809.81	44,136,390.84
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	48,268,720.94	-	6,559,513.18	54,828,234.12
二、本期期初净资产（基金净值）	48,268,720.94	-	6,559,513.18	54,828,234.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,693,742.85	-	-6,173,573.07	22,520,169.78
（一）、综合收益总额	-	-	-5,227,052.70	-5,227,052.70
（二）、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）	28,693,742.85	-	-946,520.37	27,747,222.48
其中：1. 基金申购款	36,931,229.31	-	-960,637.44	35,970,591.87
2. 基金赎回款	-8,237,486.46	-	14,117.07	-8,223,369.39
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	76,962,463.79	-	385,940.11	77,348,403.90

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：

齐斌                                      田冲                                      何柳姿  
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 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）原名为诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。原诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接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联接基金基金合同》发售，基金合同于 2015 年 6 月 9 日生效。原诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金自 2018 年 11 月 12 日至 2018 年 12 月 12 日召开基金份额持有人大会，大会审议通过了《关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案》及《关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案的说明书》，同意基金名称更名为“诺安中证 500 指数增强型证券投资基金”，将《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合同》、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》修订为《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》。上述

基金份额持有人大会决议报中国证监会备案并自 2018 年 12 月 13 日起生效。原诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 454,158,368.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 124,523.60 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。

本基金于 2020 年 10 月 28 日起进行基金份额分级，分级后本基金设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。A 级基金份额的基金代码为 001351(与分级前基金代码相同)，基金简称“诺安中证 500 增强 A”；C 级基金份额代码为 010355，基金简称“诺安中证 500 增强 C”。两级基金份额适用相同的管理费率、托管费率。本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，但不从该类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在申购时不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

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 指数增强型证券投资基金基金合同》和《诺安中证 500 指数增强型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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或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。本基金为股票指数增强型基金，股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披

露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 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〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《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《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〔2016〕36 号《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《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《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》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方

教育附加的征收规定等其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。自 2008 年 10 月 9 日起，暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	4,179,713.80
等于：本金	4,179,329.68
加：应计利息	384.12
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,179,713.80

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	42,125,087.14	-	41,296,506.09	-828,581.05
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	42,125,087.14	-	41,296,506.09	-828,581.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。



#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	116,708.70
其中：交易所市场	116,708.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,671.58
指数使用费	50,000.00
合计	206,394.18

#### 6.4.7.7 实收基金

诺安中证 500 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,597,946.19	45,597,946.19
本期申购	5,475,625.51	5,475,625.51
本期赎回（以“-”号填列）	-6,016,626.12	-6,016,626.12
本期末	45,056,945.58	45,056,945.58

诺安中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,526,798.59	8,526,798.59
本期申购	2,729,230.06	2,729,230.06
本期赎回（以“-”号填列）	-9,093,773.58	-9,093,773.58
本期末	2,162,255.07	2,162,255.07

#### 6.4.7.8 未分配利润

诺安中证 500 增强 A

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

本期期初	-1,605,592.21	-2,132,208.62	-3,737,800.83
本期利润	-2,005,882.08	2,789,084.04	783,201.96
本期基金份额交易产生的变动数	40,388.88	-7,067.79	33,321.09
其中：基金申购款	-158,769.53	26,603.13	-132,166.40
基金赎回款	199,158.41	-33,670.92	165,487.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,571,085.41	649,807.63	-2,921,277.78

诺安中证 500 增强 C

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
本期期初	-371,342.02	-394,434.02	-765,776.04
本期利润	-30,185.71	570,407.77	540,222.06
本期基金份额交易产生的变动数	208,901.23	-144,879.28	64,021.95
其中：基金申购款	-111,969.63	45,289.29	-66,680.34
基金赎回款	320,870.86	-190,168.57	130,702.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-192,626.50	31,094.47	-161,532.03

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	6,610.53
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	1,830.31
其他	129.25
合计	8,570.09

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	193,602,508.77
减：卖出股票成本总额	195,213,204.35
减：交易费用	538,566.55
买卖股票差价收入	-2,149,262.13

#### 6.4.7.11 债券投资收益

**6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.12 衍生工具收益****6.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	531,555.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	531,555.81

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,359,491.81
—股票投资	3,359,491.81
—债券投资	-
—资产支持证券投资	-
—基金投资	-
—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	3,359,491.81

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	4,399.11
基金转换费收入	1,163.75
合计	5,562.86

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
汇划手续费	1,600.52
存托服务费	8.80
合计	141,280.90

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 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

本基金本报告期不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。

##### 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
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联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无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 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无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	245,050.68	247,839.33
其中：支付销售机构的客户维护费	107,033.73	108,018.55

注：本基金的管理费率为年费率 1.00%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,757.60	37,175.93

注：本基金的托管费率为年费率 0.15%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	210.87	210.87
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	210.87	210.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	70.92	70.92
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	70.92	70.92

注：本基金诺安中证 500 增强 A 份额不收取销售服务费，诺安中证 500 增强 C 份额的年销售服务费率 0.40%。

诺安中证 500 增强 C 的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为诺安中证 500 增强 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安中证 500 增强 C 前一日的基金资产净值

#### 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未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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

**6.4.10.5.1 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。

**6.4.10.5.2 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**

本基金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。

**6.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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-活期存款	4,179,713.80	6,610.53	4,331,225.71	5,593.22

注：本基金的上述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。

**6.4.10.7 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未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 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 2023 年 06 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/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
601298	青岛港	2023年06月28日	重大事项	6.97	2023年07月03日	7.40	1,600	10,822.91	11,152.00	

					日					
--	--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

### 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

本基金本报告期末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余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。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；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手



进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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市值的 10%。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例低于 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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一定程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	-------	-----	----

2023 年 06 月 30 日						
资产						
银行存款	4,179,713.80	-	-	-	-	4,179,713.80
结算备付金	189,212.38	-	-	-	-	189,212.38
存出保证金	8,613.29	-	-	-	-	8,613.29
交易性金融资产	-	-	-	-	41,296,506.09	41,296,506.09
应收清算款	-	-	-	-	224,889.53	224,889.53
应收申购款	-	-	-	-	22,279.66	22,279.66
资产总计	4,377,539.47	-	-	-	41,543,675.28	45,921,214.75
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1,483,042.65	1,483,042.65
应付赎回款	-	-	-	-	52,185.30	52,185.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	37,000.33	37,000.33
应付托管费	-	-	-	-	5,550.05	5,550.05
应付销售服务费	-	-	-	-	651.40	651.40
其他负债	-	-	-	-	206,394.18	206,394.18
负债总计	-	-	-	-	1,784,823.91	1,784,823.91
利率敏感度缺口	4,377,539.47	-	-	-	-39,758,851.37	44,136,390.84
上年度末 2022 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	3,195,677.44	-	-	-	-	3,195,677.44
结算备付金	156,155.75	-	-	-	-	156,155.75
存出保证金	13,057.69	-	-	-	-	13,057.69
交易性金融资产	-	-	-	-	46,638,544.03	46,638,544.03
应收申购款	325.00	-	-	-	22,003.08	22,328.08
资产总计	3,365,215.88	-	-	-	46,660,547.11	50,025,762.99
负债						
应付清算款	-	-	-	-	121,935.17	121,935.17
应付赎回款	-	-	-	-	54,732.23	54,732.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	43,472.71	43,472.71
应付托管费	-	-	-	-	6,520.91	6,520.91
应付销售服务费	-	-	-	-	2,820.25	2,820.25
其他负债	-	-	-	-	175,113.81	175,113.81
负债总计	-	-	-	-	404,595.08	404,595.08
利率敏感度缺口	3,365,215.88	-	-	-	-46,255,952.03	49,621,167.91

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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

其他价格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除市场利率和外币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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	41,296,506.09	93.57	46,638,544.03	93.99
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	41,296,506.09	93.57	46,638,544.03	93.99

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的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(2023 年 06 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
业绩比较基准上升 5%	2,091,003.50	2,427,557.82
业绩比较基准下降 5%	-2,091,003.50	-2,427,557.82

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	41,285,354.09	46,638,544.03
第二层次	11,152.00	-
第三层次	-	-
合计	41,296,506.09	46,638,544.03

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其剩余期限较短，账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。

## § 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	41,296,506.09	89.93
	其中：股票	41,296,506.09	89.93
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	4,368,926.18	9.51
8	其他各项资产	255,782.48	0.56
9	合计	45,921,214.75	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	386,108.00	0.87
B	采矿业	1,914,269.00	4.34
C	制造业	21,423,977.45	48.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,086,315.00	2.46
E	建筑业	242,937.00	0.55
F	批发和零售业	1,169,780.60	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	673,580.00	1.53
H	住宿和餐饮业	100,435.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,013,806.70	4.56
J	金融业	3,409,207.40	7.72
K	房地产业	709,227.00	1.61
L	租赁和商务服务业	588,326.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	432,050.74	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	198,786.80	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	55,830.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	330,270.00	0.75

S	综合	140,936.00	0.32
	合计	34,875,842.69	79.02

### 7.2.2 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	88,969.00	0.20
B	采矿业	415,611.00	0.94
C	制造业	3,656,859.40	8.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	348,514.00	0.79
E	建筑业	200,550.00	0.45
F	批发和零售业	298,215.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	167,884.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,067.00	0.58
J	金融业	496,464.00	1.12
K	房地产业	2,003.00	0.00
L	租赁和商务服务业	120,488.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	80,388.00	0.18
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	117,740.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	172,911.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	6,420,663.40	14.55

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603688	石英股份	4,500	512,280.00	1.16
2	300058	蓝色光标	50,900	492,203.00	1.12
3	000739	普洛药业	26,800	475,432.00	1.08
4	601717	郑煤机	38,100	474,345.00	1.07
5	002600	领益智造	68,500	473,335.00	1.07
6	601966	玲珑轮胎	20,900	464,398.00	1.05
7	002936	郑州银行	194,000	446,200.00	1.01
8	600060	海信视像	17,500	433,125.00	0.98
9	688006	杭可科技	14,015	427,037.05	0.97
10	603883	老百姓	13,800	411,930.00	0.93

11	002384	东山精密	15,800	409,220.00	0.93
12	000630	铜陵有色	138,600	400,554.00	0.91
13	600315	上海家化	13,800	400,338.00	0.91
14	002568	百润股份	11,000	399,850.00	0.91
15	688390	固德威	2,380	397,126.80	0.90
16	600157	永泰能源	271,200	385,104.00	0.87
17	600096	云天化	22,500	384,075.00	0.87
18	603737	三棵树	5,600	366,352.00	0.83
19	000783	长江证券	63,000	365,400.00	0.83
20	002065	东华软件	51,200	361,472.00	0.82
21	600642	申能股份	49,000	342,510.00	0.78
22	002531	天顺风能	21,700	330,491.00	0.75
23	600481	双良节能	23,200	324,336.00	0.73
24	601108	财通证券	44,600	322,904.00	0.73
25	002025	航天电器	5,000	319,000.00	0.72
26	601958	金钼股份	28,200	314,430.00	0.71
27	002155	湖南黄金	25,700	313,540.00	0.71
28	603218	日月股份	16,500	313,335.00	0.71
29	600339	中油工程	75,600	307,692.00	0.70
30	603127	昭衍新药	7,400	302,660.00	0.69
31	300136	信维通信	15,000	301,200.00	0.68
32	002791	坚朗五金	4,600	297,666.00	0.67
33	600655	豫园股份	42,700	292,922.00	0.66
34	600038	中直股份	7,300	290,686.00	0.66
35	600487	亨通光电	19,600	287,336.00	0.65
36	002131	利欧股份	123,400	283,820.00	0.64
37	002422	科伦药业	9,100	270,088.00	0.61
38	600109	国金证券	31,000	268,770.00	0.61
39	600699	均胜电子	15,000	264,600.00	0.60
40	600988	赤峰黄金	19,500	262,470.00	0.59
41	300003	乐普医疗	11,600	262,276.00	0.59
42	300017	网宿科技	36,600	260,226.00	0.59
43	600155	华创云信	41,100	255,642.00	0.58
44	000807	云铝股份	19,900	253,327.00	0.57
45	600598	北大荒	19,000	253,270.00	0.57
46	300373	扬杰科技	6,200	251,534.00	0.57
47	600166	福田汽车	73,700	250,580.00	0.57
48	000738	航发控制	10,200	248,880.00	0.56
49	002625	光启技术	16,200	247,212.00	0.56
50	002244	滨江集团	28,000	246,960.00	0.56
51	300073	当升科技	4,900	246,617.00	0.56



52	002056	横店东磁	13,500	245,835.00	0.56
53	300595	欧普康视	8,100	244,539.00	0.55
54	600126	杭钢股份	55,800	242,172.00	0.55
55	603338	浙江鼎力	4,300	240,843.00	0.55
56	300395	菲利华	4,800	236,160.00	0.54
57	600909	华安证券	49,900	233,033.00	0.53
58	601187	厦门银行	46,400	232,928.00	0.53
59	002507	涪陵榨菜	12,720	232,903.20	0.53
60	300442	润泽科技	7,400	227,624.00	0.52
61	002444	巨星科技	10,400	227,552.00	0.52
62	002683	广东宏大	7,700	226,688.00	0.51
63	600022	山东钢铁	159,200	226,064.00	0.51
64	600516	方大炭素	35,600	220,720.00	0.50
65	300866	安克创新	2,500	218,750.00	0.50
66	688002	睿创微纳	4,763	213,382.40	0.48
67	603650	彤程新材	6,500	213,200.00	0.48
68	600862	中航高科	8,300	210,073.00	0.48
69	002223	鱼跃医疗	5,800	208,742.00	0.47
70	603816	顾家家居	5,400	206,010.00	0.47
71	600390	五矿资本	37,800	203,364.00	0.46
72	000060	中金岭南	42,800	203,300.00	0.46
73	601555	东吴证券	28,500	197,790.00	0.45
74	603885	吉祥航空	12,800	197,504.00	0.45
75	002409	雅克科技	2,700	196,776.00	0.45
76	601098	中南传媒	16,900	196,040.00	0.44
77	000537	广宇发展	16,500	192,555.00	0.44
78	600377	宁沪高速	18,400	180,872.00	0.41
79	002761	浙江建投	11,700	177,606.00	0.40
80	603568	伟明环保	9,880	172,998.80	0.39
81	600021	上海电力	15,600	168,012.00	0.38
82	688819	天能股份	4,500	165,780.00	0.38
83	002439	启明星辰	5,300	157,728.00	0.36
84	300418	昆仑万维	3,900	157,092.00	0.36
85	002572	索菲亚	8,900	155,038.00	0.35
86	300888	稳健医疗	3,700	154,179.00	0.35
87	000878	云南铜业	13,700	151,385.00	0.34
88	600879	航天电子	17,800	151,122.00	0.34
89	600927	永安期货	9,200	149,592.00	0.34
90	002738	中矿资源	2,920	148,744.80	0.34
91	603456	九洲药业	5,400	147,852.00	0.33
92	300308	中际旭创	1,000	147,450.00	0.33

93	002563	森马服饰	23,600	146,792.00	0.33
94	002532	天山铝业	24,500	146,755.00	0.33
95	000933	神火股份	10,600	137,800.00	0.31
96	601162	天风证券	44,400	132,312.00	0.30
97	000009	中国宝安	10,900	131,563.00	0.30
98	000400	许继电气	5,700	131,385.00	0.30
99	000998	隆平高科	8,500	130,475.00	0.30
100	300487	蓝晓科技	2,050	127,961.00	0.29
101	600985	淮北矿业	10,800	124,416.00	0.28
102	600885	宏发股份	3,900	124,215.00	0.28
103	603156	养元饮品	4,956	122,413.20	0.28
104	600998	九州通	11,780	122,276.40	0.28
105	600325	华发股份	12,400	122,140.00	0.28
106	600418	江淮汽车	9,700	122,123.00	0.28
107	601231	环旭电子	7,900	118,184.00	0.27
108	600549	厦门钨业	6,200	117,986.00	0.27
109	000997	新大陆	6,200	117,180.00	0.27
110	002273	水晶光电	9,500	113,430.00	0.26
111	600895	张江高科	8,100	112,752.00	0.26
112	600511	国药股份	2,900	112,665.00	0.26
113	002128	电投能源	8,500	112,370.00	0.25
114	600755	厦门国贸	14,300	110,682.00	0.25
115	600582	天地科技	18,900	110,187.00	0.25
116	601992	金隅集团	50,400	109,872.00	0.25
117	002939	长城证券	13,500	109,755.00	0.25
118	600517	国网英大	19,100	108,870.00	0.25
119	600967	内蒙一机	10,600	107,060.00	0.24
120	301029	怡合达	2,340	104,551.20	0.24
121	000959	首钢股份	29,800	104,300.00	0.24
122	600258	首旅酒店	5,300	100,435.00	0.23
123	600995	南网储能	8,900	97,989.00	0.22
124	601156	东航物流	7,500	97,500.00	0.22
125	300144	宋城演艺	7,800	96,720.00	0.22
126	600350	山东高速	14,500	92,365.00	0.21
127	600901	江苏金租	21,980	90,777.40	0.21
128	600415	小商品城	10,300	87,859.00	0.20
129	603529	爱玛科技	2,700	86,994.00	0.20
130	688256	寒武纪	400	75,200.00	0.17
131	600143	金发科技	8,600	75,078.00	0.17
132	000987	越秀资本	11,800	74,930.00	0.17
133	300474	景嘉微	800	71,992.00	0.16

134	300724	捷佳伟创	600	67,410.00	0.15
135	600968	海油发展	21,600	66,312.00	0.15
136	002028	思源电气	1,400	65,408.00	0.15
137	688777	中控技术	1,025	64,349.50	0.15
138	300037	新宙邦	1,200	62,268.00	0.14
139	601168	西部矿业	5,900	62,009.00	0.14
140	000089	深圳机场	8,800	61,160.00	0.14
141	688248	南网科技	1,566	60,118.74	0.14
142	603712	七一二	1,900	57,399.00	0.13
143	002850	科达利	400	52,900.00	0.12
144	002385	大北农	8,000	52,800.00	0.12
145	688099	晶晨股份	600	50,592.00	0.11
146	603444	吉比特	100	49,111.00	0.11
147	600536	中国软件	1,040	48,755.20	0.11
148	603596	伯特利	600	47,556.00	0.11
149	600160	巨化股份	3,400	46,852.00	0.11
150	601997	贵阳银行	8,600	44,376.00	0.10
151	600298	安琪酵母	1,200	43,452.00	0.10
152	000050	深天马 A	4,700	43,146.00	0.10
153	603939	益丰药房	1,120	41,440.00	0.09
154	002368	太极股份	1,000	41,170.00	0.09
155	605358	立昂微	1,100	40,403.00	0.09
156	000778	新兴铸管	9,700	39,576.00	0.09
157	603589	口子窖	800	39,480.00	0.09
158	002268	电科网安	1,400	39,018.00	0.09
159	300009	安科生物	3,900	39,000.00	0.09
160	601969	海南矿业	5,800	38,164.00	0.09
161	300604	长川科技	800	37,992.00	0.09
162	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.09
163	002463	沪电股份	1,800	37,692.00	0.09
164	688516	奥特维	200	37,680.00	0.09
165	002294	信立泰	1,200	37,428.00	0.08
166	300676	华大基因	600	35,994.00	0.08
167	688521	芯原股份	500	35,960.00	0.08
168	000831	中国稀土	1,200	35,520.00	0.08
169	300832	新产业	600	35,400.00	0.08
170	603000	人民网	1,200	35,040.00	0.08
171	600079	人福医药	1,300	35,022.00	0.08
172	300699	光威复材	1,120	34,552.00	0.08
173	600118	中国卫星	1,200	33,852.00	0.08
174	002078	太阳纸业	3,100	33,139.00	0.08

175	600529	山东药玻	1,200	32,664.00	0.07
176	000703	恒逸石化	4,800	32,544.00	0.07
177	600597	光明乳业	3,100	32,240.00	0.07
178	000423	东阿阿胶	600	32,070.00	0.07
179	600372	中航电子	2,100	31,878.00	0.07
180	688052	纳芯微	200	31,674.00	0.07
181	603233	大参林	1,120	31,371.20	0.07
182	003035	南网能源	4,400	31,328.00	0.07
183	000513	丽珠集团	800	31,128.00	0.07
184	603658	安图生物	600	31,038.00	0.07
185	002690	美亚光电	1,200	30,900.00	0.07
186	603927	中科软	800	30,848.00	0.07
187	603882	金城医学	400	30,200.00	0.07
188	002353	杰瑞股份	1,200	30,156.00	0.07
189	688385	复旦微电	600	30,060.00	0.07
190	601456	国联证券	3,300	30,030.00	0.07
191	002032	苏泊尔	600	30,000.00	0.07
192	000729	燕京啤酒	2,400	29,928.00	0.07
193	603517	绝味食品	800	29,720.00	0.07
194	002281	光迅科技	800	29,672.00	0.07
195	603893	瑞芯微	400	29,140.00	0.07
196	300558	贝达药业	600	28,818.00	0.07
197	002372	伟星新材	1,400	28,756.00	0.07
198	002080	中材科技	1,400	28,728.00	0.07
199	002595	豪迈科技	800	28,104.00	0.06
200	600970	中材国际	2,200	28,050.00	0.06
201	300682	朗新科技	1,200	27,936.00	0.06
202	603160	汇顶科技	600	27,750.00	0.06
203	600399	抚顺特钢	2,700	27,540.00	0.06
204	002430	杭氧股份	800	27,488.00	0.06
205	600563	法拉电子	200	27,460.00	0.06
206	601128	常熟银行	4,000	27,280.00	0.06
207	600801	华新水泥	2,200	27,170.00	0.06
208	600329	达仁堂	600	26,934.00	0.06
209	002192	融捷股份	400	26,732.00	0.06
210	000683	远兴能源	3,700	26,603.00	0.06
211	300212	易华录	800	26,584.00	0.06
212	603267	鸿远电子	400	26,120.00	0.06
213	000636	风华高科	1,700	26,078.00	0.06
214	688567	孚能科技	1,200	25,908.00	0.06
215	689009	九号公司	700	25,795.00	0.06

216	300244	迪安诊断	1,000	25,630.00	0.06
217	603077	和邦生物	10,500	25,515.00	0.06
218	002240	盛新锂能	800	25,496.00	0.06
219	002505	鹏都农牧	13,400	25,326.00	0.06
220	002508	老板电器	1,000	25,290.00	0.06
221	002557	洽洽食品	600	24,930.00	0.06
222	600416	湘电股份	1,300	24,817.00	0.06
223	603858	步长制药	1,200	24,708.00	0.06
224	600141	兴发集团	1,100	24,442.00	0.06
225	000591	太阳能	3,600	24,408.00	0.06
226	601016	节能风电	6,600	24,222.00	0.05
227	603026	胜华新材	400	23,700.00	0.05
228	300363	博腾股份	800	23,672.00	0.05
229	600566	济川药业	800	23,232.00	0.05
230	002966	苏州银行	3,400	22,270.00	0.05
231	300677	英科医疗	1,000	22,000.00	0.05
232	600171	上海贝岭	1,200	21,900.00	0.05
233	002326	永太科技	1,400	21,406.00	0.05
234	000967	盈峰环境	4,200	21,210.00	0.05
235	600637	东方明珠	2,700	21,114.00	0.05
236	002008	大族激光	800	20,960.00	0.05
237	603228	景旺电子	800	20,520.00	0.05
238	300118	东方日升	800	20,504.00	0.05
239	600131	国网信通	1,000	20,190.00	0.05
240	002518	科士达	500	20,005.00	0.05
241	603826	坤彩科技	400	20,000.00	0.05
242	002831	裕同科技	800	19,512.00	0.04
243	600737	中粮糖业	2,400	19,320.00	0.04
244	300438	鹏辉能源	400	19,216.00	0.04
245	600373	中文传媒	1,400	18,648.00	0.04
246	601233	桐昆股份	1,400	18,550.00	0.04
247	000893	亚钾国际	800	18,352.00	0.04
248	688208	道通科技	600	18,186.00	0.04
249	688779	长远锂科	1,600	18,032.00	0.04
250	300748	金力永磁	600	17,952.00	0.04
251	000012	南玻 A	3,000	17,880.00	0.04
252	002867	周大生	1,000	17,780.00	0.04
253	002985	北摩高科	400	17,648.00	0.04
254	600062	华润双鹤	1,000	17,420.00	0.04
255	300861	美畅股份	400	17,348.00	0.04
256	603638	艾迪精密	800	16,416.00	0.04

257	000975	银泰黄金	1,400	16,380.00	0.04
258	688029	南微医学	200	16,312.00	0.04
259	002423	中粮资本	2,000	16,000.00	0.04
260	300482	万孚生物	600	15,978.00	0.04
261	000581	威孚高科	1,000	15,750.00	0.04
262	600707	彩虹股份	3,300	15,708.00	0.04
263	001872	招商港口	900	15,543.00	0.04
264	688690	纳微科技	400	15,540.00	0.04
265	002081	金螳螂	3,400	15,334.00	0.03
266	300253	卫宁健康	1,400	15,148.00	0.03
267	001914	招商积余	1,000	15,050.00	0.03
268	600820	隧道股份	2,500	15,025.00	0.03
269	603866	桃李面包	1,480	14,977.60	0.03
270	300850	新强联	400	14,952.00	0.03
271	600259	广晟有色	400	14,456.00	0.03
272	603707	健友股份	1,070	14,445.00	0.03
273	002705	新宝股份	800	14,424.00	0.03
274	603379	三美股份	600	14,106.00	0.03
275	002432	九安医疗	400	14,084.00	0.03
276	600195	中牧股份	1,200	14,016.00	0.03
277	300529	健帆生物	600	13,908.00	0.03
278	002739	万达电影	1,100	13,794.00	0.03
279	688116	天奈科技	300	13,725.00	0.03
280	002340	格林美	1,900	13,129.00	0.03
281	300618	寒锐钴业	400	12,964.00	0.03
282	600208	新湖中宝	5,000	12,400.00	0.03
283	002487	大金重工	400	12,336.00	0.03
284	300257	开山股份	800	12,136.00	0.03
285	600066	宇通客车	800	11,792.00	0.03
286	600316	洪都航空	500	11,725.00	0.03
287	002925	盈趣科技	600	11,640.00	0.03
288	601298	青岛港	1,600	11,152.00	0.03
289	001203	大中矿业	1,000	11,110.00	0.03
290	000709	河钢股份	4,900	11,074.00	0.03
291	600153	建发股份	1,000	10,910.00	0.02
292	600764	中国海防	400	10,888.00	0.02
293	600392	盛和资源	800	10,296.00	0.02
294	002624	完美世界	600	10,134.00	0.02
295	688289	圣湘生物	600	10,104.00	0.02
296	300024	机器人	600	10,002.00	0.02
297	002926	华西证券	1,200	9,972.00	0.02

298	601139	深圳燃气	1,300	9,477.00	0.02
299	002653	海思科	400	9,440.00	0.02
300	600673	东阳光	1,300	9,373.00	0.02
301	603056	德邦股份	600	9,252.00	0.02
302	002399	海普瑞	800	9,176.00	0.02
303	600499	科达制造	800	9,088.00	0.02
304	300383	光环新网	800	8,600.00	0.02
305	600352	浙江龙盛	900	8,415.00	0.02
306	600867	通化东宝	800	8,352.00	0.02
307	002185	华天科技	900	8,280.00	0.02
308	002945	华林证券	600	8,208.00	0.02
309	688185	康希诺	100	8,150.00	0.02
310	002249	大洋电机	1,400	7,980.00	0.02
311	000728	国元证券	1,200	7,824.00	0.02
312	601666	平煤股份	1,000	7,540.00	0.02
313	601077	渝农商行	2,100	7,539.00	0.02
314	601869	长飞光纤	200	7,402.00	0.02
315	601158	重庆水务	1,300	7,228.00	0.02
316	002497	雅化集团	400	7,112.00	0.02
317	002673	西部证券	1,100	6,985.00	0.02
318	300357	我武生物	200	6,726.00	0.02
319	603786	科博达	100	6,570.00	0.01
320	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.01
321	002901	大博医疗	200	6,216.00	0.01
322	000869	张裕 A	200	6,132.00	0.01
323	600839	四川长虹	1,200	6,060.00	0.01
324	002608	江苏国信	800	6,056.00	0.01
325	600497	驰宏锌锗	1,200	6,024.00	0.01
326	000547	航天发展	600	6,000.00	0.01
327	600528	中铁工业	600	5,928.00	0.01
328	600667	太极实业	800	5,808.00	0.01
329	601058	赛轮轮胎	500	5,695.00	0.01
330	601598	中国外运	1,200	5,592.00	0.01
331	000066	中国长城	400	5,532.00	0.01
332	600521	华海药业	300	5,523.00	0.01
333	000750	国海证券	1,600	5,360.00	0.01
334	600956	新天绿能	600	5,232.00	0.01
335	688009	中国通号	900	5,220.00	0.01
336	600380	健康元	400	5,084.00	0.01
337	603355	莱克电气	200	5,082.00	0.01
338	600032	浙江新能	400	5,024.00	0.01

339	002958	青农商行	1,800	4,896.00	0.01
340	002203	海亮股份	400	4,804.00	0.01
341	002152	广电运通	400	4,688.00	0.01
341	600482	中国动力	200	4,688.00	0.01
343	002407	多氟多	220	4,369.20	0.01
344	600906	财达证券	600	4,320.00	0.01
345	300741	华宝股份	200	4,284.00	0.01
346	002010	传化智联	800	4,256.00	0.01
347	300088	长信科技	700	4,221.00	0.01
348	000039	中集集团	600	4,134.00	0.01
349	688772	珠海冠宇	200	4,030.00	0.01
350	001227	兰州银行	1,400	4,004.00	0.01
351	600409	三友化工	700	3,815.00	0.01
352	000988	华工科技	100	3,801.00	0.01
353	300070	碧水源	700	3,752.00	0.01
354	600507	方大特钢	800	3,704.00	0.01
355	002670	国盛金控	400	3,512.00	0.01
356	601636	旗滨集团	400	3,448.00	0.01
357	000559	万向钱潮	600	3,270.00	0.01
358	600928	西安银行	900	3,168.00	0.01
359	000031	大悦城	800	2,928.00	0.01
360	300285	国瓷材料	100	2,740.00	0.01
361	600271	航天信息	200	2,738.00	0.01
362	002373	千方科技	200	2,728.00	0.01
363	600161	天坛生物	100	2,715.00	0.01
364	600765	中航重机	100	2,651.00	0.01
365	601991	大唐发电	800	2,648.00	0.01
366	601568	北元集团	500	2,635.00	0.01
367	600739	辽宁成大	200	2,630.00	0.01
368	002110	三钢闽光	600	2,532.00	0.01
369	600863	内蒙华电	600	2,490.00	0.01
370	000930	中粮科技	300	2,430.00	0.01
371	300251	光线传媒	300	2,427.00	0.01
372	300146	汤臣倍健	100	2,398.00	0.01
373	002138	顺络电子	100	2,391.00	0.01
374	600808	马钢股份	900	2,313.00	0.01
375	002195	二三四五	800	2,312.00	0.01
376	002797	第一创业	400	2,288.00	0.01
377	000402	金融街	500	2,260.00	0.01
377	002156	通富微电	100	2,260.00	0.01
379	300001	特锐德	100	2,078.00	0.00



380	600498	烽火通信	100	2,037.00	0.00
381	000021	深科技	100	1,999.00	0.00
382	600859	王府井	100	1,979.00	0.00
383	300012	华测检测	100	1,950.00	0.00
384	002299	圣农发展	100	1,915.00	0.00
385	000937	冀中能源	300	1,914.00	0.00
386	000519	中兵红箭	100	1,809.00	0.00
387	300568	星源材质	100	1,719.00	0.00
388	000415	渤海租赁	800	1,680.00	0.00
389	000898	鞍钢股份	600	1,668.00	0.00
390	002429	兆驰股份	300	1,650.00	0.00
391	000623	吉林敖东	100	1,604.00	0.00
392	000960	锡业股份	100	1,555.00	0.00
393	000825	太钢不锈	400	1,548.00	0.00
394	601005	重庆钢铁	1,100	1,540.00	0.00
395	600580	卧龙电驱	100	1,461.00	0.00
396	002019	亿帆医药	100	1,460.00	0.00
396	600369	西南证券	400	1,460.00	0.00
398	600535	天士力	100	1,451.00	0.00
399	600546	山煤国际	100	1,447.00	0.00
400	000155	川能动力	100	1,440.00	0.00
401	601828	美凯龙	300	1,437.00	0.00
402	601136	首创证券	100	1,417.00	0.00
403	600027	华电国际	200	1,338.00	0.00
404	600827	百联股份	100	1,337.00	0.00
405	000887	中鼎股份	100	1,309.00	0.00
406	600056	中国医药	100	1,298.00	0.00
407	000970	中科三环	100	1,282.00	0.00
408	600848	上海临港	100	1,195.00	0.00
409	300115	长盈精密	100	1,191.00	0.00
410	601665	齐鲁银行	300	1,176.00	0.00
411	600435	北方导航	100	1,149.00	0.00
412	601928	凤凰传媒	100	1,140.00	0.00
413	002511	中顺洁柔	100	1,115.00	0.00
414	603225	新风鸣	100	1,105.00	0.00
415	002468	申通快递	100	1,082.00	0.00
416	600718	东软集团	100	1,066.00	0.00
417	002250	联化科技	100	1,046.00	0.00
418	002465	海格通信	100	1,034.00	0.00
419	600489	中金黄金	100	1,033.00	0.00
420	002030	达安基因	100	997.00	0.00

421	600663	陆家嘴	100	987.00	0.00
422	002745	木林森	100	920.00	0.00
423	600873	梅花生物	100	893.00	0.00
424	000156	华数传媒	100	870.00	0.00
425	002221	东华能源	100	865.00	0.00
426	601611	中国核建	100	845.00	0.00
427	002266	浙富控股	200	826.00	0.00
428	601990	南京证券	100	818.00	0.00
429	601198	东兴证券	100	802.00	0.00
430	600348	华阳股份	100	791.00	0.00
431	000629	钒钛股份	200	782.00	0.00
432	600095	湘财股份	100	780.00	0.00
433	601577	长沙银行	100	776.00	0.00
434	000401	冀东水泥	100	737.00	0.00
435	600556	天下秀	100	709.00	0.00
436	600167	联美控股	100	697.00	0.00
437	600398	海澜之家	100	688.00	0.00
438	000027	深圳能源	100	659.00	0.00
439	300296	利亚德	100	653.00	0.00
440	601228	广州港	200	646.00	0.00
441	002092	中泰化学	100	645.00	0.00
442	300182	捷成股份	100	631.00	0.00
442	600177	雅戈尔	100	631.00	0.00
444	600623	华谊集团	100	623.00	0.00
445	002500	山西证券	100	558.00	0.00
446	000598	兴蓉环境	100	543.00	0.00
447	300026	红日药业	100	542.00	0.00
448	601179	中国西电	100	541.00	0.00
449	002183	怡亚通	100	510.00	0.00
450	688538	和辉光电	200	508.00	0.00
451	600704	物产中大	100	494.00	0.00
451	601778	晶科科技	100	494.00	0.00
453	000932	华菱钢铁	100	477.00	0.00
454	000883	湖北能源	100	456.00	0.00
455	601118	海南橡胶	100	448.00	0.00
456	000958	电投产融	100	433.00	0.00
457	601608	中信重工	100	421.00	0.00
458	600705	中航产融	100	383.00	0.00
459	000785	居然之家	100	381.00	0.00
460	600782	新钢股份	100	371.00	0.00
461	601000	唐山港	100	353.00	0.00

462	600959	江苏有线	100	338.00	0.00
463	600282	南钢股份	100	337.00	0.00
464	601106	中国一重	100	336.00	0.00
465	601880	辽港股份	200	312.00	0.00
466	000563	陕国投 A	100	305.00	0.00
467	601718	际华集团	100	297.00	0.00
468	002506	协鑫集成	100	293.00	0.00
469	600008	首创环保	100	288.00	0.00
470	600170	上海建工	100	269.00	0.00
471	601866	中远海发	100	247.00	0.00
472	600297	广汇汽车	100	208.00	0.00
473	600871	石化油服	100	198.00	0.00

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688063	派能科技	1,744	345,748.00	0.78
2	300896	爱美客	600	266,970.00	0.60
3	301367	怡和嘉业	1,600	237,344.00	0.54
4	600711	盛屯矿业	39,200	190,512.00	0.43
5	601519	大智慧	26,200	187,592.00	0.43
6	300672	国科微	2,100	175,035.00	0.40
7	300855	图南股份	4,400	155,408.00	0.35
8	002352	顺丰控股	3,400	153,306.00	0.35
9	002236	大华股份	6,300	124,425.00	0.28
10	000516	国际医学	14,000	117,740.00	0.27
11	601888	中国中免	1,000	110,530.00	0.25
12	300130	新国都	3,900	110,487.00	0.25
13	301090	华润材料	8,600	108,532.00	0.25
14	300207	欣旺达	6,500	106,080.00	0.24
15	601878	浙商证券	10,700	105,716.00	0.24
16	002603	以岭药业	4,100	105,329.00	0.24
17	002011	盾安环境	7,600	105,108.00	0.24
18	600256	广汇能源	15,300	104,958.00	0.24
19	600612	老凤祥	1,500	104,820.00	0.24
20	002737	葵花药业	4,300	104,662.00	0.24
21	300674	宇信科技	5,900	104,312.00	0.24
22	000034	神州数码	3,900	103,701.00	0.23
23	603298	杭叉集团	4,400	103,620.00	0.23
24	300633	开立医疗	1,900	103,550.00	0.23
25	300433	蓝思科技	8,800	103,488.00	0.23

26	601163	三角轮胎	6,500	103,155.00	0.23
27	600458	时代新材	8,600	103,114.00	0.23
28	601801	皖新传媒	10,900	102,351.00	0.23
29	688428	诺诚健华	8,800	101,640.00	0.23
30	002060	粤水电	15,300	100,674.00	0.23
31	601669	中国电建	17,400	99,876.00	0.23
32	605090	九丰能源	4,400	98,252.00	0.22
33	601236	红塔证券	13,000	96,850.00	0.22
34	600098	广州发展	15,400	95,172.00	0.22
35	000539	粤电力 A	13,000	94,900.00	0.22
36	600000	浦发银行	13,000	94,120.00	0.21
37	600361	创新新材	19,500	93,600.00	0.21
38	600459	贵研铂业	6,100	93,330.00	0.21
39	002714	牧原股份	2,100	88,515.00	0.20
40	301039	中集车辆	6,500	85,995.00	0.19
41	300759	康龙化成	2,100	80,388.00	0.18
42	603613	国联股份	2,100	77,553.00	0.18
43	300782	卓胜微	800	77,304.00	0.18
44	300294	博雅生物	2,100	76,188.00	0.17
45	600583	海油工程	13,000	76,050.00	0.17
46	002402	和而泰	4,400	74,712.00	0.17
47	300775	三角防务	2,100	70,938.00	0.16
48	601858	中国科传	2,100	70,560.00	0.16
49	002475	立讯精密	2,100	68,145.00	0.15
50	603129	春风动力	400	64,760.00	0.15
51	600011	华能国际	6,500	60,190.00	0.14
52	601877	正泰电器	2,100	58,065.00	0.13
53	002335	科华数据	1,400	50,330.00	0.11
54	000927	中国铁物	17,400	48,372.00	0.11
55	300777	中简科技	900	42,534.00	0.10
56	688122	西部超导	700	39,011.00	0.09
57	300767	震安科技	1,400	35,504.00	0.08
58	600100	同方股份	4,100	33,292.00	0.08
59	300628	亿联网络	900	31,563.00	0.07
60	603345	安井食品	200	29,360.00	0.07
61	000603	盛达资源	2,300	27,807.00	0.06
62	605599	菜百股份	2,100	27,741.00	0.06
63	688088	虹软科技	600	25,650.00	0.06
64	600916	中国黄金	2,100	24,801.00	0.06
65	002291	遥望科技	1,800	23,580.00	0.05
66	600996	贵广网络	1,700	16,694.00	0.04

67	600728	佳都科技	2,300	15,939.00	0.04
68	000552	甘肃能化	4,400	14,652.00	0.03
69	601872	招商轮船	2,400	13,896.00	0.03
70	600120	浙江东方	3,100	11,873.00	0.03
71	002212	天融信	1,100	10,670.00	0.02
72	688981	中芯国际	200	10,104.00	0.02
73	002127	南极电商	2,600	9,958.00	0.02
74	688223	晶科能源	600	8,436.00	0.02
75	600552	凯盛科技	400	4,736.00	0.01
76	688599	天合光能	100	4,261.00	0.01
77	002410	广联达	100	3,249.00	0.01
78	688012	中微公司	12	1,877.40	0.00
79	002434	万里扬	200	1,790.00	0.00
80	601699	潞安环能	100	1,632.00	0.00
81	600064	南京高科	100	661.00	0.00
82	002191	劲嘉股份	100	602.00	0.00
83	002146	荣盛发展	300	462.00	0.00
84	002124	天邦食品	100	454.00	0.00
85	002701	奥瑞金	100	451.00	0.00
86	002002	鸿达兴业	200	448.00	0.00
87	601333	广深铁路	100	396.00	0.00
88	600376	首开股份	100	390.00	0.00
89	300072	海新能科	100	342.00	0.00
90	000656	金科股份	300	333.00	0.00
91	002948	青岛银行	100	313.00	0.00
92	600219	南山铝业	100	302.00	0.00
93	601975	招商南油	100	286.00	0.00
94	600567	山鹰国际	100	229.00	0.00
95	000961	中南建设	100	157.00	0.00
96	600307	酒钢宏兴	100	155.00	0.00

## 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	300613	富瀚微	2,426,460.53	4.89
2	002236	大华股份	1,749,076.81	3.52
3	601456	国联证券	1,545,001.00	3.11
4	002624	完美世界	1,525,308.00	3.07
5	300474	景嘉微	1,495,998.00	3.01

6	603589	口子窖	1,456,197.00	2.93
7	002409	雅克科技	1,399,188.00	2.82
8	600809	山西汾酒	1,329,711.00	2.68
9	600079	人福医药	1,311,547.00	2.64
10	600118	中国卫星	1,269,329.00	2.56
11	600988	赤峰黄金	1,242,752.00	2.50
12	688981	中芯国际	1,233,052.78	2.48
13	601658	邮储银行	1,124,529.00	2.27
14	600498	烽火通信	1,115,199.00	2.25
15	601878	浙商证券	1,084,965.00	2.19
16	300604	长川科技	1,084,743.00	2.19
17	601377	兴业证券	1,083,081.00	2.18
18	688012	中微公司	1,081,920.25	2.18
19	002568	百润股份	1,062,463.00	2.14
20	000778	新兴铸管	1,051,351.00	2.12
21	603986	兆易创新	1,014,548.00	2.04
22	600702	舍得酒业	1,013,497.00	2.04
23	603501	韦尔股份	1,001,113.00	2.02

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，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	601456	国联证券	2,688,655.00	5.42
2	300474	景嘉微	2,679,787.00	5.40
3	300613	富瀚微	2,668,258.20	5.38
4	002624	完美世界	2,261,358.00	4.56
5	300604	长川科技	2,003,478.00	4.04
6	002236	大华股份	1,933,551.78	3.90
7	300212	易华录	1,751,094.00	3.53
8	603589	口子窖	1,737,577.00	3.50
9	300861	美畅股份	1,595,591.00	3.22
10	600079	人福医药	1,518,019.00	3.06
11	688256	寒武纪	1,486,619.04	3.00
12	300763	锦浪科技	1,383,646.00	2.79
13	002384	东山精密	1,315,986.00	2.65
14	002268	电科网安	1,308,670.00	2.64
15	688099	晶晨股份	1,307,138.83	2.63
16	600809	山西汾酒	1,305,497.00	2.63
17	300144	宋城演艺	1,287,846.00	2.60
18	300724	捷佳伟创	1,284,196.00	2.59

19	002948	青岛银行	1,271,746.00	2.56
20	600498	烽火通信	1,267,268.20	2.55
21	601377	兴业证券	1,251,695.00	2.52
22	688012	中微公司	1,245,407.25	2.51
23	603290	斯达半导	1,210,124.00	2.44
24	688981	中芯国际	1,193,323.62	2.40
25	002156	通富微电	1,193,011.00	2.40
26	002409	雅克科技	1,184,710.00	2.39
27	600118	中国卫星	1,138,846.00	2.30
28	601658	邮储银行	1,104,053.00	2.22
29	000729	燕京啤酒	1,100,320.00	2.22
30	603986	兆易创新	1,077,408.00	2.17
31	600702	舍得酒业	1,067,041.00	2.15
32	300118	东方日升	1,041,451.00	2.10
33	600160	巨化股份	1,032,803.00	2.08
34	603218	日月股份	1,002,200.00	2.02

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，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	186,511,674.60
卖出股票收入（成交）总额	193,602,508.77

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)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 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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 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 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 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除郑州银行外，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。

郑州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行间市场交易商协会的行政处罚。

截至本报告期末，郑州银行（002936）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，该股票属于中证 500 指数成分股，且在基本面类和价量类因子上的综合得分较高，因此本基金才继续持有郑州银行。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	8,613.29
2	应收清算款	224,889.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,279.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	255,782.48

### 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

本基金本报告期末持有的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

本基金本报告期末持有的积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 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，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

份额单位：份

份额级别	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
诺安中证 500 增强 A	2,686	16,774.74	-	-	45,056,945.58	100.00%
诺安中证 500 增强 C	776	2,786.41	-	-	2,162,255.07	100.00%
合计	3,462	13,639.28	-	-	47,219,200.65	100.00%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺安中证 500 增强 A	85,070.21	0.1888%
	诺安中证 500 增强 C	93.17	0.0043%
	合计	85,163.38	0.1804%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 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情况

项目	份额级别	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	诺安中证 500 增强 A	0
	诺安中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	诺安中证 500 增强 A	0~10
	诺安中证 500 增强 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
基金合同生效日（2019 年 01 月 15 日）基金 份额总额	146,602,731.80	-
本报告期期初基金份额总额	45,597,946.19	8,526,798.59
本报告期基金总申购份额	5,475,625.51	2,729,230.06
减：本报告期基金总赎回份额	6,016,626.12	9,093,773.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	45,056,945.58	2,162,255.07

## § 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，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

### 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，本基金管理人重大人事变动情况如下：

俞任君先生担任公司监事，赵星明先生、梅律吾先生不再担任公司监事。

本报告期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管理业务、本基金基金财产、本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，本基金的投资策略没有重大改变。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
安信证券	1	184,392,231.57	48.54%	133,004.15	42.22%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	195,479,888.93	51.46%	182,047.68	57.78%	-
中银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位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

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

本基金租用的证券公司交易单元本报告期末进行其他证券投资交易。

### 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关于旗下部分基金增加国金证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月20日
3	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023年01月20日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月03日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年03月14日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月15日
7	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金增聘基金经理的公告	《上海证券报》	2023年03月21日
8	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要 (更新) 的提示性公告	《上海证券报》	2023年03月23日
9	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年03月23日
10	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书 (更新) 2023 年第 1 期	基金管理人网站	2023年03月23日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、《上海证	2023年03月29日

	金增加南京证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
12	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月31日
13	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金变更基金经理的公告	《上海证券报》	2023年03月31日
14	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023年03月31日
15	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 2 期	基金管理人网站	2023年04月04日
16	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年04月04日
17	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《上海证券报》	2023年04月04日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大连网金基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月14日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月20日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年04月21日
21	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023年04月22日
22	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月22日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月27日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年05月15日
25	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金	基金管理人网站	2023年05月16日

	基金产品资料概要更新		
26	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 3 期	基金管理人网站	2023年05月16日
27	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《上海证券报》	2023年05月16日
28	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金变更基金经理的公告	《上海证券报》	2023年06月03日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2023年06月07日
30	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 4 期	基金管理人网站	2023年06月07日
31	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年06月07日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
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本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 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联接基金募集的

文件。

②原诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更为诺安中证 500 指数增强型证券投资基金的批复。

③《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》。

④《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》。

⑤《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》。

⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑦报告期内诺安中证 500 指数增强型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

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

诺安基金管理有限公司  
2023 年 08 月 31 日