

诺安中证 500 指数增强型证券投资基金  
2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 03 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 2022 年 03 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。

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9	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	17
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	审计报告	17
6.1	审计报告基本信息	17
6.2	审计报告的基本内容	17
§ 7	年度财务报表	19
7.1	资产负债表	19
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	47
8.1	期末基金资产组合情况	47
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	64

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	64
8.7	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 .....	64
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	64
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	64
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12	投资组合报告附注 .....	65
§ 9	基金份额持有人信息 .....	66
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.3	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 .....	66
§ 10	开放式基金份额变动 .....	67
§ 11	重大事件揭示 .....	67
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4	基金投资策略的改变 .....	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8	其他重大事件 .....	69
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
§ 13	备查文件目录 .....	74
13.1	备查文件目录 .....	74
13.2	存放地点 .....	75
13.3	查阅方式 .....	75

## § 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	48,268,720.94 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	45,168,803.83 份	3,099,917.11 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	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%。 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。 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。
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	许俊
	联系电话	0755-83026688	010-66596688
	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		李强	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	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
本期已实现收益	6,907,789.84	224,791.75	30,660,904.62	3,987.16	18,091,049.21	-
本期利润	8,631,341.14	295,325.86	28,737,653.31	5,382.32	20,290,374.81	-

加权平均基金份额本期利润	0.1474	0.2053	0.2516	0.0679	0.1326	-
本期加权平均净值利润率	14.05%	18.92%	29.01%	7.06%	19.10%	-
本期基金份额净值增长率	15.09%	14.67%	35.01%	7.40%	23.58%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C
期末可供分配利润	2,477,625.32	154,631.25	-6,193,036.28	-7,679.24	-47,647,598.69	-
期末可供分配基金份额利润	0.0549	0.0499	-0.0655	-0.0661	-0.3317	-
期末基金资产净值	51,321,660.17	3,506,573.95	93,340,918.84	114,621.23	105,026,321.53	-
期末基金份额净值	1.1362	1.1312	0.9872	0.9865	0.7312	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	诺安中证 500 增强 A	诺安中证 500 增强 C	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	92.02%	23.16%	66.84%	7.40%	23.58%	-

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	2.29%	0.83%	3.45%	0.72%	-1.16%	0.11%
过去六个月	7.31%	1.15%	7.75%	0.91%	-0.44%	0.24%
过去一年	15.09%	1.21%	14.90%	0.92%	0.19%	0.29%
自基金合同生效起至今	92.02%	1.43%	68.04%	1.31%	23.98%	0.12%

诺安中证 500 增强 C

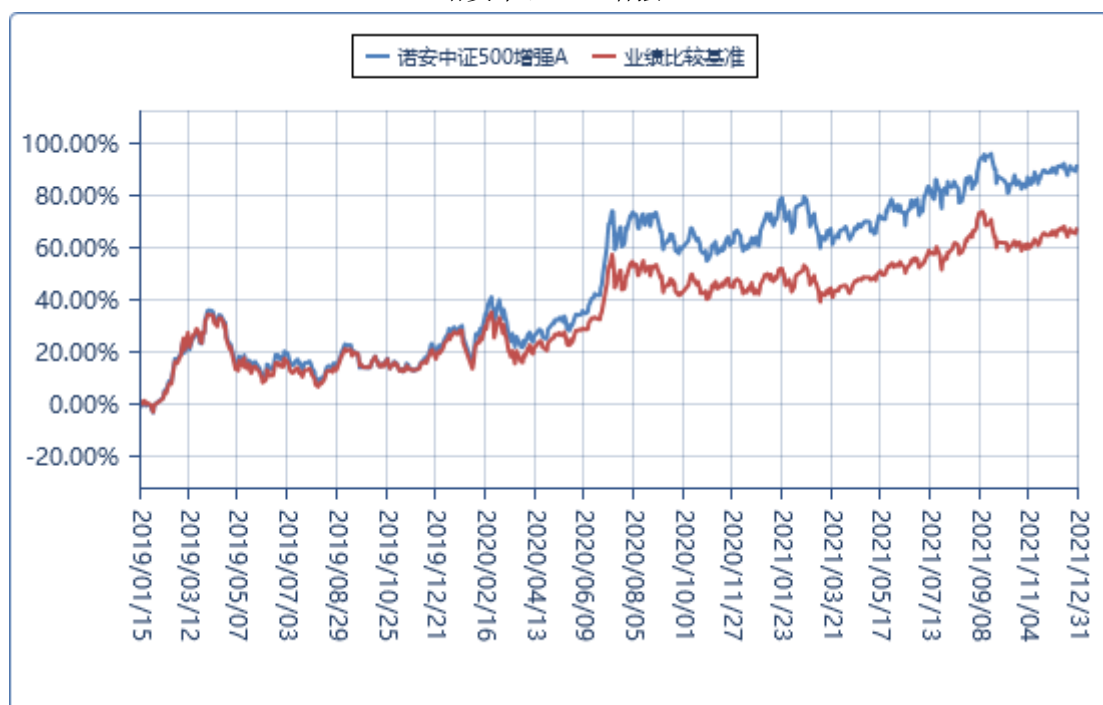
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去三个月	2.19%	0.83%	3.45%	0.72%	-1.26%	0.11%
过去六个月	7.11%	1.15%	7.75%	0.91%	-0.64%	0.24%
过去一年	14.67%	1.21%	14.90%	0.92%	-0.23%	0.29%
自基金合同生效起至今	23.16%	1.21%	19.49%	0.94%	3.67%	0.27%

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）×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。

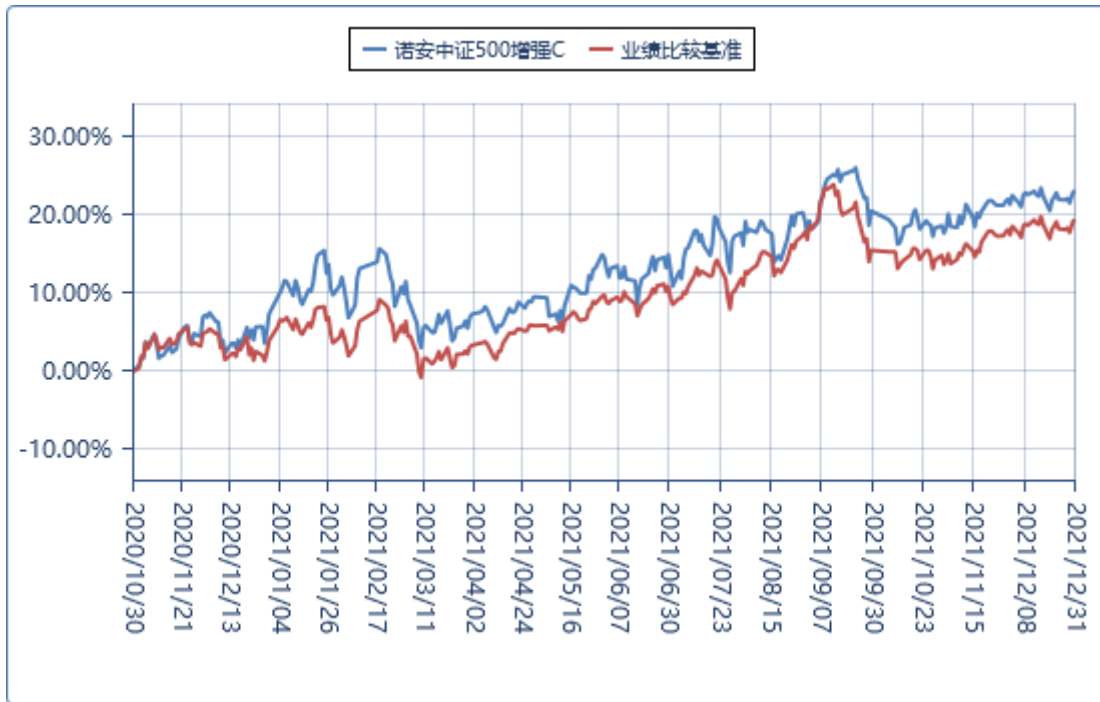
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

诺安中证 500 增强 A





诺安中证 500 增强 C

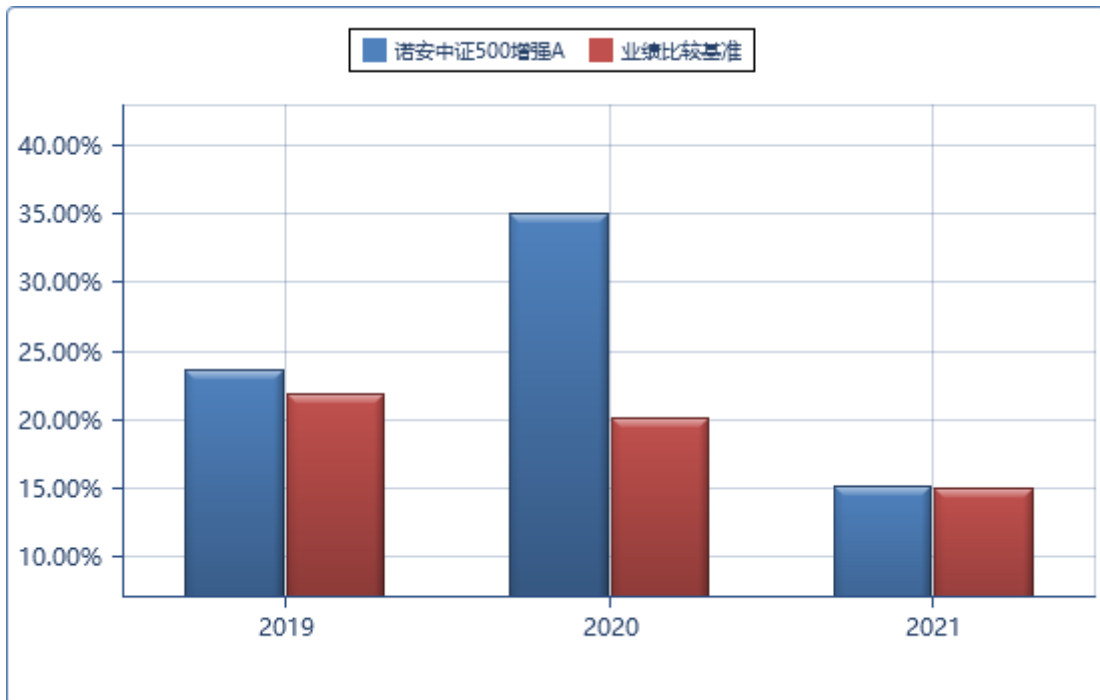


注：1、本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

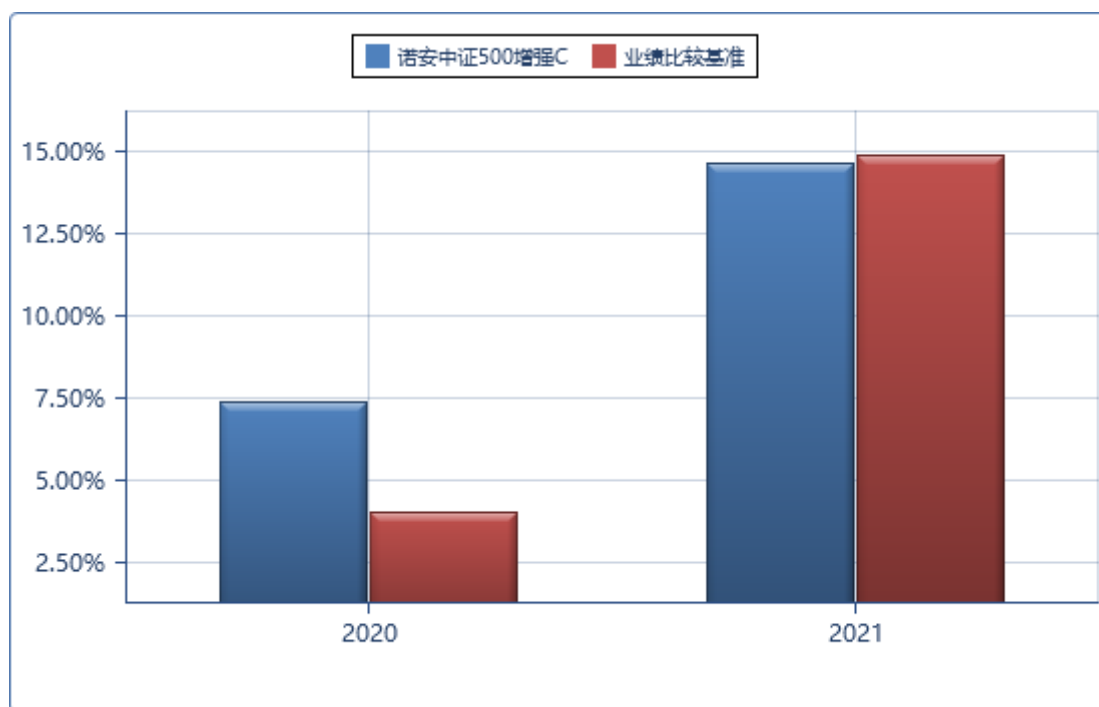
2、2019 年 01 月 15 日（含当日）起，原“诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”转型为本基金。

### 3.2.3 自基金合同生效基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安中证 500 增强 A



诺安中证 500 增强 C



注：1、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、本基金C类份额自2020年10月30日开始有申购数据，C类份额2020年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的基金合同于2019年01月15日生效，截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至2021年12月31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、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	2019年01月15日	-	24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

				<p>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，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</p>
--	--	--	--	--

					创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。
路龙凯	本基金基金经理	2019年02月20日	-	10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月起任诺安中证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，路龙凯先生的任职日期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，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《诺安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新

并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

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**

回顾2021年，由于受产业政策强化、部分房地产公司违约、新冠疫情以及上游通胀导致部分

公司盈利趋弱、美国货币政策收紧预期不断增强、中美关系积极进展不及预期等原因，A股全年表现不佳，股票市场一定程度上遵从业绩增长和成长驱动逻辑，行业分化较大。本年度我们主要采用量化选股的方法同时结合行业基本面的选择，在综合考虑行业景气度以及发展空间等因素后，适当增加某些行业的配置叠加行业内选股，在紧密跟踪指数的同时，努力获取稳健的超额收益。

#### 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1.1362元，本报告期诺安中证500增强A份额净值增长率为15.09%，同期业绩比较基准收益率为14.90%；截至本报告期末诺安中证500增强C份额净值为1.1312元，本报告期诺安中证500增强C份额净值增长率为14.67%，同期业绩比较基准收益率为14.90%。

#### 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2022年，2021年底中央经济工作会议对当前经济形势做出研判，指出当前经济面临需求收缩、供给冲击和预期转弱三重压力，并强调稳增长为明年经济首要任务。2020年的低基数效应消失，2022年国内GDP增长将回归潜在增速，全球经济复苏边际放缓，各地区复苏将不平衡。国内政策宽松，上市公司业绩增速前高后低有望触底、宏观政策边际宽松的预期支撑A股，全年行情仍以结构机会为主，总体呈现慢牛格局，市场不缺乏投资机会。目前我国正处于经济转型初期，此时各个行业所处的发展阶段差异较大，传统行业处于成熟期甚至衰退期，而新兴行业则基本处于发展期和成长期，未来仍有较大成长空间，建议关注以下方向：（1）业绩景气板块。国内经济复苏速度边际放缓，宜自下而上选择高业绩景气度的板块，比如地产及产业链、银行保险。（2）科技成长板块。在解决某些关键行业外围卡脖子的过程中，逐步实现国产替代的红利，科技板块有望重新迎来资金青睐，如芯片、军工、新能源等方向。我们将坚持在紧密跟踪指数的同时，力争持续获取稳健的超额收益。

风险方面，我们需时刻关注国内货币政策，上市公司业绩；全球新冠变种病毒对经济复苏的冲击；美国加息进程，美股震荡；中美关系；中国产业政策监管等。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以合规、监察、稽核为主导的工作体系和流程。合规管理部门依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度基金管理人合规管理、内部风险控制、监察稽核的具体情况如下：

合规管理方面，基金管理人积极开展法律法规的宣导及培训，督促各业务部门落实监管要求，持续完善公司内部制度建设，防范各类合规风险。风险控制方面，基金管理人对基金的日常投资运作进行持续的监督管理，加强基金流动性风险管理，确保基金资产的合规运作。监察稽核方面，根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，基金管理人在报告期内通过定期稽核和专项稽核等方式对公司内部控制制度、业务操作流程、基金销售、宣传推介、投资运作、后台保障、反洗钱等公司业务环节和工作岗位进行了重点监控与稽核。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由合规管理部门跟踪问题的处理情况。同时，基金管理人督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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、基金运营部、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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 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”、“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 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
报告编号	安永华明（2022）审字第 60469052_H32 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了诺安中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报

	<p>表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的诺安中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于诺安中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>诺安中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估诺安中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督诺安中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风</p>

	<p>险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对诺安中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤, 黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,244,559.08	5,635,764.52
结算备付金		591,034.85	695,088.84
存出保证金		13,266.76	92,942.34
交易性金融资产	7.4.7.2	51,680,259.14	88,164,231.77
其中：股票投资		51,680,259.14	88,164,231.77
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,537,580.63
应收利息	7.4.7.5	558.43	876.94
应收股利		-	-
应收申购款		72,950.21	39,848.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		55,602,628.47	98,166,333.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,543,917.69
应付赎回款		401,483.25	469,301.65
应付管理人报酬		46,638.82	79,341.63
应付托管费		6,995.83	11,901.25
应付销售服务费		1,198.52	46.87
应付交易费用	7.4.7.7	157,344.24	439,859.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,733.69	166,424.79
负债合计		774,394.35	4,710,793.82
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	48,268,720.94	94,671,423.33
未分配利润	7.4.7.10	6,559,513.18	-1,215,883.26
所有者权益合计		54,828,234.12	93,455,540.07
负债和所有者权益总计		55,602,628.47	98,166,333.89

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，诺安中证 500 增强 A 基金份额净值 1.1362 元，基金份额总额 45,168,803.83 份；诺安中证 500 增强 C 基金份额净值 1.1312 元，基金份额总额 3,099,917.11 份。诺安中证 500 增强份额总额合计为 48,268,720.94 份。

## 7.2 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01 日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31 日
<b>一、收入</b>		11,177,968.67	33,387,513.20
1. 利息收入		20,817.71	41,558.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	20,758.83	41,558.15
债券利息收入		58.88	-
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）		9,285,176.91	35,117,187.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,762,065.06	34,155,139.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-39.80	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	523,151.65	962,047.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,794,085.41	-1,921,856.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	77,888.64	150,623.90
<b>减：二、费用</b>		2,251,301.67	4,644,477.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	634,877.80	989,901.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	95,231.67	148,485.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,110.09	51.54
4. 交易费用	7.4.7.19	1,195,979.40	3,143,177.85
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	7.4.7.20	319,102.71	362,861.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,926,667.00	28,743,035.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,926,667.00	28,743,035.63

### 7.3 所有者权益（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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	所有者权 益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	94,671,423.3 3	-1,215,883. 26	93,455,540 .07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,926,667.0 0	8,926,667. 00
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）	-46,402,702. 39	-1,151,270. 56	-47,553,97 2.95
其中：1. 基金申购款	41,187,255.0 3	3,620,634.6 3	44,807,889 .66
2. 基金赎回款	-87,589,957. 42	-4,771,905. 19	-92,361,86 2.61
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）	48,268,720.9 4	6,559,513.1 8	54,828,234 .12
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	所有者权 益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	143,628,200. 44	-38,601,878 .91	105,026,32 1.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,743,035. 63	28,743,035 .63
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）	-48,956,777. 11	8,642,960.0 2	-40,313,81 7.09
其中：1. 基金申购款	80,398,758.0 5	-6,616,240. 79	73,782,517 .26
2. 基金赎回款	-129,355,535 .16	15,259,200. 81	-114,096,3 34.35
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）	94,671,423.3 3	-1,215,883. 26	93,455,540 .07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

齐斌

田冲

薛有为

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

诺安中证 500 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。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,在具体会计估值核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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2号《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。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产的分类



本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、存托凭证、债券、资产支持证券和衍生工具等投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### (2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件时的金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

## 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，只

有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### **7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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六次，若《诺安中证500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13 号《中国证监会关于证券投资基金估值

业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 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。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。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。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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	3,244,559.08	5,635,764.52

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	3,244,559.08	5,635,764.52

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,007,280.55	51,680,259.14	1,672,978.59
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	50,007,280.55	51,680,259.14	1,672,978.59
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,285,338.59	88,164,231.77	-121,106.82
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	88,285,338.59	88,164,231.77	-121,106.82

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	286.53	522.44
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	265.90	312.70
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.00	41.80
合计	558.43	876.94

注：此处“其他”列示的是应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	157,344.24	439,859.94
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	157,344.24	439,859.94

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	733.69	1,424.79
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	110,000.00	115,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00



合计	160,733.69	166,424.79
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

诺安中证 500 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,555,239.24	94,555,239.24
本期申购	31,771,349.38	31,771,349.38
本期赎回（以“-”号填列）	-81,157,784.79	-81,157,784.79
本期末	45,168,803.83	45,168,803.83

诺安中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,184.09	116,184.09
本期申购	9,415,905.65	9,415,905.65
本期赎回（以“-”号填列）	-6,432,172.63	-6,432,172.63
本期末	3,099,917.11	3,099,917.11

注：此处申购含红利再投资、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.10 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
上年度末	-6,193,036.28	4,978,715.88	-1,214,320.40
本期利润	6,907,789.84	1,723,551.30	8,631,341.14
本期基金份额交易产生的变动数	1,762,871.76	-3,027,036.16	-1,264,164.40
其中：基金申购款	-74,578.44	2,936,894.23	2,862,315.79
基金赎回款	1,837,450.20	-5,963,930.39	-4,126,480.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,477,625.32	3,675,231.02	6,152,856.34

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
上年度末	-7,679.24	6,116.38	-1,562.86
本期利润	224,791.75	70,534.11	295,325.86
本期基金份额交易产生的变动数	-62,481.26	175,375.10	112,893.84
其中：基金申购款	-56,464.10	814,782.94	758,318.84
基金赎回款	-6,017.16	-639,407.84	-645,425.00

本期已分配利润	-	-	-
本期末	154,631.25	252,025.59	406,656.84

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	14,168.37	28,643.96
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	5,915.42	11,803.09
其他	675.04	1,111.10
合计	20,758.83	41,558.15

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。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	443,329,253.93	1,079,938,759.49
减：卖出股票成本总额	434,567,188.87	1,045,783,620.02
买卖股票差价收入	8,762,065.06	34,155,139.47

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
债券投资收益—买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-39.80	-
债券投资收益—赎回差价收入	-	-
债券投资收益—申购差价收入	-	-
合计	-39.80	-

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成交总额	305,625.74	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成本总额	299,019.90	-
减：应收利息总额	6,645.64	-
买卖债券差价收入	-39.80	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
股票投资产生的股利收益	523,151.65	962,047.83
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	523,151.65	962,047.83

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	1,794,085.41	-1,921,856.15
--股票投资	1,794,085.41	-1,921,856.15
--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	1,794,085.41	-1,921,856.15

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	74,144.86	106,249.58
基金转换费收入	3,743.78	44,374.32
合计	77,888.64	150,623.90

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,195,979.40	3,143,177.85
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,195,979.40	3,143,177.85

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
汇划手续费	5,102.71	7,861.46
律师费	4,000.00	-
合计	319,102.71	362,861.46

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市捷隆投资有限公司	基金管理人的股东
大恒新纪元科技股份有限公司	基金管理人的股东
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司
诺安国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	634,877.80	989,901.46
其中：支付销售机构的客户维护费	228,837.29	432,142.29

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	95,231.67	148,485.26

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

#### 7.4.10.2.3 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		
	2021年01月01日至2021年12月31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	-	437.51	437.51
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	437.51	437.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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	-	51.54	51.54
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	51.54	51.54

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为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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 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。

#### 7.4.10.5.2 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。

### 7.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,244,559.08	14,168.37	5,635,764.52	28,643.96

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

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.10.8.1 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无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 2021 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	16.53	16.53	296	4,892.88	4,892.88	-

注：1、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

2、上述流通受限证券的可流通日期以上市公司公告为准。

##### 7.4.12.2 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
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项	30.12	2022年01月04日	31.00	3,300	90,289.83	99,396.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

##### 7.4.12.4 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。



## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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2021年12月31日，本基金未持有债券和资产支持证券（2020年12月31日：同）。

### 7.4.13.3 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 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的其他金融负债的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。

#### 7.4.13.3.1 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发行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 7.4.12。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 2021 年 12 月 31 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 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	3,244,559.08	-	-	-	-	3,244,559.08
结算备付金	591,034.85	-	-	-	-	591,034.85
存出保证金	13,266.76	-	-	-	-	13,266.76
交易性金融资产	-	-	-	-	51,680,259.14	51,680,259.14
应收利息	-	-	-	-	558.43	558.43
应收申购款	538.81	-	-	-	72,411.40	72,950.21
资产总计	3,849,399.50	-	-	-	51,753,228.97	55,602,628.47
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	401,483.25	401,483.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	46,638.82	46,638.82

应付托管费	-	-	-	-	6,995.83	6,995.83
应付销售服务费	-	-	-	-	1,198.52	1,198.52
应付交易费用	-	-	-	-	157,344.24	157,344.24
其他负债	-	-	-	-	160,733.69	160,733.69
负债总计	-	-	-	-	774,394.35	774,394.35
利率敏感度缺口	3,849,399.50	-	-	-	-50,978,834.62	54,828,234.12
上年度末 2020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	5,635,764.52	-	-	-	-	5,635,764.52
结算备付金	695,088.84	-	-	-	-	695,088.84
存出保证金	92,942.34	-	-	-	-	92,942.34
交易性金融资产	-	-	-	-	88,164,231.77	88,164,231.77
应收证券清算款	-	-	-	-	3,537,580.63	3,537,580.63
应收利息	-	-	-	-	876.94	876.94
应收申购款	70.00	-	-	-	39,778.85	39,848.85
资产总计	6,423,865.70	-	-	-	-91,742,468.19	98,166,333.89
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	3,543,917.69	3,543,917.69
应付赎回款	-	-	-	-	469,301.65	469,301.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	79,341.63	79,341.63
应付托管费	-	-	-	-	11,901.25	11,901.25
应付销售服务费	-	-	-	-	46.87	46.87
应付交易费用	-	-	-	-	439,859.94	439,859.94
其他负债	-	-	-	-	166,424.79	166,424.79
负债总计	-	-	-	-	4,710,793.82	4,710,793.82
利率敏感度缺口	6,423,865.70	-	-	-	-87,031,674.37	93,455,540.07

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	51,680,259.14	94.26	88,164,231.77	94.34
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	51,680,259.14	94.26	88,164,231.77	94.34

#### 7.4.13.4.3.2 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(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	2,402,957.20	4,291,925.44
	业绩比较基准下降 5%	-2,402,957.20	-4,291,925.44

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值层次

公允价值计量或披露的金融工具所属的公允价值层次，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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 51,575,970.26 元，属于第二层次的余额为 104,288.88 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 87,615,852.36 元，属于第二层次的余额为 548,379.41 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部修订印发的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》及《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以上统称新金融工具相关会计准则)，以及财政部、银保监会发布的《关于进一步贯彻落实

新金融工具相关会计准则的通知》，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	51,680,259.14	92.95
	其中：股票	51,680,259.14	92.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,835,593.93	6.90
8	其他各项资产	86,775.40	0.16
9	合计	55,602,628.47	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	618,367.00	1.13
B	采矿业	2,086,650.00	3.81
C	制造业	30,825,606.74	56.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,918,718.00	3.50
E	建筑业	1,046,248.00	1.91
F	批发和零售业	1,681,491.00	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,287,630.00	2.35
H	住宿和餐饮业	314,212.00	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,477,060.32	8.17
J	金融业	3,410,625.20	6.22
K	房地产业	1,429,650.00	2.61
L	租赁和商务服务业	647,535.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	189,085.00	0.34

N	水利、环境和公共设施管理业	462,717.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	107,424.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	682,522.00	1.24
S	综合	357,975.00	0.65
	合计	51,543,516.26	94.01

### 8.2.2 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	20,839.20	0.04
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	115,903.68	0.21
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	136,742.88	0.25

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000733	振华科技	2,700	335,556.00	0.61
2	002340	格林美	31,900	330,165.00	0.60
3	000723	美锦能源	19,200	311,616.00	0.57
4	601615	明阳智能	11,800	307,980.00	0.56
5	600157	永泰能源	167,000	303,940.00	0.55



6	600522	中天科技	17,700	300,192.00	0.55
7	600885	宏发股份	3,900	291,096.00	0.53
8	002384	东山精密	10,300	279,130.00	0.51
9	600884	杉杉股份	8,500	278,545.00	0.51
10	601117	中国化学	22,900	274,800.00	0.50
11	002385	大北农	24,900	261,201.00	0.48
12	300285	国瓷材料	6,100	259,677.00	0.47
13	002013	中航机电	14,200	258,156.00	0.47
14	300751	迈为股份	400	256,920.00	0.47
15	000009	中国宝安	17,300	249,639.00	0.46
16	300037	新宙邦	2,200	248,600.00	0.45
17	002268	卫士通	4,400	246,136.00	0.45
18	300088	长信科技	18,500	245,680.00	0.45
19	688099	晶晨股份	1,856	241,651.20	0.44
20	605358	立昂微	2,000	240,020.00	0.44
21	600563	法拉电子	1,000	232,400.00	0.42
22	688005	容百科技	2,000	231,160.00	0.42
23	600765	中航重机	4,500	227,205.00	0.41
24	600256	广汇能源	34,700	226,938.00	0.41
25	600862	中航高科	6,300	225,288.00	0.41
26	600141	兴发集团	5,900	223,492.00	0.41
27	002180	纳思达	4,600	219,696.00	0.40
28	002185	华天科技	16,900	214,799.00	0.39
29	600487	亨通光电	14,200	214,704.00	0.39
30	300363	博腾股份	2,400	214,680.00	0.39
31	603456	九洲药业	3,800	213,788.00	0.39
32	000988	华工科技	7,600	211,736.00	0.39
33	300253	卫宁健康	12,400	207,824.00	0.38
34	601636	旗滨集团	12,100	206,910.00	0.38
35	600392	盛和资源	10,500	206,010.00	0.38
36	300699	光威复材	2,400	202,752.00	0.37
37	002028	思源电气	4,100	201,761.00	0.37
38	300223	北京君正	1,500	201,000.00	0.37
39	600754	锦江酒店	3,400	199,240.00	0.36
40	600418	江淮汽车	11,400	198,360.00	0.36
41	601168	西部矿业	14,400	195,984.00	0.36
42	603613	国联股份	1,800	193,500.00	0.35
43	000630	铜陵有色	55,400	192,792.00	0.35
44	002138	顺络电子	4,900	187,082.00	0.34
45	600516	方大炭素	17,200	186,104.00	0.34
46	000998	隆平高科	8,000	186,080.00	0.34

47	002797	第一创业	25,300	185,196.00	0.34
48	300136	信维通信	7,300	184,836.00	0.34
49	603589	口子窖	2,600	184,262.00	0.34
50	300724	捷佳伟创	1,600	182,880.00	0.33
51	300474	景嘉微	1,200	182,640.00	0.33
52	603267	鸿远电子	1,000	179,440.00	0.33
53	603893	瑞芯微	1,300	177,970.00	0.32
54	600038	中直股份	2,200	176,660.00	0.32
55	000728	国元证券	22,900	176,330.00	0.32
56	002353	杰瑞股份	4,400	176,000.00	0.32
57	600875	东方电气	8,200	175,644.00	0.32
58	601689	拓普集团	3,300	174,900.00	0.32
59	002080	中材科技	5,100	173,502.00	0.32
60	300058	蓝色光标	16,100	172,753.00	0.32
61	300146	汤臣倍健	6,400	172,544.00	0.31
62	002212	天融信	9,000	172,530.00	0.31
63	600233	圆通速递	10,300	171,804.00	0.31
64	300308	中际旭创	4,000	170,000.00	0.31
65	603444	吉比特	400	168,740.00	0.31
66	000519	中兵红箭	6,300	168,021.00	0.31
67	603605	珀莱雅	800	166,648.00	0.30
68	688065	凯赛生物	900	165,852.00	0.30
69	002673	西部证券	20,200	163,014.00	0.30
70	002439	启明星辰	5,700	162,621.00	0.30
71	002223	鱼跃医疗	4,300	162,540.00	0.30
72	600733	北汽蓝谷	16,200	162,324.00	0.30
73	300763	锦浪科技	700	162,085.00	0.30
74	000547	航天发展	9,700	161,990.00	0.30
75	000636	风华高科	5,400	160,920.00	0.29
76	600188	兖矿能源	6,800	160,004.00	0.29
77	600705	中航产融	40,200	159,594.00	0.29
78	600482	中国动力	8,100	159,570.00	0.29
79	000932	华菱钢铁	31,200	159,432.00	0.29
80	688208	道通科技	2,000	158,800.00	0.29
81	002444	巨星科技	5,200	158,652.00	0.29
82	603077	和邦生物	46,500	158,565.00	0.29
83	600699	均胜电子	7,200	158,184.00	0.29
84	600739	辽宁成大	8,100	158,112.00	0.29
85	600529	山东药玻	3,600	158,040.00	0.29
86	000739	普洛药业	4,500	157,905.00	0.29
87	000039	中集集团	9,200	157,872.00	0.29

88	000807	云铝股份	14,100	157,497.00	0.29
89	300418	昆仑万维	6,800	157,420.00	0.29
90	688002	睿创微纳	2,000	157,140.00	0.29
91	300296	利亚德	15,300	156,825.00	0.29
92	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.28
93	603290	斯达半导	400	152,400.00	0.28
94	002465	海格通信	13,900	151,788.00	0.28
95	002507	涪陵榨菜	4,000	151,200.00	0.28
96	600201	生物股份	9,100	148,785.00	0.27
97	000960	锡业股份	7,600	148,428.00	0.27
98	002557	洽洽食品	2,400	147,264.00	0.27
99	601016	节能风电	22,600	147,126.00	0.27
100	002273	水晶光电	8,400	146,076.00	0.27
101	600642	申能股份	19,800	145,926.00	0.27
102	002078	太阳纸业	12,700	145,923.00	0.27
103	000738	航发控制	4,800	145,344.00	0.27
104	600521	华海药业	6,700	145,122.00	0.26
105	002299	圣农发展	6,000	145,020.00	0.26
106	600549	厦门钨业	6,400	144,832.00	0.26
106	600732	爱旭股份	6,200	144,832.00	0.26
108	002985	北摩高科	1,200	144,552.00	0.26
109	600879	航天电子	17,500	144,200.00	0.26
110	600177	雅戈尔	20,900	144,001.00	0.26
111	601198	东兴证券	12,200	141,886.00	0.26
112	600637	东方明珠	14,900	140,805.00	0.26
113	600027	华电国际	26,300	140,705.00	0.26
114	600988	赤峰黄金	9,400	140,060.00	0.26
115	600704	物产中大	23,500	139,120.00	0.25
116	600372	中航电子	6,200	138,818.00	0.25
117	000623	吉林敖东	7,500	138,525.00	0.25
118	603127	昭衍新药	1,200	138,516.00	0.25
119	002030	达安基因	6,900	138,414.00	0.25
120	300357	我武生物	2,400	137,520.00	0.25
121	601128	常熟银行	20,700	136,827.00	0.25
122	002156	通富微电	7,000	136,010.00	0.25
123	601997	贵阳银行	20,600	134,106.00	0.24
124	600497	驰宏锌锗	26,700	133,233.00	0.24
125	002603	以岭药业	6,700	131,320.00	0.24
126	600369	西南证券	24,800	131,192.00	0.24
127	002739	万达电影	8,400	130,032.00	0.24
127	600039	四川路桥	10,800	130,032.00	0.24

129	002508	老板电器	3,600	129,672.00	0.24
130	600170	上海建工	36,000	129,600.00	0.24
131	300383	光环新网	8,700	129,108.00	0.24
132	600316	洪都航空	3,300	128,898.00	0.24
133	300070	碧水源	17,900	128,701.00	0.23
134	300618	寒锐钴业	1,600	128,288.00	0.23
135	000983	山西焦煤	15,500	128,185.00	0.23
136	002092	中泰化学	13,400	127,836.00	0.23
137	600166	福田汽车	37,100	127,624.00	0.23
138	600859	王府井	4,700	126,900.00	0.23
139	600580	卧龙电驱	6,900	126,201.00	0.23
140	000750	国海证券	30,700	126,177.00	0.23
141	600867	通化东宝	11,500	126,040.00	0.23
142	600160	巨化股份	9,700	125,227.00	0.23
143	002131	利欧股份	50,900	125,214.00	0.23
144	600153	建发股份	13,800	125,166.00	0.23
145	002926	华西证券	12,700	125,095.00	0.23
146	603198	迎驾贡酒	1,800	125,010.00	0.23
147	300115	长盈精密	6,300	124,992.00	0.23
148	002373	千方科技	8,300	124,085.00	0.23
149	002372	伟星新材	5,100	124,032.00	0.23
150	300017	网宿科技	18,400	123,096.00	0.22
151	002422	科伦药业	6,500	123,045.00	0.22
152	002936	郑州银行	38,720	122,355.20	0.22
153	002002	鸿达兴业	20,100	121,806.00	0.22
154	603707	健友股份	2,900	121,800.00	0.22
155	600008	首创环保	35,500	121,055.00	0.22
156	300251	光线传媒	9,400	120,790.00	0.22
157	300009	安科生物	9,200	120,428.00	0.22
158	000825	太钢不锈	17,100	120,384.00	0.22
159	600066	宇通客车	10,900	120,118.00	0.22
160	000887	中鼎股份	5,500	119,955.00	0.22
161	600118	中国卫星	4,400	119,460.00	0.22
162	000021	深科技	7,500	118,800.00	0.22
163	000629	攀钢钒钛	30,500	118,645.00	0.22
164	603218	日月股份	3,600	118,620.00	0.22
165	600171	上海贝岭	4,600	118,036.00	0.22
166	002065	东华软件	15,100	117,780.00	0.21
167	000975	银泰黄金	13,400	117,652.00	0.21
168	600803	新奥股份	6,400	117,504.00	0.21
169	002249	大洋电机	13,300	116,907.00	0.21

170	603156	养元饮品	4,100	116,481.00	0.21
171	000050	深天马A	8,900	115,878.00	0.21
172	000027	深圳能源	14,300	115,830.00	0.21
173	600535	天士力	7,300	115,705.00	0.21
174	300630	普利制药	2,100	115,584.00	0.21
175	002266	浙富控股	16,200	115,344.00	0.21
176	600258	首旅酒店	4,400	114,972.00	0.21
177	600348	华阳股份	9,700	114,945.00	0.21
178	300001	特锐德	4,600	114,402.00	0.21
179	002500	山西证券	17,300	114,180.00	0.21
180	300026	红日药业	14,500	113,535.00	0.21
181	002572	索菲亚	5,100	113,220.00	0.21
182	601005	重庆钢铁	54,000	112,860.00	0.21
183	300024	机器人	10,100	112,817.00	0.21
184	000513	丽珠集团	2,800	112,588.00	0.21
185	600909	华安证券	20,800	112,528.00	0.21
186	000997	新大陆	6,200	112,344.00	0.20
187	300168	万达信息	8,600	111,972.00	0.20
188	000970	中科三环	6,900	110,745.00	0.20
189	002203	海亮股份	8,900	110,627.00	0.20
190	600998	九州通	7,500	110,400.00	0.20
191	000012	南玻A	11,100	110,223.00	0.20
192	600536	中国软件	2,200	109,846.00	0.20
193	600271	航天信息	8,200	109,798.00	0.20
194	601699	潞安环能	9,700	109,707.00	0.20
195	000878	云南铜业	8,200	109,634.00	0.20
196	600131	国网信通	5,000	109,250.00	0.20
197	600315	上海家化	2,700	109,107.00	0.20
198	002127	南极电商	15,800	109,020.00	0.20
199	600673	东阳光	12,200	108,336.00	0.20
200	603712	七一二	2,500	108,250.00	0.20
201	002506	协鑫集成	28,300	107,540.00	0.20
202	000656	金科股份	24,000	107,520.00	0.20
203	300244	迪安诊断	3,200	107,424.00	0.20
204	600415	小商品城	22,100	107,185.00	0.20
205	600801	华新水泥	5,500	106,150.00	0.19
206	000999	华润三九	3,100	106,144.00	0.19
207	002152	广电运通	8,900	105,910.00	0.19
208	002019	亿帆医药	6,000	105,720.00	0.19
209	002221	东华能源	8,300	104,497.00	0.19
210	000400	许继电气	4,000	104,400.00	0.19

211	002191	劲嘉股份	6,900	104,397.00	0.19
212	002056	横店东磁	5,500	103,785.00	0.19
213	600863	内蒙华电	26,200	103,228.00	0.19
214	600208	新湖中宝	34,600	103,108.00	0.19
215	300212	易华录	2,900	102,515.00	0.19
216	600970	中材国际	8,900	101,727.00	0.19
217	002745	木林森	6,700	101,371.00	0.18
218	002831	裕同科技	3,000	101,070.00	0.18
219	601872	招商轮船	24,400	100,040.00	0.18
220	688521	芯原股份	1,292	99,949.12	0.18
221	002683	广东宏大	3,300	99,396.00	0.18
222	000686	东北证券	11,300	99,214.00	0.18
223	000060	中金岭南	20,200	99,182.00	0.18
224	600498	烽火通信	5,500	98,890.00	0.18
225	002511	中顺洁柔	5,900	98,589.00	0.18
226	002294	信立泰	3,600	98,352.00	0.18
227	600839	四川长虹	29,700	98,307.00	0.18
228	002505	鹏都农牧	25,700	98,174.00	0.18
229	002153	石基信息	3,400	97,716.00	0.18
230	600155	华创阳安	9,800	97,608.00	0.18
231	000690	宝新能源	16,400	97,088.00	0.18
232	002250	联化科技	5,400	97,038.00	0.18
233	603858	步长制药	4,600	97,014.00	0.18
234	688006	杭可科技	900	96,822.00	0.18
235	000729	燕京啤酒	11,400	96,558.00	0.18
236	600390	五矿资本	18,100	96,292.00	0.18
237	600667	太极实业	11,900	96,152.00	0.18
238	002701	奥瑞金	13,700	95,900.00	0.17
239	601992	金隅集团	33,700	95,708.00	0.17
240	000401	冀东水泥	8,000	95,680.00	0.17
241	603568	伟明环保	2,600	94,978.00	0.17
242	600728	佳都科技	11,400	94,962.00	0.17
243	600511	国药股份	3,000	94,590.00	0.17
244	002195	二三四五	40,300	94,302.00	0.17
245	600517	国网英大	12,900	94,041.00	0.17
246	300463	迈克生物	3,200	93,408.00	0.17
247	600895	张江高科	6,200	93,372.00	0.17
248	300315	掌趣科技	19,200	93,312.00	0.17
249	002004	华邦健康	12,800	92,672.00	0.17
250	600380	健康元	7,200	92,448.00	0.17
251	600216	浙江医药	5,400	92,232.00	0.17

252	600282	南钢股份	24,900	92,130.00	0.17
253	601778	晶科科技	10,800	92,124.00	0.17
254	603225	新凤鸣	6,200	92,070.00	0.17
255	601866	中远海发	28,300	91,975.00	0.17
256	000598	兴蓉环境	14,500	91,640.00	0.17
257	000537	广宇发展	3,800	91,580.00	0.17
258	002368	太极股份	3,300	90,882.00	0.17
259	002966	苏州银行	13,400	90,718.00	0.17
260	002939	长城证券	7,000	90,650.00	0.17
261	300072	三聚环保	11,400	90,402.00	0.16
262	002670	国盛金控	9,400	90,240.00	0.16
263	002174	游族网络	5,900	89,916.00	0.16
264	002396	星网锐捷	3,800	89,566.00	0.16
265	000540	中天金融	33,900	89,496.00	0.16
266	600985	淮北矿业	8,000	89,440.00	0.16
267	002595	豪迈科技	3,200	88,832.00	0.16
268	000581	威孚高科	4,100	88,314.00	0.16
269	000930	中粮科技	8,100	88,047.00	0.16
270	603866	桃李面包	3,100	88,040.00	0.16
271	300182	捷成股份	13,900	87,987.00	0.16
272	600528	中铁工业	10,700	87,847.00	0.16
273	600297	广汇汽车	32,700	87,309.00	0.16
274	002430	杭氧股份	2,900	87,029.00	0.16
275	600409	三友化工	10,000	87,000.00	0.16
276	002958	青农商行	22,500	86,850.00	0.16
277	600827	百联股份	6,500	86,645.00	0.16
278	300482	万孚生物	2,200	86,636.00	0.16
279	002048	宁波华翔	4,000	86,520.00	0.16
280	002382	蓝帆医疗	5,300	86,337.00	0.16
281	603638	艾迪精密	2,700	86,184.00	0.16
282	002010	传化智联	9,900	86,130.00	0.16
283	002532	天山铝业	10,500	85,575.00	0.16
284	600567	山鹰国际	26,000	85,540.00	0.16
285	600764	中国海防	2,100	85,386.00	0.16
286	603885	吉祥航空	4,800	85,200.00	0.16
287	600755	厦门国贸	11,700	84,357.00	0.15
288	600718	东软集团	6,200	84,072.00	0.15
289	000778	新兴铸管	19,400	84,002.00	0.15
290	000709	河钢股份	34,100	83,886.00	0.15
291	002183	怡亚通	12,600	83,412.00	0.15
292	600598	北大荒	5,700	82,992.00	0.15

293	000883	湖北能源	15,800	82,792.00	0.15
294	002075	沙钢股份	14,200	82,786.00	0.15
295	601179	中国西电	14,900	82,695.00	0.15
296	600325	华发股份	13,700	82,474.00	0.15
297	600967	内蒙一机	6,900	82,455.00	0.15
298	002690	美亚光电	2,200	82,412.00	0.15
299	600820	隧道股份	15,200	81,776.00	0.15
300	002925	盈趣科技	2,400	81,672.00	0.15
301	600158	中体产业	5,400	81,648.00	0.15
302	600737	中粮糖业	8,600	80,840.00	0.15
303	000990	诚志股份	5,100	80,682.00	0.15
304	601717	郑煤机	6,900	79,971.00	0.15
305	002434	万里扬	5,400	79,596.00	0.15
306	603927	中科软	2,900	79,344.00	0.14
307	002281	光迅科技	3,400	79,186.00	0.14
308	600707	彩虹股份	11,600	79,112.00	0.14
309	603883	老百姓	1,600	79,008.00	0.14
310	600022	山东钢铁	44,000	78,760.00	0.14
311	002128	电投能源	5,300	78,705.00	0.14
312	601106	中国一重	22,200	77,256.00	0.14
313	600663	陆家嘴	7,100	77,106.00	0.14
314	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.14
315	600435	北方导航	7,200	76,896.00	0.14
316	002146	荣盛发展	17,500	76,125.00	0.14
317	002124	天邦股份	11,800	75,992.00	0.14
318	601577	长沙银行	9,700	75,757.00	0.14
319	600572	康恩贝	15,100	75,500.00	0.14
320	601456	国联证券	5,400	75,438.00	0.14
321	600060	海信视像	5,600	75,320.00	0.14
322	300271	华宇软件	5,900	74,930.00	0.14
323	600259	广晟有色	1,500	73,860.00	0.13
324	000877	天山股份	4,800	73,488.00	0.13
325	000987	越秀金控	8,400	73,080.00	0.13
326	601118	海南橡胶	13,800	72,864.00	0.13
327	601880	辽港股份	42,100	72,833.00	0.13
328	000898	鞍钢股份	19,400	72,750.00	0.13
329	002390	信邦制药	9,800	72,716.00	0.13
330	603228	景旺电子	2,100	72,513.00	0.13
331	600329	中新药业	2,300	72,243.00	0.13
332	600811	东方集团	24,000	72,240.00	0.13
333	600597	光明乳业	4,900	71,148.00	0.13



334	002429	兆驰股份	14,600	70,956.00	0.13
335	000488	晨鸣纸业	9,800	70,952.00	0.13
336	600808	马钢股份	19,200	70,848.00	0.13
337	688088	虹软科技	1,600	70,496.00	0.13
338	002155	湖南黄金	6,800	70,448.00	0.13
338	603650	彤程新材	1,400	70,448.00	0.13
340	300166	东方国信	6,500	70,200.00	0.13
341	688321	微芯生物	2,000	70,020.00	0.13
342	001914	招商积余	3,400	68,884.00	0.13
343	600037	歌华有线	7,900	68,572.00	0.13
344	688029	南微医学	322	68,479.74	0.12
345	000559	万向钱潮	10,700	68,159.00	0.12
346	600782	新钢股份	12,900	68,112.00	0.12
347	002085	万丰奥威	12,400	68,076.00	0.12
348	600908	无锡银行	12,000	68,040.00	0.12
349	601200	上海环境	5,400	67,986.00	0.12
350	600507	方大特钢	8,700	67,860.00	0.12
351	002110	三钢闽光	9,900	67,320.00	0.12
352	600398	海澜之家	10,500	67,305.00	0.12
353	002705	新宝股份	2,700	66,690.00	0.12
354	600167	联美控股	7,400	66,674.00	0.12
355	600021	上海电力	5,200	66,664.00	0.12
356	600026	中远海能	11,200	66,304.00	0.12
357	002081	金螳螂	10,900	66,272.00	0.12
358	601000	唐山港	23,900	65,725.00	0.12
359	600064	南京高科	7,000	65,380.00	0.12
360	603000	人民网	4,500	64,890.00	0.12
361	601991	大唐发电	20,000	64,800.00	0.12
362	600446	金证股份	4,500	64,440.00	0.12
363	600195	中牧股份	4,900	64,043.00	0.12
364	000528	柳工	8,300	63,993.00	0.12
365	601611	中国核建	6,400	63,808.00	0.12
366	601718	际华集团	21,300	63,474.00	0.12
367	000961	中南建设	15,200	62,928.00	0.11
368	000685	中山公用	7,100	62,835.00	0.11
369	600906	财达证券	4,900	62,524.00	0.11
370	601608	中信重工	14,000	62,440.00	0.11
371	600566	济川药业	2,200	62,348.00	0.11
372	002440	闰土股份	6,500	62,335.00	0.11
373	600120	浙江东方	14,100	62,322.00	0.11
374	300133	华策影视	9,200	62,284.00	0.11

375	002867	周大生	3,500	62,230.00	0.11
376	000090	天健集团	10,500	61,635.00	0.11
377	002233	塔牌集团	5,800	61,364.00	0.11
378	601333	广深铁路	27,200	60,928.00	0.11
379	000089	深圳机场	8,300	60,756.00	0.11
380	000959	首钢股份	10,600	60,738.00	0.11
381	000758	中色股份	11,100	60,606.00	0.11
382	600376	首开股份	10,400	58,864.00	0.11
383	002387	维信诺	6,300	58,464.00	0.11
384	003022	联泓新科	1,600	58,304.00	0.11
385	600582	天地科技	13,300	58,254.00	0.11
386	000415	渤海租赁	20,000	58,200.00	0.11
387	002242	九阳股份	2,500	58,000.00	0.11
388	000718	苏宁环球	12,200	57,462.00	0.10
389	002416	爱施德	5,000	56,900.00	0.10
390	601598	中国外运	12,700	56,896.00	0.10
391	600373	中文传媒	4,600	56,856.00	0.10
392	601975	招商南油	28,000	56,280.00	0.10
393	600062	华润双鹤	4,200	56,154.00	0.10
394	000967	盈峰环境	7,600	55,708.00	0.10
395	600307	酒钢宏兴	25,300	55,660.00	0.10
396	601098	中南传媒	5,800	55,506.00	0.10
397	002458	益生股份	4,900	55,419.00	0.10
398	000402	金融街	9,600	54,336.00	0.10
399	002038	双鹭药业	5,000	54,050.00	0.10
400	601958	金钼股份	7,800	53,430.00	0.10
401	600643	爱建集团	7,900	53,404.00	0.10
402	000158	常山北明	7,700	53,284.00	0.10
403	688289	圣湘生物	900	53,100.00	0.10
404	600959	江苏有线	16,100	52,969.00	0.10
405	600546	山煤国际	6,400	52,544.00	0.10
406	600126	杭钢股份	10,200	52,326.00	0.10
407	000563	陕国投A	16,000	51,680.00	0.09
408	002399	海普瑞	3,000	51,300.00	0.09
409	300257	开山股份	3,200	50,816.00	0.09
410	600056	中国医药	4,300	50,783.00	0.09
411	003035	南网能源	6,100	50,569.00	0.09
412	002563	森马服饰	6,500	50,245.00	0.09
413	001965	招商公路	6,500	49,855.00	0.09
414	000671	阳光城	16,500	49,830.00	0.09
415	601928	凤凰传媒	6,100	49,349.00	0.09

416	601860	紫金银行	14,700	49,245.00	0.09
417	600266	城建发展	10,900	49,050.00	0.09
418	600717	天津港	11,700	49,023.00	0.09
419	002815	崇达技术	2,900	48,865.00	0.09
420	600901	江苏租赁	9,600	48,864.00	0.09
421	000028	国药一致	1,300	48,074.00	0.09
422	300741	华宝股份	1,000	47,850.00	0.09
423	600968	海油发展	16,300	47,759.00	0.09
424	000937	冀中能源	8,600	47,386.00	0.09
425	002244	滨江集团	10,000	46,600.00	0.08
426	600928	西安银行	10,800	46,440.00	0.08
427	000717	韶钢松山	9,700	46,075.00	0.08
428	600556	天下秀	3,700	45,695.00	0.08
429	603317	天味食品	1,700	45,577.00	0.08
430	600787	中储股份	7,200	44,928.00	0.08
431	600776	东方通信	3,900	44,889.00	0.08
432	002468	申通快递	4,900	44,541.00	0.08
433	600006	东风汽车	6,400	43,584.00	0.08
434	002424	贵州百灵	5,700	43,320.00	0.08
435	000062	深圳华强	2,500	43,075.00	0.08
436	600649	城投控股	10,300	42,333.00	0.08
437	002423	中粮资本	5,200	42,120.00	0.08
438	600339	中油工程	13,600	41,888.00	0.08
439	600623	华谊集团	4,600	41,860.00	0.08
440	600729	重庆百货	1,600	41,632.00	0.08
441	600835	上海机电	2,600	41,392.00	0.08
442	601139	深圳燃气	4,600	40,618.00	0.07
443	002375	亚厦股份	5,400	40,446.00	0.07
444	600648	外高桥	3,000	39,690.00	0.07
445	601969	海南矿业	3,200	38,432.00	0.07
446	000031	大悦城	10,300	38,419.00	0.07
447	000156	华数传媒	4,500	38,070.00	0.07
448	600095	湘财股份	3,500	35,420.00	0.06
449	000869	张裕A	1,100	35,046.00	0.06
450	600377	宁沪高速	4,000	34,480.00	0.06
451	600639	浦东金桥	2,700	34,479.00	0.06
452	603379	三美股份	1,500	34,170.00	0.06
453	601228	广州港	10,000	33,300.00	0.06
454	603708	家家悦	2,000	33,280.00	0.06
455	600871	石化油服	15,400	32,956.00	0.06
456	002302	西部建设	4,100	32,923.00	0.06

457	601869	长飞光纤	1,000	32,740.00	0.06
458	601298	青岛港	5,700	32,433.00	0.06
459	603786	科博达	400	32,120.00	0.06
460	601828	美凯龙	3,500	30,835.00	0.06
461	002948	青岛银行	6,600	30,558.00	0.06
462	001872	招商港口	1,800	30,510.00	0.06
463	600823	世茂股份	9,100	29,848.00	0.05
464	601156	东航物流	1,300	28,444.00	0.05
465	002653	海思科	1,300	26,520.00	0.05
466	603355	莱克电气	900	26,388.00	0.05
467	601568	北元集团	3,200	26,016.00	0.05
468	600350	山东高速	5,000	25,800.00	0.05
469	001203	大中矿业	1,700	25,636.00	0.05
470	603056	德邦股份	2,500	25,575.00	0.05
471	600657	信达地产	6,800	25,364.00	0.05
472	600466	蓝光发展	12,300	25,092.00	0.05
473	603515	欧普照明	1,200	24,912.00	0.05
474	000046	泛海控股	12,700	23,876.00	0.04
475	002946	新乳业	1,400	22,316.00	0.04
476	601003	柳钢股份	4,200	21,924.00	0.04
477	600917	重庆燃气	2,600	21,814.00	0.04
478	603719	良品铺子	500	21,235.00	0.04
479	601665	齐鲁银行	3,800	21,204.00	0.04
480	002901	大博医疗	400	20,248.00	0.04
481	600956	新天绿能	1,100	18,931.00	0.03
482	600903	贵州燃气	1,800	17,424.00	0.03
483	603868	飞科电器	400	17,368.00	0.03
484	601187	厦门银行	2,400	16,560.00	0.03
485	603983	丸美股份	400	12,748.00	0.02

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

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	600927	永安期货	1,684	63,183.68	0.12
2	601878	浙商证券	4,000	52,720.00	0.10
3	001296	长江材料	269	15,946.32	0.03
4	001234	泰慕士	296	4,892.88	0.01

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	9,770,323.00	10.45
2	600316	洪都航空	6,977,477.83	7.47
3	601066	中信建投	6,686,498.22	7.15
4	300274	阳光电源	5,915,325.00	6.33
5	600809	山西汾酒	5,318,020.00	5.69
6	603290	斯达半导	5,153,658.00	5.51
7	002460	赣锋锂业	5,139,996.00	5.50
8	300418	昆仑万维	4,341,563.00	4.65
9	601901	方正证券	4,202,721.20	4.50
10	688363	华熙生物	3,957,901.22	4.24
11	002064	华峰化学	3,629,103.00	3.88
12	000568	泸州老窖	3,558,509.00	3.81
13	000157	中联重科	3,521,691.00	3.77
14	600893	航发动力	3,480,543.42	3.72
15	000100	TCL 科技	3,354,024.00	3.59
16	002670	国盛金控	3,320,078.00	3.55
17	000998	隆平高科	3,039,480.00	3.25
18	000807	云铝股份	2,916,361.00	3.12
19	603198	迎驾贡酒	2,848,954.00	3.05
20	002371	北方华创	2,844,538.61	3.04
21	600779	水井坊	2,817,461.00	3.01
22	600760	中航沈飞	2,804,721.10	3.00
23	600406	国电南瑞	2,801,407.30	3.00
24	000301	东方盛虹	2,786,471.00	2.98
25	002709	天赐材料	2,756,404.00	2.95
26	002142	宁波银行	2,732,861.44	2.92
27	002444	巨星科技	2,520,296.00	2.70
28	603986	兆易创新	2,478,476.00	2.65
29	002466	天齐锂业	2,444,221.00	2.62
30	002920	德赛西威	2,349,420.00	2.51
31	002340	格林美	2,326,642.00	2.49
32	300661	圣邦股份	2,303,423.00	2.46
33	002385	大北农	2,278,196.00	2.44
34	000799	酒鬼酒	2,258,118.00	2.42
35	300223	北京君正	2,258,006.00	2.42
36	600859	王府井	2,245,640.31	2.40
37	002304	洋河股份	2,221,652.00	2.38
38	000338	潍柴动力	2,197,015.00	2.35
39	600030	中信证券	2,157,155.00	2.31
40	002594	比亚迪	2,126,578.00	2.28

41	000001	平安银行	2,109,323.00	2.26
42	002078	太阳纸业	2,095,674.00	2.24
43	600999	招商证券	2,088,804.70	2.24
44	000983	山西焦煤	2,068,996.00	2.21
45	601377	兴业证券	2,055,824.00	2.20
46	002985	北摩高科	2,014,221.00	2.16
47	600559	老白干酒	1,980,243.96	2.12
48	300285	国瓷材料	1,978,840.00	2.12
49	600733	北汽蓝谷	1,917,722.00	2.05
50	603486	科沃斯	1,895,602.00	2.03
51	603456	九洲药业	1,888,937.00	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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	10,012,390.00	10.71
2	300274	阳光电源	8,387,490.00	8.97
3	600316	洪都航空	6,984,381.00	7.47
4	601066	中信建投	6,326,842.00	6.77
5	603290	斯达半导	5,568,991.00	5.96
6	002460	赣锋锂业	5,566,503.41	5.96
7	002064	华峰化学	5,514,009.00	5.90
8	600809	山西汾酒	5,511,721.80	5.90
9	600893	航发动力	5,241,109.25	5.61
10	000807	云铝股份	4,858,557.98	5.20
11	600760	中航沈飞	4,536,642.80	4.85
12	688363	华熙生物	4,171,099.14	4.46
13	601901	方正证券	4,123,941.00	4.41
14	300418	昆仑万维	3,952,473.00	4.23
15	002371	北方华创	3,870,478.00	4.14
16	000157	中联重科	3,859,726.00	4.13
17	002709	天赐材料	3,843,120.60	4.11
18	601456	国联证券	3,737,854.00	4.00
19	000301	东方盛虹	3,619,506.00	3.87
20	600779	水井坊	3,572,367.00	3.82
21	603260	合盛硅业	3,531,349.00	3.78
22	300223	北京君正	3,482,612.00	3.73
23	000568	泸州老窖	3,386,906.00	3.62
24	002594	比亚迪	3,363,988.00	3.60
25	002948	青岛银行	3,342,813.00	3.58

26	000100	TCL 科技	3,203,108.00	3.43
27	002670	国盛金控	3,183,411.00	3.41
28	003022	联泓新科	3,095,568.00	3.31
29	601615	明阳智能	3,008,801.00	3.22
30	300146	汤臣倍健	2,844,975.62	3.04
31	300618	寒锐钴业	2,807,907.74	3.00
32	600143	金发科技	2,717,674.00	2.91
33	600406	国电南瑞	2,675,216.00	2.86
34	603986	兆易创新	2,671,362.00	2.86
35	002142	宁波银行	2,650,327.63	2.84
36	000998	隆平高科	2,564,994.00	2.74
37	002030	达安基因	2,505,075.12	2.68
38	000338	潍柴动力	2,501,571.00	2.68
39	002926	华西证券	2,433,594.00	2.60
40	002414	高德红外	2,431,954.00	2.60
41	603198	迎驾贡酒	2,405,936.00	2.57
42	002920	德赛西威	2,382,292.00	2.55
43	000983	山西焦煤	2,348,771.00	2.51
44	000519	中兵红箭	2,340,552.00	2.50
45	603444	吉比特	2,334,397.00	2.50
46	000750	国海证券	2,332,416.03	2.50
47	300661	圣邦股份	2,326,259.00	2.49
48	002466	天齐锂业	2,183,301.00	2.34
49	002340	格林美	2,152,386.00	2.30
50	300463	迈克生物	2,144,593.00	2.29
51	600884	杉杉股份	2,113,807.75	2.26
52	600999	招商证券	2,111,163.40	2.26
53	600030	中信证券	2,086,310.00	2.23
54	002607	中公教育	2,082,716.00	2.23
55	002444	巨星科技	2,066,600.00	2.21
56	601377	兴业证券	2,060,927.00	2.21
57	600132	重庆啤酒	2,029,748.85	2.17
58	300244	迪安诊断	2,029,702.00	2.17
59	002304	洋河股份	2,006,528.00	2.15
60	000959	首钢股份	2,000,779.00	2.14
61	000001	平安银行	1,989,833.00	2.13
62	600559	老白干酒	1,971,173.00	2.11
63	002074	国轩高科	1,970,474.00	2.11
64	000799	酒鬼酒	1,966,449.00	2.10
65	600859	王府井	1,958,804.65	2.10

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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	396,289,130.83
卖出股票收入（成交）总额	443,329,253.93

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价



本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,266.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	558.43
5	应收申购款	72,950.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,775.40

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001234	泰慕士	4,892.88	0.01	新股未上市

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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	3,295	13,708.29	50,014.97	0.11%	45,118,788.86	99.89%
诺安中证 500 增强 C	416	7,451.72	0.00	0.00%	3,099,917.11	100.00%
合计	3,711	13,006.93	50,014.97	0.10%	48,218,705.97	99.90%

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。

### 9.2 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	334,432.70	0.7404%
	诺安中证 500 增 强 C	93.17	0.0030%
	合计	334,525.87	0.6930%

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）。

### 9.3 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	诺安中证 500 增强 A	0

式基金	诺安中证 500 增强 C	0
	合计	0

## § 10 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	94,555,239.24	116,184.09
本报告期基金总申购份额	31,771,349.38	9,415,905.65
减：本报告期基金总赎回份额	81,157,784.79	6,432,172.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,168,803.83	3,099,917.11

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

李强先生担任公司董事长、李学君女士担任公司督察长、于东升先生于 2021 年 4 月至 2022 年 1 月期间担任公司副总经理；秦维舟先生不再担任公司董事长、马宏先生不再担任公司督察长。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

（1）根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》，本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日对本基金《基金合同》《招募说明书》的相关条款进行了修订，投资策略增加“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。”

(2) 自 2021 年 11 月 5 日起, 本基金投资范围增加存托凭证, 投资策略增加存托凭证投资策略。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于 2021 年 10 月 29 日披露了《诺安基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》, 自 2021 年 10 月 27 日起, 本基金的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 3 万元。截至本报告期末, 该事务所已提供审计服务的连续年限: 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 公司收到深圳证监局关于子公司及相关人员的监管措施, 公司按要求落实。

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	465,963,498.05	55.58%	331,439.79	48.87%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	372,415,708.50	44.42%	346,829.24	51.13%	-
中银国际	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, 与被签订的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	598,000.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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基金参加平安银行开展的基金申购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》	2021年01月04日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的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》	2021年01月04日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的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》	2021年01月05日
4	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年01月16日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分增加汇成基金为代销机构并在汇成基金开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2021年01月18日
6	诺安中证500指数增强型证券投资基金2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021年01月22日
7	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年	《证券时报》、《上海证	2021年01月22日

	第 4 季度报告提示性公告	券报》、《中国证券报》、 《证券日报》	日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿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》	2021 年 02 月 08 日
9	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021 年 02 月 08 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳新兰德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》	2021 年 02 月 09 日
11	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购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》	2021 年 03 月 12 日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构并开通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》	2021 年 03 月 16 日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷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》	2021 年 03 月 16 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加同花顺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》	2021 年 03 月 16 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新浪仓石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》	2021 年 03 月 16 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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》	2021 年 03 月 18 日
17	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	2021 年 03 月 29 日
18	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021 年 03 月 29 日
19	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 期	基金管理人网站	2021 年 03 月 29 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同	《上海证券报》、《中国证券报》	2021 年 03 月 29 日

	并更新招募说明书的公告		
21	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同（2021 年 3 月修改）	基金管理人网站	2021 年 03 月 29 日
22	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021 年 03 月 31 日
23	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 03 月 31 日
24	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 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》	2021 年 03 月 31 日
25	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 04 月 01 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天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》	2021 年 04 月 06 日
27	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2021 年 04 月 22 日
28	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021 年 04 月 22 日
29	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021 年 04 月 28 日
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金为代销机构并开通定投业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2021 年 05 月 07 日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波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》	2021 年 05 月 07 日
32	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞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》	2021 年 05 月 14 日
33	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》	2021 年 05 月 21 日
34	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	2021 年 05 月 21 日
35	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 2 期	基金管理人网站	2021 年 05 月 21 日
36	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员	《中国证券报》	2021 年 05 月 29 日

	员变更的公告		日
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁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	《上海证券报》、《中国证券报》	2021年06月01日
38	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天鼎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	《上海证券报》、《中国证券报》	2021年06月01日
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加唐鼎耀华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	《上海证券报》、《中国证券报》	2021年06月01日
40	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加挖财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》	2021年06月11日
41	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年06月11日
42	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得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》	2021年06月18日
43	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金开展的基金赎回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》	2021年06月21日
44	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021年06月26日
45	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的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》	2021年06月30日
46	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国银河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》	2021年07月02日
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买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》	2021年07月12日
48	诺安基金管理有限公司旗下基金2021年第2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》	2021年07月21日
49	诺安中证500指数增强型证券投资基金	基金管理人网站	2021年07月21日



	2021 年第 2 季度报告		日
50	诺安基金管理有限公司关于董事长任职的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 08 月 27 日
51	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站	2021 年 08 月 31 日
52	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 08 月 31 日
53	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆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》	2021 年 10 月 12 日
54	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富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》	2021 年 10 月 12 日
55	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投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》	2021 年 10 月 15 日
56	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 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》	2021 年 10 月 27 日
57	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2021 年 10 月 27 日
58	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 10 月 29 日
59	诺安基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 01 日
60	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021 年 11 月 05 日
61	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021 年 11 月 05 日
62	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修改基金合同、托管协议的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 05 日
63	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	2021 年 11 月 10 日
64	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 3 期	基金管理人网站	2021 年 11 月 10 日
65	诺安基金管理有限公司关于旗下 30 只基	《证券时报》、《上海证	2021 年 11 月 10

	金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	日
66	诺安基金管理有限公司关于督察长任职的公告	《上海证券报》	2021年12月10日
67	诺安基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金销售相关业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年12月14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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	-	-	-	-	-	-
个人	1	-	-	-	-	-	-
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。							

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

## 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 13.3 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  
2022 年 03 月 31 日