

诺安中证 500 指数增强型证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 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

报告送出日期：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
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	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
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 .....	63
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 .....	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
§ 12	备查文件目录 .....	64
12.1	备查文件目录 .....	64
12.2	存放地点 .....	64
12.3	查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证 500 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	76,962,463.79 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	45,481,709.84 份	31,480,753.95 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	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（2022 年 01 月 01 日至 2022 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	-888,466.44	-158,433.89
本期利润	-5,715,799.71	488,747.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1268	0.0860
本期加权平均净值利润率	-12.82%	8.79%
本期基金份额净值增长率	-11.31%	-11.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 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	347,977.23	37,962.88
期末可供分配基金份额利润	0.0077	0.0012
期末基金资产净值	45,829,687.07	31,518,716.83
期末基金份额净值	1.0077	1.0012
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 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	70.31%	9.00%

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	7.60%	1.01%	6.75%	1.05%	0.85%	-0.04%
过去三个月	2.85%	1.65%	2.00%	1.66%	0.85%	-0.01%
过去六个月	-11.31%	1.54%	-11.62%	1.55%	0.31%	-0.01%
过去一年	-4.83%	1.35%	-4.78%	1.26%	-0.05%	0.09%
过去三年	45.10%	1.40%	29.36%	1.28%	15.74%	0.12%
自基金合同生效起至今	70.31%	1.44%	48.51%	1.35%	21.80%	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	7.56%	1.01%	6.75%	1.05%	0.81%	-0.04%
过去三个月	2.74%	1.65%	2.00%	1.66%	0.74%	-0.01%
过去六个月	-11.49%	1.54%	-11.62%	1.55%	0.13%	-0.01%
过去一年	-5.20%	1.35%	-4.78%	1.26%	-0.42%	0.09%
自基金合同生效起至今	9.00%	1.31%	5.60%	1.15%	3.40%	0.16%

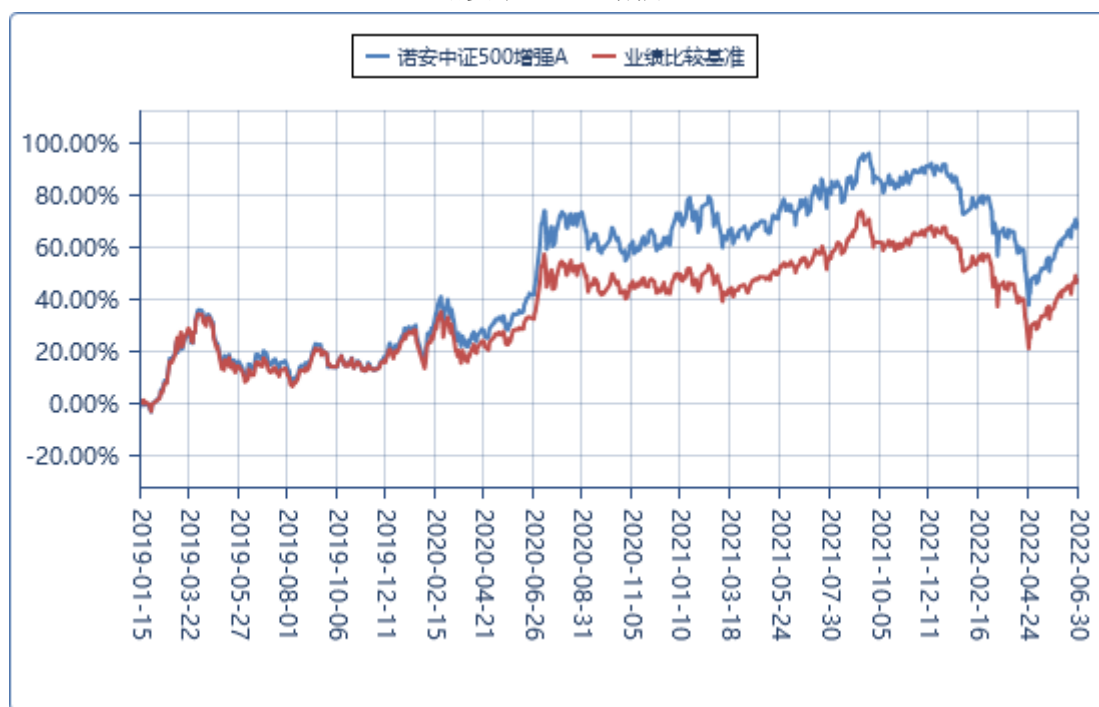
注：1、2019 年 01 月 15 日（含当日）起，原“诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95% + 一年期银

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。

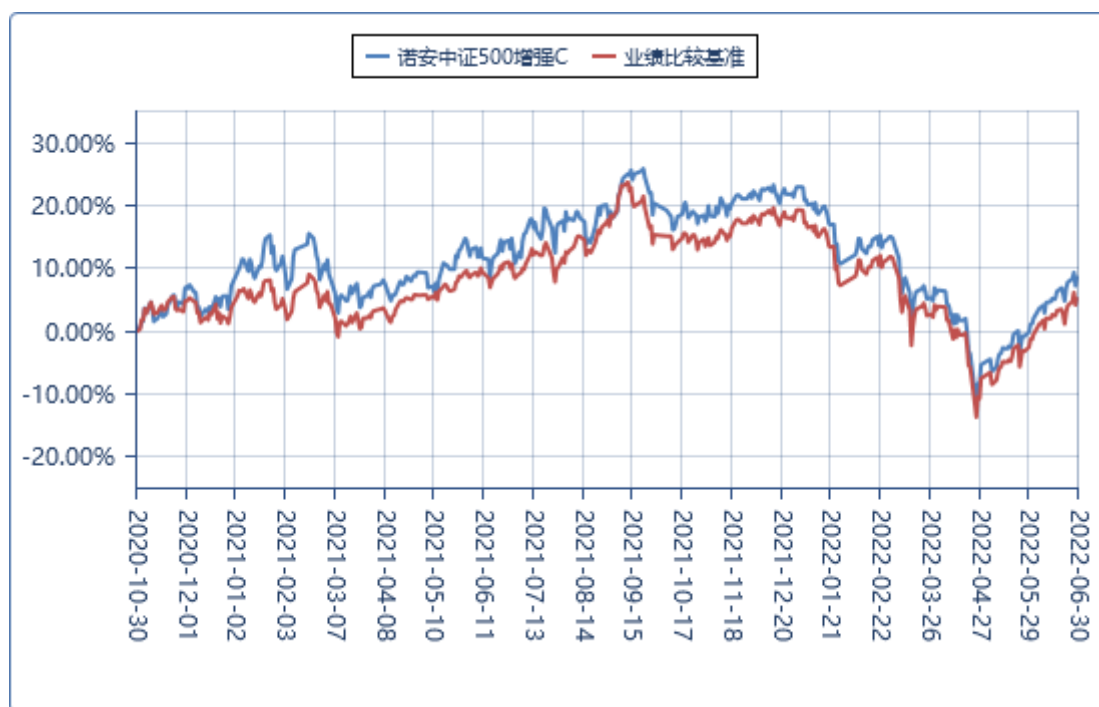
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

诺安中证 500 增强 A



诺安中证 500 增强 C





注：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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十只开放式基金：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	-	25 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 7 月担任诺安全球黄

					<p>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 月起任诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。</p>
路龙凯	本基金基金经理	2019 年 02 月	-	10 年	硕士，具有基金从业资

		20 日			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

海外方面，美国核心通胀率已远远超出了美联储自己设定的通胀目标，美国开始步入加息和收紧流动性通道。俄乌冲突爆发，冲击了全球的供应链，大宗商品价格大幅上涨，同时也进一步强化了通胀预期。国内经济受到疫情的多点暴发，二季度增速面临较大压力，进行逆周期政策调节的迫切性在提升。国内权益市场并没有如去年底投资者普遍乐观预期那样向上，反而在多重因素的作用下，出现了大幅下挫。二季度后半期疫情逐步控制后，经济逐步恢复正常，A 股也逐步反弹，走出了自己的节奏。

#### 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 1.0077 元,本报告期诺安中证 500 增强 A 份额净值增长率为-11.31%,同期业绩比较基准收益率为-11.62%;截至本报告期末诺安中证 500 增强 C 份额净值为 1.0012 元,本报告期诺安中证 500 增强 C 份额净值增长率为-11.49%,同期业绩比较基准收益率为-11.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们从一个自上而下的视角,以宏观经济形势、地缘政治危机为切入点,从货币、信用、经济增长、通胀等维度进行分析。目前我国经济逐步向好,稳增长的政策正逐步加大力度,同时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,建议重点关注以下方向:1)稳增长板块。国内经济复苏速度边际改善,宜自下而上选择稳增长政策受益板块,比如地产、银行保险、白酒。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,如医药、军工、新能源等方向。我们将坚持采用基本面选股的方法,在紧密跟踪指数的同时,努力获取稳健的超额收益。

风险方面时刻关注,稳增长的政策力度,货币信用政策的放松力度,上市公司业绩;国外时刻关注美联储货币政策等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、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。

#### 4.7 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

截至 2022 年 06 月 08 日,本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。基金管理人积极与基金托管人协商解决方案,包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等,并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

## § 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：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,331,225.71	3,244,559.08
结算备付金		38,000.12	591,034.85
存出保证金		788.39	13,266.76
交易性金融资产	6.4.7.2	73,209,912.37	51,680,259.14
其中：股票投资		73,209,912.37	51,680,259.14
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		68,378.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		118,494.72	72,950.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	558.43
资产总计		77,766,799.93	55,602,628.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付赎回款		200,905.89	401,483.25
应付管理人报酬		48,984.00	46,638.82
应付托管费		7,347.63	6,995.83
应付销售服务费		5,057.96	1,198.52
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	156,100.55	318,077.93
负债合计		418,396.03	774,394.35



<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	76,962,463.79	48,268,720.94
未分配利润	6.4.7.8	385,940.11	6,559,513.18
净资产合计		77,348,403.90	54,828,234.12
负债和净资产总计		77,766,799.93	55,602,628.47

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，诺安中证 500 增强 A 基金份额净值 1.0077 元，基金份额总额 45,481,709.84 份；诺安中证 500 增强 C 基金份额净值 1.0012 元，基金份额总额 31,480,753.95 份。诺安中证 500 增强份额总额合计为 76,962,463.79 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”项目的“本期末”余额列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,775,699.65	6,751,933.49
1. 利息收入		5,989.69	11,115.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,989.69	11,115.59
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）		-608,884.30	1,872,430.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,125,921.83	1,468,779.08
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	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	516,911.32	403,651.36
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 15	-4, 180, 152. 37	4, 830, 668. 46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 16	7, 347. 33	37, 719. 00
<b>减：二、营业总支出</b>		451, 353. 05	1, 163, 233. 36
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	247, 839. 33	340, 292. 43
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	37, 175. 93	51, 043. 87
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	10, 685. 45	1, 135. 83
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. 17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	155, 652. 34	770, 761. 23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5, 227, 052. 70	5, 588, 700. 13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5, 227, 052. 70	5, 588, 700. 13
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5, 227, 052. 70	5, 588, 700. 13

注：以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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



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,对于在具体会计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 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发布的相关规定和指引。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下文变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

##### (2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外,本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于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，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

### 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

##### 新金融工具准则

根据《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》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本

基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,244,559.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 286.53 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,244,845.61 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 591,034.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 265.90 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 591,300.75 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 13,266.76 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 13,272.76 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 558.43 元，转出至



银行存款的重分类金额为人民币 286.53 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 265.90 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 6.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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〔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。

#### 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 2022 年 06 月 30 日
活期存款	4,331,225.71
等于: 本金	4,330,806.31
加: 应计利息	419.40
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	4,331,225.71

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	75,717,086.15	-	73,209,912.37	-2,507,173.78
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	75,717,086.15	-	73,209,912.37	-2,507,173.78

### 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 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	562.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	50,989.66
其中：交易所市场	50,989.66
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	54,547.97
指数使用费	50,000.00
合计	156,100.55

#### 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,168,803.83	45,168,803.83
本期申购	5,718,702.76	5,718,702.76
本期赎回（以“-”号填列）	-5,405,796.75	-5,405,796.75
本期末	45,481,709.84	45,481,709.84

诺安中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,099,917.11	3,099,917.11
本期申购	31,212,526.55	31,212,526.55
本期赎回（以“-”号填列）	-2,831,689.71	-2,831,689.71
本期末	31,480,753.95	31,480,753.95

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。

#### 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
上年度末	2,477,625.32	3,675,231.02	6,152,856.34
本期利润	-888,466.44	-4,827,333.27	-5,715,799.71
本期基金份额交易产生的变动数	14,280.28	-103,359.68	-89,079.40
其中：基金申购款	299,637.52	-365,282.15	-65,644.63
基金赎回款	-285,357.24	261,922.47	-23,434.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,603,439.16	-1,255,461.93	347,977.23

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	154,631.25	252,025.59	406,656.84
本期利润	-158,433.89	647,180.90	488,747.01
本期基金份额交易产生的变动数	899,800.70	-1,757,241.67	-857,440.97

其中：基金申购款	1,030,316.02	-1,925,308.83	-894,992.81
基金赎回款	-130,515.32	168,067.16	37,551.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	895,998.06	-858,035.18	37,962.88

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
活期存款利息收入		5,593.22
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		329.02
其他		67.45
合计		5,989.69

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	
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
卖出股票成交总额		21,059,336.55
减：卖出股票成本总额		22,101,276.36
减：交易费用		83,982.02
买卖股票差价收入		-1,125,921.83

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
债券投资收益--利息收入		23.01
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入		103.20
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		126.21

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	404,149.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	400,616.00
减：应计利息总额	3,429.04
减：交易费用	0.80
买卖债券差价收入	103.20

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	516,911.32
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	516,911.32

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-4,180,152.37
— 股票投资	-4,180,152.37
— 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	-4,180,152.37
----	---------------

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	7,205.75
基金转换费收入	141.58
合计	7,347.33

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
汇划手续费	1,102.80
存托服务费	1.57
合计	155,652.34

### 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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	247,839.33	340,292.43
其中：支付销售机构的客户维护费	108,018.55	122,953.12

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 2022年01月01日至2022年 06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,175.93	51,043.87

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	-	334.41	334.41
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	334.41	334.41

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自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自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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	4,331,225.71	5,593.22	3,345,079.02	7,291.34

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

#### 6.4.10.7 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 2022 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
002670	国盛金控	2022 年 06 月 01 日	重大事项	9.60	2022 年 07 月 14 日	9.99	8,400	78,750.00	80,640.00	

### 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观念，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 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2021 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 2022 年 06 月 30 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。

##### 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 2022 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 2022 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 2022 年 06 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,331,225.71	-	-	-	-	4,331,225.71
结算备付金	38,000.12	-	-	-	-	38,000.12
存出保证金	788.39	-	-	-	-	788.39
交易性金融资产	-	-	-	-	73,209,912.37	73,209,912.37
应收清算款	-	-	-	-	68,378.62	68,378.62
应收申购款	310.00	-	-	-	118,184.72	118,494.72
资产总计	4,370,324.22	-	-	-	73,396,475.71	77,766,799.93
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	200,905.89	200,905.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	48,984.00	48,984.00
应付托管费	-	-	-	-	7,347.63	7,347.63
应付销售服务费	-	-	-	-	5,057.96	5,057.96
其他负债	-	-	-	-	156,100.55	156,100.55
负债总计	-	-	-	-	418,396.03	418,396.03
利率敏感度缺口	4,370,324.22	-	-	-	-72,978,079.68	77,348,403.90
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	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
其他负债	-	-	-	-	318,077.93	318,077.93
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

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

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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 2022年06月30日		上年度末 2021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	73,209,912.37	94.65	51,680,259.14	94.26
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	73,209,912.37	94.65	51,680,259.14	94.26
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 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(2022年06月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	3,758,225.17	2,402,957.20
	业绩比较基准下降 5%	-3,758,225.17	-2,402,957.20

#### 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 2022年06月30日	上年末 2021年12月31日
第一层次	73,129,272.37	51,575,970.26
第二层次	80,640.00	104,288.88
第三层次	-	-
合计	73,209,912.37	51,680,259.14

###### 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	73,209,912.37	94.14
	其中：股票	73,209,912.37	94.14
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	4,369,225.83	5.62
8	其他各项资产	187,661.73	0.24
9	合计	77,766,799.93	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	1,198,976.00	1.55
B	采矿业	1,832,912.00	2.37
C	制造业	38,749,378.83	50.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,209,441.00	1.56
E	建筑业	777,764.00	1.01
F	批发和零售业	1,997,244.00	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,679,251.00	2.17
H	住宿和餐饮业	109,120.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,598,603.60	7.24
J	金融业	2,685,502.60	3.47
K	房地产业	2,059,880.00	2.66

L	租赁和商务服务业	453,468.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	975,993.00	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	332,813.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	286,120.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	946,219.00	1.22
S	综合	361,941.00	0.47
	合计	61,254,627.03	79.19

### 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	569,281.00	0.74
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,693,958.34	12.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	215,489.00	0.28
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	577,971.00	0.75
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	898,586.00	1.16
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	11,955,285.34	15.46

### 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	000729	燕京啤酒	113,100	1,092,546.00	1.41
2	002384	东山精密	44,600	1,022,678.00	1.32
3	000519	中兵红箭	33,500	976,525.00	1.26

4	600316	洪都航空	31,800	961,632.00	1.24
5	605117	德业股份	3,400	951,626.00	1.23
6	603613	国联股份	10,000	886,000.00	1.15
7	688390	固德威	2,747	859,838.47	1.11
8	002180	纳思达	16,900	855,478.00	1.11
9	601615	明阳智能	25,200	851,760.00	1.10
10	600522	中天科技	35,800	826,980.00	1.07
11	688521	芯原股份	15,786	779,828.40	1.01
12	603786	科博达	12,400	763,468.00	0.99
13	300037	新宙邦	12,980	682,228.80	0.88
14	300769	德方纳米	1,560	637,540.80	0.82
15	601456	国联证券	51,000	625,770.00	0.81
16	300073	当升科技	6,900	623,346.00	0.81
17	603127	昭衍新药	5,400	614,520.00	0.79
18	002966	苏州银行	85,540	521,794.00	0.67
19	001914	招商积余	28,400	510,348.00	0.66
20	688188	柏楚电子	2,180	479,687.20	0.62
21	600765	中航重机	14,880	478,838.40	0.62
22	300251	光线传媒	49,900	472,553.00	0.61
23	688777	中控技术	6,490	472,212.40	0.61
24	002124	天邦食品	67,500	453,600.00	0.59
25	600521	华海药业	19,900	451,730.00	0.58
26	002240	盛新锂能	6,700	404,412.00	0.52
27	300724	捷佳伟创	4,400	393,140.00	0.51
28	603456	九洲药业	7,500	387,750.00	0.50
29	300390	天华超净	4,300	375,820.00	0.49
30	300363	博腾股份	4,800	374,352.00	0.48
31	688099	晶晨股份	3,674	371,074.00	0.48
32	300285	国瓷材料	10,300	369,976.00	0.48
33	000930	中粮科技	40,500	366,120.00	0.47
34	000998	隆平高科	21,500	358,190.00	0.46
35	002155	湖南黄金	29,400	356,916.00	0.46
36	600372	中航电子	18,300	354,837.00	0.46
37	600256	广汇能源	32,500	342,550.00	0.44
38	688185	康希诺	1,700	338,436.00	0.44
39	688006	杭可科技	4,800	336,288.00	0.43
40	600039	四川路桥	31,500	331,695.00	0.43
41	688180	君实生物	4,100	308,894.00	0.40
42	002507	涪陵榨菜	8,900	307,228.00	0.40
43	300026	红日药业	38,800	298,760.00	0.39
44	002372	伟星新材	12,100	290,884.00	0.38

45	300244	迪安诊断	9,200	286,120.00	0.37
46	002508	老板电器	7,900	284,637.00	0.37
47	002244	滨江集团	32,900	284,585.00	0.37
48	002156	通富微电	18,300	281,820.00	0.36
49	600704	物产中大	54,500	279,585.00	0.36
50	000739	普洛药业	13,300	274,512.00	0.35
51	600350	山东高速	51,900	272,475.00	0.35
52	600056	中国医药	17,820	264,092.40	0.34
53	000009	中国宝安	18,700	252,263.00	0.33
54	600141	兴发集团	5,700	250,743.00	0.32
55	002299	圣农发展	12,900	247,422.00	0.32
56	600392	盛和资源	10,200	230,520.00	0.30
57	000671	阳光城	104,100	227,979.00	0.29
58	600885	宏发股份	5,320	222,642.00	0.29
59	600233	圆通速递	10,300	210,017.00	0.27
60	002506	协鑫集成	56,200	209,064.00	0.27
61	600563	法拉电子	1,000	205,160.00	0.27
62	600399	抚顺特钢	11,400	204,060.00	0.26
63	601228	广州港	54,300	199,281.00	0.26
64	000983	山西焦煤	14,800	198,172.00	0.26
65	603218	日月股份	7,800	198,120.00	0.26
66	603077	和邦生物	46,500	198,090.00	0.26
67	600487	亨通光电	13,400	194,836.00	0.25
68	600732	爱旭股份	5,900	194,818.00	0.25
69	600195	中牧股份	15,700	192,482.00	0.25
70	603517	绝味食品	3,300	190,806.00	0.25
71	002407	多氟多	3,900	190,749.00	0.25
72	603026	石大胜华	1,300	188,955.00	0.24
73	300558	贝达药业	3,100	188,480.00	0.24
74	600499	科达制造	9,100	187,824.00	0.24
75	002385	大北农	24,000	187,440.00	0.24
76	300144	宋城演艺	12,200	187,270.00	0.24
77	603345	安井食品	1,100	184,657.00	0.24
78	601179	中国西电	38,800	181,584.00	0.23
79	000630	铜陵有色	55,400	180,604.00	0.23
80	002326	永太科技	5,400	177,822.00	0.23
81	600862	中航高科	6,300	177,030.00	0.23
82	603233	大参林	5,640	176,532.00	0.23
83	000988	华工科技	7,600	176,092.00	0.23
84	603658	安图生物	3,600	176,004.00	0.23
85	600298	安琪酵母	3,600	175,500.00	0.23

86	603939	益丰药房	3,300	174,339.00	0.23
87	603605	珀莱雅	1,020	168,483.60	0.22
88	002756	永兴材料	1,100	167,431.00	0.22
89	300832	新产业	3,700	166,907.00	0.22
90	601077	渝农商行	44,700	165,390.00	0.21
91	300676	华大基因	2,300	164,910.00	0.21
92	002625	光启技术	9,500	164,065.00	0.21
93	002353	杰瑞股份	4,000	161,200.00	0.21
94	600096	云天化	5,100	160,548.00	0.21
95	002028	思源电气	4,500	160,470.00	0.21
96	600079	人福医药	10,000	160,000.00	0.21
97	002497	雅化集团	4,900	159,985.00	0.21
98	300888	稳健医疗	2,400	159,600.00	0.21
99	000831	五矿稀土	5,100	159,375.00	0.21
100	000932	华菱钢铁	31,200	158,808.00	0.21
101	002185	华天科技	16,900	158,522.00	0.20
102	603589	口子窖	2,700	158,247.00	0.20
103	601128	常熟银行	20,700	158,148.00	0.20
104	600153	建发股份	12,100	158,147.00	0.20
105	300012	华测检测	6,800	157,828.00	0.20
106	601168	西部矿业	13,300	157,339.00	0.20
107	600848	上海临港	11,600	157,296.00	0.20
108	002056	横店东磁	5,900	157,058.00	0.20
109	688122	西部超导	1,700	156,740.00	0.20
110	601058	赛轮轮胎	13,800	155,526.00	0.20
111	601607	上海医药	8,600	155,488.00	0.20
112	688256	寒武纪	2,400	155,280.00	0.20
113	002624	完美世界	10,800	155,196.00	0.20
114	600988	赤峰黄金	9,600	153,120.00	0.20
115	688009	中国通号	33,400	151,302.00	0.20
116	688819	天能股份	4,363	150,872.54	0.20
117	601636	旗滨集团	11,700	149,175.00	0.19
118	002603	以岭药业	6,100	148,230.00	0.19
119	603267	鸿远电子	1,100	147,763.00	0.19
120	002078	太阳纸业	11,600	142,796.00	0.18
121	601872	招商轮船	24,400	140,544.00	0.18
122	600497	驰宏锌锗	26,700	138,573.00	0.18
123	600549	厦门钨业	6,400	138,368.00	0.18
124	300699	光威复材	2,300	135,401.00	0.18
125	600875	东方电气	8,200	134,890.00	0.17
126	000738	航发控制	4,800	134,880.00	0.17

127	300146	汤臣倍健	6,200	134,230.00	0.17
128	002138	顺络电子	4,900	133,525.00	0.17
129	000970	中科三环	7,100	133,338.00	0.17
130	600160	巨化股份	9,700	127,555.00	0.16
131	000960	锡业股份	7,600	127,452.00	0.16
132	000039	中集集团	9,200	127,420.00	0.16
133	300308	中际旭创	4,100	127,305.00	0.16
134	600482	中国动力	8,100	127,251.00	0.16
135	300088	长信科技	17,100	126,882.00	0.16
136	002572	索 菲 亚	4,600	126,500.00	0.16
137	002465	海格通信	13,900	126,351.00	0.16
138	600516	方大炭素	16,600	126,160.00	0.16
139	000999	华润三九	2,800	126,000.00	0.16
140	002557	洽洽食品	2,200	125,246.00	0.16
141	300357	我武生物	2,400	124,872.00	0.16
142	689009	九号公司	2,800	124,600.00	0.16
143	300136	信维通信	7,300	123,005.00	0.16
144	000975	银泰黄金	12,300	119,802.00	0.15
145	002030	达安基因	6,900	118,611.00	0.15
146	000629	攀钢钒钛	31,100	118,180.00	0.15
147	300058	蓝色光标	18,000	117,540.00	0.15
148	603198	迎驾贡酒	1,800	117,252.00	0.15
149	002409	雅克科技	2,100	116,571.00	0.15
150	603444	吉 比 特	300	116,400.00	0.15
151	600536	中国软件	2,860	116,087.40	0.15
152	002439	启明星辰	5,700	113,601.00	0.15
153	300474	景 嘉 微	1,650	112,843.50	0.15
154	002422	科伦药业	6,000	112,200.00	0.15
155	600859	王 府 井	4,300	111,714.00	0.14
156	300418	昆仑万维	6,900	110,400.00	0.14
157	002223	鱼跃医疗	4,300	110,338.00	0.14
158	600673	东 阳 光	12,200	109,678.00	0.14
159	600258	首旅酒店	4,400	109,120.00	0.14
160	300253	卫宁健康	12,400	108,872.00	0.14
161	601016	节能风电	22,600	108,480.00	0.14
162	601997	贵阳银行	18,500	107,485.00	0.14
163	600315	上海家化	2,500	106,875.00	0.14
164	600415	小商品城	19,100	106,387.00	0.14
165	600171	上海贝岭	4,200	105,126.00	0.14
166	600637	东方明珠	14,700	105,105.00	0.14
167	000547	航天发展	8,800	105,072.00	0.14

168	002936	郑州银行	38,720	104,156.80	0.13
169	002092	中泰化学	13,400	103,984.00	0.13
170	000887	中鼎股份	5,700	103,968.00	0.13
171	002739	万达电影	7,600	103,740.00	0.13
172	600236	桂冠电力	17,000	103,530.00	0.13
173	600867	通化东宝	10,000	103,400.00	0.13
174	600026	中远海能	10,000	103,300.00	0.13
175	002203	海亮股份	8,900	102,795.00	0.13
176	600879	航天电子	15,800	102,542.00	0.13
177	002273	水晶光电	8,400	101,724.00	0.13
178	300296	利亚德	13,900	101,470.00	0.13
179	000636	风华高科	5,400	101,466.00	0.13
180	002294	信立泰	3,600	101,160.00	0.13
181	600642	申能股份	17,800	101,104.00	0.13
182	600529	山东药玻	3,600	100,620.00	0.13
183	601717	郑煤机	6,900	99,429.00	0.13
184	000750	国海证券	27,000	98,010.00	0.13
185	600580	卧龙电驱	6,700	96,614.00	0.12
186	600038	中直股份	2,100	94,920.00	0.12
187	600909	华安证券	20,800	94,640.00	0.12
188	002444	巨星科技	5,000	94,200.00	0.12
189	002195	二三四五	41,500	93,375.00	0.12
190	000825	太钢不锈	17,100	93,195.00	0.12
191	300618	寒锐钴业	1,600	92,672.00	0.12
192	002373	千方科技	8,300	92,296.00	0.12
193	002683	广东宏大	3,300	91,839.00	0.12
194	300024	机器人	9,100	91,728.00	0.12
195	000027	深圳能源	14,300	91,663.00	0.12
196	600170	上海建工	30,200	91,506.00	0.12
197	002430	杭氧股份	2,900	90,654.00	0.12
197	300383	光环新网	8,700	90,654.00	0.12
199	000513	丽珠集团	2,500	90,525.00	0.12
200	000400	许继电气	4,700	90,240.00	0.12
201	601005	重庆钢铁	47,200	90,152.00	0.12
202	000060	中金岭南	20,200	90,092.00	0.12
203	600062	华润双鹤	3,500	89,810.00	0.12
204	600271	航天信息	8,200	89,708.00	0.12
205	300482	万孚生物	2,200	89,562.00	0.12
206	300017	网宿科技	16,600	88,976.00	0.12
207	600008	首创环保	30,600	88,740.00	0.11
208	000050	深天马 A	8,900	88,733.00	0.11

209	002250	联化科技	5,400	88,398.00	0.11
210	600118	中国卫星	4,400	88,352.00	0.11
211	600027	华电国际	22,400	88,032.00	0.11
212	600667	太极实业	11,900	87,822.00	0.11
213	600801	华新水泥	4,500	87,795.00	0.11
214	002505	鹏都农牧	25,700	87,123.00	0.11
215	600325	华发股份	11,500	87,055.00	0.11
216	603568	伟明环保	2,600	86,762.00	0.11
217	600970	中材国际	8,900	86,241.00	0.11
218	002131	利欧股份	44,300	85,942.00	0.11
219	600863	内蒙华电	23,500	85,775.00	0.11
220	002212	天融信	8,400	85,260.00	0.11
221	601866	中远海发	28,300	84,900.00	0.11
222	000401	冀东水泥	8,000	84,160.00	0.11
223	603156	养元饮品	3,700	84,064.00	0.11
224	300009	安科生物	8,300	83,913.00	0.11
225	000778	新兴铸管	17,400	83,868.00	0.11
226	002985	北摩高科	1,430	83,769.40	0.11
227	002065	东华软件	13,200	83,424.00	0.11
228	002152	广电运通	8,900	82,503.00	0.11
229	300070	碧水源	15,800	82,318.00	0.11
230	300182	捷成股份	14,900	81,950.00	0.11
231	600409	三友化工	10,000	81,900.00	0.11
232	603707	健友股份	2,900	81,780.00	0.11
233	002249	大洋电机	13,300	81,662.00	0.11
234	300168	万达信息	8,600	81,184.00	0.10
235	600998	九州通	6,800	80,988.00	0.10
236	603858	步长制药	4,100	80,811.00	0.10
237	000883	湖北能源	15,800	80,738.00	0.10
238	002670	国盛金控	8,400	80,640.00	0.10
239	601992	金隅集团	29,000	80,330.00	0.10
240	600208	新湖中宝	28,900	79,764.00	0.10
241	000987	越秀金控	11,340	79,720.20	0.10
242	300001	特锐德	4,600	79,626.00	0.10
243	600820	隧道股份	13,000	79,560.00	0.10
244	688002	睿创微纳	2,000	79,440.00	0.10
245	000997	新大陆	6,000	79,260.00	0.10
246	000021	深科技	6,800	79,152.00	0.10
247	600380	健康元	6,400	79,040.00	0.10
248	002183	怡亚通	10,900	78,589.00	0.10
249	002221	东华能源	8,300	77,273.00	0.10



250	600895	张江高科	6,200	77,190.00	0.10
251	600064	南京高科	7,000	77,000.00	0.10
252	002396	星网锐捷	3,400	76,976.00	0.10
253	601577	长沙银行	9,700	76,921.00	0.10
254	002831	裕同科技	2,600	76,830.00	0.10
255	600755	厦门国贸	10,200	76,500.00	0.10
256	600259	广晟有色	1,500	75,975.00	0.10
257	002153	石基信息	4,760	75,541.20	0.10
258	002019	亿帆医药	5,400	75,492.00	0.10
259	000012	南玻 A	10,000	74,200.00	0.10
260	600528	中铁工业	9,200	74,060.00	0.10
261	002191	劲嘉股份	6,900	73,968.00	0.10
262	002511	中顺洁柔	5,900	73,868.00	0.10
263	600598	北大荒	5,000	73,800.00	0.10
264	600155	华创阳安	8,700	73,776.00	0.10
265	002127	南极电商	13,700	73,158.00	0.09
266	600808	马钢股份	19,200	72,768.00	0.09
267	600827	百联股份	5,500	72,655.00	0.09
268	600511	国药股份	2,700	72,306.00	0.09
269	000690	宝新能源	16,400	71,832.00	0.09
270	601880	辽港股份	42,100	71,570.00	0.09
271	002595	豪迈科技	3,200	71,488.00	0.09
272	600718	东软集团	6,200	71,362.00	0.09
273	002939	长城证券	7,000	71,120.00	0.09
274	600498	烽火通信	4,900	70,952.00	0.09
275	600566	济川药业	2,600	70,616.00	0.09
276	002266	浙富控股	14,700	70,413.00	0.09
277	600060	海信视像	5,600	70,000.00	0.09
278	600535	天士力	6,600	69,366.00	0.09
279	603712	七一二	2,200	69,300.00	0.09
280	601958	金钼股份	7,800	68,952.00	0.09
281	600201	生物股份	7,500	68,700.00	0.09
282	600282	南钢股份	21,800	68,670.00	0.09
283	000656	金科股份	24,000	68,640.00	0.09
284	002532	天山铝业	10,500	68,565.00	0.09
285	603885	吉祥航空	3,800	68,362.00	0.09
286	601106	中国一重	22,200	68,154.00	0.09
287	600811	东方集团	24,000	67,920.00	0.09
288	600517	国网英大	12,900	66,951.00	0.09
289	300630	普利制药	1,900	66,785.00	0.09
290	002958	青农商行	20,000	66,400.00	0.09

291	000709	河钢股份	29,300	66,218.00	0.09
292	601118	海南橡胶	13,800	65,964.00	0.09
293	600728	佳都科技	10,200	65,892.00	0.09
294	688208	道通科技	2,000	65,840.00	0.09
295	300463	迈克生物	3,200	65,568.00	0.08
296	600216	浙江医药	4,800	65,520.00	0.08
297	002745	木林森	6,700	65,459.00	0.08
298	600782	新钢股份	12,900	65,016.00	0.08
299	300115	长盈精密	6,300	64,953.00	0.08
300	600737	中粮糖业	8,600	64,672.00	0.08
301	600663	陆家嘴	6,200	64,232.00	0.08
302	000089	深圳机场	8,300	64,076.00	0.08
303	002002	鸿达兴业	17,200	63,812.00	0.08
304	600582	天地科技	13,300	63,574.00	0.08
305	603225	新凤鸣	5,500	63,470.00	0.08
306	000598	兴蓉环境	12,400	63,364.00	0.08
307	002004	华邦健康	11,300	63,054.00	0.08
308	000898	鞍钢股份	19,400	62,468.00	0.08
309	600435	北方导航	7,200	62,064.00	0.08
310	002690	美亚光电	2,860	62,004.80	0.08
311	600597	光明乳业	4,900	61,887.00	0.08
312	002701	奥瑞金	11,900	61,880.00	0.08
313	603883	老百姓	1,820	61,661.60	0.08
314	600507	方大特钢	8,700	60,813.00	0.08
315	002110	三钢闽光	9,900	60,291.00	0.08
316	002281	光迅科技	3,400	59,772.00	0.08
317	600037	歌华有线	6,300	59,157.00	0.08
318	000537	广宇发展	4,500	58,455.00	0.08
319	002468	申通快递	4,900	58,408.00	0.08
320	601778	晶科科技	10,800	58,320.00	0.08
321	002390	信邦制药	8,400	58,044.00	0.08
322	002368	太极股份	3,000	57,630.00	0.07
323	000402	金融街	9,600	57,120.00	0.07
324	002010	传化智联	8,800	56,584.00	0.07
325	600120	浙江东方	14,100	56,541.00	0.07
326	002429	兆驰股份	14,600	56,064.00	0.07
327	603927	中科软	2,400	55,968.00	0.07
328	000540	中天金融	28,700	55,391.00	0.07
329	603638	艾迪精密	2,700	55,350.00	0.07
330	000488	晨鸣纸业	9,800	55,272.00	0.07
331	601200	上海环境	5,400	54,864.00	0.07

332	601098	中南传媒	5,800	54,752.00	0.07
333	000685	中山公用	7,100	54,528.00	0.07
334	002867	周大生	3,500	54,355.00	0.07
335	600707	彩虹股份	11,600	54,288.00	0.07
336	000528	柳工	8,300	54,033.00	0.07
337	600967	内蒙一机	5,900	53,808.00	0.07
338	601611	中国核建	6,400	53,696.00	0.07
339	600021	上海电力	5,200	53,300.00	0.07
340	601608	中信重工	14,000	53,060.00	0.07
341	002146	荣盛发展	17,500	53,025.00	0.07
342	600764	中国海防	2,100	53,004.00	0.07
343	002399	海普瑞	3,000	52,740.00	0.07
344	600572	康恩贝	11,900	52,717.00	0.07
345	600959	江苏有线	16,100	52,486.00	0.07
346	601000	唐山港	20,300	52,374.00	0.07
347	600126	杭钢股份	10,200	52,224.00	0.07
348	002925	盈趣科技	2,400	51,648.00	0.07
349	300072	海新能科	10,200	51,612.00	0.07
350	002233	塔牌集团	5,800	51,330.00	0.07
351	002382	蓝帆医疗	5,300	50,615.00	0.07
352	002705	新宝股份	2,300	50,577.00	0.07
353	688088	虹软科技	1,600	50,544.00	0.07
354	300212	易华录	2,900	50,460.00	0.07
355	000959	首钢股份	10,600	50,456.00	0.07
356	688321	微芯生物	2,000	50,380.00	0.07
357	002174	游族网络	5,100	49,827.00	0.06
358	001965	招商公路	6,500	49,595.00	0.06
359	601598	中国外运	12,700	49,276.00	0.06
360	600307	酒钢宏兴	25,300	49,082.00	0.06
361	300166	东方国信	5,300	48,866.00	0.06
362	601333	广深铁路	22,300	48,614.00	0.06
363	601991	大唐发电	20,000	48,600.00	0.06
364	603317	天味食品	1,700	48,399.00	0.06
365	300257	开山股份	3,200	47,872.00	0.06
366	002081	金螳螂	9,300	47,244.00	0.06
367	600167	联美控股	6,300	47,187.00	0.06
368	000990	诚志股份	4,300	47,085.00	0.06
369	600131	国网信通	3,500	47,075.00	0.06
370	600717	天津港	11,700	46,917.00	0.06
371	600446	金证股份	4,500	46,710.00	0.06
372	002416	爱施德	5,000	46,500.00	0.06

373	000961	中南建设	15,200	46,360.00	0.06
374	000158	常山北明	7,700	46,200.00	0.06
375	002434	万里扬	5,400	46,170.00	0.06
376	600373	中文传媒	4,600	45,954.00	0.06
377	603650	彤程新材	1,400	45,612.00	0.06
378	000718	苏宁环球	12,200	44,896.00	0.06
379	600329	达仁堂	1,800	44,244.00	0.06
380	002387	维信诺	6,300	42,336.00	0.05
381	600376	首开股份	8,600	42,226.00	0.05
382	601860	紫金银行	14,700	42,189.00	0.05
383	600968	海油发展	16,300	42,054.00	0.05
384	000031	大悦城	10,300	41,200.00	0.05
385	600787	中储股份	7,200	40,968.00	0.05
386	600648	外高桥	3,000	40,800.00	0.05
387	603000	人民网	3,600	40,320.00	0.05
388	600928	西安银行	10,800	39,636.00	0.05
389	688289	圣湘生物	1,332	39,440.52	0.05
390	688029	南微医学	451	39,327.20	0.05
391	600339	中油工程	13,600	39,304.00	0.05
392	003035	南网能源	6,100	38,735.00	0.05
393	000967	盈峰环境	7,600	38,456.00	0.05
394	600623	华谊集团	4,600	38,180.00	0.05
395	603228	景旺电子	1,600	37,328.00	0.05
396	002815	崇达技术	2,900	37,149.00	0.05
397	600835	上海机电	2,600	35,698.00	0.05
398	002423	中粮资本	5,200	34,892.00	0.05
399	000717	韶钢松山	9,700	33,950.00	0.04
400	603056	德邦股份	2,500	33,575.00	0.04
401	603379	三美股份	1,500	33,375.00	0.04
402	601139	深圳燃气	4,600	31,924.00	0.04
403	000062	深圳华强	2,500	31,750.00	0.04
404	601298	青岛港	5,700	31,179.00	0.04
405	002948	青岛银行	8,580	31,059.60	0.04
406	601869	长飞光纤	1,000	30,920.00	0.04
407	002945	华林证券	2,000	30,500.00	0.04
408	600556	天下秀	3,700	30,451.00	0.04
409	603868	飞科电器	400	30,300.00	0.04
410	000028	国药一致	1,000	29,790.00	0.04
411	600871	石化油服	15,400	29,106.00	0.04
412	001872	招商港口	1,800	28,080.00	0.04
413	300741	华宝股份	1,000	27,820.00	0.04

414	600823	世茂股份	9,100	27,118.00	0.04
415	600095	湘财股份	3,500	26,915.00	0.03
416	601156	东航物流	1,300	25,740.00	0.03
417	300869	康泰医学	900	25,434.00	0.03
418	603355	莱克电气	900	22,707.00	0.03
419	601568	北元集团	3,520	22,316.80	0.03
420	601828	美凯龙	3,500	21,210.00	0.03
421	002653	海思科	1,300	20,943.00	0.03
422	603515	欧普照明	1,200	20,940.00	0.03
423	001203	大中矿业	1,700	19,210.00	0.02
424	600917	重庆燃气	2,600	18,772.00	0.02
425	601665	齐鲁银行	3,800	18,544.00	0.02
426	601003	柳钢股份	4,200	17,010.00	0.02
427	002901	大博医疗	400	15,656.00	0.02
428	601187	厦门银行	2,400	14,304.00	0.02
429	600956	新天绿能	1,100	13,552.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603290	斯达半导	3,800	1,466,420.00	1.90
2	688363	华熙生物	5,412	769,478.16	0.99
3	601689	拓普集团	9,200	629,556.00	0.81
4	002714	牧原股份	10,300	569,281.00	0.74
5	601066	中信建投	18,200	526,162.00	0.68
6	300458	全志科技	16,000	481,440.00	0.62
7	600416	湘电股份	25,000	474,000.00	0.61
8	000596	古井贡酒	1,800	449,388.00	0.58
9	300316	晶盛机电	6,600	446,094.00	0.58
10	688556	高测股份	5,324	429,646.80	0.56
11	002142	宁波银行	10,400	372,424.00	0.48
12	300777	中简科技	7,600	366,320.00	0.47
13	300763	锦浪科技	1,700	362,100.00	0.47
14	300035	中科电气	12,900	360,555.00	0.47
15	000733	振华科技	2,600	353,522.00	0.46
16	002352	顺丰控股	6,000	334,860.00	0.43
17	603339	四方科技	29,200	334,048.00	0.43
18	002340	格林美	34,700	315,770.00	0.41
19	300751	迈为股份	640	314,176.00	0.41
20	300850	新强联	3,500	311,605.00	0.40
21	002179	中航光电	4,480	283,673.60	0.37

22	688005	容百科技	2,000	258,880.00	0.33
23	600018	上港集团	41,700	243,111.00	0.31
24	601117	中国化学	22,900	215,489.00	0.28
25	002182	云海金属	8,400	210,672.00	0.27
26	600809	山西汾酒	600	194,880.00	0.25
27	000858	五 粮 液	900	181,737.00	0.23
28	002013	中航机电	14,200	175,370.00	0.23
29	688981	中芯国际	3,700	167,129.00	0.22
30	002539	云图控股	10,100	161,499.00	0.21
31	300223	北京君正	1,400	148,750.00	0.19
32	601089	福元医药	1,706	35,911.30	0.05
33	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01

## 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	603290	斯达半导	1,702,142.00	3.10
2	601456	国联证券	1,248,486.00	2.28
3	000858	五 粮 液	1,170,794.00	2.14
4	688521	芯原股份	1,156,838.10	2.11
5	000729	燕京啤酒	905,999.00	1.65
6	603613	国联股份	892,379.92	1.63
7	601009	南京银行	877,173.00	1.60
8	600316	洪都航空	871,045.00	1.59
9	603786	科 博 达	836,117.00	1.52
10	002384	东山精密	786,389.00	1.43
11	605117	德业股份	779,621.00	1.42
12	000519	中兵红箭	753,536.00	1.37
13	688363	华熙生物	749,061.52	1.37
14	601066	中信建投	723,004.00	1.32
15	600559	老白干酒	696,619.00	1.27
16	688390	固德威	693,914.75	1.27
17	002180	纳 思 达	623,920.00	1.14
18	300073	当升科技	621,699.00	1.13
19	300769	德方纳米	606,655.00	1.11
20	002714	牧原股份	519,604.00	0.95

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	000858	五粮液	967,646.00	1.76
2	601009	南京银行	821,356.00	1.50
3	600559	老白干酒	731,345.00	1.33
4	601456	国联证券	689,680.00	1.26
5	600188	兖矿能源	620,742.00	1.13
6	002268	卫士通	615,719.00	1.12
7	603290	斯达半导	498,273.00	0.91
8	688521	芯原股份	395,497.20	0.72
9	000776	广发证券	392,610.00	0.72
10	600999	招商证券	361,144.00	0.66
11	000498	山东路桥	325,978.00	0.59
12	600157	永泰能源	274,360.00	0.50
13	603986	兆易创新	267,615.00	0.49
14	000723	美锦能源	255,559.00	0.47
15	000878	云南铜业	255,239.00	0.47
16	000887	中鼎股份	246,459.00	0.45
17	600884	杉杉股份	234,443.00	0.43
18	601878	浙商证券	229,521.00	0.42
19	605358	立昂微	228,104.00	0.42
20	603613	国联股份	222,775.50	0.41

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	47,811,081.96
卖出股票收入（成交）总额	21,059,336.55

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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	788.39
2	应收清算款	68,378.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	118,494.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,661.73



#### 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	3,066	14,834.22	49,136.86	0.11%	45,432,572.98	99.89%
诺安中证 500 增强 C	838	37,566.53	26,554,964.0 0	84.35%	4,925,789.95	15.65%
合计	3,904	19,713.75	26,604,100.8 6	34.57%	50,358,362.93	65.43%

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	178,034.25	0.3914%
	诺安中证 500 增	93.17	0.0003%

	强 C		
	合计	178,127.42	0.2314%

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
	诺安中证 500 增强 C	0
	合计	0

## § 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	45,168,803.83	3,099,917.11
本报告期基金总申购份额	5,718,702.76	31,212,526.55
减：本报告期基金总赎回份额	5,405,796.75	2,831,689.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,481,709.84	31,480,753.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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，王学明先生担任公司董事、赵忆波先生不再担任公司董事，于东升先生不再担任公司副总经理。

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。

### 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

本报告期内，因未按期完成境外子公司股权架构简化工作，中国证监会责令公司改正，公司将继续加紧推进。

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	30,775,108.85	44.82%	22,156.92	38.58%	-
东北证券	1	6,336.00	0.01%	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	37,880,477.95	55.17%	35,281.46	61.42%	-
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

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	801,336.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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公司旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年01月01日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万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》	2022年01月14日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长量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》	2022年01月14日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加普益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》	2022年01月21日
5	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022年01月24日
6	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》、	2022年01月24日

		《证券日报》	
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加攀赢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》	2022年01月28日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中植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》	2022年01月28日
9	诺安基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022年01月31日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业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》	2022年02月10日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启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》	2022年02月11日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国美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》	2022年02月18日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承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》	2022年02月25日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加度小满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》	2022年03月04日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加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》	2022年03月10日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部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》	2022年03月11日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰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》	2022年03月15日
18	诺安基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	《上海证券报》	2022年03月18日
19	诺安基金管理有限公司关于开通平安银行借记卡直销网上交易业务并开展基金	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2022年03月22日

	费率优惠活动的公告	《证券日报》	
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息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》	2022年03月30日
21	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022年03月31日
22	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年03月31日
23	诺安基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月01日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海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》	2022年04月08日
25	诺安基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月14日
26	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022年04月22日
27	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2022年04月22日
28	诺安基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月29日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实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》	2022年05月18日
30	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》	2022年05月19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	2022年05月19日
32	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第 1 期	基金管理人网站	2022年05月19日
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华龙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》	2022年05月27日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、《上海证	2022年06月13日

	金增加广发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》	
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信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》	2022年06月15日
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝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》	2022年06月15日
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆享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》	2022年06月15日
38	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部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》	2022年06月17日
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行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》、《证券日报》	2022年06月17日
40	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金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》	2022年06月24日
41	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州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》、《证券日报》	2022年06月29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	1	20220624-20220630	-	20,274,766.75	-	20,274,766.75	26.34%

个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形,敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

## 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  
2022 年 08 月 31 日