

诺安中证 500 指数增强型证券投资基金
2024 年年度报告

2024 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

送出日期：2025 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 2025 年 03 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	净资产变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	46
8.1	期末基金资产组合情况	46
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	58
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65

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	65
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	65
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	65
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	65
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
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	67
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	67
§ 10	开放式基金份额变动	67
§ 11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
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	69
11.8	其他重大事件	70
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
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	74
13.3	查阅方式	74

§ 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	74,295,167.16 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	38,508,657.69 份	35,786,509.47 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	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	2024 年		2023 年		2022 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	810,722.61	1,865,540.64	-6,465,313.92	-257,167.86	-4,075,692.99	-2,203,109.75
本期利润	-525,616.96	1,794,930.11	-2,945,049.86	366,482.71	-9,761,743.06	-2,378,111.13
加权平均基	-0.0129	0.2930	-0.0652	0.1053	-0.2165	-0.1660

金份额本期利润						
本期加权平均净值利润率	-1.60%	36.00%	-7.00%	11.23%	-22.28%	-17.28%
本期基金份额净值增长率	-1.39%	-1.77%	-7.30%	-7.68%	-19.20%	-19.54%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 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	-6,193,704.65	-6,248,551.34	-7,630,908.86	-632,375.68	-3,737,800.83	-765,776.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1608	-0.1746	-0.1802	-0.1907	-0.0820	-0.0898
期末基金资产净值	32,314,953.04	29,537,958.13	36,030,413.86	2,787,167.28	41,860,145.36	7,761,022.55
期末基金份额净值	0.8392	0.8254	0.8510	0.8403	0.9180	0.9102
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 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	41.83%	-10.14%	43.82%	-8.51%	55.15%	-0.90%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	-2.74%	1.76%	-0.21%	1.93%	-2.53%	-0.17%
过去六个月	7.70%	1.72%	15.17%	1.91%	-7.47%	-0.19%
过去一年	-1.39%	1.64%	5.46%	1.73%	-6.85%	-0.09%
过去三年	-26.14%	1.30%	-20.77%	1.33%	-5.37%	-0.03%
过去五年	14.77%	1.36%	9.25%	1.31%	5.52%	0.05%
自基金合同生效起至今	41.83%	1.37%	33.14%	1.32%	8.69%	0.05%

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	-2.84%	1.76%	-0.21%	1.93%	-2.63%	-0.17%
过去六个月	7.50%	1.72%	15.17%	1.91%	-7.67%	-0.19%
过去一年	-1.77%	1.64%	5.46%	1.73%	-7.23%	-0.09%
过去三年	-27.03%	1.30%	-20.77%	1.33%	-6.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-10.14%	1.28%	-5.33%	1.23%	-4.81%	0.05%

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

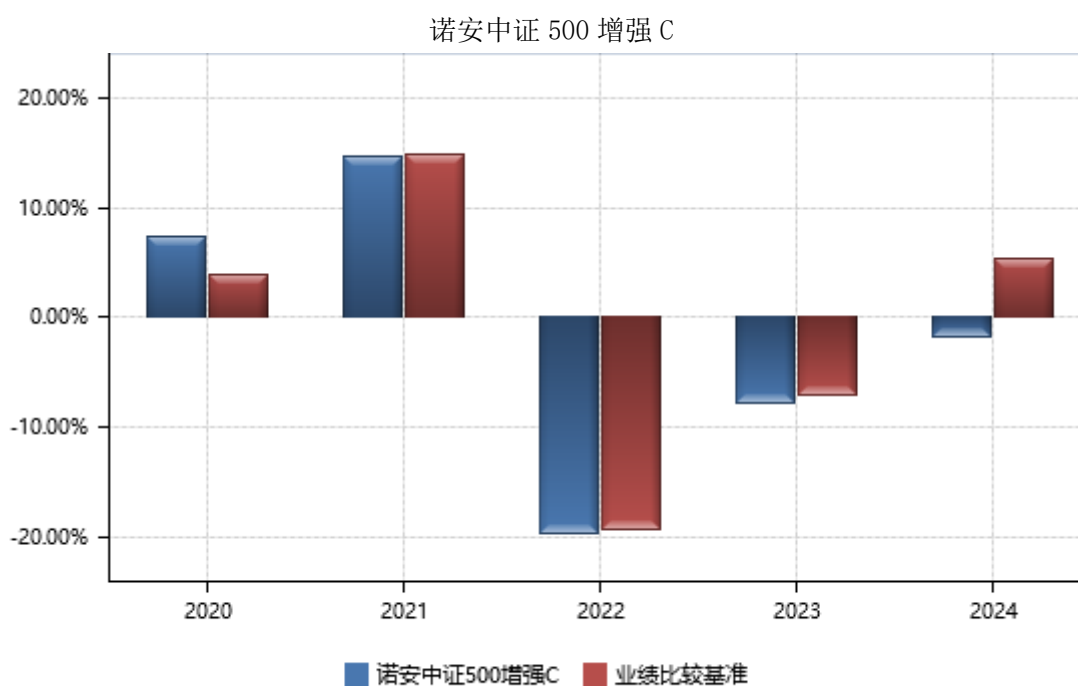
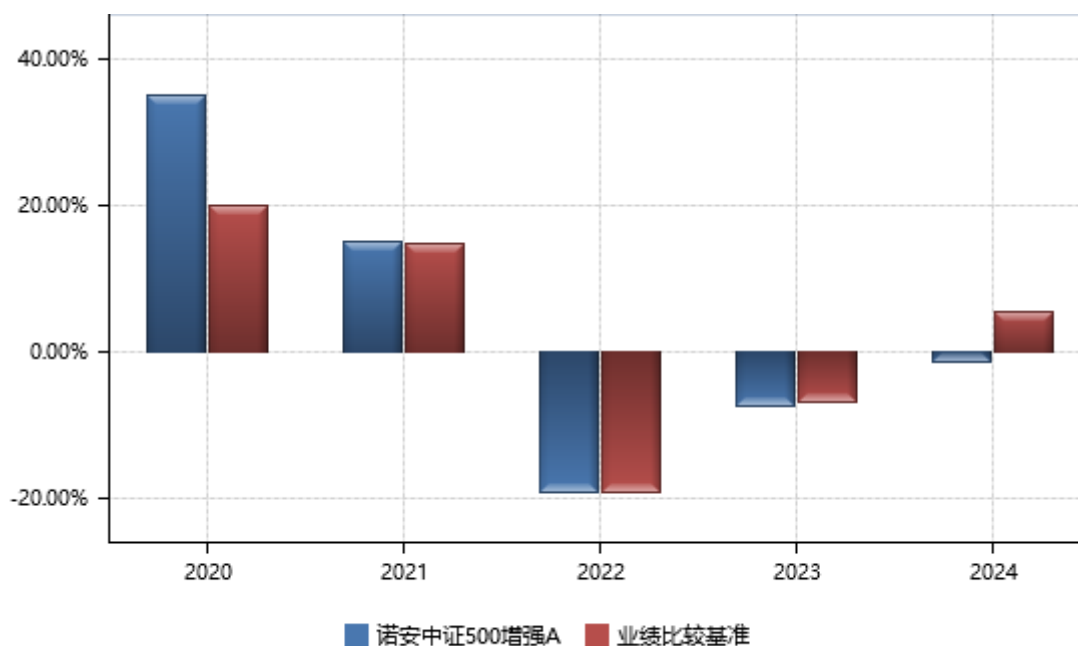
诺安中证 500 增强 A



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。

3.2.3 过去五年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



注：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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 A100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		

王海畅	本基金基金经理	2023 年 03 月 21 日	—	8 年	硕士，具有基金从业资格。2017 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2022 年 11 月至 2024 年 1 月任诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2022 年 7 月至 2024 年 8 月任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 11 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月起任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
孔宪政	本基金基金经理	2023 年 06 月 03 日	—	13 年	博士，具有基金从业资格。历任野村证券交易员、白湾基金投资经理、前海开源基金投资部副总监、兴证证券资产管理有限公司投资部投资经理、蜂巢基金管理有限公司基金经理。2021 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，现任多资产投资部总经理兼国际业务部总经理。2023 年 2 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。

					理，2023 年 6 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金及诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期指根据公司决定确定的聘任日期；

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

指数涨跌方面，2024 年全年中证 500 指数涨跌幅弱于沪深 300，强于中证 1000 和中证 2000。指数振幅方面，沪深 300、中证 500、中证 1000 三者较为接近，中证 2000 的振幅相对较大。行业指数方面，银行、非银行金融、家电、通信、交通运输等行业涨幅靠前，综合、医药、农林牧渔、消费者服务、房地产行业跌幅相对较多。指数估值和盈利能力方面，2024 年末与年初相比，沪深 300 指数的 PB 估值分位数指标有约 20% 左右的修复，盈利能力水平分位数的变动相对有限；中证 500 指数的 PB 估值分位数指标有约 10% 左右的修复，盈利能力水平分位数的变动同样相对有限。

大类因子表现方面，市值因子全年呈现较高的波动，非线性市值因子也曾在一季度出现显著超出历史长期均值的震荡，低估值类因子整体表现较好，综合成长类因子表现平淡但在年末呈现小幅修复的迹象。此外，弹性类风格因子的表现也值得关注，其全年均值呈现负向选股效果，但在 9 月末至 11 月中旬期间呈现强劲的正向选股效果，在此期间同时出现了“多数长期有效的价值因子表现显著负向偏离历史均值”现象，其可能的原因我们曾在四季报中有所提及。

报告期内产品对基准指数的跟踪误差控制符合事前预期。产品运作使用的投资策略在框架上分为深度学习类策略和多因子类策略，我们对深度学习类策略的参数做了进一步的精细调优，对多因子类策略的因子组合亦做了适应性调整，让后者为前者提供更为有效的补充，用两类策略协同争取为投资者提供更加稳定的超额收益。

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 0.8392 元,本报告期诺安中证 500 增强 A 份额净值增长率为-1.39%,同期业绩比较基准收益率为 5.46%;截至本报告期末诺安中证 500 增强 C 份额净值为 0.8254 元,本报告期诺安中证 500 增强 C 份额净值增长率为-1.77%,同期业绩比较基准收益率为 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

指数点位方面,我们维持在三季报中提到的观点,一系列金融支持经济高质量发展的政策出台和落地带来市场信心的提振,在后续有更多的上市公司经营业绩改善预期得到验证的场景下,指数有望继续企稳回升。

超额收益方面,我们认为在当前人工智能大模型训练和推理“效增本降”的趋势背景下,不同的大类因子迭代研发仍然面对不同模式的竞争格局。首先,随着大模型可得性的不断提升,各类投资者将技术分析理念与计算机代码结合参与市场交易的路径变得更加通顺,传统且经典的价格类因子出现阶段性失效的频率可能会比以往更高,但过程中也会形成新的交易行为规律,如何构建更好的深度学习或其他机器学习架构去捕捉这些新产生的规律,是我们会继续努力钻研的方向之一;另外,在基本面大类因子方面,通过数据分析复盘可知,上市公司 T 年的涨跌幅排序与 T 年的盈利增速存在稳定的截面正相关关系,而微观层面的企业盈利增速背后是宏观政策、地缘态势、市场、技术、企业家精神、偶发扰动等一系列因素的共同作用结果,借助大模型迭代出能与基本面类数据更好地融合从而对企业盈利增速做出更好预估的分析框架也是我们希望深入探究的方向之一。

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,本基金管理人始终秉持合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨,构建了多层级、多维度的合规风险控制体系。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落实及培训,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,基金管理人基金的日常投资运作进行持续的监督管理,强化基金流动性风险管理,完善压力测试与应急预案,确保基金资产的合规运作。监察稽核方面,基金管理人通过定期稽核和专项稽核相结合方式,对公司治理、基金投研交易、市场销售、后台运营、信息技术、人员管理、反洗钱管理等方面开展稽核检查;对检查中发现的问题,相关部门须认真总结、举一反三、明确具体整改措施,并定期跟踪督办,确保整改措施的有效落实。同时,基金管理人利用各种机会,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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

4.8 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

截至 2024 年 09 月 29 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；在 2024 年 10 月 22 日至 2024 年 12 月 25 日期间，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70053132_H31 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表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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。 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。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对诺安中证 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。 （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。 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。	
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	乌爱莉	邓雯
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	2025 年 03 月 28 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	3,821,726.88	2,221,858.79
结算备付金		230,849.18	146,101.99
存出保证金		9,734.04	1,473.07
交易性金融资产	7.4.7.2	57,993,103.90	36,267,987.94
其中：股票投资		57,993,103.90	36,267,987.94
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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	699,831.89
应收清算款		—	98,501.39
应收股利		—	—
应收申购款		1,359,502.73	108,630.23
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		63,414,916.73	39,544,385.30
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			

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		-	-
应付清算款		1,133,194.53	141,602.33
应付赎回款		301,222.31	358,044.45
应付管理人报酬		38,347.95	32,639.94
应付托管费		5,752.18	4,895.99
应付销售服务费		4,040.80	695.76
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	7.4.7.6	79,447.79	188,925.69
负债合计		1,562,005.56	726,804.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	74,295,167.16	45,655,393.73
未分配利润	7.4.7.8	-12,442,255.99	-6,837,812.59
净资产合计		61,852,911.17	38,817,581.14
负债和净资产总计		63,414,916.73	39,544,385.30

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，诺安中证 500 增强 A 基金份额净值 0.8392 元，基金份额总额 38,508,657.69 份；诺安中证 500 增强 C 基金份额净值 0.8254 元，基金份额总额 35,786,509.47 份。诺安中证 500 增强份额总额合计为 74,295,167.16 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,947,795.84	-1,762,816.34
1. 利息收入		14,756.74	17,409.21
其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,155.25	15,519.70
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		1,601.49	1,889.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,317,235.04	-5,936,317.42
其中：股票投资收益	7.4.7.10	2,718,412.36	-6,579,584.23
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	598,822.68	643,266.81
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-1,406,950.10	4,143,914.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	22,754.16	12,177.24
减：二、营业总支出		678,482.69	815,750.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	381,405.21	454,498.14
2. 托管费	7.4.10.2.2	57,210.74	68,174.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	20,858.54	13,314.49
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	219,008.20	279,763.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,269,313.15	-2,578,567.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,269,313.15	-2,578,567.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,269,313.15	-2,578,567.15

7.3 净资产变动表

会计主体：诺安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	45,655,393.73	-6,837,812.59	38,817,581.14
二、本期期初净资产	45,655,393.73	-6,837,812.59	38,817,581.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,639,773.43	-5,604,443.40	23,035,330.03
（一）、综合收益总额	-	1,269,313.15	1,269,313.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	28,639,773.43	-6,873,756.55	21,766,016.88
其中：1. 基金申购款	83,609,423.15	-16,024,178.40	67,585,244.75
2. 基金赎回款	-54,969,649.72	9,150,421.85	-45,819,227.87
（三）、本期向基金份额持有人分配利	-	-	-

润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	74,295,167.16	-12,442,255.99	61,852,911.17
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,124,744.78	-4,503,576.87	49,621,167.91
二、本期期初净资产	54,124,744.78	-4,503,576.87	49,621,167.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,469,351.05	-2,334,235.72	-10,803,586.77
（一）、综合收益总额	-	-2,578,567.15	-2,578,567.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-8,469,351.05	244,331.43	-8,225,019.62
其中：1. 基金申购款	15,018,089.88	-1,037,600.08	13,980,489.80
2. 基金赎回款	-23,487,440.93	1,281,931.51	-22,205,509.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	45,655,393.73	-6,837,812.59	38,817,581.14

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

何柳姿

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会

关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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）金融负债的分类

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。

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

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。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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

（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务工具投资的，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）本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本基金；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。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

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) 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) 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。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字(2022)566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外),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

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税(2016)36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式

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;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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,已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育附加。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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,股权的股息、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) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,821,726.88	2,221,858.79
等于：本金	3,821,198.71	2,221,591.73
加：应计利息	528.17	267.06
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	3,821,726.88	2,221,858.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		59,444,212.23	-	57,993,103.90	-1,451,108.33
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		59,444,212.23	-	57,993,103.90	-1,451,108.33
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		36,312,146.17	-	36,267,987.94	-44,158.23
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		36,312,146.17	-	36,267,987.94	-44,158.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	699,831.89	-
银行间市场	-	-
合计	699,831.89	-

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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14.10	672.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	23,444.05	111,253.62
其中：交易所市场	23,444.05	111,253.62
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	5,989.64	27,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	79,447.79	188,925.69

7.4.7.7 实收基金

诺安中证 500 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,338,624.86	42,338,624.86
本期申购	5,028,461.86	5,028,461.86
本期赎回（以“-”号填列）	-8,858,429.03	-8,858,429.03
本期末	38,508,657.69	38,508,657.69

诺安中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,316,768.87	3,316,768.87
本期申购	78,580,961.29	78,580,961.29
本期赎回（以“-”号填列）	-46,111,220.69	-46,111,220.69
本期末	35,786,509.47	35,786,509.47

7.4.7.8 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	-7,630,908.86	1,322,697.86	-6,308,211.00
本期期初	-7,630,908.86	1,322,697.86	-6,308,211.00
本期利润	810,722.61	-1,336,339.57	-525,616.96
本期基金份额交易产生的变动数	793,845.68	-153,722.37	640,123.31
其中：基金申购款	-1,124,616.75	245,628.68	-878,988.07
基金赎回款	1,918,462.43	-399,351.05	1,519,111.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,026,340.57	-167,364.08	-6,193,704.65

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	-632,375.68	102,774.09	-529,601.59
本期期初	-632,375.68	102,774.09	-529,601.59
本期利润	1,865,540.64	-70,610.53	1,794,930.11
本期基金份额交易产生的变动数	-7,337,860.94	-176,018.92	-7,513,879.86
其中：基金申购款	-18,595,627.95	3,450,437.62	-15,145,190.33
基金赎回款	11,257,767.01	-3,626,456.54	7,631,310.47
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-6,104,695.98	-143,855.36	-6,248,551.34
-----	---------------	-------------	---------------

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,628.20	12,036.03
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	3,447.83	3,318.34
其他	79.22	165.33
合计	13,155.25	15,519.70

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。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	334,392,258.78	329,604,521.82
减：卖出股票成本总额	331,176,562.76	335,318,504.59
减：交易费用	497,283.66	865,601.46
买卖股票差价收入	2,718,412.36	-6,579,584.23

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---	--

股票投资产生的股利收益	598,822.68	643,266.81
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	598,822.68	643,266.81

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,406,950.10	4,143,914.63
-- 股票投资	-1,406,950.10	4,143,914.63
-- 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	-1,406,950.10	4,143,914.63

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	22,555.55	10,935.38
其他	198.61	1,241.86
合计	22,754.16	12,177.24

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

审计费用	5,989.64	27,000.00
信息披露费	59,890.71	50,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	14.31	9.18
汇划手续费	3,113.54	2,754.35
指数使用费	150,000.00	200,000.00
合计	219,008.20	279,763.53

注：本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费、信息披露费等。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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
诺安控股（香港）有限公司	基金管理人的子公司
诺安基金（香港）有限公司	基金管理人子公司控股的公司

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内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内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内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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	381,405.21	454,498.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	163,701.58	198,982.37
应支付基金管理人的净管理费	217,703.63	255,515.77

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,210.74	68,174.65

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	-	2,415.67	2,415.67

中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	2,415.67	2,415.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	-	452.12	452.12
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	452.12	452.12

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年费率为 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。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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-活期存款	3,821,726.88	9,628.20	2,221,858.79	12,036.03

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

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内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 2024 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**

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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。

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 2024 年 12 月 31 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资（2023 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 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)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 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 2024 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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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						
货币资金	3,821,726.88	-	-	-	-	3,821,726.88
结算备付金	230,849.18	-	-	-	-	230,849.18
存出保证金	9,734.04	-	-	-	-	9,734.04
交易性金融资产	-	-	-	-	57,993,103.90	57,993,103.90
应收申购款	-	-	-	-	1,359,502.73	1,359,502.73
资产总计	4,062,310.10	-	-	-	59,352,606.63	63,414,916.73
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1,133,194.53	1,133,194.53
应付赎回款	-	-	-	-	301,222.31	301,222.31

应付管理人报酬	-	-	-	-	38,347.95	38,347.95
应付托管费	-	-	-	-	5,752.18	5,752.18
应付销售服务费	-	-	-	-	4,040.80	4,040.80
其他负债	-	-	-	-	79,447.79	79,447.79
负债总计	-	-	-	-	1,562,005.56	1,562,005.56
利率敏感度缺口	4,062,310.10	-	-	-	-57,790,601.07	61,852,911.17
上年度末 2023 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						
货币资金	2,221,858.79	-	-	-	-	2,221,858.79
结算备付金	146,101.99	-	-	-	-	146,101.99
存出保证金	1,473.07	-	-	-	-	1,473.07
交易性金融资产	-	-	-	-	36,267,987.94	36,267,987.94
买入返售金融资产	699,831.89	-	-	-	-	699,831.89
应收清算款	-	-	-	-	98,501.39	98,501.39
应收申购款	-	-	-	-	108,630.23	108,630.23
资产总计	3,069,265.74	-	-	-	36,475,119.56	39,544,385.30
负债						
应付清算款	-	-	-	-	141,602.33	141,602.33
应付赎回款	-	-	-	-	358,044.45	358,044.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	32,639.94	32,639.94
应付托管费	-	-	-	-	4,895.99	4,895.99
应付销售服务费	-	-	-	-	695.76	695.76
其他负债	-	-	-	-	188,925.69	188,925.69
负债总计	-	-	-	-	726,804.16	726,804.16
利率敏感度缺口	3,069,265.74	-	-	-	-35,748,315.40	38,817,581.14

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	57,993,103.90	93.76	36,267,987.94	93.43
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	57,993,103.90	93.76	36,267,987.94	93.43

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(2024 年 12 月 31 日)	上年度末(2023 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	2,927,407.88	1,731,020.57
	业绩比较基准下降 5%	-2,927,407.88	-1,731,020.57

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	57,993,103.90	36,248,891.94
第二层次	—	19,096.00
第三层次	—	—
合计	57,993,103.90	36,267,987.94

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 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	57,993,103.90	91.45
	其中：股票	57,993,103.90	91.45
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	4,052,576.06	6.39
8	其他各项资产	1,369,236.77	2.16
9	合计	63,414,916.73	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	131,791.00	0.21
B	采矿业	2,389,958.00	3.86
C	制造业	35,486,222.00	57.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,886,324.00	3.05
E	建筑业	471,735.00	0.76
F	批发和零售业	1,346,097.00	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	909,406.00	1.47
H	住宿和餐饮业	118,827.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,177,437.00	8.37
J	金融业	5,782,773.90	9.35
K	房地产业	800,367.00	1.29
L	租赁和商务服务业	426,322.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	566,159.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	278,792.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	139,740.00	0.23
Q	卫生和社会工作	478,945.00	0.77
R	文化、体育和娱乐业	725,801.00	1.17
S	综合	-	-
	合计	57,116,696.90	92.34

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	44,577.00	0.07
B	采矿业	4,536.00	0.01
C	制造业	354,697.00	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,688.00	0.07
E	建筑业	37,290.00	0.06
F	批发和零售业	88,951.00	0.14
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	112,548.00	0.18
J	金融业	103,710.00	0.17
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	42,570.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	42,840.00	0.07
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	876,407.00	1.42

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	002625	光启技术	10,100	482,780.00	0.78
2	300339	润和软件	8,700	435,261.00	0.70
3	601577	长沙银行	48,800	433,832.00	0.70
4	600879	航天电子	48,200	431,872.00	0.70
5	601555	东吴证券	54,900	428,220.00	0.69
6	002128	电投能源	21,400	419,012.00	0.68
7	000066	中国长城	28,400	413,788.00	0.67
8	600352	浙江龙盛	37,600	386,904.00	0.63
9	601168	西部矿业	24,000	385,680.00	0.62
10	002294	信立泰	12,400	383,532.00	0.62
11	300866	安克创新	3,900	380,796.00	0.62
12	600563	法拉电子	3,200	380,544.00	0.62
13	300207	欣旺达	17,000	379,270.00	0.61
14	600316	洪都航空	11,400	366,168.00	0.59

15	301236	软通动力	6,200	364,002.00	0.59
16	600418	江淮汽车	9,700	363,750.00	0.59
17	688469	芯联集成	70,600	362,178.00	0.59
18	002202	金风科技	34,200	353,286.00	0.57
19	600839	四川长虹	36,200	349,330.00	0.56
20	603087	甘李药业	7,800	343,980.00	0.56
21	688120	华海清科	2,000	325,980.00	0.53
22	002368	太极股份	13,700	324,416.00	0.52
23	300604	长川科技	7,200	317,736.00	0.51
24	600704	物产中大	62,600	316,756.00	0.51
25	300136	信维通信	12,400	315,456.00	0.51
26	301358	湖南裕能	6,900	312,708.00	0.51
27	603606	东方电缆	5,900	310,045.00	0.50
28	600546	山煤国际	26,200	309,946.00	0.50
29	300002	神州泰岳	26,700	309,453.00	0.50
30	002318	久立特材	13,200	309,012.00	0.50
31	002532	天山铝业	39,100	307,717.00	0.50
32	600109	国金证券	35,200	307,296.00	0.50
33	600298	安琪酵母	8,500	306,425.00	0.50
34	600392	盛和资源	29,600	304,288.00	0.49
35	688122	西部超导	7,000	299,740.00	0.48
36	688617	惠泰医疗	800	297,864.00	0.48
37	000728	国元证券	35,600	297,616.00	0.48
38	300142	沃森生物	24,000	289,920.00	0.47
39	600873	梅花生物	28,000	280,840.00	0.45
40	002508	老板电器	13,000	278,590.00	0.45
41	600642	申能股份	29,300	278,057.00	0.45
42	002507	涪陵榨菜	19,500	275,535.00	0.45
43	002444	巨星科技	8,500	274,975.00	0.44
44	000738	航发控制	12,300	273,552.00	0.44
45	601061	中信金属	37,400	271,524.00	0.44
46	688361	中科飞测	3,100	271,405.00	0.44
47	600536	中国软件	5,800	270,802.00	0.44
48	000729	燕京啤酒	22,300	268,492.00	0.43
49	688005	容百科技	8,500	268,175.00	0.43
50	000623	吉林敖东	15,400	265,958.00	0.43
51	002384	东山精密	9,100	265,720.00	0.43
52	002673	西部证券	32,200	262,430.00	0.42
53	688072	拓荆科技	1,700	261,239.00	0.42
54	300476	胜宏科技	6,200	260,958.00	0.42
55	000831	中国稀土	9,300	260,865.00	0.42

56	601108	财通证券	31,800	259,806.00	0.42
57	002517	恺英网络	19,000	258,590.00	0.42
58	002353	杰瑞股份	6,900	255,231.00	0.41
59	601866	中远海发	97,200	253,692.00	0.41
60	002025	航天电器	5,200	252,512.00	0.41
61	688425	铁建重工	56,800	249,920.00	0.40
62	600096	云天化	11,200	249,760.00	0.40
63	002653	海思科	7,400	246,050.00	0.40
64	000401	冀东水泥	46,900	245,287.00	0.40
65	600487	亨通光电	14,000	241,080.00	0.39
66	002797	第一创业	28,700	239,645.00	0.39
67	002065	东华软件	32,900	238,854.00	0.39
68	002465	海格通信	21,600	237,168.00	0.38
69	300888	稳健医疗	5,600	235,648.00	0.38
70	603129	春风动力	1,500	235,605.00	0.38
71	002340	格林美	36,000	235,080.00	0.38
72	600166	福田汽车	93,600	234,936.00	0.38
73	601615	明阳智能	18,600	234,546.00	0.38
74	688052	纳芯微	1,800	234,540.00	0.38
75	002261	拓维信息	12,700	232,537.00	0.38
76	300212	易华录	9,900	231,660.00	0.37
77	600867	通化东宝	28,700	231,322.00	0.37
78	600707	彩虹股份	28,100	230,982.00	0.37
79	600131	国网信通	12,200	230,702.00	0.37
80	002500	山西证券	36,700	230,476.00	0.37
81	000997	新大陆	11,500	229,425.00	0.37
82	300070	碧水源	44,800	226,688.00	0.37
83	000750	国海证券	52,700	225,556.00	0.36
84	002984	森麒麟	9,100	224,406.00	0.36
85	002281	光迅科技	4,300	224,331.00	0.36
86	600637	东方明珠	28,800	223,488.00	0.36
87	300573	兴齐眼药	3,200	223,296.00	0.36
88	601162	天风证券	49,500	221,760.00	0.36
89	600271	航天信息	24,300	221,373.00	0.36
90	300803	指南针	2,300	220,685.00	0.36
91	300144	宋城演艺	23,600	219,244.00	0.35
92	600141	兴发集团	10,100	219,170.00	0.35
93	000050	深天马 A	24,100	217,623.00	0.35
94	002926	华西证券	25,800	214,398.00	0.35
95	000683	远兴能源	38,300	214,097.00	0.35
96	002385	大北农	49,400	213,902.00	0.35

97	601399	国机重装	68,400	210,672.00	0.34
98	302132	中航成飞	2,900	208,162.00	0.34
99	002019	亿帆医药	19,400	207,968.00	0.34
100	301301	川宁生物	17,500	207,550.00	0.34
101	000559	万向钱潮	33,700	207,255.00	0.34
102	601106	中国一重	71,200	207,192.00	0.33
103	600663	陆家嘴	20,900	205,656.00	0.33
104	000783	长江证券	29,200	199,144.00	0.32
105	688249	晶合集成	8,500	198,390.00	0.32
106	600688	上海石化	65,500	197,810.00	0.32
107	600820	隧道股份	27,500	197,725.00	0.32
108	300073	当升科技	4,900	197,372.00	0.32
109	002409	雅克科技	3,400	197,030.00	0.32
110	600325	华发股份	34,100	196,416.00	0.32
111	002563	森马服饰	27,800	195,156.00	0.32
112	002262	恩华药业	7,900	192,365.00	0.31
113	002273	水晶光电	8,600	191,092.00	0.31
114	600885	宏发股份	6,000	190,920.00	0.31
115	000513	丽珠集团	5,000	190,000.00	0.31
116	600516	方大炭素	39,300	189,819.00	0.31
117	300140	节能环保	31,600	189,284.00	0.31
118	002487	大金重工	9,200	188,508.00	0.30
119	000423	东阿阿胶	3,000	188,160.00	0.30
120	600872	中炬高新	8,500	187,170.00	0.30
121	002624	完美世界	18,100	186,973.00	0.30
122	600143	金发科技	21,600	186,624.00	0.30
123	600517	国网英大	33,600	185,136.00	0.30
124	000426	兴业银锡	16,600	184,592.00	0.30
125	601966	玲珑轮胎	10,200	184,008.00	0.30
126	603885	吉祥航空	13,400	183,580.00	0.30
127	600977	中国电影	15,800	183,438.00	0.30
128	600928	西安银行	50,600	182,666.00	0.30
129	600361	创新新材	47,200	182,192.00	0.29
130	300390	天华新能	7,900	182,095.00	0.29
131	002414	高德红外	24,400	181,292.00	0.29
132	605358	立昂微	7,300	180,821.00	0.29
133	002939	长城证券	22,000	180,400.00	0.29
134	601016	节能风电	56,500	179,105.00	0.29
135	603939	益丰药房	7,400	178,562.00	0.29
136	300058	蓝色光标	19,100	177,248.00	0.29
137	601918	新集能源	24,400	175,192.00	0.28

138	688065	凯赛生物	4,400	170,720.00	0.28
139	600435	北方导航	17,400	169,824.00	0.27
140	601965	中国汽研	9,600	169,152.00	0.27
141	600390	五矿资本	25,900	167,055.00	0.27
142	002850	科达利	1,700	166,056.00	0.27
143	600416	湘电股份	14,700	165,963.00	0.27
144	601158	重庆水务	33,800	165,620.00	0.27
145	300024	机器人	9,100	163,345.00	0.26
146	000060	中金岭南	34,800	163,212.00	0.26
147	002756	永兴材料	4,300	162,196.00	0.26
148	601231	环旭电子	9,800	161,700.00	0.26
149	600329	达仁堂	5,200	160,160.00	0.26
150	600499	科达制造	20,500	159,900.00	0.26
151	603858	步长制药	10,100	159,580.00	0.26
152	003035	南网能源	38,100	159,258.00	0.26
153	000009	中国宝安	17,400	159,210.00	0.26
154	300751	迈为股份	1,500	157,725.00	0.26
155	002831	裕同科技	5,800	157,180.00	0.25
156	601212	白银有色	56,500	157,070.00	0.25
157	603882	金域医学	5,700	156,921.00	0.25
158	601567	三星医疗	5,100	156,876.00	0.25
159	600528	中铁工业	19,400	156,364.00	0.25
160	688387	信科移动	26,100	155,556.00	0.25
161	603486	科沃斯	3,300	155,100.00	0.25
162	600925	苏能股份	28,900	153,170.00	0.25
163	688301	奕瑞科技	1,600	152,912.00	0.25
164	002078	太阳纸业	10,200	151,674.00	0.25
165	000988	华工科技	3,500	151,550.00	0.25
166	002867	周大生	10,400	151,112.00	0.24
167	601568	北元集团	35,700	149,940.00	0.24
168	300765	新诺威	5,600	148,904.00	0.24
169	002120	韵达股份	19,600	147,392.00	0.24
170	603707	健友股份	11,100	147,297.00	0.24
171	603596	伯特利	3,300	147,147.00	0.24
172	002958	青农商行	48,400	147,136.00	0.24
173	603927	中科软	6,720	145,824.00	0.24
174	688002	睿创微纳	3,100	145,731.00	0.24
175	600901	江苏金租	27,900	145,638.00	0.24
176	600132	重庆啤酒	2,300	144,946.00	0.23
177	603185	弘元绿能	8,900	144,625.00	0.23
178	600578	京能电力	40,900	143,968.00	0.23

179	600583	海油工程	26,200	143,314.00	0.23
180	000032	深桑达 A	8,100	142,884.00	0.23
181	600153	建发股份	13,500	142,020.00	0.23
182	601608	中信重工	33,700	141,540.00	0.23
183	600737	中粮糖业	13,800	140,898.00	0.23
184	002607	中公教育	41,100	139,740.00	0.23
185	601233	桐昆股份	11,800	139,240.00	0.23
186	600032	浙江新能	18,700	138,380.00	0.22
187	688172	燕东微	6,900	138,345.00	0.22
188	688248	南网科技	4,300	137,987.00	0.22
189	600549	厦门钨业	7,100	136,817.00	0.22
190	600566	济川药业	4,700	136,676.00	0.22
191	601099	太平洋	31,800	135,468.00	0.22
192	688563	航材股份	2,400	134,016.00	0.22
193	002064	华峰化学	16,300	133,334.00	0.22
194	600909	华安证券	22,000	133,320.00	0.22
195	600157	永泰能源	77,400	132,354.00	0.21
196	002153	石基信息	18,500	132,090.00	0.21
197	600008	首创环保	39,900	130,872.00	0.21
198	600739	辽宁成大	12,600	130,410.00	0.21
199	002244	滨江集团	15,100	130,011.00	0.21
200	603786	科博达	2,100	129,780.00	0.21
201	600380	健康元	11,500	129,605.00	0.21
202	601666	平煤股份	12,900	129,258.00	0.21
203	000937	冀中能源	20,400	128,928.00	0.21
204	002044	美年健康	28,000	128,520.00	0.21
205	603816	顾家家居	4,600	126,868.00	0.21
206	002185	华天科技	10,900	126,549.00	0.20
207	000733	振华科技	3,000	126,510.00	0.20
208	600995	南网储能	12,500	126,500.00	0.20
209	300724	捷佳伟创	2,000	126,420.00	0.20
210	601991	大唐发电	44,200	125,970.00	0.20
211	300251	光线传媒	13,200	124,608.00	0.20
212	300699	光威复材	3,500	121,275.00	0.20
213	000987	越秀资本	17,200	120,744.00	0.20
214	002203	海亮股份	11,200	120,400.00	0.19
215	300487	蓝晓科技	2,500	119,675.00	0.19
216	603529	爱玛科技	2,900	118,958.00	0.19
217	600258	首旅酒店	8,100	118,827.00	0.19
218	000591	太阳能	24,900	118,524.00	0.19
219	300677	英科医疗	4,600	116,288.00	0.19

220	600763	通策医疗	2,600	115,440.00	0.19
221	002966	苏州银行	14,000	113,540.00	0.18
222	601098	中南传媒	7,500	112,575.00	0.18
223	300037	新宙邦	3,000	112,320.00	0.18
224	603179	新泉股份	2,600	111,020.00	0.18
225	688538	和辉光电	47,700	110,664.00	0.18
226	002432	九安医疗	2,700	110,106.00	0.18
227	601179	中国西电	14,400	109,296.00	0.18
228	601228	广州港	32,200	109,158.00	0.18
229	000739	普洛药业	6,700	108,942.00	0.18
230	002268	电科网安	6,700	108,875.00	0.18
231	600038	中直股份	2,800	107,968.00	0.17
232	002138	顺络电子	3,400	107,032.00	0.17
233	000039	中集集团	13,700	106,449.00	0.17
234	688390	固德威	2,600	106,340.00	0.17
235	300529	健帆生物	3,600	105,624.00	0.17
236	600312	平高电气	5,500	105,600.00	0.17
237	600755	厦门国贸	15,800	104,912.00	0.17
238	688521	芯原股份	2,000	104,860.00	0.17
239	000893	亚钾国际	5,200	104,832.00	0.17
240	002572	索菲亚	6,100	104,798.00	0.17
241	003031	中瓷电子	2,000	104,780.00	0.17
242	601156	东航物流	6,200	104,594.00	0.17
243	600612	老凤祥	1,900	103,113.00	0.17
244	002423	中粮资本	7,700	103,103.00	0.17
245	600959	江苏有线	30,700	102,845.00	0.17
246	688278	特宝生物	1,400	102,718.00	0.17
247	002372	伟星新材	8,100	102,303.00	0.17
248	688349	三一重能	3,300	101,904.00	0.16
249	600848	上海临港	10,000	101,000.00	0.16
250	688772	珠海冠宇	6,200	99,696.00	0.16
251	002557	洽洽食品	3,400	98,770.00	0.16
252	300957	贝泰妮	2,300	98,187.00	0.16
253	000967	盈峰环境	19,400	96,418.00	0.16
254	600282	南钢股份	20,500	96,145.00	0.16
255	003022	联泓新科	6,900	95,013.00	0.15
256	600720	中交设计	10,600	93,916.00	0.15
257	688213	思特威	1,200	93,264.00	0.15
258	603556	海兴电力	2,500	92,475.00	0.15
259	000563	陕国投 A	25,700	91,492.00	0.15
260	002558	巨人网络	7,200	91,368.00	0.15

261	300054	鼎龙股份	3,500	91,070.00	0.15
262	603826	坤彩科技	4,700	90,475.00	0.15
263	601128	常熟银行	11,170	84,556.90	0.14
264	688099	晶晨股份	1,200	82,416.00	0.13
265	002223	鱼跃医疗	2,200	80,278.00	0.13
266	600598	北大荒	5,300	78,175.00	0.13
267	301267	华夏眼科	4,100	78,064.00	0.13
268	600884	杉杉股份	10,400	77,480.00	0.13
269	600511	国药股份	2,200	75,284.00	0.12
270	000636	风华高科	5,200	74,620.00	0.12
271	300012	华测检测	6,000	74,580.00	0.12
272	000825	太钢不锈	20,600	71,688.00	0.12
273	300395	菲利华	1,900	71,459.00	0.12
274	600862	中航高科	2,800	70,728.00	0.11
275	000598	兴蓉环境	9,200	69,828.00	0.11
276	300373	扬杰科技	1,600	69,632.00	0.11
277	688777	中控技术	1,400	69,538.00	0.11
278	002156	通富微电	2,300	67,965.00	0.11
279	600521	华海药业	3,800	67,906.00	0.11
280	601155	新城控股	5,600	66,976.00	0.11
281	000921	海信家电	2,300	66,470.00	0.11
282	002155	湖南黄金	4,200	66,066.00	0.11
283	002410	广联达	5,600	65,856.00	0.11
284	002739	万达电影	5,400	65,556.00	0.11
285	002595	豪迈科技	1,300	65,247.00	0.11
286	603338	浙江鼎力	1,000	64,520.00	0.10
287	688778	厦钨新能	1,400	63,896.00	0.10
288	603290	斯达半导	700	62,874.00	0.10
289	601717	郑煤机	4,800	62,304.00	0.10
290	688525	佰维存储	1,000	61,970.00	0.10
291	603979	金诚信	1,700	61,710.00	0.10
292	000703	恒逸石化	9,700	60,916.00	0.10
293	601665	齐鲁银行	10,800	60,372.00	0.10
294	000778	新兴铸管	15,600	59,904.00	0.10
295	300558	贝达药业	1,100	59,323.00	0.10
296	002841	视源股份	1,600	59,056.00	0.10
297	600004	白云机场	6,100	58,560.00	0.09
298	600988	赤峰黄金	3,700	57,757.00	0.09
299	603379	三美股份	1,500	57,570.00	0.09
300	601990	南京证券	6,600	57,156.00	0.09
301	603658	安图生物	1,300	56,732.00	0.09

302	002430	杭氧股份	2,600	56,680.00	0.09
303	000932	华菱钢铁	13,500	56,430.00	0.09
304	600895	张江高科	2,100	56,280.00	0.09
305	600582	天地科技	9,000	55,620.00	0.09
306	000958	电投产融	8,900	55,447.00	0.09
307	603737	三棵树	1,300	55,380.00	0.09
308	300009	安科生物	6,400	55,296.00	0.09
309	601611	中国核建	6,100	55,144.00	0.09
310	300763	锦浪科技	900	54,963.00	0.09
311	301498	乖宝宠物	700	54,824.00	0.09
312	601958	金钼股份	5,400	54,324.00	0.09
313	688220	翱捷科技	1,000	54,090.00	0.09
314	600655	豫园股份	8,400	54,012.00	0.09
315	000027	深圳能源	8,300	53,784.00	0.09
316	000998	隆平高科	4,800	53,616.00	0.09
317	601001	晋控煤业	3,900	53,313.00	0.09
318	601933	永辉超市	8,400	53,256.00	0.09
319	300595	欧普康视	2,800	53,060.00	0.09
320	601598	中国外运	9,800	52,430.00	0.08
321	600021	上海电力	5,700	52,269.00	0.08
322	600998	九州通	10,200	52,224.00	0.08
323	600056	中国医药	4,700	52,170.00	0.08
324	002266	浙富控股	16,700	52,104.00	0.08
325	600497	驰宏锌锗	9,200	51,244.00	0.08
326	688234	天岳先进	1,000	51,200.00	0.08
327	688516	奥特维	1,100	47,641.00	0.08
328	600095	湘财股份	6,600	47,520.00	0.08
329	000537	中绿电	5,200	47,424.00	0.08
330	300919	中伟股份	1,300	46,956.00	0.08
331	688536	思瑞浦	500	46,250.00	0.07
332	601997	贵阳银行	7,700	46,200.00	0.07
333	000959	首钢股份	15,000	45,750.00	0.07
334	000898	鞍钢股份	19,000	45,600.00	0.07
335	600871	石化油服	22,300	45,492.00	0.07
336	600764	中国海防	1,600	45,312.00	0.07
337	688331	荣昌生物	1,500	45,165.00	0.07
338	688375	国博电子	900	44,424.00	0.07
339	600007	中国国贸	1,800	44,028.00	0.07
340	301165	锐捷网络	600	43,320.00	0.07
341	688475	萤石网络	1,400	42,266.00	0.07
342	600079	人福医药	1,800	42,084.00	0.07

343	000539	粤电力 A	9,200	41,676.00	0.07
344	600927	永安期货	3,100	40,889.00	0.07
345	002738	中矿资源	1,100	39,050.00	0.06
346	688188	柏楚电子	200	38,850.00	0.06
347	300474	景嘉微	400	37,396.00	0.06
348	600970	中材国际	3,800	36,024.00	0.06
349	600606	绿地控股	16,300	34,230.00	0.06
350	688032	禾迈股份	300	33,792.00	0.05
351	001227	兰州银行	13,700	33,702.00	0.05
352	002195	岩山科技	8,400	33,348.00	0.05
353	603893	瑞芯微	300	33,018.00	0.05
354	002439	启明星辰	2,000	31,640.00	0.05
355	002085	万丰奥威	1,600	30,320.00	0.05
356	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.04
357	300017	网宿科技	2,500	26,425.00	0.04
358	600098	广州发展	4,000	25,680.00	0.04
359	300676	华大基因	600	25,182.00	0.04
360	603228	景旺电子	900	25,056.00	0.04
361	600968	海油发展	5,200	22,204.00	0.04
362	000021	深科技	1,100	20,966.00	0.03
363	300223	北京君正	300	20,460.00	0.03
364	601858	中国科传	1,000	20,380.00	0.03
365	600498	烽火通信	1,000	19,460.00	0.03
366	002568	百润股份	600	16,806.00	0.03
367	300146	汤臣倍健	1,200	14,460.00	0.02
368	689009	九号公司	300	14,250.00	0.02
369	600060	海信视像	700	13,958.00	0.02
370	300496	中科创达	200	11,912.00	0.02
371	600859	王府井	700	10,787.00	0.02
372	603156	养元饮品	400	9,136.00	0.01
373	300748	金力永磁	500	8,940.00	0.01
374	002240	盛新锂能	500	6,890.00	0.01
375	601198	东兴证券	600	6,606.00	0.01
376	300001	特锐德	300	6,585.00	0.01
377	600339	中油工程	1,600	5,728.00	0.01
378	603456	九洲药业	400	5,472.00	0.01
379	002008	大族激光	200	5,000.00	0.01
380	000723	美锦能源	500	2,255.00	0.00
381	000785	居然智家	600	2,142.00	0.00
382	600863	内蒙华电	200	866.00	0.00

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	605080	浙江自然	2,000	47,000.00	0.08
2	301327	华宝新能	600	46,026.00	0.07
3	000541	佛山照明	7,300	45,260.00	0.07
4	002881	美格智能	1,500	44,940.00	0.07
5	600310	广西能源	9,800	44,688.00	0.07
6	300498	温氏股份	2,700	44,577.00	0.07
7	002001	新和成	2,000	43,940.00	0.07
8	603799	华友钴业	1,500	43,890.00	0.07
9	600827	百联股份	4,000	43,720.00	0.07
10	003005	竞业达	1,600	43,392.00	0.07
11	000686	东北证券	5,400	42,876.00	0.07
12	688131	皓元医药	1,200	42,840.00	0.07
13	688588	凌志软件	3,100	42,780.00	0.07
14	600861	北京人力	2,200	42,570.00	0.07
15	601618	中国中冶	11,300	37,290.00	0.06
16	300502	新易盛	300	34,674.00	0.06
17	002961	瑞达期货	2,300	33,051.00	0.05
18	002768	国恩股份	1,400	32,298.00	0.05
19	600000	浦发银行	2,700	27,783.00	0.04
20	301015	百洋医药	1,100	26,631.00	0.04
21	600710	苏美达	2,000	18,600.00	0.03
22	600633	浙数文化	1,700	17,782.00	0.03
23	600690	海尔智家	500	14,235.00	0.02
24	688508	芯朋微	200	8,594.00	0.01
25	601899	紫金矿业	300	4,536.00	0.01
26	600703	三安光电	200	2,434.00	0.00

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	601555	东吴证券	1,645,234.01	4.24
2	002273	水晶光电	1,573,712.00	4.05
3	601717	郑煤机	1,474,313.00	3.80
4	603606	东方电缆	1,464,881.00	3.77
5	000683	远兴能源	1,437,473.00	3.70
6	600062	华润双鹤	1,426,423.00	3.67

7	300866	安克创新	1,411,769.00	3.64
8	600282	南钢股份	1,403,566.00	3.62
9	688188	柏楚电子	1,381,103.20	3.56
10	300529	健帆生物	1,361,468.00	3.51
11	300502	新易盛	1,349,559.00	3.48
12	000050	深天马 A	1,307,523.00	3.37
13	002128	电投能源	1,285,877.00	3.31
14	603444	吉比特	1,248,254.00	3.22
15	600988	赤峰黄金	1,215,134.00	3.13
16	600873	梅花生物	1,214,772.00	3.13
17	002384	东山精密	1,211,825.00	3.12
18	600096	云天化	1,199,652.00	3.09
19	601231	环旭电子	1,197,808.00	3.09
20	002532	天山铝业	1,196,006.00	3.08
21	603786	科博达	1,179,446.00	3.04
22	002444	巨星科技	1,175,739.00	3.03
23	300114	中航电测	1,172,920.00	3.02
24	301236	软通动力	1,168,804.00	3.01
25	600707	彩虹股份	1,135,925.00	2.93
26	002340	格林美	1,124,880.00	2.90
27	600879	航天电子	1,120,820.00	2.89
28	002185	华天科技	1,103,901.00	2.84
29	601077	渝农商行	1,102,357.00	2.84
30	600348	华阳股份	1,086,281.00	2.80
31	600839	四川长虹	1,085,942.00	2.80
32	600418	江淮汽车	1,067,107.00	2.75
33	002156	通富微电	1,066,281.00	2.75
34	002465	海格通信	1,056,192.00	2.72
35	002422	科伦药业	1,050,232.00	2.71
36	300699	光威复材	1,048,244.00	2.70
37	002056	横店东磁	1,044,147.00	2.69
38	601577	长沙银行	1,041,330.00	2.68
39	000933	神火股份	1,031,462.00	2.66
40	002831	裕同科技	1,024,925.00	2.64
41	601108	财通证券	1,008,130.70	2.60
42	002025	航天电器	1,002,815.00	2.58
43	601128	常熟银行	997,578.00	2.57
44	601168	西部矿业	995,850.00	2.57
45	600038	中直股份	994,128.00	2.56
46	600663	陆家嘴	987,079.00	2.54
47	600352	浙江龙盛	975,243.00	2.51

48	688122	西部超导	974,288.66	2.51
49	002294	信立泰	969,971.00	2.50
50	600704	物产中大	966,365.00	2.49
51	002414	高德红外	956,755.00	2.46
52	600141	兴发集团	954,721.00	2.46
53	600549	厦门钨业	950,484.00	2.45
54	000988	华工科技	949,548.00	2.45
55	000066	中国长城	940,866.00	2.42
56	300390	天华新能	938,287.10	2.42
57	300724	捷佳伟创	935,986.00	2.41
58	601098	中南传媒	933,996.00	2.41
59	300009	安科生物	932,805.00	2.40
60	000729	燕京啤酒	931,838.00	2.40
61	000887	中鼎股份	924,590.00	2.38
62	601568	北元集团	924,541.00	2.38
63	300207	欣旺达	923,173.00	2.38
64	002153	石基信息	921,064.00	2.37
65	300136	信维通信	916,601.00	2.36
66	601866	中远海发	914,681.00	2.36
67	600642	申能股份	912,827.00	2.35
68	600079	人福医药	910,551.00	2.35
69	002472	双环传动	909,553.00	2.34
70	600885	宏发股份	905,015.00	2.33
71	689009	九号公司	900,960.32	2.32
72	002138	顺络电子	900,112.00	2.32
73	000728	国元证券	898,721.00	2.32
74	300003	乐普医疗	897,763.00	2.31
75	688772	珠海冠宇	895,177.44	2.31
76	603589	口子窖	892,926.18	2.30
77	600499	科达制造	892,494.00	2.30
78	600884	杉杉股份	885,919.00	2.28
79	300251	光线传媒	884,550.00	2.28
80	000783	长江证券	882,350.00	2.27
81	002078	太阳纸业	881,319.00	2.27
82	688099	晶晨股份	874,692.45	2.25
83	600517	国网英大	872,435.00	2.25
84	688538	和辉光电	871,930.74	2.25
85	601990	南京证券	870,190.00	2.24
86	600563	法拉电子	869,217.00	2.24
87	300604	长川科技	861,759.00	2.22
88	600390	五矿资本	861,123.00	2.22

89	002120	韵达股份	857,488.00	2.21
90	601666	平煤股份	851,144.00	2.19
91	688425	铁建重工	847,483.50	2.18
92	002281	光迅科技	846,631.00	2.18
93	002353	杰瑞股份	845,307.00	2.18
94	600521	华海药业	844,752.00	2.18
95	002065	东华软件	844,070.00	2.17
96	002500	山西证券	841,891.00	2.17
97	000039	中集集团	839,741.00	2.16
98	600546	山煤国际	839,028.00	2.16
99	688065	凯赛生物	836,702.29	2.16
100	603160	汇顶科技	832,325.00	2.14
101	688220	翱捷科技	832,267.19	2.14
102	603688	石英股份	830,822.00	2.14
103	002385	大北农	828,329.00	2.13
104	600765	中航重机	827,130.43	2.13
105	002653	海思科	822,200.00	2.12
106	601615	明阳智能	821,695.00	2.12
107	000738	航发控制	816,969.00	2.10
108	002683	广东宏大	815,726.00	2.10
109	002625	光启技术	815,383.00	2.10
110	300296	利亚德	810,373.00	2.09
111	601233	桐昆股份	809,950.00	2.09
112	600380	健康元	807,649.00	2.08
113	002008	大族激光	807,549.00	2.08
114	000559	万向钱潮	807,229.12	2.08
115	603939	益丰药房	800,774.00	2.06
116	002028	思源电气	799,781.00	2.06
117	002429	兆驰股份	795,755.00	2.05
118	000975	山金国际	794,998.20	2.05
119	600909	华安证券	789,949.00	2.04
120	000997	新大陆	789,256.00	2.03
121	600737	中粮糖业	784,488.00	2.02
122	600392	盛和资源	781,721.40	2.01
123	601058	赛轮轮胎	781,631.00	2.01
124	002739	万达电影	779,770.00	2.01
125	002673	西部证券	779,753.00	2.01
126	002487	大金重工	776,434.00	2.00

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	002273	水晶光电	1,770,155.00	4.56
2	600062	华润双鹤	1,553,299.56	4.00
3	300502	新易盛	1,549,574.00	3.99
4	688188	柏楚电子	1,419,365.65	3.66
5	601077	渝农商行	1,411,070.00	3.64
6	603606	东方电缆	1,401,020.00	3.61
7	601555	东吴证券	1,398,400.00	3.60
8	300529	健帆生物	1,327,340.00	3.42
9	601717	郑煤机	1,293,595.00	3.33
10	600988	赤峰黄金	1,285,519.00	3.31
11	600282	南钢股份	1,273,801.00	3.28
12	603444	吉比特	1,269,884.00	3.27
13	601231	环旭电子	1,265,700.00	3.26
14	002472	双环传动	1,254,227.00	3.23
15	300866	安克创新	1,217,313.60	3.14
16	600873	梅花生物	1,197,245.00	3.08
17	002384	东山精密	1,189,496.00	3.06
18	601058	赛轮轮胎	1,172,343.00	3.02
19	000683	远兴能源	1,151,244.00	2.97
20	002128	电投能源	1,129,083.00	2.91
21	600066	宇通客车	1,105,340.00	2.85
22	002422	科伦药业	1,092,001.00	2.81
23	002532	天山铝业	1,077,714.00	2.78
24	002156	通富微电	1,068,640.00	2.75
25	000933	神火股份	1,065,712.00	2.75
26	300114	中航电测	1,059,388.00	2.73
27	601128	常熟银行	1,032,340.00	2.66
28	688220	翱捷科技	1,025,580.43	2.64
29	000050	深天马 A	1,021,553.00	2.63
30	002831	裕同科技	1,020,439.00	2.63
31	600038	中直股份	1,009,557.00	2.60
32	300699	光威复材	1,009,534.00	2.60
33	688099	晶晨股份	1,008,705.01	2.60
34	600096	云天化	1,007,524.00	2.60
35	002056	横店东磁	1,002,797.00	2.58
36	600707	彩虹股份	1,000,244.00	2.58
37	002185	华天科技	999,219.92	2.57
38	600348	华阳股份	997,213.00	2.57
39	600663	陆家嘴	996,963.80	2.57

40	002028	思源电气	995,451.00	2.56
41	000039	中集集团	993,785.00	2.56
42	600765	中航重机	985,062.00	2.54
43	300001	特锐德	977,625.00	2.52
44	000728	国元证券	972,239.00	2.50
45	000887	中鼎股份	971,194.00	2.50
46	300009	安科生物	967,536.00	2.49
47	600909	华安证券	964,271.70	2.48
48	300003	乐普医疗	951,488.00	2.45
49	300251	光线传媒	943,528.00	2.43
50	603786	科博达	940,580.00	2.42
51	002138	顺络电子	939,163.00	2.42
52	000975	山金国际	938,143.00	2.42
53	600390	五矿资本	938,074.00	2.42
54	002444	巨星科技	937,403.00	2.41
55	689009	九号公司	932,896.37	2.40
56	002465	海格通信	930,648.00	2.40
57	688122	西部超导	924,635.46	2.38
58	600737	中粮糖业	921,381.00	2.37
59	002340	格林美	912,957.00	2.35
60	600418	江淮汽车	912,617.00	2.35
61	000960	锡业股份	911,959.00	2.35
62	002683	广东宏大	904,720.00	2.33
63	002195	岩山科技	904,507.00	2.33
64	603228	景旺电子	895,602.00	2.31
65	301236	软通动力	889,294.00	2.29
66	688169	石头科技	889,214.78	2.29
67	601233	桐昆股份	888,382.00	2.29
68	600549	厦门钨业	887,791.00	2.29
69	300136	信维通信	884,673.00	2.28
70	002414	高德红外	881,281.94	2.27
71	002008	大族激光	879,275.00	2.27
72	600079	人福医药	879,062.00	2.26
73	000400	许继电气	875,928.00	2.26
74	603589	口子窖	872,532.00	2.25
75	600985	淮北矿业	872,119.00	2.25
76	000423	东阿阿胶	869,752.00	2.24
77	603688	石英股份	869,098.00	2.24
78	300383	光环新网	869,082.00	2.24
79	600377	宁沪高速	867,209.00	2.23
80	002064	华峰化学	866,909.00	2.23

81	601098	中南传媒	865,246.00	2.23
82	002025	航天电器	863,977.47	2.23
83	601168	西部矿业	860,119.00	2.22
84	603893	瑞芯微	859,439.00	2.21
85	600380	健康元	858,161.00	2.21
86	300394	天孚通信	846,277.80	2.18
87	002429	兆驰股份	838,455.00	2.16
88	603338	浙江鼎力	835,186.00	2.15
89	002558	巨人网络	826,485.00	2.13
90	601108	财通证券	824,948.00	2.13
91	000988	华工科技	823,669.00	2.12
92	688819	天能股份	821,515.92	2.12
93	000630	铜陵有色	820,976.00	2.11
94	300748	金力永磁	820,875.00	2.11
95	600399	抚顺特钢	817,901.00	2.11
96	603160	汇顶科技	817,334.00	2.11
97	300296	利亚德	815,649.00	2.10
98	600862	中航高科	815,539.00	2.10
99	300253	卫宁健康	813,496.00	2.10
100	600884	杉杉股份	811,924.00	2.09
101	600521	华海药业	811,381.00	2.09
102	002153	石基信息	804,234.85	2.07
103	601990	南京证券	803,571.00	2.07
104	601216	君正集团	803,035.00	2.07
105	300088	长信科技	800,206.00	2.06
106	688772	珠海冠宇	794,197.25	2.05
107	688538	和辉光电	793,837.31	2.05
108	002497	雅化集团	786,542.00	2.03
109	600839	四川长虹	784,759.00	2.02
110	600517	国网英大	783,349.00	2.02
111	600863	内蒙华电	780,490.00	2.01
112	601568	北元集团	779,686.00	2.01
113	002078	太阳纸业	778,823.00	2.01
114	603317	天味食品	778,510.00	2.01

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	354,308,628.82
卖出股票收入（成交）总额	334,392,258.78

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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会、中国证券监督管理委员会江苏监管局、上海证券交易所的立案调查与行政监管措施，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行湖南省分行的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体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	9,734.04
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,359,502.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,369,236.77

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

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。

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	2,170	17,745.93	—	—	38,508,657.69	100.00%

诺安中证 500 增强 C	5,343	6,697.83	602,990.83	1.68%	35,183,518.64	98.32%
合计	7,513	9,888.88	602,990.83	0.81%	73,692,176.33	99.19%

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	130,129.88	0.3379%
	诺安中证 500 增强 C	27,686.99	0.0774%
	合计	157,816.87	0.2124%

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式基金	诺安中证 500 增强 A	10~50
	诺安中证 500 增强 C	0
	合计	10~50

§ 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	42,338,624.86	3,316,768.87
本报告期基金总申购份额	5,028,461.86	78,580,961.29
减：本报告期基金总赎回份额	8,858,429.03	46,111,220.69
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	38,508,657.69	35,786,509.47

§ 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人重大人事变动情况如下：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

11.5 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。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为人民币 5,989.64 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：4 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 07 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理 ETF 公募产品注册申请 3 个月，并对相关责任人员采取相应行政监管措施。

受到稽查或处罚等措施的原因	内部控制不完善。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	截至报告期末, 管理人已完成整改。
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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	
东北证券	1	54,714,535.47	7.94%	5,247.50	1.84%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	268,464,359.32	38.98%	115,260.25	40.31%	-
中信证券	1	323,997,529.59	47.04%	161,416.95	56.46%	-
中银证券	1	41,524,463.22	6.03%	3,982.00	1.39%	-

注: 1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况: 无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

- (1) 依法取得相关业务资格;
- (2) 信誉良好, 财务状况良好, 经营行为规范, 合规风控能力和交易、研究等服务能力较强;
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 能为本基金提供全面的信息服务;
- (4) 研究实力较强, 有足够数量的专职的高素质研究人员, 能为公司提供全面的研究支持和信息服务;
- (5) 能根据基金投资的特定要求, 提供个性化的研究服务;

基金管理人根据以上标准进行充分评估后, 选定证券公司, 并在完成公司内部审批流程后, 与之签

订相关协议。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年下半年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	14,700,000.00	100.00%	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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广发银行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》	2024 年 01 月 08 日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 01 月 22 日
3	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2024 年 01 月 22 日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 02 月 02 日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 02 月 29 日

	公告		
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 03 月 07 日
7	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024 年 03 月 29 日
8	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 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》	2024 年 03 月 29 日
9	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2024 年 04 月 22 日
10	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 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》	2024 年 04 月 22 日
11	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》	2024 年 04 月 26 日
12	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	2024 年 04 月 26 日
13	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2024 年第 1 期	基金管理人网站	2024 年 04 月 26 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 05 月 07 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 05 月 23 日
16	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销渠道的申购起点金额、最小追加申购金额及最低赎回份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 05 月 24 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 06 月 12 日
18	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销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 06 月 12 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公	《证券时报》、《上海证券报》	2024 年 06 月 14 日

	告		
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 06 月 14 日
21	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	2024 年 06 月 14 日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 07 月 19 日
23	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 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》	2024 年 07 月 19 日
24	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2024 年 07 月 19 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财达证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 07 月 22 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由中植基金变更为华源证券的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 07 月 30 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 08 月 14 日
28	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 08 月 15 日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 08 月 23 日
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 08 月 27 日
31	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 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》	2024 年 08 月 30 日
32	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	基金管理人网站	2024 年 08 月 30 日

33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中泰证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 09 月 03 日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国都证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2024 年 09 月 03 日
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天相投顾为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 09 月 06 日
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 09 月 10 日
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大河财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024 年 09 月 13 日
38	诺安基金管理有限公司关于暂停海银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》	2024 年 09 月 18 日
39	诺安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
40	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 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》	2024 年 10 月 25 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20% 的情形，敬请投资者留意。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

(1) 自 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

(2) 本基金管理人于 2025 年 3 月 20 日披露了《诺安基金管理有限公司关于旗下指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金的指数使用费调整为基金管理人承担。

§ 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 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2025 年 03 月 31 日