

信息披露 disclosure

诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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数量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于采用量化策略的投资组合导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在基金合同约定的范围之内,报告期内,本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整和申赎影响,跟踪误差较小的最小偏离度下,非跟踪误差文件与个股的权重与标的的权重产生了一定差异。本基金管理人完全遵循被动投资,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.28481元。本报告期基金份额净值增长率为-7.7%,同期业绩比较基准收益率为-7.9%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,027,486,211	98,334,913.34	7.66
2	000002	万科A	60,607,868.21	60,607,868.21	4.72
3	000003	招商银行	3,909,304,033	3,909,304,033	30.39
4	000004	比亚迪	1,262,000,000	1,262,000,000	9.82
5	000005	格力电器	1,442,000,000	1,442,000,000	11.24
6	000006	中兴通讯	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
7	000007	中国神华	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
8	000008	五粮液	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
9	000009	深发展A	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
10	000010	浦发银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76

5.1.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000003	招商银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
2	000006	中兴通讯	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
3	000007	中国神华	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
4	000008	五粮液	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
5	000009	深发展A	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
6	000010	浦发银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
7	000011	民生银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
8	000012	工商银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
9	000013	建设银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76
10	000014	农业银行	1,000,000,000	1,000,000,000	7.76

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

5.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A. 农林牧渔	849,047,030	6.58
B. 采矿业	3,040,500,000	23.66
C. 制造业	14,242,000,000	110.46
D. 电力、热力、燃气及生产供应业	2,866,000,000	22.34
E. 建筑业	1,662,073,236	12.93
F. 批发和零售业	4,906,201,463	38.19
G. 交通运输、仓储和邮政业	3,319,204,043	25.87
H. 信息传输业	387,141,011	3.02
I. 金融业	2,381,842,000	18.56
J. 房地产业	4,476,263,116	34.84
K. 租赁和商务服务业	1,498,921,131	11.63
M. 科学研究和技术服务业	141,474,000	1.10
N. 教育	623,834,000	4.86
O. 卫生健康业	47,296,000	0.37
P. 文化、体育和娱乐业	332,200,000	2.59
Q. 综合	1,631,064,000	12.70
R. 合计	94,359,161,000	734.65

5.2.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的港股股票投资

5.2.4 报告期末按行业分类的沪港通股票投资

5.2.5 报告期末按行业分类的深港通股票投资

5.2.6 报告期末按行业分类的沪伦通股票投资

5.2.7 报告期末按行业分类的科创板股票投资

5.2.8 报告期末按行业分类的存托凭证股票投资

5.2.9 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.10 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.11 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.12 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.13 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.14 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.15 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.16 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.17 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.18 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.19 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.20 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.21 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.22 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.23 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.24 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.25 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.26 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.27 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.28 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.29 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.30 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.31 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.32 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.33 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.34 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.35 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.36 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.37 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.38 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.39 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.40 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.41 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.42 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.43 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.44 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.45 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.46 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.47 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.48 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.49 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.50 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.51 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.52 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.53 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.54 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.55 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.56 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.57 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.58 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.59 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.60 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.61 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.62 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.63 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.64 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.65 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.66 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.67 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.68 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.69 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.70 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.71 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.72 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.73 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.74 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.75 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.76 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.77 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.78 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.79 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.80 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.81 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.82 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.83 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.84 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.85 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.86 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.87 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.88 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.89 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.90 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.91 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.92 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.93 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.94 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.95 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.96 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.97 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.98 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.99 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.100 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.101 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.102 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.103 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.104 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.105 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.106 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.107 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.108 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.109 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.110 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.111 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.112 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.113 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.114 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.115 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.116 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.117 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.118 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.119 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.120 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.121 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.122 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.123 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.124 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.125 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.126 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.127 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.128 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.129 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.130 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.131 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.132 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.133 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.134 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.135 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.136 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.137 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.138 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.139 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.140 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.141 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.142 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.143 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.144 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.145 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.146 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.147 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.148 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.149 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.150 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.151 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.152 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.153 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.154 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.155 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.156 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.157 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.158 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.159 报告期末按行业分类的债券投资组合