

诺安创业板指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：2020 年 10 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 诺安创业板指数增强（LOF）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 交易代码       | 163209                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2019 年 5 月 31 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 28,967,933.70 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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%，以实现对创业板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，在数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。</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>1. 资产配置策略</p> <p>为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于创业板指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金将采用复制为主，增强投资为辅的方式，按标的指数的成份股权重构建被动组合，通过加入增强型的积极手段，对基金投资组合进行适当调整，以保证本基金投资目标的实现。</p> <p>2. 股票投资策略</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>本基金被动投资组合采用复制的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下的方法，依靠公司宏观、中观以及微观研究，优先在创业板 指数成份股中对行业、个股进行超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数创业板 指数成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。</p> <p>(1) 构建被动投资组合</p> <p>本基金在《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起 6 个月内，将按照创业板指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在控制好跟踪误差的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重购买某成份股、预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小被动组合相对标的指数的跟踪误差。</p> <p>(2) 构建增强型投资组合</p> <p>主要通过数量化投资模型，并与基本面研究相结合，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1) 多因子股票模型</p> <p>该模型以对影响 A 股市场的长期因素研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，找到可能影响股票回报的因子，利用统计分析建立单个因子与未来超额之间的回报关系，用精研的因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，筛选出针对不同市场环境和行业的有效因子，在综合评判的基础上，构建优质股票组合。具体的因子包括：估值类因子、成长类因子、盈利类因子、流动性类因子、杠杆类因子、技术类因子、一致预期因子等。该模型会综合获取到的各类信息做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>2) 合理价格成长股票模型</p> <p>该模型将综合考虑企业的营业收入增长率、净利润增长率等成长性的指标和市净率、市盈率、市销率等价值指标，同时根据相关的市场预期，找出成长性高而价值被相对低估的股票组合。</p> <p>3) 投资组合优化模型</p> <p>本基金将综合考虑跟踪误差、流动性冲击、预期收益及风险等因素进行投资组合优化。选股范围以成份股为主，同时精选少量的成份股之外的股票作为增强股票库，在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析，评定各品种的投资价值。</p> <p>4. 投资组合调整策略</p> <p>(1) 投资组合调整原则</p> <p>本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,力争基金份额净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最优化。</p> <p>(2) 投资组合调整方法</p> <p>1) 对标的指数的跟踪调整</p> <p>本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的创业板指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。</p> <p>a) 定期调整</p> <p>根据深圳证券信息有限公司按照既定指数编制方法公布的创业板指数成分股定期调整结果,基于本基金的投资组合调整原则,对投资组合进行相应调整。</p> <p>b) 不定期调整</p> <p>根据指数编制规则,当创业板指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据深圳交易所和深圳证券信息有限公司发布的临时调整公告,基于本基金的投资组合调整原则,对投资组合进行相应调整。</p> <p>2) 限制性调整</p> <p>a) 投资比例限制调整</p> <p>根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将在法律法规和基金合同规定的时限内对其进行被动性卖出调整,并相应地对其他资产类别或个股进行微调,以保证基金合法规范运行。</p> <p>b) 大额赎回调整</p> <p>当发生大额赎回超过现金保有比例时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。</p> <p>5、跟踪误差控制策略</p> <p>本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时,需要控制跟踪偏离过大的风险。本基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析,采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合的跟踪效果进行预估,并及时对投资组合进行适当的调整,力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>本基金的风险控制目标是: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%。</p> <p>6. 股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎的原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。</p> <p>在预判市场风险较大时,应用股指期货对冲策略,即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后,在面临市场下跌时择机卖出股指期货合约进行套期保值,当股市好转之后再 will 期指合约空单平仓。</p> <p>7. 国债期货投资策略</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。</p> <p>8. 权证投资策略</p> <p>本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。</p> <p>9. 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 创业板指数收益率×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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

注：本基金由原诺安中证创业成长指数分级证券投资基金于 2019 年 5 月 31 日转型而来；截至本报告期末，本基金暂未上市交易。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2020 年 7 月 1 日 — 2020 年 9 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 753,384.59                            |
| 2. 本期利润         | 1,277,209.00                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0486                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 42,910,329.70                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4813                                |

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

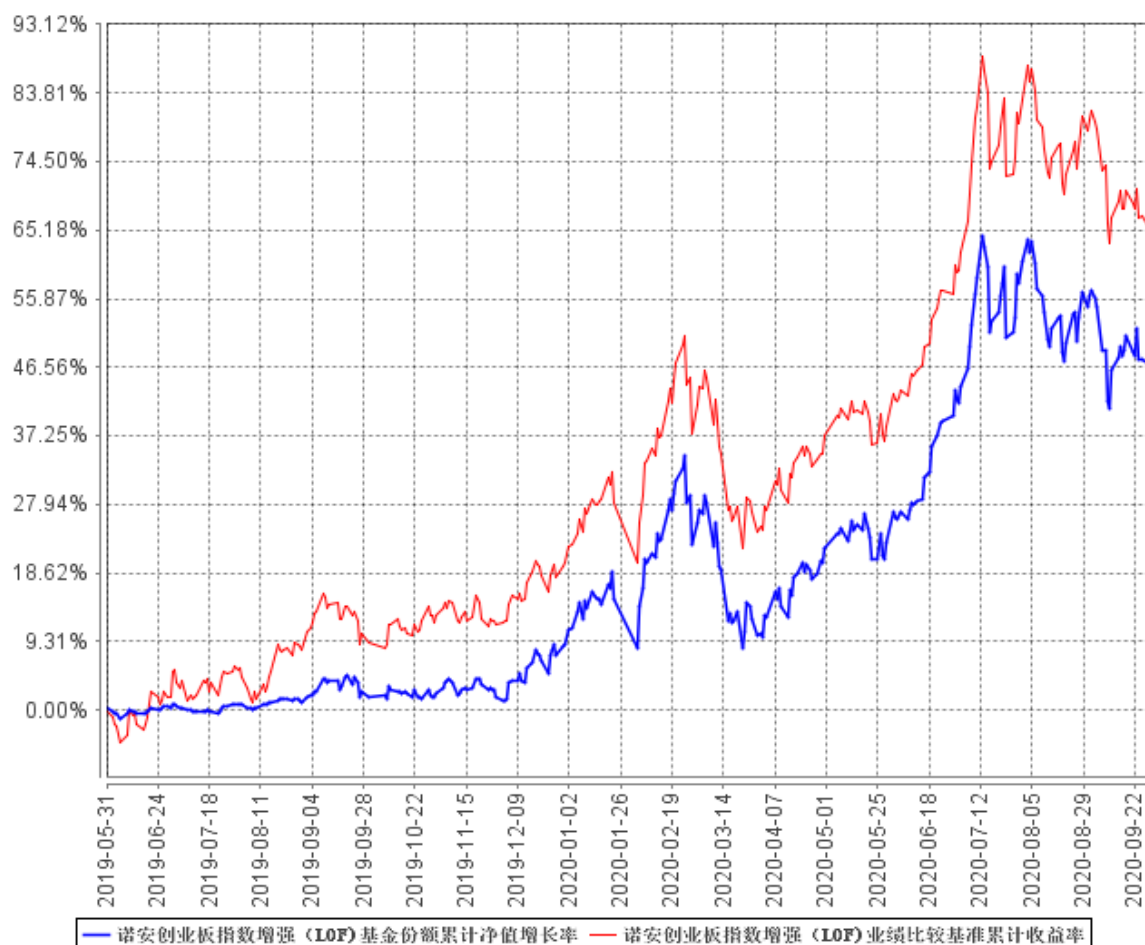
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标准<br>差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | 4.33%      | 2.03%         | 5.41%          | 1.99%                 | -1.08%  | 0.04%  |
| 过去六个月          | 35.58%     | 1.77%         | 35.56%         | 1.71%                 | 0.02%   | 0.06%  |
| 过去一年           | 46.91%     | 1.76%         | 55.05%         | 1.77%                 | -8.14%  | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 49.55%     | 1.53%         | 69.24%         | 1.66%                 | -19.69% | -0.13% |

注：本基金业绩比较基准：创业板指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 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 5 月 31 日 | —    | 23     | 硕士，曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司。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、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。曾于 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。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内经济进一步复苏，动力来自出口、房地产和基建。消费仍未恢复到疫情之前的状态。对外出口强劲，主要是由于欧美宽松政策刺激。房地产和基建主要受益于国内宽松信贷政策。因此在疫情后时代，中国经济成为全球复苏的急先锋，人民币也呈现强劲的升值趋势。

国内经济强劲复苏，导致资本市场呈现“股牛债熊”格局。三季度 A 股仍然是牛市高歌猛进。但是行情结构有所分化，此前领涨牛市的医药和科技股出现较大幅度回落，军工和新能源成为牛市新的领涨板块。受益于房地产和基建的传统行业板块，本季度也有比较好的市场表现。

创业板指数主要配置医药和科技股。本季度由于医药和科技股出现较大幅度回落，导致创业板指数也冲高回落。

本基金在第三季度略下调低了医药和科技股配置比例，同时加大了新能源行业的配置比例。由此力争超越指数基准，为本基金持有人创造满意的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4813 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.33%，同期业绩比较基准收益率为 5.41%。

#### 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 40,146,192.31 | 92.83        |
|    | 其中：股票             | 40,146,192.31 | 92.83        |
| 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      | 2,977,299.64  | 6.88         |
| 8  | 其他资产              | 124,483.01    | 0.29         |
| 9  | 合计                | 43,247,974.96 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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         | 1,188,540.04  | 2.77         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 28,419,678.33 | 66.23        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,052,240.00  | 4.78         |
| J  | 金融业              | 1,721,042.60  | 4.01         |
| 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       | 2,723,660.00  | 6.35         |
| 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          | 1,871,835.00  | 4.36         |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,161,008.00  | 5.04  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 40,138,003.97 | 93.54 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -        | -            |
| B  | 采矿业              | -        | -            |
| C  | 制造业              | -        | -            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -        | -            |
| E  | 建筑业              | -        | -            |
| F  | 批发和零售业           | -        | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -        | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -        | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 8,188.34 | 0.02         |
| J  | 金融业              | -        | -            |
| 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               | 8,188.34 | 0.02         |

### 5.3 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股票投资明细

#### 5.3.1 报告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  | 300750 | 宁德时代 | 12,800 | 2,677,760.00 | 6.24         |
| 2  | 300274 | 阳光电源 | 85,600 | 2,353,144.00 | 5.48         |
| 3  | 300760 | 迈瑞医疗 | 5,800  | 2,018,400.00 | 4.70         |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 71,740 | 1,721,042.60 | 4.01         |
| 5  | 300558 | 贝达药业 | 13,900 | 1,581,264.00 | 3.69         |
| 6  | 300433 | 蓝思科技 | 48,800 | 1,567,456.00 | 3.65         |
| 7  | 300316 | 晶盛机电 | 49,900 | 1,529,435.00 | 3.56         |
| 8  | 300601 | 康泰生物 | 8,203  | 1,493,028.03 | 3.48         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 9  | 300122 | 智飞生物 | 10,500 | 1,462,755.00 | 3.41 |
| 10 | 300136 | 信维通信 | 25,700 | 1,400,907.00 | 3.26 |

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 003010 | 若羽臣  | 281   | 8,188.34 | 0.02         |

### 5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 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。

### 5.7 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投资贵金属。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 本基金本报告期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。

**5.11.2** 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,278.05   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 328.85     |
| 5  | 应收申购款   | 116,876.11 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 124,483.01 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 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,分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位:份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 20,975,784.27 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 21,171,580.60 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 13,179,431.17 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 28,967,933.70 |

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意。 |                |                         |      |      |      |            |      |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

（1）本基金管理人于 2020 年 8 月 7 日发布了《诺安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，2020 年 8 月 5 日起，杨文先生不再担任公司副总经理。

（2）本基金管理人于 2020 年 8 月 8 日发布了《诺安基金管理有限公司关于深圳办公地址临时变更的公告》，自 2020 年 8 月 10 日起，诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）深圳总部的办公地址临时搬迁至“深圳市福田区中心益田路 5033 号平安国际金融中心 85 层”，本公司原深圳总部办公地址恢复办公的时间将另行公告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。
- ②原诺安中证创业成长指数分级证券投资基金变更为诺安创业板指数增强型证券投资基金

（LOF）的批复及相关公告。

③《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》。

④《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》。

⑤《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑦诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）2020 年第三季度报告正文。

⑧报告期内诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）在中国证监会基金电子披露网站上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 9.3 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

2020 年 10 月 28 日