

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	20
§ 8	投资组合报告	49
8.1	期末基金资产组合情况	49
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
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	63
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	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12	投资组合报告附注	64
§ 9	基金份额持有人信息	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 10	开放式基金份额变动	66
§ 11	重大事件揭示	66
11.1	基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4	基金投资策略的改变	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8	其他重大事件	69
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13	备查文件目录	72
13.1	备查文件目录	73
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安和鑫混合
基金主代码	002560
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 10 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,348,357,065.80 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由诺安和鑫保本混合型证券投资基金首个保本周期到期后转型而来，并自 2018 年 5 月 10 日起转型正式生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金通过积极配置大类资产,动态控制组合风险,并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角,综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险,并据此进行大类资产的配置与组合构建,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类金融风险收益特征的相对变化,适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资分析</p> <p>本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>4、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中,将采用积极主动的投资策略,结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种,在兼顾收益的同时,有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上,本基金将综合运用</p>

	<p>估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×60%+中证全债指数×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益的品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95559
传真	0755-83026677	021-62701216
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	李强	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

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	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	1,082,799,525.96	-160,309,416.78	-5,178,110.15
本期利润	1,443,294,291.43	-318,532,303.39	156,406,145.82
加权平均基金份额本期利润	0.4040	-0.0882	0.4631
本期加权平均净值利润率	25.95%	-6.13%	50.92%
本期基金份额净值增长率	18.18%	39.34%	48.39%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	128,131,806.11	-1,696,686,599.45	-423,665,722.20
期末可供分配基金份额利润	0.0546	-0.3030	-0.3490
期末基金资产净值	4,072,081,326.31	8,216,718,136.80	1,278,217,320.24
期末基金份额净值	1.7340	1.4673	1.0530
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	66.89%	41.22%	1.35%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	3.66%	1.66%	1.51%	0.47%	2.15%	1.19%
过去六个月	-0.81%	2.25%	-1.89%	0.61%	1.08%	1.64%
过去一年	18.18%	2.23%	-0.60%	0.70%	18.78%	1.53%
过去三年	144.36%	2.36%	44.13%	0.77%	100.23%	1.59%
自基金合同生效起至今	66.89%	2.23%	27.05%	0.78%	39.84%	1.45%

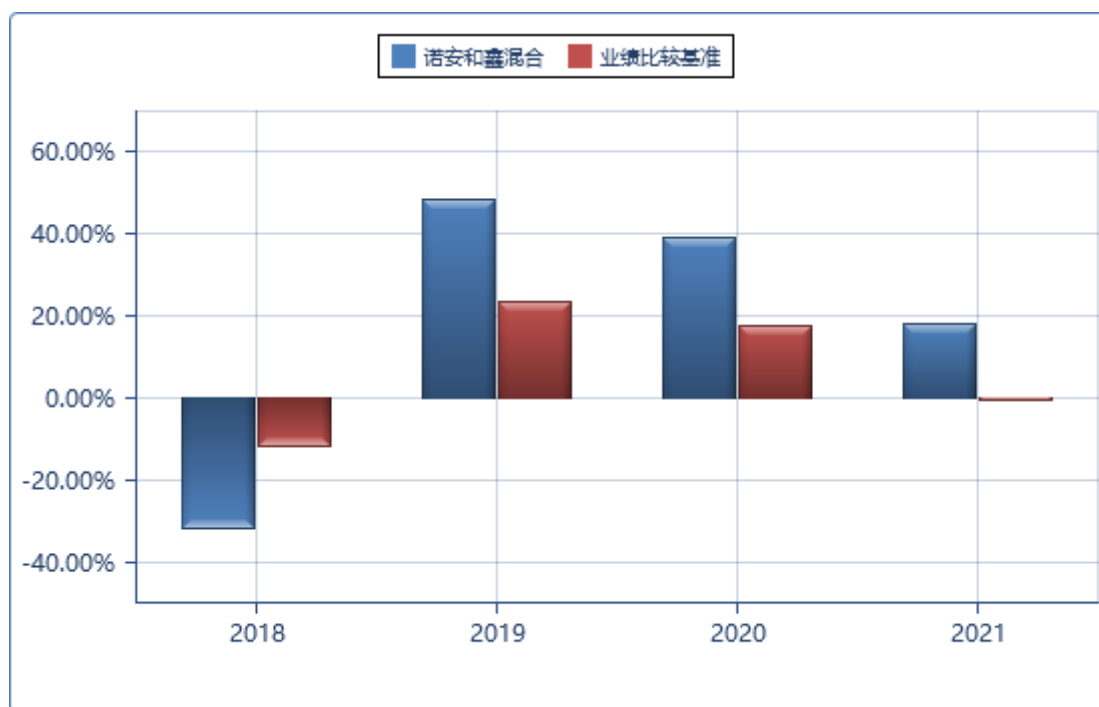
注：2018年05月10日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。

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



注：1、本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。
2、2018年05月10日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金。

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



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 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 62 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币

市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡嵩松	本基金基金经理	2019年03月14日	-	6年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、华泰证券股份有限公司，2017年11月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2019年2月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年5月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年，疫情的反复成为各国货币政策的掣肘。虽然美联储的加息预期渐行渐近，但相对宽松的货币环境让全球资本市场延续强势，A 股走出了先抑后扬的走势，尤其是高景气度赛道中的小成长股取得了不错的相对收益。

从半导体行业来看，2021 年 1 月市场的运行延续了 2020 年底的惯性，表现出了强者恒强的状况，新能源、医药依旧表现强势，科技也在产业高景气度和利空出尽之后有了比较像样的表现；2 月春节假期结束后经历了流动性最紧的几天，市场剧烈震动，新能源、军工、半导体等高估值品种出现了较大幅度的调整，静态估值相对较低的光伏、白酒以及顺周期的资源品有明显相对收益；3 月随着美债收益率上行，通胀预期和流动性杀估值的逻辑仍在延续，新能源、半导体为主的高估值品种继续调整，市场对基本面的反应已经失效，静态估值较高的品种杀跌。经历了核心资产因为美债收益率上行带来的杀跌之后，4 月在印度疫情全面爆发的背景下，市场对社融数据和货币流动性边际变化普遍预期乐观，核心资产也在医药板块的带动下出现了反弹行情；进入 5 月，几个手机厂商砍单的消息传出，触动了半导体板块中空方的最后一根神经，本轮半导体芯片的景气度全市场有目共睹，但是股价却没有表现出相应的走势，这其中市场对于手机厂商重复订单的担忧是主要因素，担忧这轮景气周期的持续性不够，这次的消息传出也是这个利空的落地，因此五一之后，龙头设计厂商领跌。而本轮景气周期的需求端是全面创新周期触发的，现在供货商、渠道商、终端厂商手中的货源一货难求，不是某一项单方面需求能够左右的，因此板块在急跌之后快速修复；随着七一临近，市场情绪逐渐上行，半导体芯片产业端持续高景气度，国产替代方面，关键核心要素进展超预期，6 月中旬芯片为首的科技板块全面爆发，而后随着芯片公司的中报业绩预告拉开序幕，超高的业绩增速彻底点燃市场，整个 7 月对产业的高景气与股价的剪刀差越来越大的修复进行了完美演绎，伴随着芯片板块的中报披露，超高的业绩增速彻底点燃市场，板块在 7 月底达到高点。在经历一波急涨之后，8、9 月持续回落，市场对行业景气度的担忧拖累板块的走势。伴随着市场对行业景气度

持续性的担忧，四季度走势平淡。

在本基金的运作过程中，投资理念遵循产业投资，伴随产业的优秀公司成长。细分到科技赛道，投资框架是自上而下选股，首先选择高景气周期的赛道，在好赛道中再选择龙头公司。在这个大前提下，遵循产业逻辑去投资。持股周期较长，伴随着产业成长。理想状况是持仓的公司到了成熟状态，我国的硬核科技腾飞，不再被卡脖子。在这个成长的过程中，需要仔细甄别、密切跟踪、抓主要矛盾，最重要的是对产业的理解，既要有对产业周期的把握，也要有对个股技术壁垒和产品护城河的理解，换言之既要格局够大，高度够高，又要对细节有充分的认知和敏锐的洞察力。股价是受多方面因素影响的，会有波动，但最重要的是抓每个时期的主要矛盾，在产业逻辑不发生变化的情况下，陪伴优秀公司成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.7340 元，本报告期内基金份额净值增长率为 18.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮半导体行业的景气度根源在于科技创新，创新需求侧的提升是线性向上的，而产能资本开支的扩张是非线性的，这就导致了供给侧和需求侧的矛盾。而新冠疫情、美国对中国科技的封锁等因素又使之加剧，短期之内这一矛盾无法缓解，只能在新增产能陆续达产之后再动态观察供需关系。现在还远未到担忧行业景气周期结束的时候。

展望 2022 年，一方面，芯片行业缺货涨价可能会更加紧张，目前某些品类的芯片交期已经达到了自 2017 年的峰值，并且还在不断延长；另一方面，自主关键技术即将突破。这两者一个是行业景气度继续加速，另外一个替代的大幕拉开。2022 年产业面临的是两者叠加的最强逻辑。但是股价却在低位徘徊，甚至由于某些因素扰动继续向下，目前状况又出现了 2021 年一季度的情况，就是产业和股价的剪刀差越来越大。2022 年，虽然经济增速或有一定程度放缓，虽然企业盈利形势不明朗，但是宏观经济环境“货币、财政、信用”处于宽松的周期，这对资本市场是有利的环境。在宏观经济政策边际向好的背景下，我们更多需要关注的是产业本身，出现分歧的时候正是需要重视和布局的时刻。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

尽责地管理基金资产。

本年度基金管理人合规管理、内部风险控制、监察稽核的具体情况如下：

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每份基金份额每次

分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2021 年度，基金托管人在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021 年度，诺安基金管理有限公司在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2021 年度，由诺安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23041 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	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“诺安和鑫混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了诺安和鑫混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于诺安和鑫混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>诺安和鑫混合基金的基金管理人诺安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估诺安和鑫混合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,除非基金管理人管理层计划清算诺安和鑫混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺安和鑫混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 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</p>

	<p>的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对诺安和鑫混合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和鑫混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞, 肖菊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	357,591,513.97	449,468,208.33
结算备付金		2,517,933.75	8,786,261.67
存出保证金		1,604,715.67	2,436,691.47
交易性金融资产	7.4.7.2	3,714,611,642.86	7,779,185,702.69
其中：股票投资		3,714,611,642.86	7,779,185,702.69
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,994,207.33	69,887,337.58
应收利息	7.4.7.5	68,568.82	99,620.50
应收股利		-	-
应收申购款		3,835,398.69	21,118,860.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,090,223,981.09	8,330,982,682.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,948,221.20	97,963,967.04
应付管理人报酬		5,170,210.40	10,710,543.89
应付托管费		861,701.71	1,785,090.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	893,584.63	3,391,081.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	268,936.84	413,862.90
负债合计		18,142,654.78	114,264,545.88
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,348,357,065.80	5,599,725,454.70
未分配利润	7.4.7.10	1,723,724,260.51	2,616,992,682.10
所有者权益合计		4,072,081,326.31	8,216,718,136.80
负债和所有者权益总计		4,090,223,981.09	8,330,982,682.68

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7340 元，基金份额总额 2,348,357,065.80 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年12月31	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31

		日	日
一、收入		1,558,311,787.43	-209,117,719.70
1. 利息收入		3,179,671.91	3,805,595.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,676,772.46	3,796,343.58
债券利息收入		502,899.45	9,252.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,149,787,278.11	-141,100,282.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,143,895,529.55	-144,931,353.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-375,982.00	-2,848.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,267,730.56	3,833,919.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	360,494,765.47	-158,222,886.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,850,071.94	86,399,853.54
减：二、费用		115,017,496.00	109,414,583.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	83,572,420.94	76,381,411.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	13,928,736.82	12,730,235.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	17,224,991.35	19,992,287.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	291,346.89	310,649.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,443,294,291.43	-318,532,303.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,443,294,291.43	-318,532,303.39

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,599,725,454.70	2,616,992,682.10	8,216,718,136.80
二、本期经营活动产生的基金净	-	1,443,294,291.43	1,443,294,291.43

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,251,368,388.90	-2,336,562,713.02	-5,587,931,101.92
其中：1. 基金申购款	4,793,507,549.28	2,945,496,061.01	7,739,003,610.29
2. 基金赎回款	-8,044,875,938.18	-5,282,058,774.03	-13,326,934,712.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,348,357,065.80	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,213,871,230.26	64,346,089.98	1,278,217,320.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-318,532,303.39	-318,532,303.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,385,854,224.44	2,871,178,895.51	7,257,033,119.95
其中：1. 基金申购款	14,796,470,385.95	7,444,705,728.86	22,241,176,114.81
2. 基金赎回款	-10,410,616,161.51	-4,573,526,833.35	-14,984,142,994.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,599,725,454.70	2,616,992,682.10	8,216,718,136.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

齐斌 田冲 薛有为
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金是根据原诺安和鑫保本混合型证券投资基金（以下简称“诺安和鑫保本混合基金”）《诺安和鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由原诺安和鑫保本混合基金转型而来。原诺安和鑫保本混合基金为契约型开放式，存续期限不定，原诺安和鑫保本混合基金第一个保本期于 2018 年 5 月 2 日到期，原诺安和鑫保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件，自 2018 年 5 月 10 日起，诺安和鑫保本混合基金更名为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为诺

安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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发行并上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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)。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中证全债指数×40%。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、存托凭证、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、存托凭证、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，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，才可以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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 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；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 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 20%，若《诺安和鑫灵活配置混合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；

(b) 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基金份额进行再投资；若投资者不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 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基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(d) 每一基金份额享有同等分配权；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分

能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、

红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	357,591,513.97	449,468,208.33
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	357,591,513.97	449,468,208.33

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,350,709,498.75	3,714,611,642.86	363,902,144.11
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	3,350,709,498.75	3,714,611,642.86	363,902,144.11
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,775,778,324.05	7,779,185,702.69	3,407,378.64
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	7,775,778,324.05	7,779,185,702.69	3,407,378.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	66,713.62	94,570.20
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,133.10	3,953.80
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	722.10	1,096.50
合计	68,568.82	99,620.50

注：此处“其他”列示的是应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

交易所市场应付交易费用	893,584.63	3,391,081.39
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	893,584.63	3,391,081.39

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	19,936.84	183,862.90
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	249,000.00	230,000.00
合计	268,936.84	413,862.90

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,599,725,454.70	5,599,725,454.70
本期申购	4,793,507,549.28	4,793,507,549.28
本期赎回（以“-”号填列）	-8,044,875,938.18	-8,044,875,938.18
本期末	2,348,357,065.80	2,348,357,065.80

注：此处申购含红利再投资、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

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	-1,696,686,599.45	4,313,679,281.55	2,616,992,682.10
本期利润	1,082,799,525.96	360,494,765.47	1,443,294,291.43
本期基金份额交易产生的变动数	742,018,879.60	-3,078,581,592.62	-2,336,562,713.02
其中：基金申购款	-796,362,587.29	3,741,858,648.30	2,945,496,061.01
基金赎回款	1,538,381,466.89	-6,820,440,240.92	-5,282,058,774.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,131,806.11	1,595,592,454.40	1,723,724,260.51

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	2,602,578.72	3,600,863.86

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	40,010.25	152,167.66
其他	34,183.49	43,312.06
合计	2,676,772.46	3,796,343.58

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	8,219,200,991.42	4,947,064,536.20
减：卖出股票成本总额	7,075,305,461.87	5,091,995,889.53
买卖股票差价收入	1,143,895,529.55	-144,931,353.33

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	823,349,222.19	51,045,301.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	812,443,990.90	49,999,576.30
减：应收利息总额	11,281,213.29	1,048,573.97
买卖债券差价收入	-375,982.00	-2,848.70

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
股票投资产生的股利收益	6,267,730.56	3,833,919.70
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	6,267,730.56	3,833,919.70

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	360,494,765.47	-158,222,886.61
--股票投资	360,494,765.47	-158,222,886.61
--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	360,494,765.47	-158,222,886.61

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31 日
基金赎回费收入	44,255,431.72	85,050,243.60
基金转换费收入	594,640.22	1,349,138.17
其他	-	471.77
合计	44,850,071.94	86,399,853.54

注：上年度可比期间“其他”为蚂蚁集团退款中由新股认购资金及新股配售经纪佣金产生的利息返还。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
交易所市场交易费用	17,224,991.35	19,992,287.21
银行间市场交易费用	-	-
合计	17,224,991.35	19,992,287.21

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31 日
审计费用	120,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	160,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	3,146.89	3,449.66
律师费	2,000.00	-
账户维护费	45,000.00	36,900.00
其他	1,200.00	300.00
合计	291,346.89	310,649.66

注：此处“其他”列示的是银行间市场清算所股份有限公司查询服务费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市捷隆投资有限公司	基金管理人的股东
大恒新纪元科技股份有限公司	基金管理人的股东
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司
诺安国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	83,572,420.94	76,381,411.51
其中：支付销售机构的客户维护费	32,820,555.82	29,492,417.81

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,928,736.82	12,730,235.31

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	357,591,513.97	2,602,578.72	449,468,208.33	3,600,863.86

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

			日							
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年07月12日	2022年01月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年07月14日	2022年01月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年07月21日	2022年01月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

		日	月 07 日							
301039	中集车辆	2021 年 07 月 01 日	2022 年 01 月 10 日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 07 月 26 日	2022 年 02 月 07 日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 08 月 02 日	2022 年 02 月 11 日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021 年 08 月 06 日	2022 年 02 月 17 日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 08 月 10 日	2022 年 02 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 08 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 08 月 17 日	2022 年 02 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 08 月 17 日	2022 年 02 月 24 日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021 年 08 月 25 日	2022 年 03 月 01 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 08 月 26 日	2022 年 03 月 07 日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301059	金三	2021 年	2022	新股锁	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-

	江	09月03日	年03月14日	定						
301060	兰卫医学	2021年09月06日	2022年03月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年09月07日	2022年03月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年09月13日	2022年03月22日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年09月16日	2022年03月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年09月22日	2022年03月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年09月22日	2022年03月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年09月30日	2022年04月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年04月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年04月28日	新股锁定	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年04月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年04月26日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年06月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年05月12日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年05月23日	新股锁定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年06月06日	新股锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月09日	2022年05月18日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-

			日							
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年06月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月08日	2022年06月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月03日	2022年05月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年05月24日	新股锁定	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年06月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021年12月02日	2022年06月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301179	泽宇智能	2021年12月01日	2022年06月08日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年11月09日	2022年05月	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-

		日	月 16 日							
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 06 月 23 日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 05 月 19 日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 02 日	2022 年 06 月 09 日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 06 月 02 日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 06 月 07 日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 06 月 22 日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
601728	中国电信	2021 年 08 月 11 日	2022 年 02 月 21 日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688151	华强科技	2021 年 11 月 29 日	2022 年 06 月 06 日	新股锁定	35.09	33.82	12,238	429,431.42	413,889.16	-
688236	春立医疗	2021 年 12 月 23 日	2022 年 06 月 30 日	新股锁定	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688272	富吉	2021 年	2022	新股锁	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-

	瑞	10月08日	年04月18日	定						
688776	国光电气	2021年08月24日	2022年02月28日	新股锁定	51.44	184.99	1,447	74,433.68	267,680.53	-
688778	厦钨新能	2021年07月29日	2022年02月07日	新股锁定	24.50	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	-
688789	宏华数科	2021年07月01日	2022年01月10日	新股锁定	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-

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

2、上述流通受限证券的可流通日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中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。本基金的基金管理人

从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，因而与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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，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可在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透

原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31 日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	357,591,513.97	-	-	-	-	357,591,513.97
结算备付金	2,517,933.75	-	-	-	-	2,517,933.75
存出保证金	1,604,715.67	-	-	-	-	1,604,715.67
交易性金融资产	-	-	-	-	3,714,611,642.86	3,714,611,642.86
应收证券清算款	-	-	-	-	9,994,207.33	9,994,207.33
应收利息	-	-	-	-	68,568.82	68,568.82
应收申购款	1,955.00	-	-	-	3,833,443.69	3,835,398.69
资产总计	361,716,118.39	-	-	-	3,728,507,862.70	4,090,223,981.09
负债						

应付赎回款	-	-	-	-	10,948,221.20	10,948,221.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,170,210.40	5,170,210.40
应付托管费	-	-	-	-	861,701.71	861,701.71
应付交易费用	-	-	-	-	893,584.63	893,584.63
其他负债	-	-	-	-	268,936.84	268,936.84
负债总计	-	-	-	-	18,142,654.78	18,142,654.78
利率敏感度缺口	361,716,118.39	-	-	-	-3,710,365,207.92	4,072,081,326.31
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	449,468,208.33	-	-	-	-	449,468,208.33
结算备付金	8,786,261.67	-	-	-	-	8,786,261.67
存出保证金	2,436,691.47	-	-	-	-	2,436,691.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-7,779,185,702.69	7,779,185,702.69
应收证券清算款	-	-	-	-	69,887,337.58	69,887,337.58
应收利息	-	-	-	-	99,620.50	99,620.50
应收申购款	10,878.00	-	-	-	21,107,982.44	21,118,860.44
资产总计	460,702,039.47	-	-	-	-7,870,280,643.21	8,330,982,682.68
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	97,963,967.04	97,963,967.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,710,543.89	10,710,543.89
应付托管费	-	-	-	-	1,785,090.66	1,785,090.66
应付交易费用	-	-	-	-	3,391,081.39	3,391,081.39
其他负债	-	-	-	-	413,862.90	413,862.90
负债总计	-	-	-	-	114,264,545.88	114,264,545.88
利率敏感度缺口	460,702,039.47	-	-	-	-7,756,016,097.33	8,216,718,136.80

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 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 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(2020 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，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，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,714,611,642.86	91.22	7,779,185,702.69	94.68
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	3,714,611,642.86	91.22	7,779,185,702.69	94.68

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2021 年 12 月 31 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	164,990,506.42	504,028,230.74
业绩比较基准下降 5%	-164,990,506.42	-504,028,230.74	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,709,853,381.27 元，属于第二层次的余额为 4,758,261.59 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额 7,644,513,172.56 元，属于第二层次的余额 134,672,530.13 元，无属于第三层次余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具相关会计准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券

投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具相关会计准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具相关会计准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

(3) 除公允价值和执行新金融工具相关会计准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,714,611,642.86	90.82
	其中：股票	3,714,611,642.86	90.82
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	360,109,447.72	8.80
8	其他各项资产	15,502,890.51	0.38
9	合计	4,090,223,981.09	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	251,789.09	0.01
B	采矿业	67,903.38	0.00
C	制造业	2,949,910,429.83	72.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	234,289.00	0.01
E	建筑业	156,552.08	0.00
F	批发和零售业	1,742,338.37	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	153,016.10	0.00
H	住宿和餐饮业	48,812.16	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	757,234,677.13	18.60
J	金融业	435,781.68	0.01
K	房地产业	119,122.36	0.00
L	租赁和商务服务业	19,241.25	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,688,034.42	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,111,487.87	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,585.37	0.00
Q	卫生和社会工作	201,605.64	0.00
R	文化、体育和娱乐业	207,977.13	0.01
S	综合	-	-
	合计	3,714,611,642.86	91.22

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

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	603501	韦尔股份	1,296,392	402,879,741.84	9.89
2	002268	卫士通	7,003,782	391,791,565.08	9.62
3	688521	芯原股份	4,644,980	359,335,652.80	8.82
4	002371	北方华创	1,030,868	357,731,813.36	8.78
5	300661	圣邦股份	1,152,759	356,202,531.00	8.75
6	600703	三安光电	9,181,359	344,851,844.04	8.47
7	688126	沪硅产业	13,161,829	339,838,424.78	8.35
8	300604	长川科技	5,082,492	292,243,290.00	7.18
9	688012	中微公司	2,196,440	278,069,304.00	6.83
10	688339	亿华通	960,440	260,135,174.00	6.39
11	603650	彤程新材	3,327,943	167,462,091.76	4.11
12	300207	欣旺达	2,448,072	103,210,715.52	2.53
13	601728	中国电信	562,873	2,413,599.43	0.06
14	688032	禾迈股份	1,810	1,274,221.90	0.03
15	688819	天能股份	28,382	1,214,749.60	0.03
16	688082	盛美上海	9,337	1,193,268.60	0.03
17	688538	和辉光电	375,156	1,155,480.48	0.03
18	688779	长远锂科	43,086	1,009,935.84	0.02
19	300919	中伟股份	6,093	923,150.43	0.02
20	688680	海优新材	2,795	853,313.50	0.02
21	300979	华利集团	9,246	823,356.30	0.02
22	688232	新点软件	18,893	820,900.85	0.02

23	688798	艾为电子	3,592	775,872.00	0.02
24	688739	成大生物	9,882	752,316.66	0.02
25	688728	格科微	23,033	694,905.61	0.02
26	688425	铁建重工	135,282	685,879.74	0.02
27	688105	诺唯赞	6,180	655,080.00	0.02
28	688110	东芯股份	14,044	634,507.92	0.02
29	688772	珠海冠宇	12,960	630,504.00	0.02
30	688499	利元亨	2,149	629,657.00	0.02
31	688660	电气风电	51,238	607,170.30	0.01
32	301050	雷电微力	2,329	565,720.18	0.01
33	688107	安路科技	7,821	560,765.70	0.01
34	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.01
35	688131	皓元医药	1,955	486,169.40	0.01
36	688112	鼎阳科技	4,901	480,199.98	0.01
37	300973	立高食品	3,593	474,563.44	0.01
38	688385	复旦微电	8,986	452,355.24	0.01
39	688182	灿勤科技	18,387	443,678.31	0.01
40	301029	怡合达	4,617	424,278.54	0.01
41	688148	芳源股份	11,860	414,981.40	0.01
42	688151	华强科技	12,238	413,889.16	0.01
43	688707	振华新材	8,130	409,589.40	0.01
44	688558	国盛智科	8,488	383,657.60	0.01
45	301035	润丰股份	6,438	372,296.32	0.01
46	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.01
47	301090	华润材料	27,635	360,304.12	0.01
48	688190	云路股份	3,026	358,520.48	0.01
49	301127	天源环保	16,843	334,584.06	0.01
50	688192	迪哲医药	8,926	330,351.26	0.01
51	688383	新益昌	2,701	326,118.74	0.01
52	688280	精进电动	21,211	323,467.75	0.01
53	301099	雅创电子	3,510	316,781.01	0.01
54	688055	龙腾光电	45,228	309,811.80	0.01
55	300894	火星人	6,279	308,738.43	0.01
56	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
57	688639	华恒生物	2,302	297,533.50	0.01
58	688317	之江生物	5,740	296,413.60	0.01
59	688690	纳微科技	3,477	277,534.14	0.01
60	688800	瑞可达	1,967	273,963.76	0.01
61	688733	壹石通	3,409	271,901.84	0.01
62	688248	南网科技	11,763	271,725.30	0.01
63	688776	国光电气	1,447	267,680.53	0.01

64	301221	光庭信息	2,791	264,566.77	0.01
65	301039	中集车辆	20,640	264,150.72	0.01
66	301069	凯盛新材	5,386	260,217.38	0.01
67	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.01
68	301149	隆华新材	12,138	251,935.44	0.01
69	688766	普冉股份	704	249,645.44	0.01
70	605111	新洁能	1,386	246,846.60	0.01
71	688269	凯立新材	1,941	242,625.00	0.01
72	688630	芯碁微装	3,397	241,288.91	0.01
73	688276	百克生物	3,486	239,139.60	0.01
74	688087	英科再生	2,469	233,221.74	0.01
75	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.01
76	688711	宏微科技	1,865	231,092.15	0.01
77	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.01
78	301100	风光股份	5,985	218,204.16	0.01
79	688668	鼎通科技	3,037	214,047.76	0.01
80	688626	翔宇医疗	3,652	207,871.84	0.01
81	688700	东威科技	3,049	207,636.90	0.01
82	301018	申菱环境	7,811	206,506.84	0.01
83	688667	菱电电控	1,191	205,030.65	0.01
84	300941	创识科技	3,989	203,718.23	0.01
85	301060	兰卫医学	5,869	201,605.64	0.00
86	688049	炬芯科技	3,260	198,892.60	0.00
87	688161	威高骨科	3,069	195,556.68	0.00
88	688533	上声电子	3,493	195,153.91	0.00
89	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.00
90	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.00
91	301118	恒光股份	3,142	190,856.65	0.00
92	301180	万祥科技	6,536	188,319.06	0.00
93	300932	三友联众	4,918	187,375.80	0.00
94	688097	博众精工	3,983	185,846.78	0.00
95	301088	戎美股份	7,036	181,366.48	0.00
96	688621	阳光诺和	1,485	180,576.00	0.00
97	688601	力芯微	1,174	178,213.20	0.00
98	301111	粤万年青	3,783	178,144.72	0.00
99	688670	金迪克	2,310	174,820.80	0.00
100	301089	拓新药业	2,198	173,975.80	0.00
101	688323	瑞华泰	4,513	173,885.89	0.00
102	688308	欧科亿	2,457	173,660.76	0.00
103	300925	法本信息	5,997	172,833.54	0.00
104	605117	德业股份	627	171,666.33	0.00

105	300986	志特新材	2,632	168,474.32	0.00
106	301108	洁雅股份	2,800	166,667.20	0.00
107	688677	海泰新光	1,768	166,368.80	0.00
108	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.00
109	301138	华研精机	2,849	163,804.70	0.00
110	688059	华锐精密	1,023	162,350.10	0.00
111	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.00
112	300997	欢乐家	9,279	160,805.07	0.00
113	688305	科德数控	1,496	160,072.00	0.00
114	300968	格林精密	11,620	159,775.00	0.00
115	300614	百川畅银	3,283	157,584.00	0.00
116	688079	美迪凯	10,622	155,824.74	0.00
117	688767	博拓生物	2,220	155,178.00	0.00
118	688663	新风光	3,279	154,736.01	0.00
119	688682	霍莱沃	946	154,179.08	0.00
120	688315	诺禾致源	3,711	153,264.30	0.00
121	688793	倍轻松	1,454	151,943.00	0.00
122	301185	鸥玛软件	5,776	151,069.06	0.00
123	688625	呈和科技	2,672	149,979.36	0.00
124	688091	上海谊众	3,294	147,834.72	0.00
125	301126	达嘉维康	6,615	147,803.83	0.00
126	688687	凯因科技	5,354	146,485.44	0.00
127	301046	能辉科技	2,891	146,077.80	0.00
128	688661	和林微纳	1,452	146,013.12	0.00
129	688613	奥精医疗	2,617	144,615.42	0.00
130	300985	致远新能	2,945	144,363.90	0.00
131	688121	卓然股份	3,681	141,534.45	0.00
132	301199	迈赫股份	4,014	139,825.80	0.00
133	301015	百洋医药	4,614	139,804.20	0.00
134	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.00
135	688569	铁科轨道	6,841	137,777.74	0.00
136	688678	福立旺	4,198	137,652.42	0.00
137	688689	银河微电	3,258	136,216.98	0.00
138	300967	晓鸣股份	5,061	134,926.26	0.00
139	301017	漱玉平民	5,550	133,838.25	0.00
140	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.00
141	688201	信安世纪	2,129	133,381.85	0.00
142	688560	明冠新材	3,832	132,548.88	0.00
143	688212	澳华内镜	3,496	132,043.92	0.00
144	688609	九联科技	10,372	130,894.64	0.00
145	301020	密封科技	4,210	130,084.79	0.00

146	688636	智明达	918	129,667.50	0.00
147	301026	浩通科技	2,027	129,306.03	0.00
148	688737	中自科技	2,186	127,902.86	0.00
149	300942	易瑞生物	4,428	127,792.08	0.00
150	688619	罗普特	5,856	127,719.36	0.00
151	688698	伟创电气	4,751	127,421.82	0.00
152	688669	聚石化学	2,681	125,872.95	0.00
153	301092	争光股份	3,230	124,293.63	0.00
154	688676	金盘科技	3,750	122,437.50	0.00
155	688319	欧林生物	3,412	122,183.72	0.00
156	301078	孩子王	7,551	122,178.69	0.00
157	300996	普联软件	3,856	121,811.04	0.00
158	301006	迈拓股份	5,051	121,678.59	0.00
159	301021	英诺激光	2,899	121,096.99	0.00
160	605376	博迁新材	1,421	119,406.63	0.00
161	300917	特发服务	3,644	119,122.36	0.00
162	300943	春晖智控	2,542	117,643.76	0.00
163	300993	玉马遮阳	4,097	117,624.87	0.00
164	300966	共同药业	2,858	117,235.16	0.00
165	300987	川网传媒	3,004	116,555.20	0.00
166	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.00
167	301048	金鹰重工	8,424	114,557.55	0.00
168	300962	中金辐照	5,757	114,161.31	0.00
169	688069	德林海	2,253	111,523.50	0.00
170	688103	国力股份	1,595	111,123.65	0.00
171	300937	药易购	2,434	110,868.70	0.00
172	688296	和达科技	2,173	110,388.40	0.00
173	003022	联泓新科	2,995	109,137.80	0.00
174	300940	南极光	3,068	109,006.04	0.00
175	300918	南山智尚	10,626	108,703.98	0.00
176	688662	富信科技	2,556	108,630.00	0.00
177	301002	崧盛股份	2,001	107,653.80	0.00
178	300978	东箭科技	5,930	107,095.80	0.00
179	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.00
180	301011	华立科技	1,750	105,350.00	0.00
181	601825	沪农商行	15,480	104,490.00	0.00
182	300930	屹通新材	3,220	104,456.80	0.00
183	300922	天秦装备	2,863	104,213.20	0.00
184	301182	凯旺科技	2,932	103,061.60	0.00
185	301133	金钟股份	2,860	102,096.28	0.00
186	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00

187	688768	容知日新	907	101,130.50	0.00
188	301028	东亚机械	7,329	100,722.42	0.00
189	300945	曼卡龙	4,731	99,492.93	0.00
190	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.00
191	688611	杭州柯林	1,400	99,078.00	0.00
192	688633	星球石墨	1,558	98,340.96	0.00
193	688697	纽威数控	5,837	98,295.08	0.00
194	300971	博亚精工	2,445	97,677.75	0.00
195	301045	天禄科技	3,350	97,602.25	0.00
196	600906	财达证券	7,597	96,937.72	0.00
197	688456	有研粉材	3,396	96,921.84	0.00
198	301040	中环海陆	2,401	95,680.91	0.00
199	301198	喜悦智行	2,613	95,084.09	0.00
200	301193	家联科技	2,970	93,789.63	0.00
201	301062	上海艾录	5,225	93,673.29	0.00
202	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.00
203	003035	南网能源	11,046	91,571.34	0.00
204	300950	德固特	2,186	91,265.50	0.00
205	688355	明志科技	2,710	90,622.40	0.00
206	688219	会通股份	7,336	90,599.60	0.00
207	688076	诺泰生物	2,189	90,471.37	0.00
208	688718	唯赛勃	3,145	89,506.70	0.00
209	601568	北元集团	11,007	89,486.91	0.00
210	688597	煜邦电力	3,907	87,868.43	0.00
211	688195	腾景科技	2,693	87,468.64	0.00
212	301025	读客文化	4,027	87,417.84	0.00
213	688656	浩欧博	1,371	86,373.00	0.00
214	688113	联测科技	1,415	86,315.00	0.00
215	300975	商络电子	4,917	85,703.31	0.00
216	301066	万事利	3,436	85,682.60	0.00
217	688786	悦安新材	1,513	85,650.93	0.00
218	301012	扬电科技	1,691	85,632.24	0.00
219	300920	润阳科技	2,503	85,352.30	0.00
220	300926	博俊科技	3,584	85,299.20	0.00
221	301098	金埔园林	3,069	84,970.79	0.00
222	605358	立昂微	693	83,166.93	0.00
223	688577	浙海德曼	1,503	82,574.82	0.00
224	688511	天微电子	1,490	82,531.10	0.00
225	688628	优利德	2,789	81,689.81	0.00
226	688070	纵横股份	2,407	81,260.32	0.00
227	688683	莱尔科技	3,296	80,982.72	0.00

228	300814	中富电路	3,280	80,865.12	0.00
229	300958	建工修复	2,993	80,840.93	0.00
230	301055	张 小 泉	3,541	80,181.54	0.00
231	300961	深水海纳	3,936	80,097.60	0.00
232	300956	英力股份	3,707	79,589.29	0.00
233	300952	恒辉安防	3,398	79,513.20	0.00
234	300948	冠中生态	3,229	79,175.08	0.00
235	688799	华纳药厂	1,917	78,922.89	0.00
236	300931	通用电梯	6,713	78,005.06	0.00
237	301030	仕净科技	2,417	77,945.59	0.00
238	688329	艾隆科技	1,846	77,698.14	0.00
239	600955	维远股份	1,694	77,297.22	0.00
240	688590	新致软件	4,171	76,662.98	0.00
241	688787	海天瑞声	817	75,515.31	0.00
242	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
243	688071	华依科技	1,101	72,434.79	0.00
244	688622	禾信仪器	1,204	72,179.80	0.00
245	688607	康众医疗	1,890	71,801.10	0.00
246	688316	青云科技	1,428	71,614.20	0.00
247	688314	康拓医疗	1,085	71,588.30	0.00
248	688685	迈信林	2,612	71,307.60	0.00
249	301016	雷 尔 伟	2,747	71,202.24	0.00
250	688191	智洋创新	3,203	70,786.30	0.00
251	688468	科美诊断	3,919	70,228.48	0.00
252	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
253	688571	杭华股份	8,200	69,618.00	0.00
254	300963	中洲特材	2,830	68,882.20	0.00
255	300972	万辰生物	4,300	68,155.00	0.00
256	301072	中捷精工	1,802	67,726.26	0.00
257	301049	超越科技	1,954	67,173.64	0.00
258	605589	圣泉集团	1,750	67,025.00	0.00
259	300998	宁波方正	2,003	66,759.99	0.00
260	688109	品茗股份	1,301	66,637.22	0.00
261	601963	重庆银行	7,472	66,500.80	0.00
262	688255	凯尔达	1,648	66,183.68	0.00
263	301033	迈普医学	1,076	65,640.92	0.00
264	301032	新柴股份	5,124	65,484.54	0.00
265	688328	深科达	1,499	65,011.63	0.00
266	301041	金 百 泽	2,150	63,670.10	0.00
267	301036	双乐股份	2,047	62,445.59	0.00
268	688509	正元地信	9,851	61,962.79	0.00

269	301007	德迈仕	3,022	60,198.24	0.00
270	301063	海锅股份	1,524	59,268.03	0.00
271	688350	富淼科技	2,552	58,849.12	0.00
272	300960	通业科技	2,332	58,136.76	0.00
273	300886	华业香料	1,903	57,737.02	0.00
274	001203	大中矿业	3,809	57,439.72	0.00
275	688655	迅捷兴	3,083	56,357.24	0.00
276	301038	深水规院	2,660	55,607.30	0.00
277	003021	兆威机电	680	54,298.00	0.00
278	300995	奇德新材	1,909	52,898.39	0.00
279	301059	金三江	2,581	52,808.68	0.00
280	301010	晶雪节能	2,172	52,084.56	0.00
281	300860	锋尚文化	614	52,042.64	0.00
282	688557	兰剑智能	1,812	49,830.00	0.00
283	688260	昀冢科技	2,990	49,813.40	0.00
284	688618	三旺通信	1,117	49,583.63	0.00
285	300992	泰福泵业	1,998	49,450.50	0.00
286	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
287	300929	华骐环保	1,827	48,963.60	0.00
288	301073	君亭酒店	1,432	48,812.16	0.00
289	301027	华蓝集团	2,856	48,631.80	0.00
290	688659	元琛科技	3,671	48,567.33	0.00
291	301037	保立佳	1,923	48,157.08	0.00
292	600032	浙江新能	3,045	47,075.70	0.00
293	603529	爱玛科技	1,019	46,435.83	0.00
294	688395	正弦电气	1,627	46,304.42	0.00
295	600916	中国黄金	3,371	46,283.83	0.00
296	301053	远信工业	1,544	45,992.00	0.00
297	601156	东航物流	2,090	45,729.20	0.00
298	003031	中瓷电子	542	45,414.18	0.00
299	301068	大地海洋	1,436	43,660.68	0.00
300	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.00
301	688092	爱科科技	1,137	43,024.08	0.00
302	603324	盛剑环境	732	42,939.12	0.00
303	688367	工大高科	1,717	42,873.49	0.00
304	688226	威腾电气	2,693	42,791.77	0.00
305	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
306	688038	中科通达	2,132	40,742.52	0.00
307	688679	通源环境	3,139	40,273.37	0.00
308	300870	欧陆通	478	40,037.28	0.00
309	688565	力源科技	2,464	39,916.80	0.00

310	688517	金冠电气	2,892	39,446.88	0.00
311	605337	李子园	788	39,163.60	0.00
312	688501	青达环保	1,759	38,557.28	0.00
313	003009	中天火箭	623	38,482.71	0.00
314	605090	九丰能源	1,090	38,335.30	0.00
315	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
316	300910	瑞丰新材	474	37,848.90	0.00
317	601665	齐鲁银行	6,731	37,558.98	0.00
318	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.00
319	605305	中际联合	368	35,434.72	0.00
320	601187	厦门银行	5,129	35,390.10	0.00
321	300861	美畅股份	454	35,307.58	0.00
322	605338	巴比食品	1,012	35,258.08	0.00
323	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.00
324	605089	味知香	370	35,094.50	0.00
325	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.00
326	300869	康泰医学	862	34,954.10	0.00
327	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.00
328	003026	中晶科技	460	34,063.00	0.00
329	688701	卓锦股份	2,340	32,572.80	0.00
330	003039	顺控发展	1,024	31,774.72	0.00
331	300953	震裕科技	240	31,336.80	0.00
332	003012	东鹏控股	2,278	31,254.16	0.00
333	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.00
334	300900	广联航空	879	30,193.65	0.00
335	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
336	300872	天阳科技	871	29,056.56	0.00
337	003040	楚天龙	1,101	28,978.32	0.00
338	605339	南侨食品	864	28,788.48	0.00
339	003038	鑫铂股份	383	28,330.51	0.00
340	605080	浙江自然	374	27,975.20	0.00
341	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
342	605020	永和股份	850	26,095.00	0.00
343	001208	华菱线缆	1,754	26,011.82	0.00
344	605077	华康股份	617	25,821.45	0.00
345	001201	东瑞股份	668	25,771.44	0.00
346	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
347	300887	谱尼测试	378	25,590.60	0.00
348	601528	瑞丰银行	2,230	25,154.40	0.00
349	605167	利柏特	2,471	24,339.35	0.00
350	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.00

351	605336	帅丰电器	701	23,904.10	0.00
352	300873	海晨股份	484	23,764.40	0.00
353	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
354	601686	友发集团	2,374	23,265.20	0.00
355	605068	明新旭腾	641	23,172.15	0.00
356	605296	神农集团	569	22,936.39	0.00
357	300902	国安达	551	22,706.71	0.00
358	605186	健麾信息	626	22,698.76	0.00
359	603171	税友股份	637	22,422.40	0.00
360	605099	共创草坪	624	22,058.40	0.00
361	300878	维康药业	401	21,164.78	0.00
362	605268	王力安防	1,642	21,066.86	0.00
363	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.00
364	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
365	603836	海程邦达	733	19,241.25	0.00
366	603759	海天股份	1,119	19,101.33	0.00
367	605377	华旺科技	1,050	18,837.00	0.00
368	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
369	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
370	300891	惠云钛业	1,143	18,299.43	0.00
371	003028	振邦智能	432	18,100.80	0.00
372	605286	同力日升	597	17,850.30	0.00
373	605133	嵘泰股份	618	17,742.78	0.00
374	300890	翔丰华	286	17,683.38	0.00
375	605162	新中港	1,377	17,570.52	0.00
376	003019	宸展光电	601	17,567.23	0.00
377	605056	咸亨国际	933	17,521.74	0.00
378	003016	欣贺股份	1,681	17,516.02	0.00
379	605368	蓝天燃气	1,204	17,397.80	0.00
380	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
381	003020	立方制药	374	17,151.64	0.00
382	605208	永茂泰	801	16,861.05	0.00
383	300909	汇创达	386	16,617.30	0.00
384	605389	长龄液压	356	16,575.36	0.00
385	605098	行动教育	289	16,279.37	0.00
386	605169	洪通燃气	951	15,995.82	0.00
387	605122	四方新材	703	15,922.95	0.00
388	300893	松原股份	414	15,876.90	0.00
389	605016	百龙创园	445	15,623.95	0.00
390	605277	新亚电子	507	15,448.29	0.00
391	300908	仲景食品	285	15,447.00	0.00

392	300868	杰美特	593	15,275.68	0.00
393	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
394	601279	英利汽车	2,004	15,210.36	0.00
395	605289	罗曼股份	379	15,197.90	0.00
396	605005	合兴股份	634	15,082.86	0.00
397	003029	吉大正元	716	15,071.80	0.00
398	605060	联德股份	883	15,011.00	0.00
399	001207	联科科技	682	14,922.16	0.00
400	001206	依依股份	321	14,894.40	0.00
401	605151	西上海	722	14,656.60	0.00
402	605183	确成股份	741	14,560.65	0.00
403	003013	地铁设计	724	14,537.92	0.00
404	300877	金春股份	569	14,458.29	0.00
405	003006	百亚股份	804	14,415.72	0.00
406	003025	思进智能	427	14,342.93	0.00
407	605028	世茂能源	615	14,329.50	0.00
408	300864	南大环境	315	14,304.15	0.00
409	605179	一鸣食品	939	14,225.85	0.00
410	605299	舒华体育	738	14,110.56	0.00
411	300907	康平科技	473	14,057.56	0.00
412	001205	盛航股份	577	13,992.25	0.00
413	605058	澳弘电子	548	13,952.08	0.00
414	003037	三和管桩	1,274	13,912.08	0.00
415	605007	五洲特纸	598	13,759.98	0.00
416	605500	森林包装	762	13,754.10	0.00
417	605378	野马电池	473	13,650.78	0.00
418	605180	华生科技	384	13,555.20	0.00
419	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
420	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
421	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
422	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
423	003015	日久光电	1,128	13,129.92	0.00
424	603511	爱慕股份	553	13,117.16	0.00
425	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.00
426	003027	同兴环保	523	12,792.58	0.00
427	003005	竞业达	412	12,776.12	0.00
428	605196	华通线缆	1,172	12,575.56	0.00
429	003010	若羽臣	562	12,560.70	0.00
430	003030	祖名股份	480	12,475.20	0.00
431	605300	佳禾食品	576	12,401.28	0.00
432	605365	立达信	645	12,364.65	0.00

433	003032	传智教育	586	12,306.00	0.00
434	605177	东亚药业	439	12,133.96	0.00
435	605069	正和生态	608	11,685.76	0.00
436	003018	金富科技	1,027	11,348.35	0.00
437	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
438	605228	神通科技	1,217	11,281.59	0.00
439	605488	福莱新材	416	11,119.68	0.00
440	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.00
441	001210	金房节能	311	11,037.39	0.00
442	300892	品渥食品	272	11,021.44	0.00
443	003042	中农联合	420	10,878.00	0.00
444	605258	协和电子	340	10,822.20	0.00
445	300882	万胜智能	572	10,759.32	0.00
446	605189	富春染织	423	10,651.14	0.00
447	605580	恒盛能源	654	10,614.42	0.00
448	300876	蒙泰高新	350	10,594.50	0.00
449	605086	龙高股份	443	10,463.66	0.00
450	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
451	605287	德才股份	349	9,991.87	0.00
452	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.00
453	605259	绿田机械	295	9,838.25	0.00
454	003036	泰坦股份	776	9,606.88	0.00
455	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
456	605303	园林股份	610	9,540.40	0.00
457	300889	爱克股份	479	9,263.86	0.00
458	300879	大叶股份	466	9,212.82	0.00
459	605055	迎丰股份	1,146	9,053.40	0.00
460	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
461	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.00
462	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
463	003041	真爱美家	349	8,690.10	0.00
464	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
465	001202	炬申股份	459	8,551.17	0.00
466	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
467	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
468	003004	声迅股份	306	8,301.78	0.00
469	003033	征和工业	301	8,292.55	0.00
470	300881	盛德鑫泰	291	8,081.07	0.00
471	003023	彩虹集团	296	7,971.28	0.00
472	605155	西大门	350	7,672.00	0.00
473	605298	必得科技	391	7,397.72	0.00

474	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
475	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	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	002268	卫士通	492,164,646.26	5.99
2	300604	长川科技	237,763,539.50	2.89
3	603650	彤程新材	223,416,379.12	2.72
4	600703	三安光电	219,991,998.42	2.68
5	603501	韦尔股份	194,946,344.35	2.37
6	300207	欣旺达	166,318,180.84	2.02
7	603986	兆易创新	154,949,348.50	1.89
8	300223	北京君正	152,712,513.03	1.86
9	300782	卓胜微	143,848,614.73	1.75
10	688521	芯原股份	137,093,807.50	1.67
11	688012	中微公司	119,985,008.80	1.46
12	002371	北方华创	113,013,511.38	1.38
13	300059	东方财富	79,983,540.44	0.97
14	688981	中芯国际	29,999,945.28	0.37
15	002532	天山铝业	19,998,631.00	0.24
16	300896	爱美客	19,904,440.14	0.24
17	600733	北汽蓝谷	14,997,281.97	0.18
18	688126	沪硅产业	9,999,900.75	0.12
19	601600	中国铝业	9,999,792.00	0.12
20	000960	锡业股份	9,999,765.17	0.12

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	002371	北方华创	1,073,495,850.74	13.06
2	300782	卓胜微	1,066,695,858.35	12.98
3	603501	韦尔股份	886,510,042.37	10.79
4	603986	兆易创新	863,664,182.75	10.51
5	600584	长电科技	736,081,986.84	8.96
6	688981	中芯国际	732,475,349.36	8.91
7	300661	圣邦股份	524,141,734.22	6.38
8	688012	中微公司	468,409,562.43	5.70

9	300223	北京君正	410,906,580.77	5.00
10	600703	三安光电	323,924,126.23	3.94
11	605111	新洁能	295,442,959.46	3.60
12	002268	卫士通	246,780,294.14	3.00
13	688126	沪硅产业	231,062,340.99	2.81
14	300059	东方财富	83,611,852.71	1.02
15	688339	亿华通	59,999,693.90	0.73
16	300207	欣旺达	49,998,986.80	0.61
17	300896	爱美客	21,843,285.64	0.27
18	600733	北汽蓝谷	16,424,272.00	0.20
19	002532	天山铝业	16,213,187.00	0.20
20	000625	长安汽车	10,844,199.00	0.13

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	2,650,236,636.57
卖出股票收入（成交）总额	8,219,200,991.42

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，除韦尔股份外，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。

2021年4月28日，上海韦尔半导体股份有限公司（简称“韦尔股份”）因未及时披露资产质押情况，违反了《上市公司信息披露管理办法》，被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监管措施。

截至本报告期末，韦尔股份（603501）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司是 CIS 芯片的领军企业，上述监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有韦尔股份。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

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	1,604,715.67
2	应收证券清算款	9,994,207.33
3	应收股利	-

4	应收利息	68,568.82
5	应收申购款	3,835,398.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,502,890.51

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

本基金本报告期末持有的前十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

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
253,973	9,246.48	344,028,030.46	14.65%	2,004,329,035.34	85.35%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,903,287.36	0.0810%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 05 月 10 日）基金份额总额	270,829,069.66
本报告期期初基金份额总额	5,599,725,454.70
本报告期基金总申购份额	4,793,507,549.28
减：本报告期基金总赎回份额	8,044,875,938.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,348,357,065.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

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

本报告期内，本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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

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

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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 12 万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
长江证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
国金证券	1	565,976,705.72	5.23%	402,579.76	5.08%	
国联证券	1	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
华金证券	1	823,123,936.06	7.60%	585,487.43	7.39%	本报告期新增
华西证券	1	-	-	-	-	
开源证券	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
太平洋证券	1	-	-	-	-	
天风证券	1	3,762,180,019.50	34.74%	2,676,020.33	33.77%	本报告期新增
万联证券	1	-	-	-	-	
西部证券	1	-	-	-	-	
西南证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	1	62,229,325.63	0.57%	44,264.25	0.56%	
招商证券	2	4,512,766,194.55	41.67%	3,209,931.07	40.51%	
中泰证券	1	1,103,998,418.72	10.19%	1,006,074.80	12.70%	
中信建投	1	-	-	-	-	

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 2 个交易单元：华金证券股份有限公司（1 个交易单元）、天风证券股份有限公司（1 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被签订的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	902,796,707.70	58.83%	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	631,721,292.10	41.17%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年01月04日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年01月05日
3	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年01月16日
4	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 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》	2021年01月22日
5	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021年01月22日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年02月08日
7	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021年02月08日
8	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年03月12日
9	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加代销机构并在代销机构开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》	2021年03月23日
10	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年03月29日
11	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021年03月31日
12	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021年03月31日

13	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 03 月 31 日
14	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 04 月 01 日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵州银行为代销机构并开通定投、转换业务及旗下部分基金参加贵州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》	2021 年 04 月 02 日
16	诺安和鑫灵活配置混合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	《证券时报》	2021 年 04 月 21 日
17	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 期	基金管理人网站	2021 年 04 月 21 日
18	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021 年 04 月 21 日
19	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 04 月 22 日
20	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021 年 04 月 22 日
21	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021 年 04 月 28 日
22	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2021 年 05 月 29 日
23	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 06 月 11 日
24	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加中国银河证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》	2021 年 06 月 24 日
25	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021 年 06 月 26 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 06 月 30 日
27	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 06 月 30 日
28	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 07 月 21 日

		《证券日报》	
29	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2021 年 07 月 21 日
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2021 年 07 月 22 日
31	诺安基金管理有限公司关于部分基金增加万联证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2021 年 08 月 23 日
32	诺安基金管理有限公司关于董事长任职的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 08 月 27 日
33	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站	2021 年 08 月 31 日
34	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 08 月 31 日
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 10 月 12 日
36	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 10 月 27 日
37	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2021 年 10 月 27 日
38	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加恒天明泽为代销机构的公告	《证券时报》	2021 年 10 月 29 日
39	诺安基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 01 日
40	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021 年 11 月 05 日
41	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修改基金合同、托管协议的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 05 日
42	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021 年 11 月 05 日
43	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 2 期	基金管理人网站	2021 年 11 月 10 日
44	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021 年 11 月 10 日

45	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 10 日
46	诺安基金管理有限公司关于旗下 30 只基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 11 月 10 日
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2021 年 12 月 01 日
48	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》	2021 年 12 月 01 日
49	诺安基金管理有限公司关于督察长任职的公告	《上海证券报》	2021 年 12 月 10 日
50	诺安基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金销售相关业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021 年 12 月 14 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安和鑫保本混合型证券投资基金公开募集的文件。
- ②原诺安和鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的相关公告。
- ③《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ④《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- ⑤《诺安和鑫灵活配置混合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报告期内诺安和鑫灵活配置混合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
2022年03月31日