

诺安主题精选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 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	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	15
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	48
8.1	期末基金资产组合情况	48
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	54
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	54
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	54
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	55
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12	投资组合报告附注	55
§ 9	基金份额持有人信息	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 10	开放式基金份额变动	56
§ 11	重大事件揭示	57
11.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4	基金投资策略的改变	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8	其他重大事件	59
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 13	备查文件目录	63
13.1	备查文件目录	63
13.2	存放地点	63
13.3	查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安主题精选混合型证券投资基金
基金简称	诺安主题精选混合
基金主代码	320012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年09月15日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,073,467.08份
基金合同存续期	不定期

注：自2015年8月6日起，原“诺安主题精选股票型证券投资基金”变更为“诺安主题精选混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选主题，稳健投资，力图在不同的市场环境下均可突破局限，在长期内获得超过比较基准的超额收益。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略五部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2. 股票投资策略方面，本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。</p> <p>3. 存托凭证投资策略方面，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. 债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>5. 权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	75%沪深300指数+25%中证全债指数
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，属于中高风险、中高收益的基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	李申
	联系电话	0755-83026688	021-60637102
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	021-60637111
传真		0755-83026677	021-60635778
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		李强	田国立

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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	84,152,476.62	112,030,018.24	39,940,214.53
本期利润	-38,385,257.49	213,096,644.36	59,652,646.78
加权平均基金份额本期利润	-0.3173	1.3846	0.7376
本期加权平均净值利润率	-8.35%	42.33%	36.32%
本期基金份额净值增长率	-8.31%	63.29%	46.80%
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	265,074,276.81	350,334,197.15	140,064,305.63
期末可供分配基金份额利润	2.4990	2.4189	1.3373
期末基金资产净值	371,147,743.89	552,736,170.26	244,797,171.24
期末基金份额净值	3.499	3.816	2.337
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	283.97%	318.76%	156.46%
-------------	---------	---------	---------

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。

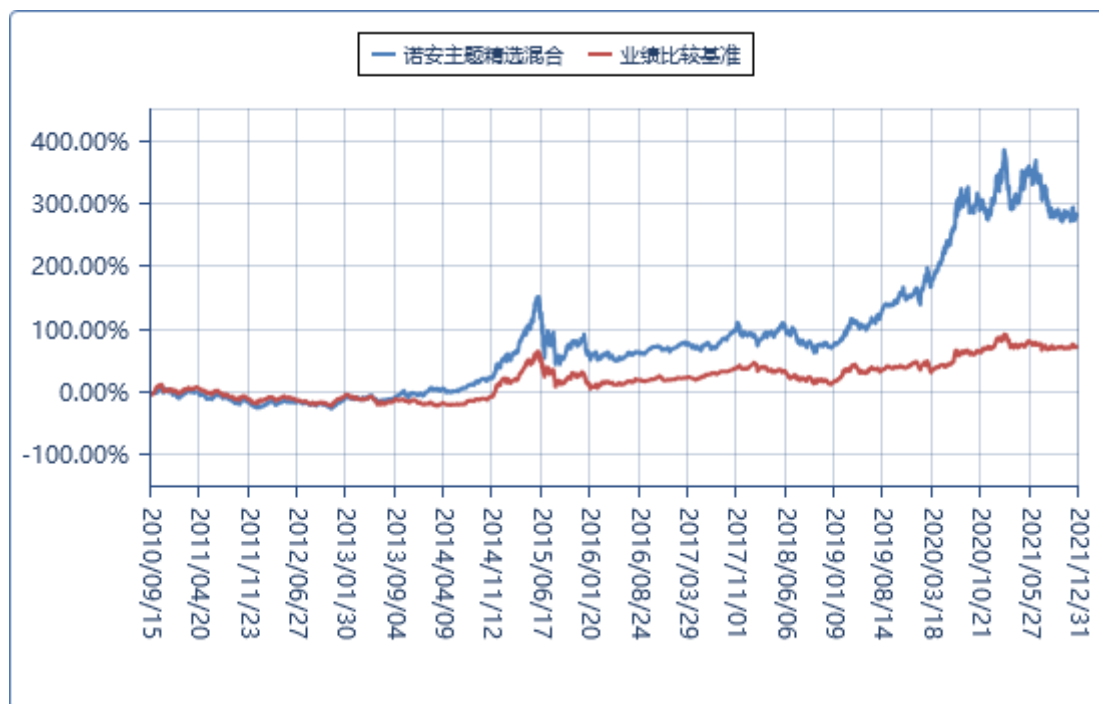
3.2 基金净值表现

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	-1.21%	1.10%	1.52%	0.59%	-2.73%	0.51%
过去六个月	-17.77%	1.34%	-3.21%	0.77%	-14.56%	0.57%
过去一年	-8.31%	1.48%	-2.29%	0.88%	-6.02%	0.60%
过去三年	119.79%	1.38%	51.68%	0.96%	68.11%	0.42%
过去五年	125.89%	1.25%	44.92%	0.90%	80.97%	0.35%
自基金合同生效起至今	283.97%	1.37%	74.39%	1.07%	209.58%	0.30%

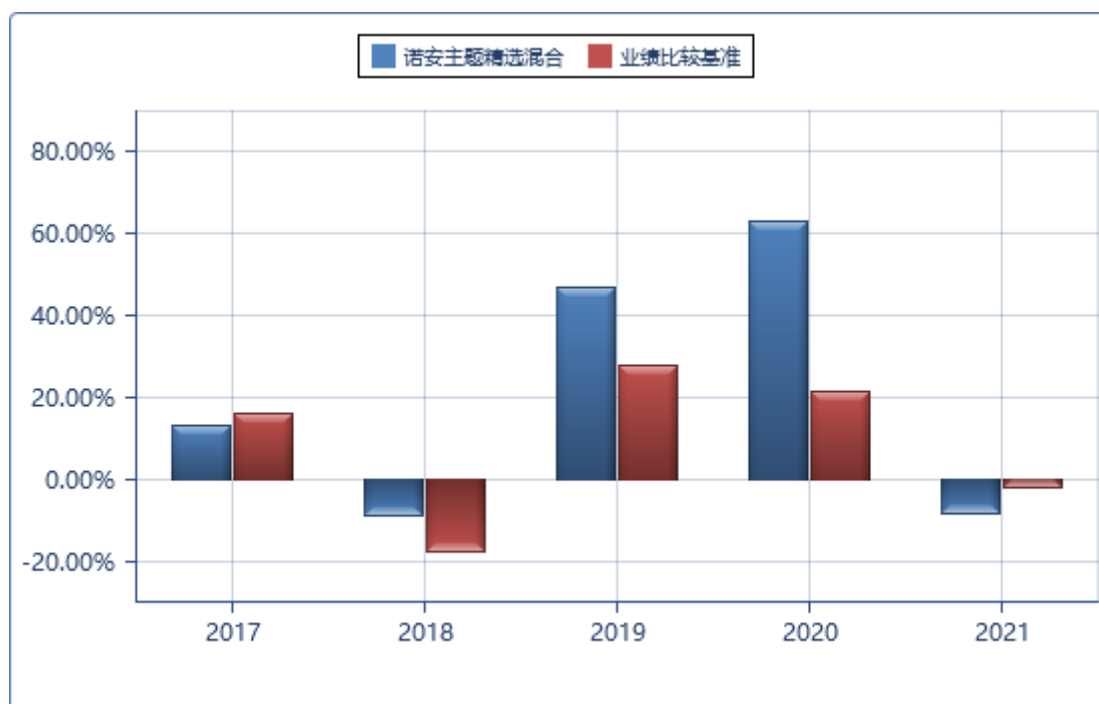
注：本基金的业绩比较基准为：75%沪深300指数+25%中证全债指数。

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：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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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		
罗春蕾	本基金基金经理	2015年09月26日	-	15年	硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银华基金管理有限公司，从事医药行业研究工作。2011年12月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2019年2月至2020年4月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年5月任诺安鸿鑫混合型证

					券投资基金基金经理。 2015年9月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理， 2019年1月起任诺安积极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遵规守信情况的说明

报告期间，诺安主题精选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《诺安主题精选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

报告期内，A股呈明显分化的走势。小盘股，尤其是小盘成长股表现优秀，小盘成长、小盘价值、中证1000、中证500等指数涨幅都在15%以上甚至更多。大盘价值、上证50等指数跌幅在10%左右。小盘股表现明显优于大盘股。从行业看，新能源、化工、有色、钢铁、煤炭等涨幅居前，而社服、家电、食品饮料、医药等大消费行业则跌幅居前。这种明显的结构性行情与前两年正好相反。

本基金长期投资大消费及医药领域，其中医药、食品饮料、社服、化妆品、家电是我们一直有持仓的行业。在医药及消费整体走弱的背景下，基金收益率为-8.31%，弱于上述大多数指数，也弱于本基金自身的基准。无论是收益率和排名，该业绩均是本基金近三年最差的表现。年末之际，我们也对本年投资进行了反思。之所以业绩不佳，主要原因如下：

第一方面，2019-2020年是大盘成长股表现最好的两年，也是大消费和医药的牛市。行业里的龙头公司涨幅领先，而且该涨幅主要来自估值推动，其次才是业绩。这使得买龙头、长期持有、少做波段、降低换手率成为那个阶段最好的投资策略。但是这也导致2020年底，相关公司的股价都已处于估值的历史高位，为2021年较差的表现埋下了伏笔。

第二方面，新冠病毒在2020年突然爆发之后，其对消费行业的种种负面影响在2021年逐渐暴露。

2020年，爆发之初消费骤降，随后因居家工作、隔离等因素，反而导致To C端消费较快增长。另外，政府出台了很多鼓励消费、帮企业度过难关的政策（减税等），使得很多公司出现收入较快增

长、费用下降，利润大幅增长的局面。

2021年，很多地方与2020年正相反。（1）疫情的此起彼伏导致很多中低收入的服务业人员受到影响，收入下降，消费意愿降低，消费档次降级。（2）政府对多个行业（地产、教育、互联网、影视娱乐）的政策调控也导致从业人员收入受到影响。（3）2020年政府出台的鼓励消费、企业减税政策在2021年取消，这使得2020年的优秀业绩变成了高基数。（4）各种成本上涨带来经营压力。

第三方面，对于上述消费行业在2021年遭遇的疲软，我们虽然有所感知，但终究还是反应慢了。

一方面，在过去两年的行情中，我们的选股思路一定程度上也因为思维惯性而显得僵化了，过度强调对优质公司的长期持有，而忽视了其阶段性高估值的风险。对消费行业景气度的拐点不敏感，这也包括因为想做到长期主义，而忽视阶段性的行业调整、市场风格的切换。

另一方面，我们总想找到在长坡厚雪的好赛道、长期立于不败之地的好公司，却忽视了对一些小而美、主业看起来不是那么光鲜靓丽、但是财务稳健估值便宜的公司的研究与跟踪，因而错失了他们在某个阶段（比如2021年）的投资机会。2019-2020年是食品饮料、社服、家电、医药的牛市，但并非所有消费品的牛市，纺织、零售、传媒甚至轻工在这两年都不太理想，这一方面有行业自身属性的问题，也有市场偏好的问题。但是2021年，上述那些不太受欢迎的消费行业都打了翻身仗，而最热门的消费医药赛道则比较差。从长期看，我们依旧认为医药、食品饮料、家电等是黄金赛道，但短期在市场风格极致演绎的时候，我们还是要克服贪婪与恐惧，勇敢尝试着切换。

第四方面，单独讲讲医药。与大消费类似，2019-2020年医药里的创新药、CXO、医药消费品、医疗服务都经历了一波大牛市。医药的龙头白马并没有比大消费的白马涨幅更高，但估值却是对方的至少2倍以上。如果只投资医药，我们出于跑赢指数的考虑无论如何也要配上这些贵的公司，但是如果把投资范围扩展到大消费，我们希望能少些抱团，多些谨慎。这种选股的思路在2021年的大部分时间是错误的，但在三四季度则逐渐变成优势。回头复盘2021年的医药投资机会，虽然之前公募基金的抱团重心在上半取得了不错的收益，但在下半年纷纷启动了估值回调甚至是戴维斯双杀。全年真正有收益的反而被市场冷落多年的中药和依旧热门的原料药（背后也是CXO逻辑）。

总之，我们认为2021年本基金业绩不甚理想既有大消费及医药行业整体走势疲软的因素，也有我们过去两年投资框架迭代较慢、选股思路略显僵化、在长期风格和短期目标之前平衡不够的问题。所幸，市场是最好的老师，我们也并非固执己见、冥顽不灵的学生，坚守长期、灵活应变、乐观谨慎、勤勉好学是投资路上始终铭刻的印记。2021年消费与医药的低迷是暂时的，只要中国经济长期向上的趋势不变，民众的消费需求稳步提升。在这两个长期的优质赛道布局依然是我们坚定的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安主题精选混合基金份额净值为 3.499 元；本报告期内，基金份额净值增长率为-8.31%，同期业绩比较基准收益率为-2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2022 年，无论是中央经济工作会议中释放出“六稳”的信号，还是欧美对新冠疫情管控日渐放松的外围环境，以及很多民众、企业这两年多来因疫情而受到的种种影响。提振经济、稳就业、保增长将是 2022 年宏观经济层面最重要的主题。我们现在已经能看到各种财政、货币政策陆续出台，为增长提供弹药。因此，在政策支持、宏观流动性层面，从一年的维度看，利好较多。

至于海外方面，美联储自疫情之后大规模放水也已有两年，日积月累之下大宗商品价格上涨、人力成本上涨、物价上涨已经逐渐成为经济主要矛盾，2022 年美联储加息几乎不可避免。加之美股也正处于多年牛市的高点，因此，海外风险大于国内。

另一层面，A 股从 2018 年 11 月份的熊市低点至 2021 年底，牛市已经走了整整三年。虽然，不同年份有不同的结构性行情，但是这三年里很多行业都已积累了不小的涨幅，且牛市里向来估值弹性大于业绩弹性。此外，这三年来机构投资的抱团取暖风格很明显，尤其是一些涨势好中大市值的公司，机构扎堆现象明显。如果股市走势平稳则无妨，如果市场一旦出现波动，机构重仓股可能会有较大风险。

大消费和医药在 2021 年是市场表现最差的行业之一，目前机构持仓都已下降不少，但从筹码角度讲风险不大。但目前制约股价最重要的因素仍然是疫情。在国内“动态清零”的政策下，民众的线下消费场景不可避免受到冲击，这既影响相关从业人员收入，也影响民众消费意愿和能力。因此，从目前各种数据看，大众消费仍然不算景气。但是，投资也不仅仅是追踪数据，同时也有对经济和市场的预判。我们一方面看到政府对于提振经济的决心，一方面认为人的经济活动、乃至新冠病毒变异与环境气候密不可分。

就整个社会而言，新冠疫情爆发至今已两年有余，期间虽然一直此起彼伏，但我们对病毒的认识在不断深化，应对疫情的手段也从当初“武汉封城，倾全国之力援助一个重点区域”进化得更加立体、丰富。就病毒而言，虽然每一次变异都有偶然性，但是从趋势看符合毒性下降、感染性增强的规律，最终实现与人类真正的和平共处。

因此，虽然疫情尚未消退，我们依然选择做一个长期的乐观主义者，相信医药科技的进步会让我们有更多手段克服疫情，也相信面对疫情、面对经济我们都能“上下同欲者胜”。因此，我们对 2022 年大消费及医药的表现保有乐观信心。

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,每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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	安永华明(2022)审字第 60469052_H06 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	诺安主题精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了诺安主题精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的诺安主题精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了诺安主题精选混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于诺安主题精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>诺安主题精选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估诺安主题精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督诺安主题精选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对诺安主题精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安主题精选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤, 黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022年03月29日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安主题精选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	54,697,730.04	60,492,461.03
结算备付金		743,585.13	615,673.30
存出保证金		165,726.55	210,216.04

交易性金融资产	7.4.7.2	323,557,988.51	512,102,852.21
其中：股票投资		323,557,988.51	512,102,852.21
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	25,900,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,829.03	6,468.65
应收股利		-	-
应收申购款		125,131.28	363,737.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		405,194,990.54	573,791,408.90
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2021年12月31日	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		32,302,428.73	12,913,271.94
应付赎回款		510,841.56	6,523,809.51
应付管理人报酬		454,304.51	679,973.80
应付托管费		75,717.44	113,328.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	537,453.47	633,860.38
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	166,500.94	190,994.04
负债合计		34,047,246.65	21,055,238.64
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	106,073,467.08	144,830,136.29
未分配利润	7.4.7.10	265,074,276.81	407,906,033.97
所有者权益合计		371,147,743.89	552,736,170.26
负债和所有者权益总计		405,194,990.54	573,791,408.90

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.499 元，基金份额总额 106,073,467.08 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安主题精选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日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31 日
一、收入		-26,595,477.57	225,283,684.14
1. 利息收入		258,530.54	478,830.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	258,530.54	478,830.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		95,107,778.06	122,064,886.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	91,942,993.62	118,535,929.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	3,164,784.44	3,528,957.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-122,537,734.11	101,066,626.12
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	575,947.94	1,673,340.64
减：二、费用		11,789,779.92	12,187,039.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,931,011.09	7,492,330.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,155,168.51	1,248,721.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,524,978.88	3,257,861.05
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	178,621.44	188,126.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-38,385,257.49	213,096,644.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-38,385,257.49	213,096,644.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安主题精选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）	144,830,136.29	407,906,033.97	552,736,170.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-38,385,257.49	-38,385,257.49
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）	-38,756,669.21	-104,446,499.67	-143,203,168.88
其中：1. 基金申购款	85,974,306.72	250,834,112.46	336,808,419.18
2. 基金赎回款	-124,730,975.93	-355,280,612.13	-480,011,588.06
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）	106,073,467.08	265,074,276.81	371,147,743.89
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）	104,732,865.61	140,064,305.63	244,797,171.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	213,096,644.36	213,096,644.36
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）	40,097,270.68	54,745,083.98	94,842,354.66
其中：1. 基金申购款	371,782,666.03	835,907,466.17	1,207,690,132.20
2. 基金赎回款	-331,685,395.35	-781,162,382.19	-1,112,847,777.54
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）	144,830,136.29	407,906,033.97	552,736,170.26

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

诺安主题精选混合型证券投资基金(简称“本基金”)原名为诺安主题精选股票型证券投资基金。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会第104号)规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月6日起,诺安主题精选股票型证券投资基金名称变更为诺安主题精选混合型证券投资基金。原诺安主题精选股

票型证券投资基金经中国证监会《关于核准诺安主题精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2010〕984号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安主题精选股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2010年9月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为3,309,251,362.03份基金份额，其中认购资金利息折合189,075.35份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安主题精选混合型证券投资基金基金合同》和《诺安主题精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票、存托凭证等权益类资产占基金资产的60%–95%，其中不低于80%的股票、存托凭证资产投资于与基金管理人构建的备选主题库相关联的个股；债券等固定收益类资产占基金资产的0%–40%；权证占基金资产净值的0%–3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务

状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

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主要包括股票、存托凭证、债券、资产支持证券和衍生工具等投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入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、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

（2）金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；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，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件时的金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(b) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

(c) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配六次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

(d) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(e) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(f) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(g) 基金收益分配后每一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；

(h) 法律法规或监管机构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、债券投资和资产支持证券的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

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

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	54,697,730.04	60,492,461.03
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	54,697,730.04	60,492,461.03

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	326,005,358.51	323,557,988.51	-2,447,370.00
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	326,005,358.51	323,557,988.51	-2,447,370.00
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	392,012,488.10	512,102,852.21	120,090,364.11
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	392,012,488.10	512,102,852.21	120,090,364.11

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,900,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,900,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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	4,419.83	6,096.95
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	334.60	277.10
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	74.60	94.60
合计	4,829.03	6,468.65

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	537,453.47	633,860.38
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	537,453.47	633,860.38

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	1,500.94	20,994.04
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	165,000.00	170,000.00
合计	166,500.94	190,994.04

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	144,830,136.29	144,830,136.29
本期申购	85,974,306.72	85,974,306.72

本期赎回（以“-”号填列）	-124,730,975.93	-124,730,975.93
本期末	106,073,467.08	106,073,467.08

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	350,334,197.15	57,571,836.82	407,906,033.97
本期利润	84,152,476.62	-122,537,734.11	-38,385,257.49
本期基金份额交易产生的变动数	-106,573,752.10	2,127,252.43	-104,446,499.67
其中：基金申购款	243,301,067.73	7,533,044.73	250,834,112.46
基金赎回款	-349,874,819.83	-5,405,792.30	-355,280,612.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	327,912,921.67	-62,838,644.86	265,074,276.81

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	236,346.08	446,905.51
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	13,637.05	13,129.87
其他	8,547.41	18,795.46
合计	258,530.54	478,830.84

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	1,243,965,550.01	1,062,742,149.62
减：卖出股票成本总额	1,152,022,556.39	944,206,220.16
买卖股票差价收入	91,942,993.62	118,535,929.46

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14 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	3,164,784.44	3,528,957.08
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	3,164,784.44	3,528,957.08

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	-122,537,734.11	101,066,626.12
--股票投资	-122,537,734.11	101,066,626.12
--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	-122,537,734.11	101,066,626.12

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	478,385.40	1,400,809.47
基金转换费收入	97,562.54	272,531.17
合计	575,947.94	1,673,340.64

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	3,524,978.88	3,257,861.05
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,524,978.88	3,257,861.05

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	13,621.44	18,126.80
合计	178,621.44	188,126.80

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
中国建设银行股份有限公司	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	6,931,011.09	7,492,330.24
其中：支付销售机构的客户维护费	2,057,250.04	2,052,475.76

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	1,155,168.51	1,248,721.69

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自有资金投资本基金的情况

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

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
中国建设银行股份有限公司	54,697,730.04	236,346.08	60,492,461.03	446,905.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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	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	630	13,885.20	35,456.40	-
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07日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
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	金三江	2021年09月03日	2022年03月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
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	-
30107	中捷	2021年	2022年	新股锁	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

2	精工	09月22日	03月29日	定						
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	395	13,098.20	9,744.65	-
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	1,534	16,030.30	17,211.48	-
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	238	8,641.78	8,453.76	-
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	374	10,400.94	11,646.36	-
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	168	9,621.36	9,023.28	-
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	-
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	-

		日	日							
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	1,179	14,183.37	20,184.48	-
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07月11日	新股锁定	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	275	16,681.50	26,606.25	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年06月28日	新股锁定	86.06	94.50	123	10,585.38	11,623.50	-
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	276	10,786.08	14,387.88	-
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	182	8,006.18	9,240.14	-
301180	万祥科技	2021年11月09日	2022年05月16日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
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	332	9,720.96	10,624.00	-
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	184	12,859.76	16,324.48	-
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	-
688148	芳源股份	2021年07月30日	2022年02月07日	新股锁定	4.58	34.00	11,860	54,318.80	403,240.00	-
688232	新点软件	2021年11月10日	2022年05月17日	新股锁定	48.49	41.99	4,724	229,066.76	198,360.76	-
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	3,004	126,107.92	126,107.92	-
688697	纽威数控	2021年09月09日	2022年03月17日	新股锁定	7.55	16.03	5,837	44,069.35	93,567.11	-
688711	宏微科技	2021年08月25日	2022年03月01日	新股锁定	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
688718	唯赛勃	2021年07月20日	2022年01月28日	新股锁定	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95	-
688739	成大生物	2021年10月21日	2022年04月28日	新股锁定	110.00	70.32	2,100	231,000.00	147,672.00	-
688767	博拓生物	2021年09月01日	2022年03月08日	新股锁定	34.55	66.38	2,220	76,701.00	147,363.60	-
688799	华纳药厂	2021年07月05日	2022年01月13日	新股锁定	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-

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。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行

人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有债券和资产支持证券（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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

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时间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低于15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等。

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	54,697,730.04	-	-	-	-	54,697,730.04
结算备付金	743,585.13	-	-	-	-	743,585.13
存出保证金	165,726.55	-	-	-	-	165,726.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-323,557,988.51	323,557,988.51
买入返售金融资产	25,900,000.00	-	-	-	-	25,900,000.00
应收利息	-	-	-	-	4,829.03	4,829.03
应收申购款	2,348.00	-	-	-	122,783.28	125,131.28
资产总计	81,509,389.72	-	-	-	-323,685,600.82	405,194,990.54
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-32,302,428.73	32,302,428.73
应付赎回款	-	-	-	-	510,841.56	510,841.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	454,304.51	454,304.51
应付托管费	-	-	-	-	75,717.44	75,717.44
应付交易费用	-	-	-	-	537,453.47	537,453.47
其他负债	-	-	-	-	166,500.94	166,500.94
负债总计	-	-	-	-	-34,047,246.65	34,047,246.65
利率敏感度缺口	81,509,389.72	-	-	-	-289,638,354.17	371,147,743.89
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	60,492,461.03	-	-	-	-	60,492,461.03
结算备付金	615,673.30	-	-	-	-	615,673.30
存出保证金	210,216.04	-	-	-	-	210,216.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-512,102,852.21	512,102,852.21
应收利息	-	-	-	-	6,468.65	6,468.65
应收申购款	2,820.00	-	-	-	360,917.67	363,737.67
资产总计	61,321,170.37	-	-	-	-512,470,238.53	573,791,408.90
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-12,913,271.94	12,913,271.94
应付赎回款	-	-	-	-	6,523,809.51	6,523,809.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	679,973.80	679,973.80
应付托管费	-	-	-	-	113,328.97	113,328.97
应付交易费用	-	-	-	-	633,860.38	633,860.38
其他负债	-	-	-	-	190,994.04	190,994.04
负债总计	-	-	-	-	-21,055,238.64	21,055,238.64
利率敏感度缺口	61,321,170.37	-	-	-	-491,414,999.89	552,736,170.26

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和资产支持证券投资（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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	323,557,988.51	87.18	512,102,852.21	92.65
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	323,557,988.51	87.18	512,102,852.21	92.65

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%	16,174,396.81	23,360,963.26
	业绩比较基准下降5%	-16,174,396.81	-23,360,963.26

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) 金融工具公允价值层次

公允价值计量或披露的金融工具所属的公允价值层次，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319,487,033.93元，属于第二层次的余额为4,070,954.58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为505,239,585.93元，属于第二层次的余额为6,863,266.28元，无属于第三层次的余额)。

(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)根据财政部修订印发的《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》及《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以上统称新金融工具相关会计准则),以及财政部、银保监会发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3)除上述事项外,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	323,557,988.51	79.85
	其中:股票	323,557,988.51	79.85
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	25,900,000.00	6.39
	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	55,441,315.17	13.68
8	其他各项资产	295,686.86	0.07
9	合计	405,194,990.54	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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	233,188,710.65	62.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	16,160,728.61	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	13,784,000.00	3.71
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,516,690.75	4.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	42,709,200.00	11.51
M	科学研究和技术服务业	99,799.62	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	26,636.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.01
S	综合	-	-
	合计	323,557,988.51	87.18

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	601888	中国中免	120,000	26,329,200.00	7.09
2	603866	桃李面包	700,000	19,880,000.00	5.36
3	603345	安井食品	110,000	18,785,800.00	5.06
4	002027	分众传媒	2,000,000	16,380,000.00	4.41
5	000963	华东医药	399,980	16,079,196.00	4.33
6	688521	芯原股份	200,000	15,472,000.00	4.17
7	002507	涪陵榨菜	400,000	15,120,000.00	4.07
8	000333	美的集团	200,000	14,762,000.00	3.98
9	001215	千味央厨	250,009	14,553,023.89	3.92
10	603816	顾家家居	180,000	13,888,800.00	3.74
11	002352	顺丰控股	200,000	13,784,000.00	3.71
12	688161	威高骨科	210,000	13,381,200.00	3.61
13	300760	迈瑞医疗	35,000	13,328,000.00	3.59

14	600276	恒瑞医药	250,000	12,677,500.00	3.42
15	688016	心脉医疗	50,056	12,450,929.44	3.35
16	688085	三友医疗	400,064	12,349,975.68	3.33
17	300973	立高食品	90,027	11,890,766.16	3.20
18	002603	以岭药业	599,977	11,759,549.20	3.17
19	603288	海天味业	110,000	11,562,100.00	3.12
20	002271	东方雨虹	150,000	7,902,000.00	2.13
21	300223	北京君正	55,017	7,372,278.00	1.99
22	600872	中炬高新	189,200	7,183,924.00	1.94
23	603987	康 德 菜	200,000	4,346,000.00	1.17
24	688026	洁特生物	46,266	4,078,810.56	1.10
25	002508	老板电器	103,297	3,720,757.94	1.00
26	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.45
27	688148	芳源股份	11,860	403,240.00	0.11
28	600535	天 士 力	17,600	278,960.00	0.08
29	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.06
30	688232	新点软件	4,724	198,360.76	0.05
31	688739	成大生物	2,100	147,672.00	0.04
32	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.04
33	688262	国芯科技	3,004	126,107.92	0.03
34	688192	迪哲医药	3,179	117,654.79	0.03
35	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.03
36	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.02
37	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.02
38	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
39	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
40	301029	怡 合 达	462	41,519.94	0.01
41	301035	润丰股份	630	35,456.40	0.01
42	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
43	301155	海力风电	275	26,606.25	0.01
44	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.01
45	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
46	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
47	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
48	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
49	301127	天源环保	1,179	20,184.48	0.01
50	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
51	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
52	301090	华润材料	1,534	17,211.48	0.00
53	301221	光庭信息	184	16,324.48	0.00
54	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00

55	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
56	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
57	301168	通灵股份	276	14,387.88	0.00
58	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
59	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
60	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
61	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
62	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
63	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
64	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
65	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
66	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
67	301100	风光股份	374	11,646.36	0.00
68	301166	优宁维	123	11,623.50	0.00
69	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
70	301199	迈赫股份	332	10,624.00	0.00
71	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
72	301088	戎美股份	395	9,744.65	0.00
73	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
74	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
75	301179	泽宇智能	182	9,240.14	0.00
76	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
77	301108	洁雅股份	168	9,023.28	0.00
78	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
79	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
80	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
81	301092	争光股份	238	8,453.76	0.00
82	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
83	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
84	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
85	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
86	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
87	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
88	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
89	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
90	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
91	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
92	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
93	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
94	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
95	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00

96	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
97	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
98	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
99	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
100	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
101	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
102	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
103	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
104	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
105	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
106	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	300601	康泰生物	61,132,938.84	11.06
2	000963	华东医药	50,518,342.89	9.14
3	000333	美的集团	42,111,560.00	7.62
4	002508	老板电器	38,917,251.72	7.04
5	688521	芯原股份	34,808,894.66	6.30
6	300973	立高食品	31,294,152.61	5.66
7	603345	安井食品	26,166,568.86	4.73
8	603288	海天味业	26,069,764.12	4.72
9	300760	迈瑞医疗	24,452,900.00	4.42
10	688007	光峰科技	23,793,299.96	4.30
11	002216	三全食品	22,067,479.14	3.99
12	002791	坚朗五金	20,876,042.00	3.78
13	688085	三友医疗	20,296,503.29	3.67
14	603833	欧派家居	19,958,865.75	3.61
15	603317	天味食品	18,801,791.91	3.40
16	000538	云南白药	18,676,083.96	3.38
17	603027	千禾味业	18,301,385.00	3.31
18	688626	翔宇医疗	17,619,247.08	3.19
19	601318	中国平安	17,606,349.00	3.19
20	300661	圣邦股份	17,266,024.00	3.12
21	603605	珀莱雅	16,911,221.95	3.06
22	000002	万科A	16,657,269.10	3.01
23	300003	乐普医疗	16,193,856.70	2.93
24	300558	贝达药业	16,169,698.42	2.93

25	002236	大华股份	15,655,323.20	2.83
26	603883	老百姓	15,518,927.00	2.81
27	001215	千味央厨	15,471,764.55	2.80
28	688161	威高骨科	15,463,611.03	2.80
29	002271	东方雨虹	15,363,523.50	2.78
30	002027	分众传媒	15,040,115.00	2.72
31	603899	晨光文具	14,861,505.00	2.69
32	603816	顾家家居	14,221,274.00	2.57
33	688179	阿拉丁	13,899,892.04	2.51
34	002507	涪陵榨菜	13,473,561.00	2.44
35	688016	心脉医疗	13,285,276.88	2.40
36	600588	用友网络	12,922,117.20	2.34
37	002352	顺丰控股	12,835,687.00	2.32
38	600276	恒瑞医药	12,776,340.69	2.31
39	600305	恒顺醋业	12,230,289.94	2.21
40	301080	百普赛斯	11,322,324.96	2.05
41	002603	以岭药业	11,278,523.85	2.04

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	300601	康泰生物	74,452,686.58	13.47
2	603605	珀莱雅	54,308,327.56	9.83
3	300760	迈瑞医疗	52,159,891.56	9.44
4	603259	药明康德	47,292,945.16	8.56
5	600315	上海家化	46,105,836.53	8.34
6	000661	长春高新	43,220,170.00	7.82
7	603345	安井食品	42,658,751.00	7.72
8	000538	云南白药	39,600,632.92	7.16
9	688029	南微医学	31,696,678.17	5.73
10	002508	老板电器	30,155,348.00	5.46
11	603195	公牛集团	27,392,705.77	4.96
12	000963	华东医药	26,893,860.12	4.87
13	000333	美的集团	26,149,816.15	4.73
14	688626	翔宇医疗	24,877,233.24	4.50
15	601888	中国中免	24,758,389.28	4.48
16	600276	恒瑞医药	23,942,563.92	4.33
17	688007	光峰科技	23,601,627.30	4.27
18	002791	坚朗五金	22,039,380.70	3.99
19	300973	立高食品	20,726,987.80	3.75

20	688521	芯原股份	18,976,919.62	3.43
21	300143	盈康生命	18,493,004.00	3.35
22	300661	圣邦股份	18,397,668.06	3.33
23	000651	格力电器	18,324,260.63	3.32
24	603096	新经典	17,755,954.72	3.21
25	603719	良品铺子	17,567,544.79	3.18
26	603833	欧派家居	16,912,847.00	3.06
27	601318	中国平安	16,724,495.00	3.03
28	603883	老百姓	16,166,925.03	2.92
29	300003	乐普医疗	16,089,425.00	2.91
30	000002	万科A	15,715,709.70	2.84
31	002216	三全食品	15,578,333.60	2.82
32	301080	百普赛斯	15,560,169.00	2.82
33	002507	涪陵榨菜	15,514,203.33	2.81
34	603027	千禾味业	15,292,642.12	2.77
35	300558	贝达药业	14,487,728.00	2.62
36	002236	大华股份	14,245,049.00	2.58
37	603317	天味食品	14,199,533.00	2.57
38	603899	晨光文具	13,717,148.61	2.48
39	603288	海天味业	12,739,003.87	2.30
40	688696	极米科技	12,263,424.91	2.22

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	1,086,015,426.80
卖出股票收入（成交）总额	1,243,965,550.01

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，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。

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	165,726.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	4,829.03
5	应收申购款	125,131.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	295,686.86

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
27,422	3,868.19	16,381,118.63	15.44%	89,692,348.45	84.56%

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	696,282.19	0.6564%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年09月15日）基金份额总额	3,309,251,362.03
本报告期期初基金份额总额	144,830,136.29
本报告期基金总申购份额	85,974,306.72
减：本报告期基金总赎回份额	124,730,975.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	106,073,467.08

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金管理人于2021年10月29日披露了《诺安基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》，自2021年10月27日起，本基金的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为4.5万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：1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，本基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	546,679,025.93	23.73%	498,189.11	24.71%	-
国海证券	1	537,020,595.25	23.31%	500,128.50	24.81%	-
华金证券	1	541,131,397.25	23.49%	384,906.88	19.09%	-
申万宏源	1	679,303,668.34	29.48%	632,629.79	31.38%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被签订的券商签订《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
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	25,900,000.00	100.00%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《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
3	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
4	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加烟台银行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06日
5	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
6	诺安主题精选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
7	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

8	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
9	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
10	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
11	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
12	诺安主题精选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
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
15	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
16	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
17	诺安主题精选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
18	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
19	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
20	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
21	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机	《证券时报》、	2021年06月11日

	构代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金开展的基金赎回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21日
23	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
24	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
25	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
26	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
27	诺安主题精选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
28	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021年07月31日
29	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
30	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加上海农商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》	2021年08月30日
31	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
32	诺安主题精选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
33	诺安主题精选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09月13日
34	诺安主题精选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09月13日

35	诺安主题精选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09月13日
36	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
37	诺安主题精选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
39	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加新时代证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年10月29日
40	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年10月29日
41	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
42	诺安主题精选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
43	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
44	诺安主题精选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
45	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
46	诺安主题精选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
47	诺安主题精选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
48	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
49	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》、	2021年12月14日

		《证券日报》	
--	--	--------	--

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主题精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安主题精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安主题精选混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安主题精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安主题精选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