

诺安平衡证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 08 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 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	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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 ..	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3	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	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6	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	50
7.7	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	51
7.8	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	51
7.9	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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	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	52
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1	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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安平衡证券投资基金
基金简称	诺安平衡混合
基金主代码	320001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 05 月 21 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	957,568,623.07 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担市场同等风险的情况下,取得好于市场平均水平的收益水平,在控制风险的前提下,兼顾当期的稳定回报以及长期的资本增值。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在类别资产配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产和债券资产的配置比例;在行业配置层面,本基金注重把握中国经济结构及消费结构变迁的趋势,关注各行业的周期性和景气度,实现行业优化配置;在个股选择层面,本基金借助诺安核心竞争力分析系统,在深入分析上市公司基本面的基础上,挖掘价格尚未完全反映公司成长潜力的股票;在债券投资方面,本基金实施利率预测策略、收益率曲线模拟、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,风险低于股票型基金,收益水平高于债券型基金。

注:自 2020 年 8 月 12 日起,本基金业绩比较基准由“65%×标普中国 A 股综合指数+35%×上证国债指数”变更为“沪深 300 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%”。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	郭明
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588

传真	0755-83026677	010-66105798
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李强	陈四清

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-57,193,106.91
本期利润	-111,101,268.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1111
本期加权平均净值利润率	-9.15%
本期基金份额净值增长率	-6.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	260,331,954.60
期末可供分配基金份额利润	0.2719
期末基金资产净值	1,217,900,577.67
期末基金份额净值	1.2719
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	512.59%

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

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

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

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
过去一个月	8.77%	1.00%	6.18%	0.70%	2.59%	0.30%
过去三个月	8.89%	1.35%	4.52%	0.93%	4.37%	0.42%
过去六个月	-6.91%	1.32%	-5.23%	0.94%	-1.68%	0.38%
过去一年	0.33%	1.12%	-7.53%	0.81%	7.86%	0.31%
过去三年	32.71%	0.96%	7.90%	0.78%	24.81%	0.18%
自基金合同生 效起至今	512.59%	1.31%	247.84%	1.08%	264.75%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率×35%。

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



§ 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十只开放式基金：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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

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		
曲泉儒	本基金基金经理	2021 年 03 月 02 日	-	10 年	硕士，具有基金从业资格，曾任远策投资管理有限公司研究员、长盛

					基金管理有限公司投资经理。2016 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，历任投资经理，现任研究部副总经理。2019 年 4 月至 2020 年 7 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 4 月起任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任诺安平衡证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任诺安汇利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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

2022 年年初，我们认为全年市场的关键词是“边际变化”和“价值回归”，在此思路下，组合对油产业链和泛消费产业链做了重点布局。对于油产业链，油价短期在上攻到 120 美金后有比较大的波动，主要原因在于受到美联储加息对需求担心的影响，且每次全球制造业 PMI 大幅向下的过程中油价会有波动。但这一轮油价上行过程中供给始终没有有效释放，同时油的库存、库存井都在历史较低的位置。当然，判断油价是非常难的，对油的持仓也未完全依赖于油价的上涨，但基本认为油价在较高的位置会有支撑。在这个基础上为了避免油产业链的持仓跟随油价的大幅波动，一方面围绕油田、油服、油运三个方向适当均衡布局，另外一方面会看中持仓公司量增长的确定性。对于消费成长，是我们中期重点布局的方向，即使短期数据不太好也没太大关系，只要找好安全边际就好。当然，对于消费成长普遍担心消费场景、消费意愿和消费能力的问题。消费场景短期内容易恢

复，消费意愿和消费能力确实有一些压力，但是我们要看到随着经济企稳的预期，消费意愿和消费能力也会渐次恢复，且我们对中长期消费升级充满信心。在消费成长的选择维度有几个：一是明显受益于消费场景恢复能提供弹性的，如免税行业；二是受消费能力和消费意愿边际影响小但确定性强的，如一部分必选消费品；三是即使充分考虑到消费意愿和消费能力目前相对较弱，细分行业和公司中期空间足够大且目前市值有安全边际的，如部分医疗服务。我们不把消费场景、意愿和能力的恢复作为投资这类泛消费公司的必要条件，只是基于一个中性假设下公司价值的挖掘。所以即使上述三个场景不发生更好的变化，也不影响我们看好这些泛消费方向的观点。

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 1.2719 元，本报告期内基金份额净值增长率为-6.91%，同期业绩比较基准收益率为-5.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从大势研判上看，过去几年，在“低利率、低通胀”的温和环境下，市场表现出较好的结构性机会。随着全球资本开支多年低迷、中国“供给侧改革”和“双碳”政策的推进以及流动性的边际效应递减等多种因素的影响，我们倾向于认为利率和通胀中枢可能处在中期上行通道的初期。而 2022 年可能也是扭转“低利率、低通胀”环境的拐点。在这种背景下，适用于过去几年的研究范式和投资逻辑也可能随之变化。从市场结构上看，我们认为 2022 年市场的关键词是“边际变化”和“价值回归”，结合中期景气度和长期空间，考虑各行业边际变化，结合估值历史分位数情况，机会可能出现在价值回归和景气度边际变化的过程中。我们认为大众消费、可选消费、部分医药类资产以及周期成长类资产的性价比日渐突出，逐渐到了“逆向”储备和布局的临界点，我们会积极寻求数据改善、估值合理的大消费类细分行业和龙头公司进行重点研究。同时，我们会密切关注高成长、高景气度行业增速的边际变化，在不断纷繁复杂、不断变化的市场中寻求不变。

总之，我们的投资理念是坚持价值投资，赚业绩和估值匹配条件下上市公司持续稳健增长的钱。方法里有两个关键词：逆向和估值。我们会把细分行业和公司分成“由差变好”、“好上更好”、“由好变差”以及“差里更差”四类状态，我们更多去投资行业规模效应带来的“由差变好”，以及公司自身竞争力带来的“好上更好”。我们会按照长期空间和中期景气两个维度将所有行业图谱化，动态观察这些行业的变化趋势，寻求长期空间扩大、中期景气向上且估值合理的方向。同时，我们始终相信市场是在预期加速和均值回归两种力量的驱使下螺旋式发展，我们更多关注价值投资里估值回归的可能。我们认为，如果能有效规避价值陷阱，即使缺失想象的空间和赛道的贝塔，也能至少赚到超额的目标收益。逆向前瞻不是单纯赚业绩增长的钱，是赚在逆向被扭正、前瞻被验证的过程中

业绩和估值双重提升的钱，这个钱的风险收益比或很高。

4.6 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验，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；基金收益分配每年至少一次，基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	98,797,816.21	82,588,376.18
结算备付金		260,104.36	323,581.91
存出保证金		144,033.59	86,970.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,124,137,830.33	1,173,440,046.33
其中：股票投资		875,898,844.59	918,292,295.32
基金投资		—	—
债券投资		248,238,985.74	255,147,751.01
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		34,742.33	36,066.34
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	2,067,179.71
资产总计		1,223,374,526.82	1,258,542,221.27

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,442,035.22	1,248,356.99
应付赎回款		662,378.62	1,461,689.12
应付管理人报酬		1,423,564.56	1,559,286.80
应付托管费		237,260.74	259,881.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		193,325.28	192,791.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	515,384.73	508,120.81
负债合计		5,473,949.15	5,230,126.53
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	957,568,623.07	917,312,051.96
未分配利润	6.4.7.8	260,331,954.60	336,000,042.78
净资产合计		1,217,900,577.67	1,253,312,094.74
负债和净资产总计		1,223,374,526.82	1,258,542,221.27

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2719 元，基金份额总额 957,568,623.07 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”项目的“本期末”余额列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-100,442,689.08	55,530,476.98

1. 利息收入		172,548.09	3,106,115.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	172,548.09	194,390.41
债券利息收入		-	2,682,826.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	228,899.05
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,936,990.58	119,104,541.74
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-50,006,954.19	106,217,287.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-1,634,205.06	4,307,538.60
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	4,704,168.67	8,579,715.31
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-53,908,161.19	-66,713,369.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	229,914.60	33,188.78
减：二、营业总支出		10,658,579.02	14,300,500.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,025,284.71	9,180,294.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,504,214.18	1,530,049.15
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		832.19	332.02
8. 其他费用	6.4.7.18	128,247.94	3,589,824.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-111,101,268.10	41,229,976.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-111,101,268.10	41,229,976.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-111,101,268.10	41,229,976.75

注：以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	917,312,051.96	-	336,000,042.78	1,253,312,094.74
二、本期期初净资产（基金净值）	917,312,051.96	-	336,000,042.78	1,253,312,094.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	40,256,571.11	-	-75,668,088.18	-35,411,517.07
（一）、综合收益总额	-	-	-111,101,268.10	-111,101,268.10
（二）、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）	40,256,571.11	-	35,433,179.92	75,689,751.03
其中：1. 基金申购款	222,830,334.12	-	64,147,172.57	286,977,506.69
2. 基金赎回款	-182,573,763.01	-	-28,713,992.65	-211,287,755.66
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	957,568,623.07	-	260,331,954.60	1,217,900,577.67
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,067,701,400.44	-	242,458,067.66	1,310,159,468.10
二、本期期初净资产（基金净值）	1,067,701,400.44	-	242,458,067.66	1,310,159,468.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-107,018,442.19	-	14,704,609.17	-92,313,833.02
（一）、综合收益总额	-	-	41,229,976.75	41,229,976.75
（二）、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）	-107,018,442.19	-	-26,525,367.58	-133,543,809.77
其中：1. 基金申购款	40,627,220.01	-	9,933,824.04	50,561,044.05
2. 基金赎回款	-147,645,662.20	-	-36,459,191.62	-184,104,853.82
（三）、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）	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	960,682,958.25	-	257,162,676.83	1,217,845,635.08
-----------------	----------------	---	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安平衡证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字〔2004〕40号《关于同意诺安平衡证券投资基金设立的批复》核准,由诺安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《诺安平衡证券投资基金基金契约》(后更名为《诺安平衡证券投资基金基金合同》)发起,并于2004年5月21日募集成立。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2,206,708,982.01份基金份额,其中认购资金利息折合247,745.96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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安平衡证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围界定为股票、存托凭证、债券以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债。现金资产包括各类银行存款。债券投资、股票和存托凭证投资的比重根据基金管理人市场的判断灵活配置,目标配置比例为:股票、存托凭证的比例为65%,债券资产的比例为30%,现金的比例为5%;原则上可能的资产配置比例为:股票、存托凭证的比例为45-75%,债券资产的比例为20-50%,现金的比例为5-10%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。于2020年8月12日前,本基金的业绩比较基准为:标普中国A股综合指数 $\times$ 65%+上证国债指数收益率 $\times$ 35%;自2020年8月12日起,本基金的业绩比较基准变更为沪深300指数收益率 $\times$ 65%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 35%。

6.4.2 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》、《诺安平衡证券投资基金基金合同》和在财

务报表附注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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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、存托凭证和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,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,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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相关交易费用确认为投资收益，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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 82,588,376.18 元、323,581.91 元、86,970.80 元、2,067,179.71 元和 36,066.34 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产—应收利息和应收申购款，金额分别为 82,595,477.46 元、323,727.51 元、87,010.00 元、0.00 元和 36,066.34 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,173,440,046.33 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,175,499,939.96 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债—其他应付款，金额分别为 1,248,356.99 元、1,461,689.12

元、1,559,286.80 元、259,881.15 元、278,881.46 元和 239.35 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,248,356.99 元、1,461,689.12 元、1,559,286.80 元、259,881.15 元、278,881.46 元和 239.35 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	98,797,816.21
等于：本金	98,789,122.79
加：应计利息	8,693.42
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—

加：应计利息	-
合计	98,797,816.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		894,455,182.37	-	875,898,844.59	-18,556,337.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	160,144,406.87	533,299.70	158,238,936.42	-2,438,770.15
	银行间市场	85,669,470.00	99,049.32	90,000,049.32	4,231,530.00
	合计	245,813,876.87	632,349.02	248,238,985.74	1,792,759.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,140,269,059.24	632,349.02	1,124,137,830.33	-16,763,577.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	841.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	396,147.06
其中：交易所市场	396,147.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,395.94
合计	515,384.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	917,312,051.96	917,312,051.96
本期申购	222,830,334.12	222,830,334.12
本期赎回（以“-”号填列）	-182,573,763.01	-182,573,763.01
本期末	957,568,623.07	957,568,623.07

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。

6.4.7.8 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	788,622,347.69	-452,622,304.91	336,000,042.78
本期利润	-57,193,106.91	-53,908,161.19	-111,101,268.10
本期基金份额交易产生的变动数	36,295,950.18	-862,770.26	35,433,179.92
其中：基金申购款	189,023,893.60	-124,876,721.03	64,147,172.57
基金赎回款	-152,727,943.42	124,013,950.77	-28,713,992.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	767,725,190.96	-507,393,236.36	260,331,954.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	148,060.12
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	5,966.66
其他	18,521.31

合计	172,548.09
----	------------

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。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	415,799,700.10
减：卖出股票成本总额	464,551,061.62
减：交易费用	1,255,592.67
买卖股票差价收入	-50,006,954.19

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益—利息收入	2,035,065.59
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-3,669,270.65
债券投资收益—赎回差价收入	-
债券投资收益—申购差价收入	-
合计	-1,634,205.06

6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	81,580,640.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,017,229.34
减：应计利息总额	230,460.65
减：交易费用	2,221.10
买卖债券差价收入	-3,669,270.65

6.4.7.12 贵金属投资收益

6.4.7.12.1 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,704,168.67
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	4,704,168.67

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-53,908,161.19
--股票投资	-34,442,922.70
--债券投资	-19,465,238.49
--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	-53,908,161.19

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	122,351.75
基金转换费收入	107,562.85
合计	229,914.60

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	252.00
账户维护费	18,900.00
合计	128,247.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,025,284.71	9,180,294.90
其中：支付销售机构的客户维护费	1,019,084.29	1,340,954.03

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,504,214.18	1,530,049.15

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中国中化集团公司	175,587,304.69	18.34%	175,587,304.69	19.14%

注：关联方投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	98,797,816.21	148,060.12	85,367,670.00	146,717.54

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

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末 2022 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022 年 01 月 06 日	6 个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022 年 03 月 25 日	6 个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022 年 03 月 15 日	6 个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 03 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301109	军信股份	2022 年 04 月 06 日	6 个月	新股锁定	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301110	青木股份	2022 年 03 月 04 日	6 个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022 年 06 月 20 日	6 个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 01 月 10 日	6 个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022 年 04 月 11 日	6 个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022 年 05 月 27 日	6 个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-

301130	西点药业	2022 年 02 月 16 日	6 个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022 年 04 月 01 日	6 个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022 年 03 月 14 日	6 个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022 年 03 月 30 日	6 个月	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022 年 05 月 10 日	6 个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 01 月 07 日	6 个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022 年 05 月 25 日	6 个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301163	宏德股份	2022 年 04 月 11 日	6 个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022 年 06 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022 年 06 月 30 日	6 个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301181	标榜股份	2022 年 02 月 11 日	6 个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 01 月 04 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 02 月 18 日	6 个月	新股锁定	76.56	51.92	760	58,185.60	39,459.20	-
301207	华兰疫苗	2022 年 02 月 10 日	6 个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
30121	联盛	2022 年	6 个月	新股锁	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-

2	化学	04 月 07 日		定							
301215	中汽股份	2022 年 02 月 28 日	6 个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	
301216	万凯新材	2022 年 03 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-	
301219	腾远钴业	2022 年 03 月 10 日	6 个月	新股锁定	96.76	87.82	374	36,187.84	32,844.68	-	
301220	亚香股份	2022 年 06 月 15 日	6 个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-	
301222	浙江恒威	2022 年 03 月 02 日	6 个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-	
301228	实朴检测	2022 年 01 月 21 日	6 个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-	
301233	盛帮股份	2022 年 06 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301233	盛帮股份	2022 年 06 月 24 日	6 个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301236	软通动力	2022 年 03 月 08 日	6 个月	新股锁定	48.59	31.38	1,287	62,531.04	40,386.06	-	
301237	和顺科技	2022 年 03 月 16 日	6 个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301238	瑞泰新材	2022 年 06 月 10 日	6 个月	新股锁定	19.18	32.07	3,248	62,296.64	104,163.36	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 06 月 22 日	1 个月内 (含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 06 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-	
301248	杰创智能	2022 年 04 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-	

		日								
301256	华融化学	2022 年 03 月 14 日	6 个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022 年 03 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022 年 04 月 18 日	6 个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022 年 03 月 22 日	6 个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301268	铭利达	2022 年 03 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301286	侨源股份	2022 年 06 月 06 日	6 个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022 年 04 月 14 日	6 个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022 年 05 月 27 日	6 个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 06 月 16 日	6 个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 04 月 14 日	6 个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688046	药康生物	2022 年 04 月 14 日	6 个月	新股锁定	22.53	26.24	12,070	271,937.10	316,716.80	-
688237	超卓航科	2022 年 06 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688238	和元生物	2022 年 03 月 15 日	6 个月	新股锁定	13.23	25.32	12,836	169,820.28	325,007.52	-
688259	创耀科技	2022 年 01 月 05 日	6 个月	新股锁定	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	-

688267	中触媒	2022 年 02 月 09 日	6 个月	新股锁定	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00	-
688320	禾川科技	2022 年 04 月 21 日	6 个月	新股锁定	23.66	46.21	6,048	143,095.68	279,478.08	-
688400	凌云光	2022 年 06 月 27 日	1 个月内 (含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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、本基金持有的流通受限股票“301219 腾远钴业”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.8 股；“301103 何氏眼科”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.3 股；“301236 软通动力”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.5 股；“301109 军信股份”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.5 股。以上流通受限股票转增股本数量与金额已包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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级风险管理架构体系。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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 12.35%(2021 年 12 月 31 日：12.81%)。

6.4.13.3 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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。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 2022 年 6 月 30 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 2022 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 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	98,797,816.21	-	-	-	-	98,797,816.21
结算备付金	260,104.36	-	-	-	-	260,104.36
存出保证金	144,033.59	-	-	-	-	144,033.59
交易性金融资产	7,846,679.73	22,847,064.52	115,276,017.80	102,269,223.69	875,898,844.59	1,124,137,830.33
应收申购款	-	-	-	-	34,742.33	34,742.33
资产总计	107,048,633.	22,847,064.	115,276,017.	102,269,223.	875,933,586.	1,223,374,526

	89	52	80	69	92	. 82
负债						
应付清算款	-	-	-	-	2, 442, 035. 22	2, 442, 035. 22
应付赎回款	-	-	-	-	662, 378. 62	662, 378. 62
应付管理人报酬	-	-	-	-	1, 423, 564. 56	1, 423, 564. 56
应付托管费	-	-	-	-	237, 260. 74	237, 260. 74
应交税费	-	-	-	-	193, 325. 28	193, 325. 28
其他负债	-	-	-	-	515, 384. 73	515, 384. 73
负债总计	-	-	-	-	5, 473, 949. 15	5, 473, 949. 15
利率敏感度缺口	107, 048, 633. 89	22, 847, 064. 52	115, 276, 017. 80	102, 269, 223. 69	870, 459, 637. 77	1, 217, 900, 577. 67
上年度末 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	82, 588, 376. 18	-	-	-	-	82, 588, 376. 18
结算备付金	323, 581. 91	-	-	-	-	323, 581. 91
存出保证金	86, 970. 80	-	-	-	-	86, 970. 80
交易性金融资产	5, 001, 000. 00	-	109, 815, 207. 80	140, 331, 543. 21	918, 292, 295. 32	1, 173, 440, 046. 33
其他资产	-	-	-	-	2, 067, 179. 71	2, 067, 179. 71
应收申购款	-	-	-	-	36, 066. 34	36, 066. 34
资产总计	87, 999, 928. 89	-	109, 815, 207. 80	140, 331, 543. 21	920, 395, 541. 37	1, 258, 542, 221. 27
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1, 248, 356. 99	1, 248, 356. 99
应付赎回款	-	-	-	-	1, 461, 689. 12	1, 461, 689. 12
应付管理人报酬	-	-	-	-	1, 559, 286. 80	1, 559, 286. 80
应付托管费	-	-	-	-	259, 881. 15	259, 881. 15
应交税费	-	-	-	-	192, 791. 66	192, 791. 66
其他负债	-	-	-	-	508, 120. 81	508, 120. 81
负债总计	-	-	-	-	5, 230, 126. 53	5, 230, 126. 53
利率敏感度缺口	87, 999, 928. 89	-	109, 815, 207. 80	140, 331, 543. 21	915, 165, 414. 84	1, 253, 312, 094. 74

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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(2022 年 06 月 30 日)	上年度末(2021 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 27 个基点	3,089,558.81	3,643,161.91
	市场利率上升 27 个基点	-3,089,558.81	-3,643,161.91

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，债券投资和股票投资的比重根据基金管理人对市场的判断灵活配置，目标配置比例为：股票、存托凭证的比例为 65%，债券资产的比例为 30%，现金的比例为 5%；原则上可能的资产配置比例为：股票、存托凭证的比例为 45-75%，债券资产的比例为 20-50%，现金的比例为 5-10%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	875,898,844.59	71.92	918,292,295.32	73.27
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	875,898,844.59	71.92	918,292,295.32	73.27

6.4.13.4.3.2 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(2022 年 06 月 30 日)	上年度末(2021 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	47,394,493.71	37,315,180.51
	业绩比较基准下降 5%	-47,394,493.71	-37,315,180.51

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,022,093,835.16	1,044,896,026.24
第二层次	98,755,698.00	128,544,020.09
第三层次	3,288,297.17	0.00
合计	1,124,137,830.33	1,173,440,046.33

6.4.14.2.2 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；本基金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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	875,898,844.59	71.60
	其中：股票	875,898,844.59	71.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	248,238,985.74	20.29
	其中：债券	248,238,985.74	20.29
	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	99,057,920.57	8.10
8	其他各项资产	178,775.92	0.01
9	合计	1,223,374,526.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	41,870,313.04	3.44
C	制造业	484,946,098.75	39.82

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,838.19	0.00
F	批发和零售业	128,518.98	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	184,626,110.04	15.16
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,965,870.31	2.21
J	金融业	32,370,830.66	2.66
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	40,944,349.51	3.36
M	科学研究和技术服务业	718,337.15	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	719,462.57	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	62,568,137.95	5.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	875,898,844.59	71.92

7.3 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	002353	杰瑞股份	2,533,661	102,106,538.30	8.38
2	601021	春秋航空	1,728,006	100,829,150.10	8.28
3	300558	贝达药业	1,379,508	83,874,086.40	6.89
4	600276	恒瑞医药	2,134,784	79,179,138.56	6.50
5	002352	顺丰控股	842,114	46,998,382.34	3.86
6	002027	分众传媒	6,049,300	40,711,789.00	3.34
7	601808	中海油服	2,860,917	39,909,792.15	3.28
8	600763	通策医疗	215,620	37,612,752.80	3.09
9	603866	桃李面包	2,262,862	37,450,366.10	3.07
10	601872	招商轮船	6,386,295	36,785,059.20	3.02
11	601318	中国平安	693,314	32,370,830.66	2.66
12	002841	视源股份	371,853	28,007,967.96	2.30
13	600872	中炬高新	801,546	27,741,507.06	2.28
14	300601	康泰生物	559,220	25,265,559.60	2.07
15	002044	美年健康	4,438,996	24,725,207.72	2.03

16	002493	荣盛石化	1,424,900	21,929,211.00	1.80
17	601058	赛轮轮胎	1,936,800	21,827,736.00	1.79
18	688161	威高骨科	427,208	20,587,153.52	1.69
19	688066	航天宏图	252,080	19,863,904.00	1.63
20	688196	卓越新能	236,141	18,182,857.00	1.49
21	688348	昱能科技	4,891	2,386,808.00	0.20
22	688327	云从科技	88,678	2,199,214.40	0.18
23	600938	中国海油	120,005	1,960,520.89	0.16
24	688052	纳芯微	4,176	1,582,536.96	0.13
25	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.12
26	688297	中无人机	23,539	1,251,804.02	0.10
27	301238	瑞泰新材	32,478	1,204,088.26	0.10
28	688281	华秦科技	4,386	1,153,518.00	0.09
29	688120	华海清科	3,918	973,231.20	0.08
30	688349	三一重能	21,941	894,095.75	0.07
31	688072	拓荆科技	5,300	822,030.00	0.07
32	688082	盛美上海	7,870	745,839.90	0.06
33	688197	首药控股	24,261	598,761.48	0.05
34	688107	安路科技	7,821	537,302.70	0.04
35	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.04
36	688728	格科微	23,033	472,406.83	0.04
37	688234	天岳先进	6,517	436,639.00	0.04
38	301236	软通动力	12,862	421,782.31	0.03
39	301200	大族数控	7,595	408,549.20	0.03
40	688279	峰岬科技	5,505	406,929.60	0.03
41	301219	腾远钴业	3,744	344,502.28	0.03
42	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.03
43	688046	药康生物	12,070	316,716.80	0.03
44	301109	军信股份	18,376	312,961.26	0.03
45	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.02
46	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
47	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.02
48	688320	禾川科技	6,048	279,478.08	0.02
49	688182	灿勤科技	18,387	270,840.51	0.02
50	688733	壹石通	3,409	250,186.51	0.02
51	688280	精进电动	21,211	248,168.70	0.02
52	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.02
53	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
54	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.02
55	301102	兆讯传媒	6,414	211,821.06	0.02
56	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.02

57	301153	中科江南	3,973	196,933.29	0.02
58	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
59	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.01
60	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.01
61	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.01
62	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.01
63	301248	杰创智能	4,716	153,047.20	0.01
64	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.01
65	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.01
66	301097	天益医疗	2,486	130,023.27	0.01
67	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.01
68	688049	炬芯科技	3,260	124,075.60	0.01
69	688225	亚信安全	5,534	124,072.28	0.01
70	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.01
71	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
72	301237	和顺科技	2,610	116,160.66	0.01
73	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.01
74	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.01
75	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.01
76	688175	高凌信息	2,851	96,477.84	0.01
77	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
78	000423	东阿阿胶	2,506	92,596.70	0.01
79	688737	中自科技	2,186	90,347.38	0.01
80	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.01
81	301155	海力风电	954	86,814.00	0.01
82	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.01
83	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.01
84	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.01
85	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.01
86	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.01
87	688171	纬德信息	2,821	66,152.45	0.01
88	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
89	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
90	301035	润丰股份	644	53,097.80	0.00
91	301050	雷电微力	420	42,655.20	0.00
92	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.00
93	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
94	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
95	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
96	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
97	301090	华润材料	2,764	30,155.24	0.00

98	301099	雅创电子	351	29,301.48	0.00
99	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
100	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.00
101	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.00
102	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
103	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
104	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
105	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
106	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
106	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
108	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
109	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
110	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.00
111	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
112	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
113	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
114	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.00
115	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
116	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.00
117	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
118	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
119	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
120	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
121	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
122	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
123	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
124	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
125	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
126	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
127	301180	万祥科技	654	13,701.30	0.00
128	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
129	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00
130	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
131	301088	戎美股份	704	13,136.64	0.00
132	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
133	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
134	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
135	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
136	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
137	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
138	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00

139	301078	孩 子 王	756	11,082.96	0.00
140	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
141	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
142	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
143	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
144	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
145	301092	争光股份	323	10,161.58	0.00
146	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
147	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
148	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
149	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
150	001234	泰 慕 士	333	9,017.64	0.00
151	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
152	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
153	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
154	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
155	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
156	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
157	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
158	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
159	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
160	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
161	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
162	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
163	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
164	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
165	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
166	301066	万 事 利	482	6,873.32	0.00
167	301055	张 小 泉	355	6,311.90	0.00
168	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
169	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
170	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
171	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
172	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
173	301059	金 三 江	259	4,351.20	0.00
174	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
175	301041	金 百 泽	215	4,237.65	0.00
176	301037	保 立 佳	193	4,215.12	0.00
177	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
178	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
179	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300558	贝达药业	73,718,794.32	5.88
2	600276	恒瑞医药	71,448,767.15	5.70
3	603866	桃李面包	37,651,193.44	3.00
4	002353	杰瑞股份	29,253,262.00	2.33
5	002841	视源股份	27,876,979.27	2.22
6	600763	通策医疗	27,335,221.65	2.18
7	688262	国芯科技	26,911,143.56	2.15
8	002493	荣盛石化	23,416,133.50	1.87
9	300601	康泰生物	23,407,663.08	1.87
10	600872	中炬高新	23,050,911.49	1.84
11	300837	浙矿股份	19,931,307.60	1.59
12	300014	亿纬锂能	13,499,223.00	1.08
13	002044	美年健康	11,094,671.00	0.89
14	688161	威高骨科	10,390,141.48	0.83
15	002236	大华股份	6,598,695.00	0.53
16	300394	天孚通信	4,028,678.00	0.32
17	002352	顺丰控股	3,780,122.00	0.30
18	688327	云从科技	1,362,980.86	0.11
19	600938	中国海油	1,296,054.00	0.10
20	688197	首药控股	968,013.90	0.08

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。

7.4.2 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	002353	杰瑞股份	38,038,459.00	3.04
2	002236	大华股份	35,789,075.00	2.86
3	600989	宝丰能源	35,618,133.56	2.84
4	002557	洽洽食品	32,000,810.29	2.55
5	601872	招商轮船	30,005,284.60	2.39
6	002221	东华能源	25,605,943.60	2.04
7	300837	浙矿股份	24,315,700.85	1.94
8	601808	中海油服	24,106,573.20	1.92
9	000423	东阿阿胶	21,961,681.00	1.75
10	300558	贝达药业	21,343,759.40	1.70
11	002508	老板电器	20,773,248.36	1.66

12	300394	天孚通信	20,421,629.90	1.63
13	688262	国芯科技	18,349,029.06	1.46
14	601021	春秋航空	16,074,128.00	1.28
15	002415	海康威视	11,966,146.00	0.95
16	002690	美亚光电	11,562,680.00	0.92
17	300014	亿纬锂能	10,990,032.00	0.88
18	688063	派能科技	9,649,964.43	0.77
19	688223	晶科能源	1,347,329.37	0.11
20	688499	利元亨	532,954.00	0.04

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。

7.4.3 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	456,600,533.59
卖出股票收入（成交）总额	415,799,700.10

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,846,679.73	0.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,000,049.32	7.39
	其中：政策性金融债	90,000,049.32	7.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	150,392,256.69	12.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	248,238,985.74	20.38

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200210	20 国开 10	900,000	90,000,049.32	7.39
2	113044	大秦转债	228,690	24,940,492.82	2.05
3	113011	光大转债	214,860	22,847,064.52	1.88
4	113042	上银转债	216,210	22,718,327.95	1.87
5	110053	苏银转债	167,200	21,063,768.96	1.73

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	144,033.59
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	34,742.33

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	178,775.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	24,940,492.82	2.05
2	113011	光大转债	22,847,064.52	1.88
3	113042	上银转债	22,718,327.95	1.87
4	110053	苏银转债	21,063,768.96	1.73
5	128109	楚江转债	17,690,049.64	1.45
6	123025	精测转债	14,096,389.29	1.16
7	127045	牧原转债	12,269,174.37	1.01
8	123099	普利转债	7,394,359.49	0.61
9	123064	万孚转债	7,372,629.65	0.61

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
45,823	20,897.12	286,770,053.13	29.95%	670,798,569.94	70.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

8.3 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	0

研究部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 05 月 21 日）基金份额总额	2,206,708,982.01
本报告期期初基金份额总额	917,312,051.96
本报告期基金总申购份额	222,830,334.12
减：本报告期基金总赎回份额	182,573,763.01
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	957,568,623.07

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，王学明先生担任公司董事、赵忆波先生不再担任公司董事，于东升先生不再担任公司副总经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 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。

10.6 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，因未按期完成境外子公司股权架构简化工作，中国证监会责令公司改正，公司将继续加紧推进。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
渤海证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
华安证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	108,163,571.88	12.74%	100,734.68	14.36%	—
中泰证券	1	407,130,578.23	47.94%	289,968.98	41.33%	—
中信建投	1	333,898,457.53	39.32%	310,960.64	44.32%	—
中信证券	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，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 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
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	4,712,566.06	2.64%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	47,739,781.99	26.73%	-	-	-	-	-	-
中信建投	126,148,063.20	70.63%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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公司旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年01月01日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加普益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》、《证券日报》	2022年01月21日
3	诺安平衡证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022年01月24日
4	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年01月24日

		《证券日报》	
5	诺安基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022年01月31日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业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》	2022年02月10日
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通定投、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》	2022年03月15日
8	诺安基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	《上海证券报》	2022年03月18日
9	诺安基金管理有限公司关于开通平安银行借记卡直销网上交易业务并开展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》	2022年03月22日
10	诺安平衡证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022年03月31日
11	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年03月31日
12	诺安基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月01日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海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》	2022年04月08日
14	诺安基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月14日
15	诺安平衡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》	2022年04月21日
16	诺安平衡证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2022年04月21日
17	诺安平衡证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第 1 期	基金管理人网站	2022年04月21日
18	诺安平衡证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022年04月22日
19	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2022年04月22日
20	诺安基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月29日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为代销机构并开通定投、	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2022年06月15日

	转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券日报》	
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆享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》、《证券日报》	2022年06月15日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部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》	2022年06月17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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。							

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安平衡证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安平衡证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安平衡证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤报告期内诺安平衡证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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 08 月 31 日