

诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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：渤海银行股份有限公司

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。

基金托管人渤海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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 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遵规守信情况的说明	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	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遵规守信情况声明	13
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	13
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	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	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46

7.12	投资组合报告附注 .....	46
§ 8	基金份额持有人信息 .....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
§ 9	开放式基金份额变动 .....	47
§ 10	重大事件揭示 .....	48
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§ 12	备查文件目录 .....	52
12.1	备查文件目录 .....	52
12.2	存放地点 .....	52
12.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安优选回报混合
基金主代码	001743
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 09 月 22 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	393,241,330.51 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金通过积极配置大类资产,动态控制组合风险,并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角,综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险,并据此进行大类资产的配置与组合构建,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类金融风险收益特征的相对变化,适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资分析</p> <p>本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>4、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中,将采用积极主动的投资策略,结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种,在兼顾收益的同时,有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上,本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素,对个券进行积极的管理。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p>

	<p>本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、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	渤海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	郭晓磊
	联系电话	0755-83026688	022-58314934
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	xl.guo@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	400888811/95541
传真		0755-83026677	022-58314791
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	天津市河东区海河东路 218 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	天津市河东区海河东路 218 号
邮政编码		518048	300012
法定代表人		李强	李伏安

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	-42,008,975.56
本期利润	-47,871,039.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1307
本期加权平均净值利润率	-8.14%
本期基金份额净值增长率	-9.98%
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	46,304,017.86
期末可供分配基金份额利润	0.1177
期末基金资产净值	652,767,565.21
期末基金份额净值	1.660
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	106.81%

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

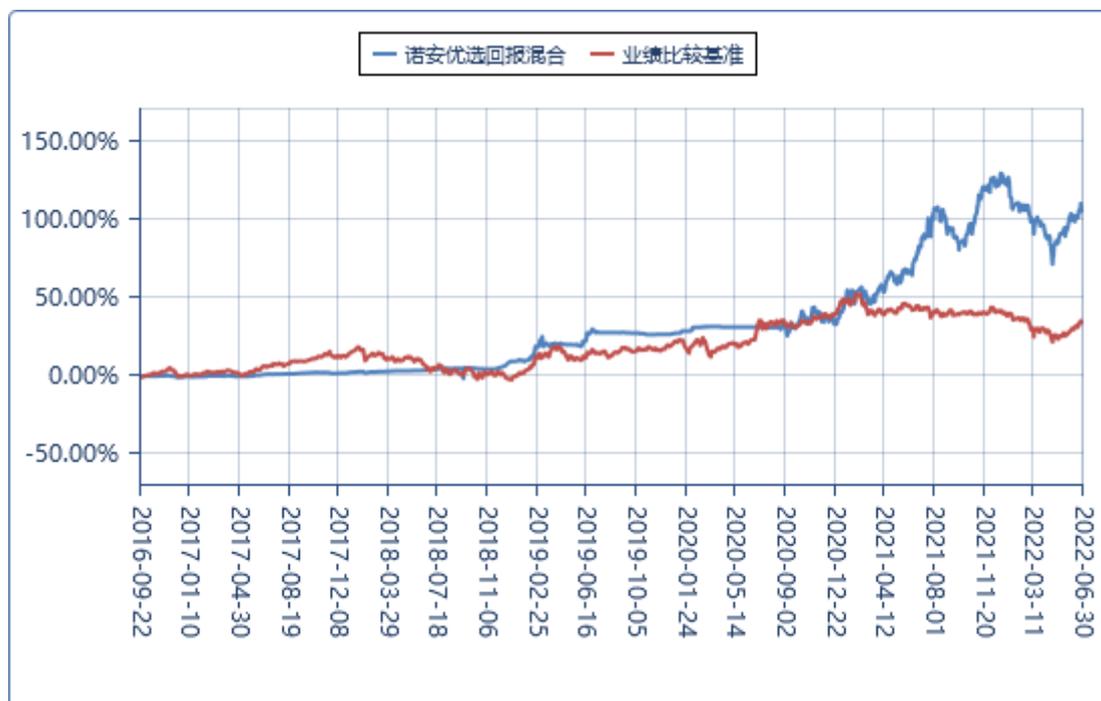
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.93%	1.14%	5.69%	0.64%	-0.76%	0.50%
过去三个月	4.86%	1.46%	4.30%	0.86%	0.56%	0.60%
过去六个月	-9.98%	1.37%	-4.64%	0.87%	-5.34%	0.50%
过去一年	13.54%	1.35%	-6.44%	0.75%	19.98%	0.60%
过去三年	61.32%	1.04%	17.65%	0.76%	43.67%	0.28%
自基金合同生	106.81%	0.82%	35.34%	0.72%	71.47%	0.10%

效起至今					
------	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×40%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



## § 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		
张堃	本基金基金经理	2020年09月 26日	-	15年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于国泰君安证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司，从事策略研究分析工作。2014年5月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2015年8月至2020年4月任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年4月起任诺安先锋混合型证券投资基金基金经理，2020年9月起任诺安优选

					回报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

考虑到经济仍处于减速之中，且可能仍会持续几个季度，我们二季度保持了一个偏谨慎的仓位，并坚持了我们选择成长股的几个原则。我们的组合主要靠企业业绩增长来获得超额收益，这个超额收益在上涨的市场中体现为收益的加成，在下跌的市场中，对抗市场估值的下降。上半年在疫情影响下，大部分企业受物流影响，小部分企业同时受到原材料价格上涨的影响，整体而言，业绩增长受到影响，因此在上半年市场下跌的过程中，基金相对于指数，超额收益不明显。

好的一方面是，疫情背景下，投资者得以识别出成长能力更确定的企业。即使宏观数据、行业需求并不乐观，结构性的、自下而上的成长机会依然存在，只是比较稀缺。

实际上，从新冠疫情发生之前开始，中国内地多数行业，一些发展趋势至今并未改变，甚至继续强化。比如，各个行业的数字化、智能化的趋势，半导体等高端制造业的自主可控趋势，工程师红利逐步兑现趋势，产业链更加健全、产品附加值更高的趋势等等。这些趋势一直都是我们研究和投资的切入点。

我们相信，那些善于用人工智能、物联网技术，赋能改进公司业务的企业，那些新材料、新应用的创新型企业，得以在困难的环境中继续成长。这类企业正在逐步积累长期竞争优势，成为我们投资的目标。

#### 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 1.660 元，本报告期内基金份额净值增长率为-9.98%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债务化是目前全球经济的重要特征。它造成不同市场价格出现周期性快速波动、切换；而地缘政治也带来更多的不确定因素。

展望未来，我们一如既往相信“专精特新”成长型企业的企业家，更能够整合企业内部、外部

资源，在变化中及时把握机会，填补空档，提升行业地位。

就本基金运作而言，我们喜欢在各个领域有独特竞争优势的企业，我们的投资组合也尽量分散在经济不同的领域，我们相信我们投资的企业在各自领域都能体现出经营上的阿尔法，能对抗经济中出现的各种不确定性。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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。

#### 4.8 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，渤海银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本基金托管人对 2022 年中期报告中财务指标、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金  
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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	169,673,807.91	21,053,456.16
结算备付金		770,212.79	627,987.56
存出保证金		967,133.53	181,894.38
交易性金融资产	6.4.7.2	480,151,549.16	331,151,888.36
其中：股票投资		480,151,549.16	331,151,888.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	20,000,000.00	-

应收清算款		4,036,161.64	5,444,679.20
应收股利		-	-
应收申购款		1,893,165.83	20,139,772.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	6,080.98
资产总计		677,492,030.86	378,605,759.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		18,623,507.37	12,868,761.42
应付赎回款		4,804,443.75	2,114,403.78
应付管理人报酬		650,115.81	245,343.77
应付托管费		54,176.32	20,445.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	592,222.40	488,697.44
负债合计		24,724,465.65	15,737,651.74
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	393,241,330.51	196,788,538.73
未分配利润	6.4.7.8	259,526,234.70	166,079,568.84
净资产合计		652,767,565.21	362,868,107.57
负债和净资产总计		677,492,030.86	378,605,759.31

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.660 元，基金份额总额 393,241,330.51 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：诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-44,009,321.30	4,477,651.34
1. 利息收入		746,055.38	9,567.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	746,055.38	6,210.35
债券利息收入		-	3,356.87
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）		-39,941,423.80	774,385.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-43,691,986.19	497,348.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	166,110.39
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	3,750,562.39	110,926.00
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	-5,862,064.15	3,611,958.86
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	1,048,111.27	81,740.10
<b>减：二、营业总支出</b>		3,861,718.41	197,998.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,478,555.05	87,858.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	289,879.60	7,321.58
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		-	12.06
8. 其他费用	6.4.7.18	93,283.76	102,806.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-47,871,039.71	4,279,652.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-47,871,039.71	4,279,652.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-47,871,039.71	4,279,652.60

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：诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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）	196,788,538.73	-	166,079,568.84	362,868,107.57
二、本期期初净资产（基金净值）	196,788,538.73	-	166,079,568.84	362,868,107.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	196,452,791.78	-	93,446,665.86	289,899,457.64
（一）、综合收益总额	-	-	-47,871,039.71	-47,871,039.71
（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）	196,452,791.78	-	141,317,705.57	337,770,497.35
其中：1. 基金申购款	383,377,402.55	-	256,757,955.87	640,135,358.42
2. 基金赎回款	-186,924,610.77	-	-115,440,250.30	-302,364,861.07
（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）	393,241,330.51	-	259,526,234.70	652,767,565.21
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）	7,901,984.26	-	767,927.60	8,669,911.86
二、本期期初净资产（基金净值）	7,901,984.26	-	767,927.60	8,669,911.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,826,548.55	-	6,041,762.43	12,868,310.98
（一）、综合收益总额	-	-	4,279,652.60	4,279,652.60
（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）	6,826,548.55	-	1,762,109.83	8,588,658.38

其中：1. 基金申购款	21,525,195.75	-	5,974,230.75	27,499,426.50
2. 基金赎回款	-14,698,647.20	-	-4,212,120.92	-18,910,768.12
(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）	14,728,532.81	-	6,809,690.03	21,538,222.84

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

诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金（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”）《关于准予诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可（2015）1743号）及《关于诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函（2016）642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《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年9月22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1,034,170,048.07份基金份额，其中认购资金利息折合45,475.45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，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安优选回报灵活配置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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、公司债 / 企业债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金为混合型基金，股票、存托凭证资产占基金资产的比例为0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

## 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 3 号《半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。

## 6.4.3 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 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

除下文变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 6.4.4.1 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）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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和金融负债，以及不作为有效套期工

具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额 计入公允价值变动损益。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及在适用情况下的相关税费 后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

### 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

##### 新金融工具准则

根据《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》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不

予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。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。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,053,456.16 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,716.48 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,059,172.64 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 627,987.56 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 282.60 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 628,270.16 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 181,894.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 81.90 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 181,976.28 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,080.98 元，转出

至银行存款的重分类金额为人民币 5,716.48 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 282.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 81.90 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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。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。

#### 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	169,673,807.91
等于：本金	169,627,745.30
加：应计利息	46,062.61
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	169,673,807.91

##### 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	462,229,987.35	-	480,151,549.16	17,921,561.81
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	462,229,987.35	-	480,151,549.16	17,921,561.81

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

#### 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	2,765.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	505,773.41
其中：交易所市场	505,773.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,683.76
合计	592,222.40

#### 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	196,788,538.73	196,788,538.73
本期申购	383,377,402.55	383,377,402.55
本期赎回（以“-”号填列）	-186,924,610.77	-186,924,610.77
本期末	393,241,330.51	393,241,330.51

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	45,065,206.17	121,014,362.67	166,079,568.84
本期利润	-42,008,975.56	-5,862,064.15	-47,871,039.71
本期基金份额交易产生的变动数	43,247,787.25	98,069,918.32	141,317,705.57
其中：基金申购款	73,811,963.16	182,945,992.71	256,757,955.87
基金赎回款	-30,564,175.91	-84,876,074.39	-115,440,250.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,304,017.86	213,222,216.84	259,526,234.70

#### 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	706,074.11
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	9,803.84	
其他	30,177.43	
合计	746,055.38	

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	646,886,272.04
减：卖出股票成本总额	688,466,299.90
减：交易费用	2,111,958.33
买卖股票差价收入	-43,691,986.19

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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	3,750,562.39
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	3,750,562.39

#### 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	-5,862,064.15
—股票投资	-5,862,064.15

—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	-5,862,064.15

#### 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	1,015,123.92
基金转换费收入	32,987.35
合计	1,048,111.27

#### 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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,900.00
合计	93,283.76

#### 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
渤海银行股份有限公司	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	3,478,555.05	87,858.99
其中：支付销售机构的客户维护费	736,013.84	26,574.08

注：本基金的管理费率为年费率 1.20%。

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：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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	289,879.60	7,321.58

注：本基金的托管费率为年费率 0.10%。

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

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。

#### 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
渤海银行股份有限公司	169,673,807.91	706,074.11	1,974,454.45	5,187.43

注：本基金的银行存款由基金托管人渤海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内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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
002921	联诚精密	2022年03月21日	6个月	非公开发行锁定	16.55	13.80	343,060	5,677,643.00	4,734,228.00	-
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	204	11,336.28	6,126.12	-
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	491	19,581.08	15,265.19	-
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	-
30110	军信	2022年	6个月	新股锁	23.20	16.14	1,361	31,572.67	21,966.54	-

9	股份	04 月 06 日		定							
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	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	82	5,254.56	3,076.64	-
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	320	24,499.20	16,614.40	-
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	301	17,120.88	16,982.42	-
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
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	560	19,980.80	16,710.40	-
301219	腾远钴业	2022年03月10日	6个月	新股锁定	96.90	87.82	158	15,310.24	13,875.56	-
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	48.54	31.38	551	26,746.96	17,290.38	-
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	2,011	38,570.98	64,492.77	-
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	-
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	-
30130	华如	2022年	6个月	新股锁	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-

2	科技	06月16日		定							
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	-	
688072	拓荆科技	2022年04月12日	6个月	新股锁定	71.88	139.78	3,233	232,388.04	451,908.74	-	
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	-	
688400	凌云光	2022年06月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	11,347	248,839.71	248,839.71	-	

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。

### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，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公司的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2021 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.3 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 market 出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2022 年 06 月 30 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。

#### 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 06 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 2022 年 06 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、应收申购款和买入返售金融资产等。

##### 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	169,673,807.91	-	-	-	-	169,673,807.91
结算备付金	770,212.79	-	-	-	-	770,212.79
存出保证金	967,133.53	-	-	-	-	967,133.53
交易性金融资产	-	-	-	-	480,151,549.16	480,151,549.16
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	20,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	4,036,161.64	4,036,161.64
应收申购款	1,392,635.85	-	-	-	500,529.98	1,893,165.83
资产总计	192,803,790.08	-	-	-	484,688,240.78	677,492,030.86
负债						
应付清算款	-	-	-	-	18,623,507.37	18,623,507.37

应付赎回款	-	-	-	-	4,804,443.75	4,804,443.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	650,115.81	650,115.81
应付托管费	-	-	-	-	54,176.32	54,176.32
其他负债	-	-	-	-	592,222.40	592,222.40
负债总计	-	-	-	-	24,724,465.65	24,724,465.65
利率敏感度缺口	192,803,790.08	-	-	-	-459,963,775.13	652,767,565.21
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	21,053,456.16	-	-	-	-	21,053,456.16
结算备付金	627,987.56	-	-	-	-	627,987.56
存出保证金	181,894.38	-	-	-	-	181,894.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-331,151,888.36	331,151,888.36
应收清算款	-	-	-	-	5,444,679.20	5,444,679.20
其他资产	-	-	-	-	6,080.98	6,080.98
应收申购款	37,239.88	-	-	-	20,102,532.79	20,139,772.67
资产总计	21,900,577.98	-	-	-	-356,705,181.33	378,605,759.31
负债						
应付清算款	-	-	-	-	12,868,761.42	12,868,761.42
应付赎回款	-	-	-	-	2,114,403.78	2,114,403.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	245,343.77	245,343.77
应付托管费	-	-	-	-	20,445.33	20,445.33
其他负债	-	-	-	-	488,697.44	488,697.44
负债总计	-	-	-	-	15,737,651.74	15,737,651.74
利率敏感度缺口	21,900,577.98	-	-	-	-340,967,529.59	362,868,107.57

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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。本基金持有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，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。

#### 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	480,151,549.16	73.56	331,151,888.36	91.26
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	480,151,549.16	73.56	331,151,888.36	91.26

#### 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%		24,866,847.53
业绩比较基准下降 5%		-24,866,847.53	-9,434,998.12

#### 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	471,806,361.33	330,951,515.33
第二层次	870,284.43	200,373.03
第三层次	7,474,903.40	-
合计	480,151,549.16	331,151,888.36

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 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均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，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	480,151,549.16	70.87
	其中：股票	480,151,549.16	70.87
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	20,000,000.00	2.95
	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	170,444,020.70	25.16
8	其他各项资产	6,896,461.00	1.02
9	合计	677,492,030.86	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	10,202,087.44	1.56
C	制造业	381,244,853.34	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,081,803.60	3.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,729,268.96	9.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,265.19	0.00
M	科学研究和技术服务业	362,902.11	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	284,346.67	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	480,151,549.16	73.56

## 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	603181	皇马科技	3,169,202	47,823,258.18	7.33
2	688377	迪威尔	1,502,501	46,502,405.95	7.12
3	300007	汉威科技	2,215,800	39,862,242.00	6.11
4	688290	景业智能	696,585	35,456,176.50	5.43
5	688262	国芯科技	692,671	33,719,224.28	5.17
6	600206	有研新材	1,683,900	32,566,626.00	4.99
7	603112	华翔股份	1,869,200	27,869,772.00	4.27
8	002250	联化科技	1,648,864	26,991,903.68	4.13
9	002930	宏川智慧	1,268,680	25,081,803.60	3.84
10	688698	伟创电气	1,219,587	24,818,595.45	3.80
11	300286	安科瑞	829,400	22,518,210.00	3.45
12	300515	三德科技	1,940,349	19,791,559.80	3.03
13	300996	普联软件	600,000	17,730,000.00	2.72
14	688258	卓易信息	325,694	11,190,845.84	1.71
15	688355	明志科技	479,497	10,266,030.77	1.57
16	300909	汇创达	359,363	9,239,222.73	1.42
17	603619	中曼石油	431,200	8,869,784.00	1.36
18	300725	药石科技	87,584	8,669,940.16	1.33
19	603639	海利尔	374,300	7,804,155.00	1.20
20	605060	联德股份	356,400	6,468,660.00	0.99
21	002921	联诚精密	445,856	6,219,630.20	0.95
22	688628	优利德	174,377	5,124,940.03	0.79
23	688737	中自科技	45,644	1,886,466.52	0.29
24	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.20
25	688072	拓荆科技	3,233	451,908.74	0.07
26	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.05
27	688400	凌云光	11,347	248,839.71	0.04
28	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.04
29	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
30	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
31	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
32	301238	瑞泰新材	2,011	64,492.77	0.01
33	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
34	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
35	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
36	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
37	301109	军信股份	1,361	21,966.54	0.00
38	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00

39	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
40	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
41	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
42	301236	软通动力	551	17,290.38	0.00
43	301207	华兰疫苗	301	16,982.42	0.00
44	301216	万凯新材	560	16,710.40	0.00
45	301200	大族数控	320	16,614.40	0.00
46	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
47	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
48	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
49	301102	兆讯传媒	491	15,265.19	0.00
50	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
51	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
52	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
53	301219	腾远钴业	158	13,875.56	0.00
54	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
55	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
56	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
57	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
58	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
59	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
60	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
61	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
62	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
63	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
64	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
65	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
66	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
67	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
68	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
69	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
70	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
71	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
72	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
73	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
74	301127	天源环保	631	7,023.03	0.00
75	300834	星辉环材	204	6,126.12	0.00
76	301221	光庭信息	92	5,964.36	0.00
77	301182	凯旺科技	193	4,585.68	0.00
78	301100	风光股份	158	3,409.64	0.00
79	301196	唯科科技	82	3,076.64	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	002915	中欣氟材	46,445,100.48	12.80
2	002921	联诚精密	45,334,763.44	12.49
3	688262	国芯科技	42,938,810.55	11.83
4	300007	汉威科技	41,226,568.00	11.36
5	600206	有研新材	37,127,410.33	10.23
6	300590	移为通信	35,683,889.98	9.83
7	603181	皇马科技	33,285,983.41	9.17
8	688355	明志科技	30,433,176.69	8.39
9	688290	景业智能	29,408,100.32	8.10
10	603112	华翔股份	26,787,973.00	7.38
11	002250	联化科技	24,661,789.70	6.80
12	300218	安利股份	22,984,752.00	6.33
13	688169	石头科技	22,762,507.51	6.27
14	688025	杰普特	22,467,554.96	6.19
15	688698	伟创电气	21,385,484.01	5.89
16	688377	迪威尔	21,030,336.09	5.80
17	300286	安科瑞	20,848,565.08	5.75
18	300909	汇创达	20,785,679.55	5.73
19	002930	宏川智慧	17,187,258.80	4.74
20	300996	普联软件	16,829,016.32	4.64
21	300657	弘信电子	14,077,370.97	3.88
22	600522	中天科技	13,998,829.82	3.86
23	002236	大华股份	12,595,142.60	3.47
24	605060	联德股份	12,531,767.16	3.45
25	688128	中国电研	12,244,116.98	3.37
26	001205	盛航股份	11,891,462.00	3.28
27	603639	海利尔	11,435,531.63	3.15
28	688258	卓易信息	11,323,309.92	3.12
29	601058	赛轮轮胎	10,963,536.00	3.02
30	688737	中自科技	9,912,533.78	2.73
31	300725	药石科技	8,747,491.86	2.41
32	300515	三德科技	8,723,299.79	2.40
33	603619	中曼石油	8,394,871.00	2.31
34	605183	确成股份	8,150,572.00	2.25
35	300430	诚益通	7,994,270.00	2.20
36	600645	中源协和	7,375,862.00	2.03

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	002915	中欣氟材	59,277,715.80	16.34
2	300590	移为通信	41,137,479.80	11.34
3	002921	联诚精密	31,296,680.20	8.62
4	688025	杰普特	31,161,614.90	8.59
5	300218	安利股份	30,185,483.00	8.32
6	002236	大华股份	28,000,296.48	7.72
7	688169	石头科技	22,063,185.05	6.08
8	601058	赛轮轮胎	21,979,667.64	6.06
9	002008	大族激光	20,461,826.25	5.64
10	688377	迪威尔	20,322,292.21	5.60
11	688355	明志科技	18,633,607.83	5.14
12	002415	海康威视	18,145,256.04	5.00
13	300007	汉威科技	17,693,502.00	4.88
14	600522	中天科技	14,461,260.22	3.99
15	300909	汇创达	14,200,778.49	3.91
16	688737	中自科技	12,312,677.18	3.39
17	688262	国芯科技	12,197,093.92	3.36
18	001205	盛航股份	12,183,289.40	3.36
19	300657	弘信电子	11,934,201.34	3.29
20	002559	亚威股份	11,840,612.50	3.26
21	688128	中国电研	10,959,204.60	3.02
22	603639	海利尔	9,691,045.11	2.67
23	603936	博敏电子	9,290,200.72	2.56
24	600273	嘉化能源	8,192,477.00	2.26
25	300430	诚益通	7,316,610.00	2.02

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	843,328,024.85
卖出股票收入(成交)总额	646,886,272.04

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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	967,133.53
2	应收清算款	4,036,161.64

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,893,165.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,896,461.00

#### 7.12.4 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。

#### 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
20,742	18,958.70	264,229,001.05	67.19%	129,012,329.46	32.81%

#### 8.2 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	10,608,009.35	2.6976%

#### 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 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 09 月 22 日）基金份额总额	1,034,170,048.07
本报告期期初基金份额总额	196,788,538.73
本报告期基金总申购份额	383,377,402.55
减：本报告期基金总赎回份额	186,924,610.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	393,241,330.51

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。

本报告期内，本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	
首创证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
浙商证券	2	282,879,182.58	19.28%	204,032.77	15.75%	本报告期新增
中金财富	2	1,184,691,961.22	80.72%	1,091,551.73	84.25%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 3 个交易单元：首创证券股份有限公司（1 个交易单元）、浙商证券股份有限公司（2 个交易单元）。

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

浙商证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金 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
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诺安优选回报混合增加广发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	《上海证券报》	2022年02月28日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加度小满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》	2022年03月04日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加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》	2022年03月10日
10	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
11	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
12	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
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资联诚精密非公开发行的公告	《上海证券报》	2022年03月23日

14	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022年03月31日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022年04月22日
20	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
21	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
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城国瑞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》	2022年05月25日
23	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、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
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆亨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
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金财富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24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优选回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件。
- ② 《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③ 《诺安优选回报灵活配置混合型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 报告期内诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

### 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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2022 年 08 月 31 日

