

# 诺安行业轮动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：招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。

基金托管人招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	6
2.4	信息披露方式	7
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合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12	投资组合报告附注 .....	47
§ 8	基金份额持有人信息 .....	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
§ 9	开放式基金份额变动 .....	49
§ 10	重大事件揭示 .....	49
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4	基金投资策略的改变 .....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8	其他重大事件 .....	51
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
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 .....	53
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
§ 12	备查文件目录 .....	53
12.1	备查文件目录 .....	53
12.2	存放地点 .....	54
12.3	查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	诺安行业轮动混合
基金主代码	320015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 06 月 23 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	68,912,843.92 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2017 年 6 月 23 日起，原“诺安保本混合型证券投资基金”转型为“诺安行业轮动混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化资产配置，力争获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	<p>诺安行业轮动混合型证券投资基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，有效实施大类资产配置策略，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>具体而言，基金的投资策略包括大类资产配置策略、行业投资策略、个股精选策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略七个方面。</p> <p>（1）大类资产配置策略</p> <p>本基金从宏观层面的经济基本面与流动性水平出发，研判市场当前所处阶段，调整基金所持有的主要资产种类即股票类资产、债券类资产比例，实施资产配置策略。</p> <p>本基金采用定性分析和定量分析相结合的手段，对宏观经济整体景气情况、政策环境、行业表现以及证券市场走势等因素进行综合分析后研判当前宏观经济所处周期阶段，来预测市场未来整体的趋势性表现，从而为基金的大类资产配置提供决策依据，在不同情况下构建较好的资产配置结构。</p> <p>（2）行业投资策略</p> <p>诺安行业轮动混合型证券投资基金在股票投资的战术层面采用行业组合投资策略，即以宏观分析为基础、通过对行业景气情况、市场环境、上下游环境以及市场偏好等对行业盈利及估值水平有重大影响的因素加以分析，挖掘在行业轮动效应下的行业投资机会。增加景气上升的强势行业配置，减少弱势行业的配置。</p>

	<p>具体实施时，基金在宏观经济的各个阶段投资不同行业类型的股票。</p> <p>基金将超配评价较高的重点行业，轻配或者不配置预期表现较差的行业，以期收获行业轮动效应下带来的丰厚收益。</p> <p>（3）个股精选策略</p> <p>在明确大类资产配置以及拟配置的重点行业后，诺安行业轮动混合型证券投资基金将按照最大范围覆盖原则选出重点行业的相应股票群，构成备选股票库。在此基础上，基金将综合考虑个股主营业务与重点行业间的关联度以及股票本身的投资价值，精选股票，并根据定量以及定性分析的结果，赋予备选个股以不同的投资价值权重。</p> <p>（4）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>（5）债券投资策略</p> <p>诺安行业轮动混合型证券投资基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线策略、溢价分析策略以及个券选择策略。</p> <p>（6）权证投资策略</p> <p>诺安行业轮动混合型证券投资基金在权证投资方面主要运用的策略包括：价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，基金会结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p> <p>（7）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	混合型基金，一般情况下其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	张燕
	联系电话	0755-83026688	0755-83199084
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95555
传真		0755-83026677	0755-83195201
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行	深圳市深南大道 7088 号招商银

	大厦 19-20 层	行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	李强	缪建民

## 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	-13,363,553.60
本期利润	-28,228,826.24
加权平均基金份额本期利润	-0.4023
本期加权平均净值利润率	-21.21%
本期基金份额净值增长率	-17.63%
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	82,294,295.48
期末可供分配基金份额利润	1.1942
期末基金资产净值	127,389,865.14
期末基金份额净值	1.8486
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	84.86%

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。

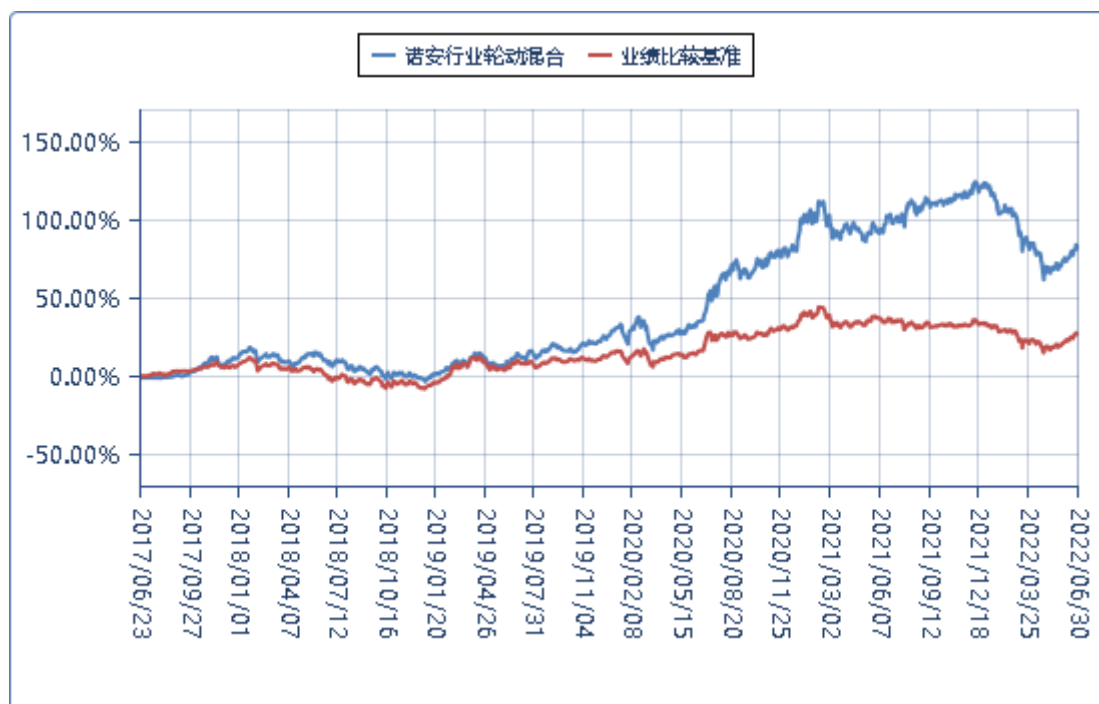
### 3.2 基金净值表现

### 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	6.47%	0.87%	5.69%	0.64%	0.78%	0.23%
过去三个月	0.14%	1.29%	4.30%	0.86%	-4.16%	0.43%
过去六个月	-17.63%	1.27%	-4.64%	0.87%	-12.99%	0.40%
过去一年	-9.52%	1.09%	-6.44%	0.75%	-3.08%	0.34%
过去三年	62.71%	1.17%	17.65%	0.76%	45.06%	0.41%
自基金合同生效起至今	84.86%	1.05%	28.80%	0.76%	56.06%	0.29%

注：2017年06月23日（含当日）起，原“诺安保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中证全债指数收益率。

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



注：2017年06月23日（含当日）起，原“诺安保本混合型证券投资基金”转型为本基金。

## § 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		
韩冬燕	本基金基金经理	2017 年 06 月 23 日	-	18 年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于华夏基金管理有限公司，先后从

				<p>事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司,从事行业研究工作,现任公司总经理助理、权益投资事业部总经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理,2019年4月起任诺安恒鑫混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券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

今年在错综复杂的内外部环境下，开年以来 A 股经历了 4 个月的持续下跌，上证综指从年初的 3652 点持续下滑至 4 月 27 日最低的 2863 点，最大跌幅 22%，随后开始修复上涨。年初以来 A 股的急跌从表面因素上来看源于美联储加息升温、俄乌冲突、国内疫情反弹等多个因素共振，但背后核心逻辑还是在于经济周期进入了需求下降、供给冲击和预期转弱叠加的弱势阶段。从市场阶段上来看，市场在经历 2019 年到 2021 年连续 3 年的较好表现后，结构性过高的估值也有阶段性调整的内需。

从市场的阶段来看，阶段性调整已经比较明显，沪深 300 从 2021 年 2 月开始下跌到 2022 年 4 月调整超过 14 个月，最大跌幅达 37%，创业板指数也出现了明显调整，对比历史这轮调整时空已经显著，结构性高估值也得到很大程度下修。从 4 月底以来的市场表现来看，4 月到 5 月，大部分投资人信心依然脆弱，盈利依然下行，但市场不再趋势下跌，6 月以来，海外衰退和紧缩预期升温、美股下跌、美债利率上行，均未对 A 股产生过多负面影响，A 股市场表现出独立于美国的上扬行情。6 月以来北向资金打破边际平衡转向大幅净流入，在本轮市场上涨中提供了重要的增量资金，带动

市场情绪回暖，同时两融底部回暖延续，投资者情绪持续上扬，行业流向上，加速回流医药、食饮，持续加仓电力设备。

在基金操作策略上，本基金通过研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，精选优质行业的优质股票，实现基金资产的长期稳健增值。上半年，在权衡长期和短期后，我们在消费制造、科技和新能源等代表未来的行业方向上进行了重点配置，从微观的、长期的角度精选能符合我们长期收益率预期的优秀个股。我们会持续优化我们的投资策略，努力给投资者实现长期优秀的投资回报。

#### 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 1.8486 元，本报告期内基金份额净值增长率为-17.63%，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

我们认为中国宏观经济上半年的经济弱势是阶段性的，也是多重因素叠加导致的，国内稳增长政策正不断加码，尤其 4 月 29 日中央政治局会议更明确了坚持 5.5% 左右的经济增速目标不动摇，5 月 23 日国常会部署 6 方面 33 项一揽子措施“稳经济”，5 月 25 日国务院稳住经济大盘大会强调“稳增长+保就业”、就稳住经济一揽子政策做出全面部署，随着国内疫情趋缓，各项复工复产政策相继推出，中国政策经济预期最悲观的阶段基本已经过去。从国家实力和信用表征来看，2022 年以来，美元兑日元上涨 18.52%，欧元兑美元下跌 10.09%，美元兑离岸人民币上涨 6.11%，美元加息和缩表推升的美元指数飙涨，并未撼动人民币的全球信用。也即是说，2022 年以来内外众多因素汇聚而致的大风浪并未实质影响到中国的大局，中国的安全、稳定、疫情仍然相对可控，中国宏观经济在高质量发展路上坚定前行。

对于市场未来的展望，我们维持长期震荡向上走势的判断。中国宏观现实短期处于修复过程之中，企业盈利增速还在回落找底中，通胀上升、盈利下行有可能是 3 季度需要面对的基本面艰难场景，这将使得逆周期调节成为一种有节制的常态，货币政策相对宽松，A 股证券市场的整个流动性逻辑没有被根本破坏。近期国内政策在防疫上体现了务实的动态调整以取得防疫与发展的平衡，以互联网传媒为代表的行业压制性政策逐步转向宽松，以及决策层改善民营经济信用环境等都会增强市场信心。在行业走势上，从中长期产业结构变迁趋势、产业发展空间和行业景气度等角度考量，消费制造、产业数字化浪潮中的科技运用和新能源等依然是中长期需要重点关注的方向。在市场下行风险上，主要是一些外部因素如美国经济由通胀向衰退的转变、美股进一步下跌的联动影响、地缘政治的不确定性等仍然有待观察。

#### 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六次，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并

根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：诺安行业轮动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	28,844,350.36	13,755,433.13
结算备付金		113,300.33	211,272.41
存出保证金		22,909.04	39,720.29
交易性金融资产	6.4.7.2	103,629,894.57	146,352,803.64
其中：股票投资		103,629,894.57	146,352,803.64
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,586.65	39,119.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,642.04
资产总计		132,619,040.95	160,399,991.03
<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		4,584,824.52	-
应付赎回款		329,953.84	162,149.48
应付管理人报酬		151,533.08	200,592.02
应付托管费		25,255.50	33,432.02
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	137,608.87	238,208.90
负债合计		5,229,175.81	634,382.42
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	45,095,569.66	46,584,254.37
未分配利润	6.4.7.8	82,294,295.48	113,181,354.24
净资产合计		127,389,865.14	159,765,608.61
负债和净资产总计		132,619,040.95	160,399,991.03

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8486 元，基金份额总额 68,912,843.92 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：诺安行业轮动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>		-26,974,458.30	15,993,901.16
1. 利息收入		31,618.14	35,872.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,618.14	35,872.03
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,162,301.09	19,635,771.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,467,374.98	17,933,528.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	1,305,073.89	1,702,242.41
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	-14,865,272.64	-3,748,230.24
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	21,497.29	70,488.25
<b>减：二、营业总支出</b>		1,254,367.94	2,208,685.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	993,065.70	1,257,670.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	165,510.89	209,611.71
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	95,791.35	741,403.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-28,228,826.24	13,785,215.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-28,228,826.24	13,785,215.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-28,228,826.24	13,785,215.83

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：诺安行业轮动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）	46,584,254.37	-	113,181,354.24	159,765,608.61
二、本期期初净资产（基金净值）	46,584,254.37	-	113,181,354.24	159,765,608.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,488,684.71	-	-30,887,058.76	-32,375,743.47
（一）、综合收益总额	-	-	-28,228,826.24	-28,228,826.24
（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）	-1,488,684.71	-	-2,658,232.52	-4,146,917.23
其中：1. 基金申购款	2,193,491.74	-	4,631,064.33	6,824,556.07
2. 基金赎回款	-3,682,176.45	-	-7,289,296.85	-10,971,473.30
（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）	45,095,569.66	-	82,294,295.48	127,389,865.14
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）	59,678,863.04	-	111,981,227.98	171,660,091.02
二、本期期初净资产（基金净值）	59,678,863.04	-	111,981,227.98	171,660,091.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,625,065.35	-	599,188.54	-6,025,876.81
（一）、综合收益总额	-	-	13,785,215.83	13,785,215.83
（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）	-6,625,065.35	-	-13,186,027.29	-19,811,092.64
其中：1. 基金申购款	6,485,806.67	-	13,405,215.23	19,891,021.90
2. 基金赎回款	-13,110,872.02	-	-26,591,242.52	-39,702,114.54
（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）	53,053,797.69	-	112,580,416.52	165,634,214.21

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

诺安行业轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）原名为诺安保本混合型证券投资基金。2017 年 6 月 20 日，诺安保本混合型证券投资基金保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《诺安保本混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，该基金保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“诺安行业轮动混合型证券投资基金”。诺安保本混合型证券投资基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日），即 2017 年 6 月 20 日至 2017 年 6 月 22 日。根据《诺安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，自 2017 年 6 月 23 日起，诺安保本混合型证券投资基金变更为诺安行业轮动混合型证券投资基金。原诺安保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺安保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2011〕357 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《诺安保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2011 年 5 月 13 日生效。原诺安保本混合型证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,701,127,764.96 基金份额，其中认购资金利息折合 951,519.52 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，基金托管人为招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》及其配套规则、《诺安行业轮动混合型证券投资基金基金合同》和《诺安行业轮动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国内依法公开发行的 A 股股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、债券（国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含分离交易债）、可交换债券、央票、中期票据）、债券回购、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资股票、存托凭证占基金资产的 60%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

### 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资产变动情况。

### 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，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 13,755,433.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,517.85 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 13,756,950.98 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 211,272.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 104.61 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 211,377.02 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 39,720.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 19.58 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 39,739.87 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 1,642.04 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,517.85 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 104.61 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 19.58 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	28,844,350.36
等于：本金	28,841,456.22
加：应计利息	2,894.14
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	28,844,350.36

### 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	112,799,217.87	-	103,629,894.57	-9,169,323.30
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	112,799,217.87	-	103,629,894.57	-9,169,323.30

### 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。

### 6.4.7.5 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	5.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	53,919.40
其中：交易所市场	53,919.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,683.76
合计	137,608.87

### 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	71,187,775.28	46,584,254.37

本期申购	3,351,998.65	2,193,491.74
本期赎回（以“-”号填列）	-5,626,930.01	-3,682,176.45
本期末	68,912,843.92	45,095,569.66

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	127,712,214.31	-14,530,860.07	113,181,354.24
本期利润	-13,363,553.60	-14,865,272.64	-28,228,826.24
本期基金份额交易产生的变动数	-4,078,864.14	1,420,631.62	-2,658,232.52
其中：基金申购款	6,002,795.38	-1,371,731.05	4,631,064.33
基金赎回款	-10,081,659.52	2,792,362.67	-7,289,296.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,269,796.57	-27,975,501.09	82,294,295.48

#### 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	30,293.54
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	1,078.91
其他	245.69
合计	31,618.14

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	100,926,538.90
减：卖出股票成本总额	114,138,458.00
减：交易费用	255,455.88
买卖股票差价收入	-13,467,374.98

#### 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	1,305,073.89
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	1,305,073.89

#### 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	-14,865,272.64
—股票投资	-14,865,272.64
—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	-14,865,272.64

#### 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	16,244.84
基金转换费收入	5,252.45
合计	21,497.29

#### 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	-
汇划手续费	2,807.59
账户维护费	18,600.00
合计	95,791.35

#### 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
招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	993,065.70	1,257,670.23
其中：支付销售机构的客户维护费	448,556.36	607,357.91

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	165,510.89	209,611.71

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

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
招商银行股份有限公司	28,844,350.36	30,293.54	15,262,029.65	32,759.18

注：本基金的银行存款由基金托管人招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
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	115	6,390.55	3,453.45	-
301097	天益医疗	2022年03月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	95	4,975.15	4,543.85	-
301102	兆讯传媒	2022年03月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	120	4,785.60	3,730.80	-
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股锁定	32.77	32.02	131	4,292.50	4,194.62	-
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	70	4,417.00	2,789.50	-
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	397	4,525.80	8,122.62	-
301130	西点药业	2022年02月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	166	3,743.30	6,258.20	-
301137	哈焊华通	2022年03月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	296	4,549.52	4,733.04	-
301158	德石股份	2022年01月07日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	272	4,254.08	5,543.36	-
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	110	4,427.50	3,364.90	-

301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	52	3,332.16	1,951.04	-
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	86	6,584.16	4,465.12	-
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	80	4,550.40	4,513.60	-
301215	中汽股份	2022年02月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	1,787	6,790.60	11,418.93	-
301216	万凯新材	2022年03月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	126	4,495.68	3,759.84	-
301219	腾远钴业	2022年03月10日	6个月	新股锁定	96.66	87.82	36	3,479.60	3,161.52	-
301222	浙江恒威	2022年03月02日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	137	4,655.26	3,967.52	-
301228	实朴检测	2022年01月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	282	5,662.56	5,735.88	-
301236	软通动力	2022年03月08日	6个月	新股锁定	48.59	31.38	135	6,559.20	4,236.30	-
301237	和顺科技	2022年03月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	74	4,195.06	3,097.64	-
301256	华融化学	2022年03月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	554	4,459.70	5,584.32	-
301258	富士莱	2022年03月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	78	3,767.40	3,251.04	-
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	199	3,966.07	6,244.62	-
688175	高凌信息	2022年03月08日	6个月	新股锁定	51.68	32.23	1,008	52,093.44	32,487.84	-
68828	理工	2022年	6个月	新股锁	65.21	45.37	882	57,515.22	40,016.34	-



2	导航	03月10日		定						
---	----	--------	--	---	--	--	--	--	--	--

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。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招商银行股份有限公司，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 6 月 30 日，本基金无债券投资（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上市公司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 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、结算备付金和存出保证金等。

#### 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	28,844,350.36	-	-	-	-	28,844,350.36
结算备付金	113,300.33	-	-	-	-	113,300.33
存出保证金	22,909.04	-	-	-	-	22,909.04
交易性金融资产	-	-	-	-	103,629,894.57	103,629,894.57
应收申购款	-	-	-	-	8,586.65	8,586.65
资产总计	28,980,559.73	-	-	-	103,638,481.22	132,619,040.95
负债						
应付清算款	-	-	-	-	4,584,824.52	4,584,824.52
应付赎回款	-	-	-	-	329,953.84	329,953.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	151,533.08	151,533.08
应付托管费	-	-	-	-	25,255.50	25,255.50
其他负债	-	-	-	-	137,608.87	137,608.87
负债总计	-	-	-	-	5,229,175.81	5,229,175.81
利率敏感度缺口	28,980,559.73	-	-	-	98,409,305.41	127,389,865.14
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	13,755,433.13	-	-	-	-	13,755,433.13
结算备付金	211,272.41	-	-	-	-	211,272.41
存出保证金	39,720.29	-	-	-	-	39,720.29
交易性金融资产	-	-	-	-	146,352,803.64	146,352,803.64
其他资产	-	-	-	-	1,642.04	1,642.04
应收申购款	10.00	-	-	-	39,109.52	39,119.52
资产总计	14,006,435.83	-	-	-	146,393,555.20	160,399,991.03
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	162,149.48	162,149.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	200,592.02	200,592.02
应付托管费	-	-	-	-	33,432.02	33,432.02
其他负债	-	-	-	-	238,208.90	238,208.90

负债总计	-	-	-	634,382.42	634,382.42
利率敏感度缺口	14,006,435.83	-	-	-145,759,172.78	159,765,608.61

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 6 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	103,629,894.57	81.35	146,352,803.64	91.60
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	103,629,894.57	81.35	146,352,803.64	91.60

#### 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%	4,969,994.12	5,810,257.81
	业绩比较基准下降 5%	-4,969,994.12	-5,810,257.81

### 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	103,449,268.68	144,752,511.37
第二层次	-	1,600,292.27
第三层次	180,625.89	-
合计	103,629,894.57	146,352,803.64

##### 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，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	103,629,894.57	78.14
	其中：股票	103,629,894.57	78.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,957,650.69	21.84
8	其他各项资产	31,495.69	0.02
9	合计	132,619,040.95	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	5,559.90	0.00
B	采矿业	26,202.94	0.02
C	制造业	72,812,617.86	57.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,232,709.42	2.54
E	建筑业	18,785.47	0.01
F	批发和零售业	60,336.28	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	5,450,253.98	4.28

H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,473,959.41	9.01
J	金融业	10,059,886.59	7.90
K	房地产业	14,706.00	0.01
L	租赁和商务服务业	24,470.25	0.02
M	科学研究和技术服务业	288,301.41	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	89,286.49	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,751.36	0.02
R	文化、体育和娱乐业	33,089.77	0.03
S	综合	-	-
	合计	103,629,894.57	81.35

### 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	600887	伊利股份	160,072	6,234,804.40	4.89
2	601615	明阳智能	180,000	6,084,000.00	4.78
3	000333	美的集团	100,030	6,040,811.70	4.74
4	601169	北京银行	1,330,000	6,038,200.00	4.74
5	000089	深圳机场	700,000	5,404,000.00	4.24
6	601877	正泰电器	136,000	4,866,080.00	3.82
7	300037	新宙邦	91,440	4,806,086.40	3.77
8	300007	汉威科技	260,000	4,677,400.00	3.67
9	002236	大华股份	260,000	4,269,200.00	3.35
10	601728	中国电信	1,086,690	4,053,353.70	3.18
11	002966	苏州银行	646,800	3,945,480.00	3.10
12	603899	晨光股份	66,000	3,701,280.00	2.91
13	688981	中芯国际	80,082	3,617,303.94	2.84
14	002439	启明星辰	180,000	3,587,400.00	2.82
15	600050	中国联通	937,900	3,245,134.00	2.55
16	000338	潍柴动力	260,000	3,242,200.00	2.55
17	600905	三峡能源	508,000	3,195,320.00	2.51
18	603986	兆易创新	20,000	2,844,200.00	2.23
19	300223	北京君正	26,000	2,762,500.00	2.17
20	601138	工业富联	280,000	2,755,200.00	2.16



21	300573	兴齐眼药	16,000	2,453,120.00	1.93
22	000157	中联重科	375,200	2,311,232.00	1.81
23	603501	韦尔股份	11,965	2,070,303.95	1.63
24	603195	公牛集团	12,300	1,880,793.00	1.48
25	603385	惠达卫浴	232,860	1,762,750.20	1.38
26	000858	五粮液	7,400	1,494,282.00	1.17
27	000725	京东方 A	360,000	1,418,400.00	1.11
28	002916	深南电路	12,000	1,124,520.00	0.88
29	688223	晶科能源	16,685	249,107.05	0.20
30	688320	禾川科技	2,322	119,815.20	0.09
31	688212	澳华内镜	2,272	106,329.60	0.08
32	688279	峰岬科技	1,193	88,186.56	0.07
33	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.07
34	688105	诺唯赞	954	80,994.60	0.06
35	688110	东芯股份	2,060	78,115.20	0.06
36	688232	新点软件	2,047	77,008.14	0.06
37	688113	联测科技	1,415	64,453.25	0.05
38	688262	国芯科技	1,322	64,354.96	0.05
39	688209	英集芯	2,046	62,607.60	0.05
40	688590	新致软件	4,171	59,770.43	0.05
41	688129	东来技术	3,970	58,200.20	0.05
42	301228	实朴检测	2,811	58,035.60	0.05
43	301127	天源环保	5,197	57,842.61	0.05
44	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.05
45	301158	德石股份	2,711	56,396.51	0.04
46	688557	兰剑智能	1,722	55,396.74	0.04
47	688234	天岳先进	821	55,007.00	0.04
48	688206	概伦电子	1,800	54,720.00	0.04
49	688317	之江生物	1,435	53,654.65	0.04
50	301221	光庭信息	797	51,669.51	0.04
51	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.04
52	688626	翔宇医疗	1,331	44,269.06	0.03
53	688171	纬德信息	1,854	43,476.30	0.03
54	688259	创耀科技	532	42,863.24	0.03
55	301182	凯旺科技	1,745	41,461.20	0.03
56	688799	华纳药厂	1,287	41,377.05	0.03
57	688265	南模生物	633	40,530.99	0.03
58	688282	理工导航	882	40,016.34	0.03
59	688173	希荻微	1,191	39,958.05	0.03
60	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.03
61	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.03

62	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
63	688227	品高股份	1,666	35,685.72	0.03
64	688210	统联精密	1,603	34,737.01	0.03
65	300834	星辉环材	1,142	34,530.47	0.03
66	688175	高凌信息	1,008	32,487.84	0.03
67	688737	中自科技	694	28,683.02	0.02
68	301029	怡合达	348	28,362.00	0.02
69	688236	春立医疗	1,421	28,135.80	0.02
70	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.02
71	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.02
72	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.02
73	688255	凯尔达	809	24,998.10	0.02
74	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.02
75	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.02
76	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.02
77	301089	拓新药业	173	21,732.26	0.02
78	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.02
79	001228	永泰运	383	20,739.45	0.02
80	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.02
81	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.02
82	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.02
83	301196	唯科科技	513	19,404.50	0.02
84	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
85	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.01
86	301035	润丰股份	202	16,654.90	0.01
87	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
88	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
89	001317	三羊马	300	15,222.00	0.01
90	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.01
91	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
92	300917	特发服务	475	14,706.00	0.01
93	301050	雷电微力	144	14,624.64	0.01
94	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.01
95	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.01
96	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.01
97	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.01
98	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.01
99	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
100	300930	屹通新材	322	11,566.24	0.01
101	301215	中汽股份	1,787	11,418.93	0.01
102	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01

103	300879	大叶股份	466	10,885.76	0.01
104	300873	海晨股份	381	10,770.87	0.01
105	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.01
106	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.01
107	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.01
108	001296	长江材料	403	9,905.74	0.01
109	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.01
110	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.01
111	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.01
112	300878	维康药业	412	9,644.92	0.01
113	301078	孩子王	657	9,631.62	0.01
114	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.01
115	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.01
116	301020	密封科技	421	9,472.50	0.01
117	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.01
118	300918	南山智尚	1,063	9,088.65	0.01
119	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.01
120	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.01
121	605086	龙高股份	443	8,877.72	0.01
122	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.01
123	605287	德才股份	349	8,798.29	0.01
124	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.01
125	605180	华生科技	499	8,677.61	0.01
126	300945	曼卡龙	531	8,538.48	0.01
127	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.01
128	605189	富春染织	423	8,493.84	0.01
129	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.01
130	300926	博俊科技	359	8,382.65	0.01
131	001288	运机集团	537	8,382.57	0.01
132	301116	益客食品	397	8,122.62	0.01
133	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.01
134	300876	蒙泰高新	350	7,836.50	0.01
135	001210	金房节能	311	7,790.55	0.01
136	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.01
137	301039	中集车辆	692	7,494.36	0.01
138	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.01
139	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.01
140	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.01
141	301038	深水规院	346	7,193.34	0.01
142	301028	东亚机械	653	7,065.46	0.01
143	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.01

144	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.01
145	301066	万事利	482	6,873.32	0.01
146	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.01
147	300860	锋尚文化	144	6,801.12	0.01
148	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.01
149	300956	英力股份	371	6,729.94	0.01
150	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.01
151	300881	盛德鑫泰	291	6,652.26	0.01
152	300968	格林精密	731	6,622.86	0.01
153	300975	商络电子	738	6,472.26	0.01
154	300864	南大环境	308	6,468.00	0.01
155	300892	品渥食品	214	6,409.30	0.01
156	301090	华润材料	580	6,327.80	0.00
157	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
158	301130	西点药业	166	6,258.20	0.00
159	301263	泰恩康	199	6,244.62	0.00
160	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
161	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
162	300971	博亚精工	245	6,039.25	0.00
163	300943	春晖智控	383	6,016.93	0.00
164	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
165	300886	华业香料	191	5,936.28	0.00
166	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
167	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
168	300991	创益通	407	5,852.66	0.00
169	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
170	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
171	300908	仲景食品	150	5,644.50	0.00
172	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
173	301256	华融化学	554	5,584.32	0.00
174	300972	万辰生物	430	5,559.90	0.00
175	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00
176	300963	中洲特材	283	5,484.54	0.00
177	301138	华研精机	178	5,473.50	0.00
178	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
179	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
180	300931	通用电梯	672	5,194.56	0.00
181	300948	冠中生态	324	5,141.88	0.00
182	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
183	300985	致远新能	174	4,993.80	0.00
184	300877	金春股份	296	4,901.76	0.00

185	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
186	301137	哈焊华通	296	4,733.04	0.00
187	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
188	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
189	301097	天益医疗	95	4,543.85	0.00
190	301049	超越科技	191	4,528.61	0.00
191	301207	华兰疫苗	80	4,513.60	0.00
192	301200	大族数控	86	4,465.12	0.00
193	300960	通业科技	234	4,380.48	0.00
194	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
195	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
196	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
197	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
198	301236	软通动力	135	4,236.30	0.00
199	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
200	301103	何氏眼科	131	4,194.62	0.00
201	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
202	300929	华骐环保	293	4,028.75	0.00
203	301222	浙江恒威	137	3,967.52	0.00
204	301193	家联科技	146	3,963.90	0.00
205	300868	杰美特	216	3,862.08	0.00
206	301216	万凯新材	126	3,759.84	0.00
207	301036	双乐股份	167	3,754.16	0.00
208	301102	兆讯传媒	120	3,730.80	0.00
209	301100	风光股份	172	3,711.76	0.00
210	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
211	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
212	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00
213	301181	标榜股份	110	3,364.90	0.00
214	301258	富士莱	78	3,251.04	0.00
215	301219	腾远钴业	36	3,161.52	0.00
216	301237	和顺科技	74	3,097.64	0.00
217	301092	争光股份	89	2,799.94	0.00
218	301110	青木股份	70	2,789.50	0.00
219	301088	戎美股份	149	2,780.34	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	000089	深圳机场	7,947,932.00	4.97
2	601877	正泰电器	6,034,795.00	3.78
3	600183	生益科技	5,666,637.00	3.55
4	300454	深信服	4,944,383.00	3.09
5	002966	苏州银行	4,237,852.00	2.65
6	300037	新宙邦	4,236,961.00	2.65
7	603899	晨光股份	4,112,409.73	2.57
8	600028	中国石化	3,862,875.00	2.42
9	601138	工业富联	3,312,673.00	2.07
10	600905	三峡能源	3,194,088.00	2.00
11	002202	金风科技	3,175,515.30	1.99
12	600606	绿地控股	2,916,980.16	1.83
13	688660	电气风电	2,900,170.32	1.82
14	601169	北京银行	2,891,727.00	1.81
15	300223	北京君正	2,373,302.00	1.49
16	300573	兴齐眼药	2,346,437.00	1.47
17	000063	中兴通讯	2,311,217.00	1.45
18	300007	汉威科技	2,304,018.00	1.44
19	000034	神州数码	2,053,309.00	1.29
20	603195	公牛集团	1,766,809.00	1.11

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	601877	正泰电器	5,396,445.00	3.38
2	603197	保隆科技	5,311,315.20	3.32
3	603899	晨光股份	5,199,556.00	3.25
4	300138	晨光生物	5,003,941.00	3.13
5	600900	长江电力	4,742,967.00	2.97
6	600183	生益科技	4,275,819.00	2.68
7	002705	新宝股份	4,041,942.64	2.53
8	000725	京东方 A	4,037,873.00	2.53
9	002415	海康威视	3,876,234.00	2.43
10	300454	深信服	3,664,395.00	2.29
11	600028	中国石化	3,617,142.00	2.26
12	603181	皇马科技	3,287,006.10	2.06
13	000333	美的集团	3,238,222.00	2.03
14	002202	金风科技	3,222,993.60	2.02
15	000157	中联重科	2,914,390.00	1.82
16	688660	电气风电	2,831,673.09	1.77

17	603609	禾丰股份	2,707,720.00	1.69
18	000089	深圳机场	2,638,571.00	1.65
19	600309	万华化学	2,544,828.00	1.59
20	600050	中国联通	2,368,638.00	1.48

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	86,280,821.57
卖出股票收入（成交）总额	100,926,538.90

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 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	22,909.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,586.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,495.69

### 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
2,766	24,914.26	-	-	68,912,843.92	100.00%



## 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	430,327.06	0.6245%

## 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	0
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（2017年06月23日）基金份额总额	306,629,170.26
本报告期期初基金份额总额	71,187,775.28
本报告期基金总申购份额	3,351,998.65
减：本报告期基金总赎回份额	5,626,930.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	68,912,843.92

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，基金托管人无重大人事变动。

### 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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	95,616,018.07	51.84%	68,299.10	51.79%	-
国信证券	1	88,837,353.76	48.16%	63,576.95	48.21%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
  - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
  - (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
  - (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
  - (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务。
  - (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金租用的证券公司交易单元本报告期未进行其他证券投资交易。

### 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	诺安行业轮动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设立成都分公司的公告	《上海证券报》	2022年03月18日
8	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
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、《上海证	2022年03月24日

	金增加天风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	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
10	诺安行业轮动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
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	诺安行业轮动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
16	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
17	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
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华龙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05月27日
19	诺安行业轮动混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2022年06月10日
20	诺安行业轮动混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《上海证券报》	2022年06月10日
21	诺安行业轮动混合型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06月10日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年06月13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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年06月15日

	告		
24	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
25	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保本混合型证券投资基金公开募集的文件。
- ②原诺安保本混合型证券投资基金转型为诺安行业轮动混合型证券投资基金的相关公告。
- ③《诺安行业轮动混合型证券投资基金基金合同》。
- ④《诺安行业轮动混合型证券投资基金托管协议》。
- ⑤《诺安行业轮动混合型证券投资基金招募说明书》。

⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑦报告期内诺安行业轮动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