

# 诺安多策略混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	净资产（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	20
§ 8	投资组合报告	46
8.1	期末基金资产组合情况	46
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	60
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	60
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	60
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12	投资组合报告附注 .....	61
§ 9	基金份额持有人信息 .....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
§ 10	开放式基金份额变动 .....	62
§ 11	重大事件揭示 .....	63
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	63
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4	基金投资策略的改变 .....	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8	其他重大事件 .....	65
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	68
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§ 13	备查文件目录 .....	68
13.1	备查文件目录 .....	68
13.2	存放地点 .....	69
13.3	查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安多策略混合型证券投资基金
基金简称	诺安多策略混合
基金主代码	320016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 08 月 09 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,361,568.62 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安多策略股票型证券投资基金”变更为“诺安多策略混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过数量化手段优化投资策略，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略以及股指期货投资策略六个部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略 本基金主要投资的大类资产是股票、债券和现金，我们将从宏观面、政策面、资金面和基本面等全面研究、综合分析，发掘择时因子，根据择时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。</p> <p>2. 股票投资策略 本基金以“定量投资”为主，辅以“定性投资”，力争实现稳定超额回报。</p> <p>3. 存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4. 债券投资策略 本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。</p> <p>5. 权证投资策略 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，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，进行稳健投资。</p> <p>6. 股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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、中高预期收益的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	王小飞
	联系电话	0755-83026688	021-60637103
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-8998	021-60637228
传真		0755-83026677	021-60635778
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		李强	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-4,752,648.29	12,515,723.70	11,133,731.96
本期利润	-5,206,473.60	213,070.55	21,237,036.47
加权平均基金份额本期利润	-0.5467	0.0070	0.4681
本期加权平均净值利润率	-28.10%	0.32%	25.51%
本期基金份额净值增长率	-24.36%	2.13%	29.59%

3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	6,569,959.10	12,072,327.09	46,245,582.11
期末可供分配基金份额利润	0.7018	1.2495	1.1222
期末基金资产净值	15,931,527.72	21,733,848.92	90,772,839.34
期末基金份额净值	1.702	2.250	2.203
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	70.20%	125.00%	120.30%

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

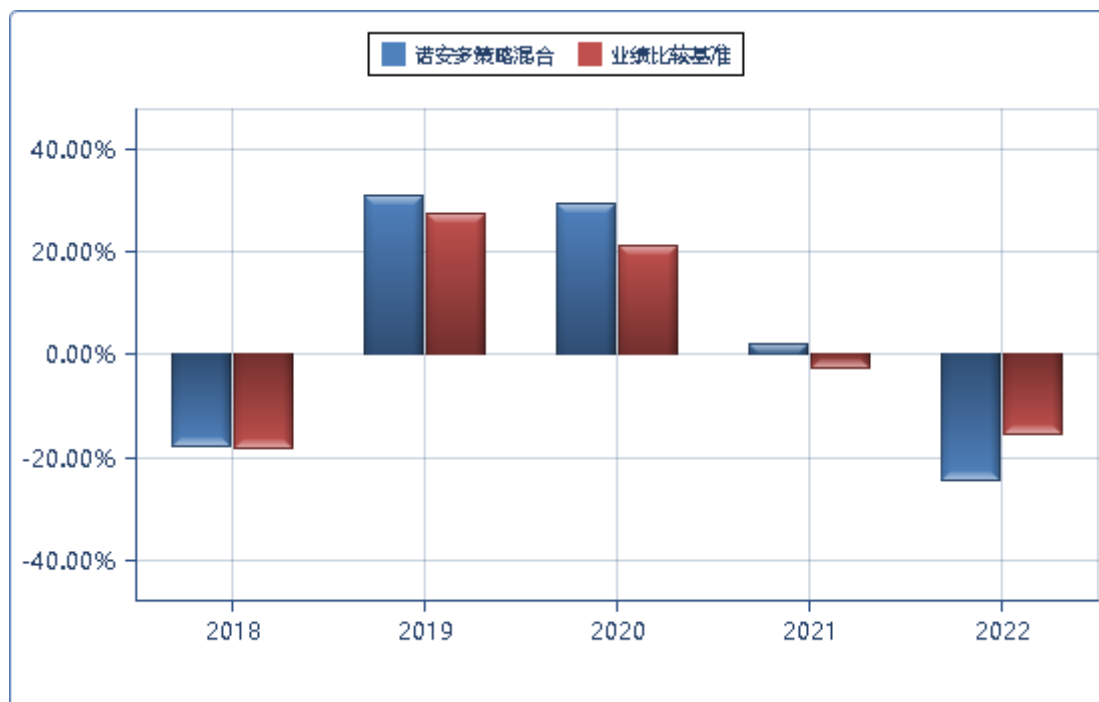
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.06%	1.10%	1.49%	0.97%	-5.55%	0.13%
过去六个月	-18.37%	1.20%	-9.97%	0.83%	-8.40%	0.37%
过去一年	-24.36%	1.31%	-15.64%	0.96%	-8.72%	0.35%
过去三年	0.12%	1.20%	-0.23%	0.97%	0.35%	0.23%
过去五年	8.20%	1.25%	4.28%	0.97%	3.92%	0.28%
自基金合同生效起至今	70.20%	1.46%	49.96%	1.06%	20.24%	0.40%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

### 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



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况



#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2022 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理六十一只开放式基金: 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、诺安均衡优选一年持有期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		

王海畅	本基金基金经理	2022 年 11 月 03 日	-	6 年	硕士,具有基金从业资格。2017 年 1 月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员。2022 年 7 月起任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2022 年 11 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。
李玉良	本基金基金经理	2015 年 07 月 14 日	2022 年 11 月 03 日	18 年	博士,具有基金从业资格。曾就职于中国工商银行股份有限公司,从事内部风险管理及稽核工作。2010 年 6 月加入诺安基金管理有限公司,历任产品经理、基金经理助理。2015 年 3 月至 2019 年 5 月任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2016 年 9 月至 2019 年 8 月任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 9 月至 2020 年 4 月任诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 9 月至 2020 年 9 月任诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015 年 7 月至 2022 年 11 月任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资

					基金基金经理，2018年7月起任诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年8月起任诺安稳健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、离任日期均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 公平交易制度和控制方法

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

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

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中

心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金执行的运作策略是“以定量投资为主，定性投资为辅”，力争实现稳定超额回报。今年以来通胀和疫情两方因素持续深刻影响着资本市场的运行，但如我们所预期，国内通胀数据快速下滑至平稳区间，而针对疫情扰动和稳经济政策的博弈在四季度以来逐渐占据主导位置。根据年末在疫情防控和房地产相关政策所作出的调整，我们可以看到经济需求端的回落触底，以及房地产市场风险的缓释。本产品当前时点的股票资产配置比例已经调整至 90%以上，相比业绩基准中所包含的“75%沪深 300 指数”配比而言更加乐观。

#### 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 1.702 元，本报告期内基金份额净值增长率为-24.36%，同期业绩比较基准收益率为-15.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段的市场，我们从赔率角度观察认为股票的上涨空间相对于其它资产是可观的；而随着居民消费端场景的恢复以及未来经济上行的预期，我们认为胜率角度天平也将向股票类资产倾斜。结构上，企业利润空间和通胀将伴随需求往中下游传导，但物价指标仍处于温和可控的范围之内，短期之内造成股价估值压力的概率较低。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本年度基金管理人合规管理、内部风险控制、监察稽核的具体情况如下：

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至 2022 年 12 月 30 日，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。基金管理人积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 21972 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺安多策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了诺安多策略混合型证券投资基金(以下简称“诺安多策略基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了诺安多策略基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于诺安多策略基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>诺安多策略基金的基金管理人诺安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括诺安多策略基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估诺安多策略基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算诺安多策略基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺安多策略基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对诺安多策略基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安多策略基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	周祎   肖菊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------



<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	892,182.10	4,985,343.53
结算备付金		281,000.78	251,143.56
存出保证金		23,075.48	25,523.44
交易性金融资产	7.4.7.2	14,931,289.00	17,978,933.81
其中：股票投资		14,931,289.00	17,978,933.81
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		12,910.37	9,352.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	755.49
资产总计		16,140,457.73	23,251,052.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,229,381.07
应付赎回款		1,478.70	68,995.91
应付管理人报酬		21,134.67	27,465.97
应付托管费		3,522.45	4,577.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19.03	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	182,775.16	186,782.88
负债合计		208,930.01	1,517,203.47
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	9,361,568.62	9,661,521.83
未分配利润	7.4.7.8	6,569,959.10	12,072,327.09
净资产合计		15,931,527.72	21,733,848.92
负债和净资产总计		16,140,457.73	23,251,052.39

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.702 元，基金份额总额 9,361,568.62 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,852,934.76	1,866,820.82
1. 利息收入		16,445.09	51,681.43
其中：存款利息收入	7.4.7.9	16,067.94	48,800.31
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		377.15	2,881.12
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,417,630.14	14,106,004.37
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,520,324.32	12,355,207.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-56,059.96	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	158,754.14	1,750,797.29
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-453,825.31	-12,302,653.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	2,075.60	11,788.17
<b>减：二、营业总支出</b>		353,538.84	1,653,750.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	277,892.23	1,010,152.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	46,315.32	168,358.73
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		6.29	-
8. 其他费用	7.4.7.17	29,325.00	475,238.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,206,473.60	213,070.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,206,473.60	213,070.55
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,206,473.60	213,070.55

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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）	9,661,521.83	-	12,072,327.09	21,733,848.92
二、本期期初净资产（基金净值）	9,661,521.83	-	12,072,327.09	21,733,848.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-299,953.21	-	-5,502,367.99	-5,802,321.20
（一）、综合收益总额	-	-	-5,206,473.60	-5,206,473.60
（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）	-299,953.21	-	-295,894.39	-595,847.60
其中：1. 基金申购款	729,781.91	-	724,033.84	1,453,815.75
2. 基金赎回款	-1,029,735.12	-	-1,019,928.23	-2,049,663.35
（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）	9,361,568.62	-	6,569,959.10	15,931,527.72
项目	上年度可比期间			

	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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)	41,208,267.82	-	49,564,571.52	90,772,839.34
二、本期期初净资产 (基金净值)	41,208,267.82	-	49,564,571.52	90,772,839.34
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-31,546,745.99	-	-37,492,244.43	-69,038,990.42
(一)、综合收益总额	-	-	213,070.55	213,070.55
(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)	-31,546,745.99	-	-37,705,314.98	-69,252,060.97
其中：1. 基金申购款	2,522,347.55	-	3,111,479.30	5,633,826.85
2. 基金赎回款	-34,069,093.54	-	-40,816,794.28	-74,885,887.82
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	9,661,521.83	-	12,072,327.09	21,733,848.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

齐斌

田冲

何柳姿

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

诺安多策略混合型证券投资基金(原名为“诺安多策略股票型证券投资基金”，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”)证监许可〔2011〕739号《关于核准诺安多策略股票型证券投资基金募集的批复》核准，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》和《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,248,834,629.84元。经向中国证监会备案，《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》于2011年8月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,249,071,475.18份基金份额，其中认购资金利息折合236,845.34份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，诺安多策略股票

型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为诺安多策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于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上市的股票）、存托凭证、债券、权证、货币市场工具、股指期货和资产支持证券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）。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2022 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产（基金净值）变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

##### 权益工具

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

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

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

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

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

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

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



收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

#### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

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

(c) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

(d) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

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

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

(g) 本基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(h) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交

易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会〔2022〕14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日

及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 4,985,343.53 元、251,143.56 元、25,523.44 元、755.49 元和 9,352.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 4,985,974.52 元、251,256.56 元、25,534.94 元、0.00 元和 9,352.56 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 17,978,933.81 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 17,978,933.81 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,229,381.07 元、68,995.91 元、27,465.97 元、4,577.64 元、156,615.62 元和 167.26 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,229,381.07 元、68,995.91 元、27,465.97 元、4,577.64 元、156,615.62 元和 167.26 元。

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

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	892,182.10	4,985,343.53
等于：本金	892,074.07	4,985,343.53
加：应计利息	108.03	-
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	892,182.10	4,985,343.53

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,872,170.15	-	14,931,289.00	59,118.85
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	14,872,170.15	-	14,931,289.00	59,118.85
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,465,989.65	-	17,978,933.81	512,944.16
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	17,465,989.65	-	17,978,933.81	512,944.16

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	755.49
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	755.49

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	167.26
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	154,775.16	156,615.62
其中：交易所市场	154,775.16	156,615.62
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	28,000.00	30,000.00
合计	182,775.16	186,782.88

#### 7.4.7.7 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,661,521.83	9,661,521.83
本期申购	729,781.91	729,781.91
本期赎回（以“-”号填列）	-1,029,735.12	-1,029,735.12
本期末	9,361,568.62	9,361,568.62

#### 7.4.7.8 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
本期期初	17,307,397.55	-5,235,070.46	12,072,327.09
本期利润	-4,752,648.29	-453,825.31	-5,206,473.60
本期基金份额交易产生的变动数	-443,421.98	147,527.59	-295,894.39
其中：基金申购款	1,173,056.34	-449,022.50	724,033.84
基金赎回款	-1,616,478.32	596,550.09	-1,019,928.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,111,327.28	-5,541,368.18	6,569,959.10

#### 7.4.7.9 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12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
	活期存款利息收入	13,060.46
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	2,499.77	1,062.80
其他	507.71	107.01
合计	16,067.94	48,800.31

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	223,924,398.10	160,471,999.49
减：卖出股票成本总额	227,767,493.13	148,116,792.41
减：交易费用	677,229.29	-
买卖股票差价收入	-4,520,324.32	12,355,207.08

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益--利息收入	1,857.14	-
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-57,917.10	-
债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	-56,059.96	-

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,161,693.49	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,211,602.48	-
减：应计利息总额	7,757.92	-
减：交易费用	250.19	-
买卖债券差价收入	-57,917.10	-

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	158,754.14	1,750,797.29
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	158,754.14	1,750,797.29

#### 7.4.7.14 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-453,825.31	-12,302,653.15
-- 股票投资	-453,825.31	-12,302,653.15
-- 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	-453,825.31	-12,302,653.15

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,825.30	10,879.65
基金转换费收入	250.30	908.52
合计	2,075.60	11,788.17

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
----	---	--

审计费用	28,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,325.00	4,615.34
交易费用	-	440,623.42
合计	29,325.00	475,238.76

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	277,892.23	1,010,152.78
其中：支付销售机构的客户维护费	75,678.05	128,393.92

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	46,315.32	168,358.73

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

## 的情况

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

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司-活期存款	892,182.10	13,060.46	4,985,343.53	47,630.50

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末 2022 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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



靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	892,182.10	-	-	-	-	892,182.10
结算备付金	281,000.78	-	-	-	-	281,000.78
存出保证金	23,075.48	-	-	-	-	23,075.48
交易性金融资产	-	-	-	-	14,931,289.00	14,931,289.00
应收申购款	-	-	-	-	12,910.37	12,910.37
资产总计	1,196,258.36	-	-	-	14,944,199.37	16,140,457.73
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,478.70	1,478.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	21,134.67	21,134.67
应付托管费	-	-	-	-	3,522.45	3,522.45
应交税费	-	-	-	-	19.03	19.03
其他负债	-	-	-	-	182,775.16	182,775.16
负债总计	-	-	-	-	208,930.01	208,930.01
利率敏感度缺口	1,196,258.36	-	-	-	14,735,269.36	15,931,527.72
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	4,985,343.53	-	-	-	-	4,985,343.53
结算备付金	251,143.56	-	-	-	-	251,143.56
存出保证金	25,523.44	-	-	-	-	25,523.44
交易性金融资产	-	-	-	-	17,978,933.81	17,978,933.81
其他资产	-	-	-	-	755.49	755.49
应收申购款	-	-	-	-	9,352.56	9,352.56
资产总计	5,262,010.53	-	-	-	17,989,041.86	23,251,052.39
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1,229,381.07	1,229,381.07
应付赎回款	-	-	-	-	68,995.91	68,995.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	27,465.97	27,465.97
应付托管费	-	-	-	-	4,577.64	4,577.64

其他负债	-	-	-	186,782.88	186,782.88
负债总计	-	-	-	1,517,203.47	1,517,203.47
利率敏感度缺口	5,262,010.53	-	-	-16,471,838.39	21,733,848.92

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	14,931,289.00	93.72	17,978,933.81	82.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	14,931,289.00	93.72	17,978,933.81	82.72

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2022年12月31日)	上年度末(2021年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	757,669.24	599,701.34
	业绩比较基准下降 5%	-757,669.24	-599,701.34

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	14,931,289.00	17,759,493.00
第二层次	-	219,440.81
第三层次	-	-
合计	14,931,289.00	17,978,933.81

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、

或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,931,289.00	92.51
	其中：股票	14,931,289.00	92.51
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	1,173,182.88	7.27
8	其他各项资产	35,985.85	0.22
9	合计	16,140,457.73	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	----------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	800,904.00	5.03
C	制造业	7,750,039.00	48.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	573,300.00	3.60
E	建筑业	428,497.00	2.69
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,477.00	0.59
J	金融业	3,984,418.00	25.01
K	房地产业	504,094.00	3.16
L	租赁和商务服务业	432,060.00	2.71
M	科学研究和技术服务业	364,500.00	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,931,289.00	93.72

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	19,300	719,118.00	4.51
2	601318	中国平安	15,300	719,100.00	4.51
3	600519	贵州茅台	400	690,800.00	4.34
4	000568	泸州老窖	2,800	627,984.00	3.94
5	601166	兴业银行	34,300	603,337.00	3.79
6	000858	五粮液	3,300	596,277.00	3.74
7	002304	洋河股份	3,700	593,850.00	3.73
8	600276	恒瑞医药	15,200	585,656.00	3.68
9	600900	长江电力	27,300	573,300.00	3.60
10	600030	中信证券	22,400	445,984.00	2.80
11	601888	中国中免	2,000	432,060.00	2.71

12	603259	药明康德	4,500	364,500.00	2.29
13	601398	工商银行	81,200	352,408.00	2.21
14	600887	伊利股份	11,000	341,000.00	2.14
15	601899	紫金矿业	32,600	326,000.00	2.05
16	600309	万华化学	3,500	324,275.00	2.04
17	688016	心脉医疗	1,600	302,464.00	1.90
18	300911	亿田智能	6,300	290,682.00	1.82
19	002142	宁波银行	8,800	285,560.00	1.79
20	600809	山西汾酒	1,000	284,990.00	1.79
21	601668	中国建筑	52,300	283,989.00	1.78
22	000333	美的集团	5,400	279,720.00	1.76
23	002049	紫光国微	2,100	276,822.00	1.74
24	600048	保利发展	17,800	269,314.00	1.69
25	000661	长春高新	1,600	266,320.00	1.67
26	000002	万科 A	12,900	234,780.00	1.47
27	601088	中国神华	8,400	232,008.00	1.46
28	601288	农业银行	74,000	215,340.00	1.35
29	603288	海天味业	2,700	214,920.00	1.35
30	600031	三一重工	13,400	211,720.00	1.33
31	600690	海尔智家	8,600	210,356.00	1.32
32	601601	中国太保	7,200	176,544.00	1.11
33	600436	片仔癀	600	173,076.00	1.09
34	603799	华友钴业	3,100	172,453.00	1.08
35	002271	东方雨虹	5,000	167,850.00	1.05
36	601688	华泰证券	12,800	163,072.00	1.02
37	600104	上汽集团	11,100	159,951.00	1.00
38	600585	海螺水泥	5,600	153,328.00	0.96
39	603899	晨光股份	2,700	148,446.00	0.93
40	601117	中国化学	18,200	144,508.00	0.91
41	600893	航发动力	3,400	143,752.00	0.90
42	600028	中国石化	32,000	139,520.00	0.88
43	601628	中国人寿	3,600	133,632.00	0.84
44	600111	北方稀土	5,300	132,765.00	0.83
45	600010	包钢股份	55,500	106,560.00	0.67
46	600196	复星医药	3,000	105,720.00	0.66
47	601857	中国石油	20,800	103,376.00	0.65
48	600406	国电南瑞	3,700	90,280.00	0.57
49	601066	中信建投	3,800	90,250.00	0.57
50	601633	长城汽车	3,000	88,860.00	0.56
51	600346	恒力石化	5,600	86,968.00	0.55
52	601995	中金公司	2,100	80,073.00	0.50



53	688668	鼎通科技	189	12,474.00	0.08
54	688078	龙软科技	100	3,197.00	0.02

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600873	梅花生物	2,624,278.00	12.07
2	300558	贝达药业	2,066,770.48	9.51
3	002258	利尔化学	2,054,727.00	9.45
4	002025	航天电器	2,053,781.00	9.45
5	600958	东方证券	1,941,992.36	8.94
6	688262	国芯科技	1,927,589.53	8.87
7	300088	长信科技	1,875,719.00	8.63
8	600276	恒瑞医药	1,864,938.00	8.58
9	000997	新大陆	1,839,654.00	8.46
10	600546	山煤国际	1,782,380.00	8.20
11	601001	晋控煤业	1,781,066.00	8.19
12	300601	康泰生物	1,685,686.00	7.76
13	300919	中伟股份	1,669,593.16	7.68
14	601888	中国中免	1,643,345.00	7.56
15	002049	紫光国微	1,641,665.00	7.55
16	000519	中兵红箭	1,615,956.00	7.44
17	002230	科大讯飞	1,597,149.00	7.35
18	600456	宝钛股份	1,595,938.00	7.34
19	605399	晨光新材	1,567,141.00	7.21
20	002268	电科网安	1,545,400.00	7.11
21	002402	和而泰	1,542,760.00	7.10
22	603259	药明康德	1,495,753.00	6.88
23	600760	中航沈飞	1,468,657.00	6.76
24	600416	湘电股份	1,439,292.00	6.62
25	300573	兴齐眼药	1,420,034.00	6.53
26	301117	佳缘科技	1,399,603.00	6.44
27	601899	紫金矿业	1,370,759.00	6.31
28	300130	新国都	1,356,999.00	6.24
29	600233	圆通速递	1,338,732.00	6.16
30	002008	大族激光	1,311,050.00	6.03
31	000568	泸州老窖	1,299,637.00	5.98
32	002821	凯莱英	1,294,446.00	5.96
33	300674	宇信科技	1,280,810.00	5.89

34	000858	五粮液	1,275,026.00	5.87
35	600438	通威股份	1,268,846.00	5.84
36	605123	派克新材	1,264,202.00	5.82
37	603799	华友钴业	1,233,729.00	5.68
38	000776	广发证券	1,228,050.00	5.65
39	300841	康华生物	1,194,562.00	5.50
40	600104	上汽集团	1,188,873.00	5.47
41	601318	中国平安	1,185,430.00	5.45
42	300861	美畅股份	1,180,734.00	5.43
43	600499	科达制造	1,179,693.00	5.43
44	600570	恒生电子	1,157,622.00	5.33
45	002735	王子新材	1,155,120.00	5.31
46	600030	中信证券	1,147,265.00	5.28
47	002120	韵达股份	1,137,472.00	5.23
48	002352	顺丰控股	1,135,630.00	5.23
49	300748	金力永磁	1,129,347.00	5.20
50	603816	顾家家居	1,118,042.00	5.14
51	000975	银泰黄金	1,116,640.00	5.14
52	300083	创世纪	1,087,332.00	5.00
53	600988	赤峰黄金	1,079,657.00	4.97
54	300724	捷佳伟创	1,061,567.00	4.88
55	002938	鹏鼎控股	1,047,447.00	4.82
56	603327	福蓉科技	1,035,909.90	4.77
57	600519	贵州茅台	1,027,145.00	4.73
58	000155	川能动力	1,026,645.00	4.72
59	300821	东岳硅材	1,019,744.00	4.69
60	601666	平煤股份	1,007,651.89	4.64
61	002304	洋河股份	1,006,829.00	4.63
62	601166	兴业银行	992,763.00	4.57
63	600315	上海家化	987,187.00	4.54
64	603986	兆易创新	984,731.00	4.53
65	002466	天齐锂业	973,225.00	4.48
66	002415	海康威视	953,531.42	4.39
67	603876	鼎胜新材	951,031.00	4.38
68	601231	环旭电子	950,675.00	4.37
69	002057	中钢天源	948,757.00	4.37
70	300260	新莱应材	948,631.00	4.36
71	300035	中科电气	932,868.11	4.29
72	601238	广汽集团	914,365.00	4.21
73	000738	航发控制	904,358.00	4.16
74	603489	八方股份	890,488.69	4.10

75	688196	卓越新能	869,947.71	4.00
76	002932	明德生物	869,855.00	4.00
77	300450	先导智能	859,419.00	3.95
78	600967	内蒙一机	857,346.00	3.94
79	600036	招商银行	790,781.00	3.64
80	688016	心脉医疗	790,483.27	3.64
81	002465	海格通信	783,422.00	3.60
82	300009	安科生物	771,431.00	3.55
83	688518	联赢激光	764,758.65	3.52
84	300481	濮阳惠成	762,822.00	3.51
85	603214	爱婴室	761,010.00	3.50
86	600718	东软集团	760,038.00	3.50
87	603668	天马科技	759,099.67	3.49
88	002475	立讯精密	757,094.00	3.48
89	300916	朗特智能	747,376.00	3.44
90	002738	中矿资源	742,655.00	3.42
91	300373	扬杰科技	740,316.00	3.41
92	603901	永创智能	729,549.00	3.36
93	000333	美的集团	727,583.00	3.35
94	300073	当升科技	724,719.97	3.33
95	002064	华峰化学	723,720.00	3.33
96	600150	中国船舶	719,055.00	3.31
97	002129	TCL 中环	713,037.00	3.28
98	002384	东山精密	711,102.00	3.27
99	603529	爱玛科技	704,158.02	3.24
100	688278	特宝生物	704,149.35	3.24
101	000915	华特达因	699,171.00	3.22
102	603345	安井食品	697,727.00	3.21
103	688169	石头科技	685,774.00	3.16
104	601668	中国建筑	683,478.00	3.14
105	002756	永兴材料	676,374.00	3.11
106	603676	卫信康	675,491.00	3.11
107	688639	华恒生物	673,683.22	3.10
108	600547	山东黄金	668,152.00	3.07
109	600089	特变电工	667,134.00	3.07
110	300584	海辰药业	665,698.00	3.06
111	601117	中国化学	663,303.00	3.05
112	688100	威胜信息	660,591.62	3.04
113	600862	中航高科	660,216.00	3.04
114	600966	博汇纸业	658,967.00	3.03
115	600048	保利发展	654,923.00	3.01

116	600348	华阳股份	644,974.00	2.97
117	000002	万科 A	640,432.00	2.95
118	603987	康德莱	632,571.00	2.91
119	601088	中国神华	630,838.00	2.90
120	000768	中航西飞	629,465.00	2.90
121	300014	亿纬锂能	626,320.00	2.88
122	603501	韦尔股份	624,038.00	2.87
123	600750	江中药业	621,352.00	2.86
124	300593	新雷能	620,672.00	2.86
125	000625	长安汽车	619,887.00	2.85
126	300026	红日药业	618,371.00	2.85
127	603712	七一二	615,521.00	2.83
128	002556	辉隆股份	611,408.00	2.81
129	603936	博敏电子	609,228.00	2.80
130	600690	海尔智家	608,609.00	2.80
131	600536	中国软件	601,060.00	2.77
132	300634	彩讯股份	600,712.00	2.76
133	688180	君实生物	596,823.99	2.75
134	000933	神火股份	589,415.00	2.71
135	600160	巨化股份	589,263.00	2.71
136	002241	歌尔股份	582,120.00	2.68
137	600641	万业企业	581,123.00	2.67
138	300604	长川科技	580,537.00	2.67
139	600201	生物股份	579,040.00	2.66
140	300207	欣旺达	578,900.00	2.66
141	300474	景嘉微	578,436.00	2.66
142	600711	盛屯矿业	578,380.00	2.66
143	002283	天润工业	578,373.00	2.66
144	300095	华伍股份	578,371.00	2.66
145	002371	北方华创	578,232.00	2.66
146	002171	楚江新材	578,225.00	2.66
147	603859	能科科技	578,179.00	2.66
148	000012	南玻 A	577,854.00	2.66
149	600521	华海药业	576,917.00	2.65
150	601168	西部矿业	574,497.00	2.64
151	600219	南山铝业	572,843.00	2.64
152	600577	精达股份	572,819.00	2.64
153	300059	东方财富	571,780.00	2.63
154	000810	创维数字	568,914.00	2.62
155	688176	亚虹医药	566,854.49	2.61
156	600900	长江电力	555,542.00	2.56

157	603993	洛阳钼业	552,802.00	2.54
158	601633	长城汽车	551,213.91	2.54
159	301021	英诺激光	547,489.00	2.52
160	300122	智飞生物	537,553.00	2.47
161	301236	软通动力	533,242.00	2.45
162	600493	凤竹纺织	532,485.00	2.45
163	600455	博通股份	532,385.00	2.45
164	600206	有研新材	532,201.00	2.45
165	300535	达威股份	530,918.00	2.44
166	002830	名雕股份	530,500.00	2.44
167	600137	浪莎股份	530,006.00	2.44
168	300298	三诺生物	528,387.00	2.43
169	300575	中旗股份	528,237.00	2.43
170	300502	新易盛	528,061.00	2.43
171	002085	万丰奥威	527,900.00	2.43
172	600060	海信视像	527,678.00	2.43
173	300532	今天国际	526,846.00	2.42
174	603035	常熟汽饰	526,733.00	2.42
175	600259	广晟有色	526,163.00	2.42
176	002831	裕同科技	525,770.00	2.42
177	002959	小熊电器	525,545.00	2.42
178	000691	亚太实业	524,809.00	2.41
179	002899	英派斯	524,568.00	2.41
180	603813	原尚股份	524,456.00	2.41
181	603316	诚邦股份	523,813.00	2.41
182	300902	国安达	522,768.00	2.41
183	300669	沪宁股份	522,531.00	2.40
184	603806	福斯特	522,125.00	2.40
185	300639	凯普生物	521,515.00	2.40
186	300717	华信新材	520,778.00	2.40
187	300644	南京聚隆	520,483.00	2.39
188	300626	华瑞股份	520,389.00	2.39
189	300637	扬帆新材	520,179.00	2.39
190	603320	迪贝电气	519,431.00	2.39
191	300910	瑞丰新材	519,029.00	2.39
192	000586	汇源通信	515,971.00	2.37
193	603860	中公高科	515,873.00	2.37
194	002295	精艺股份	515,638.00	2.37
195	300521	爱司凯	515,525.00	2.37
196	300743	天地数码	515,314.00	2.37
197	603269	海鸥股份	514,867.00	2.37

198	688707	振华新材	510,669.55	2.35
199	300929	华骐环保	507,679.60	2.34
200	603112	华翔股份	507,168.00	2.33
201	000887	中鼎股份	505,619.00	2.33
202	300854	中兰环保	504,845.00	2.32
203	300823	建科机械	504,160.00	2.32
204	301079	邵阳液压	503,995.12	2.32
205	300957	贝泰妮	502,376.00	2.31
206	600893	航发动力	501,211.00	2.31
207	300899	上海凯鑫	500,060.00	2.30
208	603439	贵州三力	498,998.00	2.30
209	300308	中际旭创	495,247.00	2.28
210	300995	奇德新材	486,077.64	2.24
211	688105	诺唯赞	482,210.39	2.22
212	688029	南微医学	482,151.81	2.22
213	603185	上机数控	476,169.66	2.19
214	002063	远光软件	472,639.00	2.17
215	688981	中芯国际	469,318.44	2.16
216	000408	藏格矿业	467,908.00	2.15
217	300451	创业慧康	459,690.00	2.12
218	002036	联创电子	444,000.00	2.04
219	002139	拓邦股份	437,016.00	2.01

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600873	梅花生物	2,711,281.00	12.47
2	300260	新莱应材	2,356,514.00	10.84
3	002258	利尔化学	2,215,290.80	10.19
4	002025	航天电器	2,155,984.29	9.92
5	000519	中兵红箭	2,135,961.00	9.83
6	600456	宝钛股份	2,048,670.91	9.43
7	601001	晋控煤业	1,938,650.00	8.92
8	600546	山煤国际	1,931,540.00	8.89
9	600958	东方证券	1,925,393.00	8.86
10	300558	贝达药业	1,889,600.00	8.69
11	002352	顺丰控股	1,886,119.00	8.68
12	300674	宇信科技	1,883,834.34	8.67
13	600416	湘电股份	1,842,122.00	8.48
14	300088	长信科技	1,802,098.00	8.29

15	000997	新大陆	1,800,699.00	8.29
16	300601	康泰生物	1,732,392.00	7.97
17	605399	晨光新材	1,725,881.00	7.94
18	688262	国芯科技	1,690,920.75	7.78
19	002230	科大讯飞	1,619,643.00	7.45
20	002402	和而泰	1,618,327.00	7.45
21	002268	电科网安	1,612,209.00	7.42
22	300919	中伟股份	1,580,270.03	7.27
23	600760	中航沈飞	1,471,515.20	6.77
24	300573	兴齐眼药	1,414,636.00	6.51
25	301117	佳缘科技	1,360,770.00	6.26
26	002049	紫光国微	1,358,438.00	6.25
27	601888	中国中免	1,354,263.00	6.23
28	605123	派克新材	1,341,604.00	6.17
29	000012	南玻 A	1,331,838.00	6.13
30	600219	南山铝业	1,310,892.00	6.03
31	600438	通威股份	1,303,826.00	6.00
32	600233	圆通速递	1,293,470.00	5.95
33	300130	新国都	1,238,622.00	5.70
34	000776	广发证券	1,214,819.00	5.59
35	000975	银泰黄金	1,205,971.00	5.55
36	002821	凯莱英	1,187,163.84	5.46
37	600570	恒生电子	1,170,848.00	5.39
38	600499	科达制造	1,158,202.00	5.33
39	300724	捷佳伟创	1,156,426.00	5.32
40	300083	创世纪	1,155,047.00	5.31
41	002938	鹏鼎控股	1,137,001.00	5.23
42	603816	顾家家居	1,133,835.00	5.22
43	600276	恒瑞医药	1,131,442.00	5.21
44	603259	药明康德	1,116,919.00	5.14
45	603799	华友钴业	1,103,420.00	5.08
46	600988	赤峰黄金	1,081,010.00	4.97
47	600010	包钢股份	1,079,818.00	4.97
48	002738	中矿资源	1,059,641.00	4.88
49	000657	中钨高新	1,054,006.00	4.85
50	002735	王子新材	1,047,137.00	4.82
51	603327	福蓉科技	1,019,988.00	4.69
52	601377	兴业证券	1,013,393.00	4.66
53	002008	大族激光	1,010,786.00	4.65
54	601899	紫金矿业	999,089.00	4.60
55	002120	韵达股份	974,827.00	4.49

56	000988	华工科技	972,521.00	4.47
57	600104	上汽集团	954,410.00	4.39
58	601231	环旭电子	948,010.00	4.36
59	603986	兆易创新	945,254.00	4.35
60	000625	长安汽车	932,102.00	4.29
61	603489	八方股份	923,850.00	4.25
62	002415	海康威视	919,558.00	4.23
63	300841	康华生物	918,251.00	4.22
64	300821	东岳硅材	914,505.00	4.21
65	601666	平煤股份	912,774.88	4.20
66	300035	中科电气	910,391.00	4.19
67	300450	先导智能	904,552.00	4.16
68	300799	左江科技	893,426.00	4.11
69	300861	美畅股份	889,864.00	4.09
70	000738	航发控制	889,586.00	4.09
71	601238	广汽集团	886,681.00	4.08
72	002466	天齐锂业	874,652.00	4.02
73	002212	天融信	862,276.00	3.97
74	688128	中国电研	848,958.19	3.91
75	000155	川能动力	847,919.00	3.90
76	688196	卓越新能	844,360.39	3.89
77	300748	金力永磁	842,472.00	3.88
78	603676	卫信康	841,170.00	3.87
79	002932	明德生物	836,111.25	3.85
80	688180	君实生物	829,612.04	3.82
81	000100	TCL 科技	828,170.00	3.81
82	600315	上海家化	810,658.00	3.73
83	688518	联赢激光	783,788.69	3.61
84	300026	红日药业	773,679.00	3.56
85	000768	中航西飞	761,351.00	3.50
86	300009	安科生物	758,825.00	3.49
87	688100	威胜信息	755,554.09	3.48
88	300373	扬杰科技	750,950.00	3.46
89	600967	内蒙一机	750,435.00	3.45
90	002384	东山精密	747,156.00	3.44
91	688639	华恒生物	744,334.24	3.42
92	002057	中钢天源	731,545.00	3.37
93	002851	麦格米特	731,482.00	3.37
94	603876	鼎胜新材	731,431.00	3.37
95	002129	TCL 中环	729,553.00	3.36
96	002465	海格通信	726,918.00	3.34



97	300604	长川科技	722,133.00	3.32
98	002475	立讯精密	716,355.00	3.30
99	603131	上海沪工	714,820.00	3.29
100	600718	东软集团	714,567.00	3.29
101	300916	朗特智能	711,093.00	3.27
102	688278	特宝生物	709,947.87	3.27
103	688169	石头科技	709,498.00	3.26
104	600150	中国船舶	708,790.00	3.26
105	600030	中信证券	706,485.00	3.25
106	300584	海辰药业	704,725.00	3.24
107	603345	安井食品	703,261.00	3.24
108	600348	华阳股份	700,166.00	3.22
109	002064	华峰化学	692,812.00	3.19
110	000915	华特达因	691,897.00	3.18
111	300073	当升科技	687,410.00	3.16
112	603993	洛阳钼业	679,185.00	3.13
113	000568	泸州老窖	675,006.00	3.11
114	600160	巨化股份	672,920.00	3.10
115	600547	山东黄金	672,494.00	3.09
116	000858	五粮液	669,761.00	3.08
117	300014	亿纬锂能	663,739.58	3.05
118	600862	中航高科	663,522.00	3.05
119	002756	永兴材料	661,156.00	3.04
120	603901	永创智能	658,525.00	3.03
121	600536	中国软件	648,677.00	2.98
122	002056	横店东磁	647,555.00	2.98
123	300481	濮阳惠成	644,602.00	2.97
124	000963	华东医药	643,556.00	2.96
125	603529	爱玛科技	636,569.50	2.93
126	002556	辉隆股份	634,991.00	2.92
127	600089	特变电工	630,945.00	2.90
128	300348	长亮科技	625,265.00	2.88
129	600750	江中药业	623,986.00	2.87
130	603214	爱婴室	613,964.00	2.82
131	301021	英诺激光	611,817.00	2.82
132	600521	华海药业	603,691.00	2.78
133	603668	天马科技	602,852.00	2.77
134	300634	彩讯股份	597,288.08	2.75
135	603859	能科科技	597,039.00	2.75
136	600966	博汇纸业	592,863.00	2.73
137	601615	明阳智能	586,344.00	2.70

138	603936	博敏电子	585,614.00	2.69
139	600201	生物股份	583,082.00	2.68
140	600060	海信视像	581,529.00	2.68
141	002283	天润工业	578,661.00	2.66
142	600577	精达股份	578,102.00	2.66
143	300059	东方财富	576,575.00	2.65
144	603501	韦尔股份	570,606.06	2.63
145	603035	常熟汽饰	568,949.00	2.62
146	002371	北方华创	564,566.00	2.60
147	300532	今天国际	564,300.00	2.60
148	002171	楚江新材	564,200.00	2.60
149	300502	新易盛	559,110.00	2.57
150	600641	万业企业	559,090.00	2.57
151	300095	华伍股份	557,278.00	2.56
152	002959	小熊电器	556,271.00	2.56
153	300474	景嘉微	552,237.00	2.54
154	603987	康德莱	551,855.00	2.54
155	600455	博通股份	551,430.00	2.54
156	002085	万丰奥威	548,848.00	2.53
157	688176	亚虹医药	546,189.24	2.51
158	600711	盛屯矿业	546,139.00	2.51
159	300298	三诺生物	545,957.00	2.51
160	600259	广晟有色	541,765.00	2.49
161	300207	欣旺达	538,475.00	2.48
162	601168	西部矿业	538,200.00	2.48
163	002036	联创电子	536,606.00	2.47
164	603806	福斯特	531,141.00	2.44
165	000810	创维数字	526,657.00	2.42
166	600206	有研新材	526,107.00	2.42
167	300575	中旗股份	525,000.00	2.42
168	002241	歌尔股份	524,575.00	2.41
169	300910	瑞丰新材	524,103.00	2.41
170	603112	华翔股份	522,798.00	2.41
171	002831	裕同科技	521,524.00	2.40
172	300902	国安达	517,249.00	2.38
173	688016	心脉医疗	514,621.62	2.37
174	600493	凤竹纺织	513,609.00	2.36
175	000691	亚太实业	513,000.00	2.36
176	688063	派能科技	511,336.43	2.35
177	301079	邵阳液压	509,036.00	2.34
178	300122	智飞生物	508,143.00	2.34

179	601117	中国化学	507,738.00	2.34
180	603712	七一二	504,263.00	2.32
181	002899	英派斯	500,816.00	2.30
182	000408	藏格矿业	499,918.00	2.30
183	300669	沪宁股份	499,589.00	2.30
184	300639	凯普生物	497,874.00	2.29
185	300929	华骐环保	497,260.00	2.29
186	603813	原尚股份	496,978.00	2.29
187	600137	浪莎股份	496,279.00	2.28
188	002830	名雕股份	493,441.00	2.27
189	300308	中际旭创	491,178.89	2.26
190	300593	新雷能	490,189.00	2.26
191	300823	建科机械	489,990.00	2.25
192	000887	中鼎股份	489,630.00	2.25
193	603316	诚邦股份	489,214.00	2.25
194	000933	神火股份	487,849.00	2.24
195	688707	振华新材	485,891.05	2.24
196	300521	爱司凯	485,828.00	2.24
197	300717	华信新材	485,775.00	2.24
198	300743	天地数码	485,578.00	2.23
199	300854	中兰环保	485,379.00	2.23
200	300626	华瑞股份	485,278.00	2.23
201	300899	上海凯鑫	483,369.00	2.22
202	601318	中国平安	481,804.00	2.22
203	300644	南京聚隆	481,164.00	2.21
204	603860	中公高科	477,303.00	2.20
205	603320	迪贝电气	477,110.00	2.20
206	603439	贵州三力	476,755.00	2.19
207	300535	达威股份	474,798.00	2.18
208	300637	扬帆新材	474,763.00	2.18
209	002139	拓邦股份	472,603.00	2.17
210	688981	中芯国际	471,440.54	2.17
211	603269	海鸥股份	470,754.00	2.17
212	002063	远光软件	470,556.00	2.17
213	688105	诺唯赞	469,523.46	2.16
214	002295	精艺股份	469,285.00	2.16
215	601633	长城汽车	468,747.00	2.16
216	300957	贝泰妮	468,397.00	2.16
217	000586	汇源通信	467,209.00	2.15
218	301236	软通动力	465,983.00	2.14
219	688596	正帆科技	458,299.58	2.11

220	688029	南微医学	458,212.99	2.11
221	603185	上机数控	457,680.00	2.11
222	600893	航发动力	444,632.00	2.05
223	603868	飞科电器	443,709.00	2.04
224	000333	美的集团	443,164.00	2.04
225	002801	微光股份	440,662.00	2.03
226	300995	奇德新材	434,699.82	2.00

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	225,173,673.63
卖出股票收入（成交）总额	223,924,398.10

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行、招商银行、中国平安、中信证券外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

(2) 招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

(3) 中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局深圳市分局的行政处罚。

(4) 中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会、中国证券监督管理委员会深圳监管局的行政监管措施。

截至本报告期末，兴业银行(601166)、招商银行(600036)、中国平安(601318)、中信证券(600030)为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，上述股票在我们的多因素模型中综合得分较高，且我们认为上述行政监管措施并不影响这些公司的长期竞争力，因此本基金才继续持有。本基金对上述股票的投资符合法律法规和公司制度。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,075.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,910.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	35,985.85

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,301	7,195.67	1,182.74	0.01%	9,360,385.88	99.99%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	51.49	0.0006%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年08月09日）基金份额总额	1,249,071,475.18
本报告期期初基金份额总额	9,661,521.83
本报告期基金总申购份额	729,781.91

减：本报告期基金总赎回份额	1,029,735.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,361,568.62

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

王学明先生、卫濛濛女士担任公司董事，赵忆波先生、张一冰女士不再担任公司董事，于东升先生不再担任公司副总经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为人民币 28,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：3 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 06 月 02 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会

构	
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	未按期完成境外子公司股权架构简化工作。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	截至报告期末,公司已根据监管要求完成境外子公司股权架构简化工作。
其他	-
措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	旗下基金因证券市场波动、基金规模变动导致证券投资比例超标,未能在规定时间内调整。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	截至报告披露日,已调整比例至合规。
其他	-

### 11.6.2 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,本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	135,367,542.42	30.14%	125,398.94	30.10%	-
华西证券	1	218,590,050.19	48.67%	203,576.46	48.86%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	95,140,479.12	21.18%	87,655.08	21.04%	-



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》。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	3,567,610.88	55.90%	3,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	2,815,023.45	44.10%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于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	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年	《证券时报》、《上海证	2022 年 01 月 24

	第 4 季度报告提示性公告	券报》、《中国证券报》、 《证券日报》	日
4	诺安多策略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
5	诺安基金管理有限公司关于运用固有资 金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022 年 01 月 31 日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参 加第一创业开展的基金费率优惠活动的 公告	《证券时报》、《上海证 券报》、《中国证券报》、 《证券日报》	2022 年 02 月 10 日
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金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
8	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
9	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
10	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
11	诺安多策略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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	诺安多策略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
17	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
18	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
19	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 05 月 27

	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	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	日
20	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
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为代销机构并开通定投、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
22	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加西南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 07 月 07 日
23	诺安多策略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 07 月 08 日
24	诺安多策略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 07 月 08 日
25	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2022 年 07 月 08 日
26	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 07 月 21 日
27	诺安多策略混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2022 年 07 月 21 日
28	诺安多策略混合型证券投资基金 2022 年中期报告	基金管理人网站	2022 年 08 月 31 日
29	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 08 月 31 日
30	诺安基金管理有限公司关于终止洛阳银行销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 09 月 01 日
31	诺安基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 09 月 24 日
32	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 10 月 26 日
33	诺安多策略混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2022 年 10 月 26 日
34	诺安多策略混合型证券投资基金变更基	《证券时报》	2022 年 11 月 03 日

	金经理的公告		日
35	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第 2 期	基金管理人网站	2022 年 11 月 07 日
36	诺安多策略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 11 月 07 日
37	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2022 年 11 月 07 日
38	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在代销渠道的申购起点金额及最小追加申购金额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 11 月 10 日

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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 2 月 21 日披露了《诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增聘基金经理的公告》，自 2023 年 2 月 21 日起，增聘孔宪政先生担任本基金基金经理。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- ① 中国证券监督管理委员会批准诺安多策略股票型证券投资基金募集的文件。
- ② 《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》。
- ③ 《诺安多策略混合型证券投资基金托管协议》。

④《诺安基金管理有限公司关于诺安多策略股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥报告期内诺安多策略混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2023 年 03 月 31 日