

诺安和鑫灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
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	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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 ..	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	18
7.3	净资产（基金净值）变动表	20
7.4	报表附注	21
§ 8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	71

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	71
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	71
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	71
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	71
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12	投资组合报告附注	71
§ 9	基金份额持有人信息	72
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§ 10	开放式基金份额变动	73
§ 11	重大事件揭示	73
11.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	77
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13	备查文件目录	81
13.1	备查文件目录	81
13.2	存放地点	81
13.3	查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安和鑫混合
基金主代码	002560
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 10 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,583,672,492.98 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由诺安和鑫保本混合型证券投资基金首个保本周期到期后转型而来，并自 2018 年 5 月 10 日起转型正式生效。

2.2 基金产品说明

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

	<p>估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×60%+中证全债指数×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益的品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95559
传真	0755-83026677	021-62701216
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	李强	任德奇

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	-166,850,832.08	1,082,799,525.96	-160,309,416.78
本期利润	-1,226,415,838.18	1,443,294,291.43	-318,532,303.39
加权平均基金份额本期利润	-0.4680	0.4040	-0.0882
本期加权平均净值利润率	-35.52%	25.95%	-6.13%
本期基金份额净值增长率	-29.77%	18.18%	39.34%
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	-28,877,135.60	128,131,806.11	-1,696,686,599.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0112	0.0546	-0.3030
期末基金资产净值	3,146,335,734.14	4,072,081,326.31	8,216,718,136.80
期末基金份额净值	1.2178	1.7340	1.4673
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	17.21%	66.89%	41.22%

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	0.02%	1.95%	1.12%	0.77%	-1.10%	1.18%
过去六个月	-6.92%	1.87%	-7.70%	0.66%	0.78%	1.21%
过去一年	-29.77%	2.08%	-11.98%	0.77%	-17.79%	1.31%
过去三年	15.65%	2.41%	2.95%	0.78%	12.70%	1.63%
自基金合同生效起至今	17.21%	2.20%	11.83%	0.78%	5.38%	1.42%

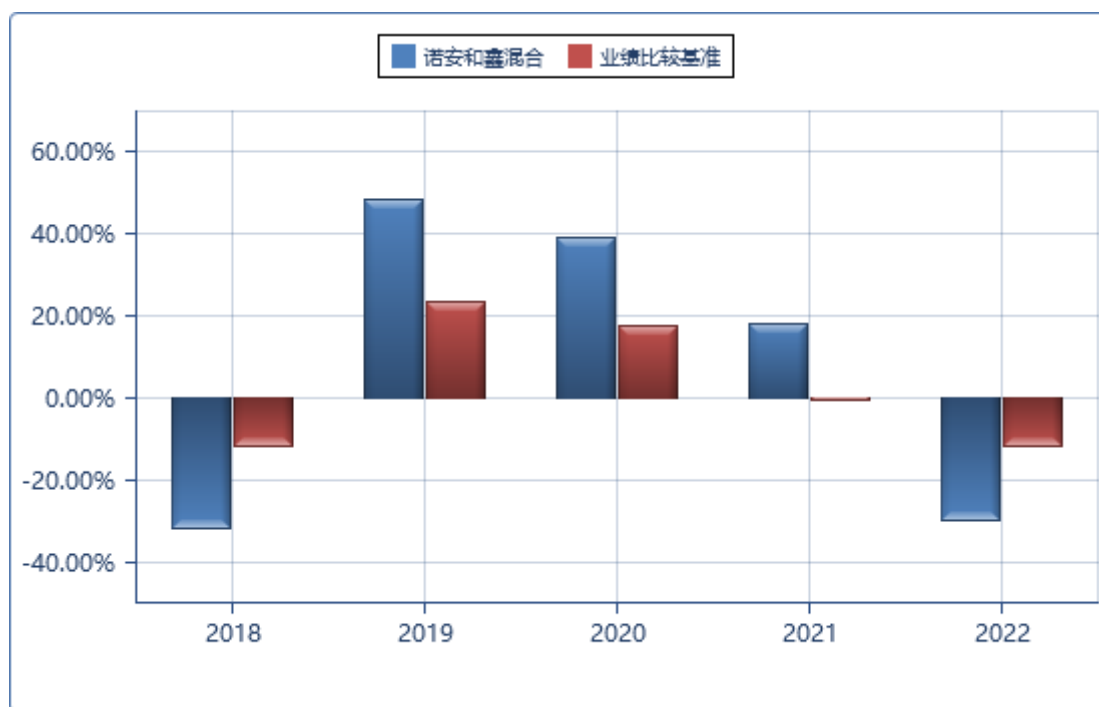
注：2018年05月10日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。

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



注：2018年05月10日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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		
蔡嵩松	本基金基金经理	2019年03月14日	-	7年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、华泰证券股份有限公司，2017年11月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员，现任投资管理部副总经理。2019年2月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年5月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资

					资基金基金经理, 2022 年 7 月起任诺安优化配置混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 8 月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2022 年开年市场不平静，元旦过后，受美联储加息预期的影响，市场风险偏好急剧下降，出现了疯狂杀估值的阶段，尤其是高位的赛道股首当其冲，半导体、新能源、军工等成长赛道跌幅居前，消费、医药等赛道持续低迷；2 月爆发的俄乌冲突进一步冲击全球投资者的风险偏好，外资对全球新兴市场的投资呈现出了加速流出的趋势；而新一轮全球及国内疫情的爆发，投资者对于未来经济的担忧主导了市场，海外通胀高企流动性收紧，国内疫情带来的经济增速压力大，市场渐渐只聚焦于稳增长的相关板块，对于具有长期产业趋势的成长板块完全规避，造成成长赛道一季度出现了单边下跌的行情。

二季度因为疫情的影响，芯片行业最大的下游应用消费电子面临较大压力。进入六月份跌幅有所收窄，但是依然没有恢复到去年同期的正常水平。虽然某些品类在电动车、新能源等下游拉动下有结构性的机会，但相比整个行业的疲软杯水车薪。在宏观环境相对友好的情况下，芯片板块真正的独立行情需要消费电子出现实质性的拐点，而这个时间点渐行渐近，但仍需观察，目前股价处于低位区间。另外，芯片设备材料板块景气度持续高企，中报同比预期接近翻倍增长，而板块却在情绪的影响下持续向下，基本面和股价出现了明显的背离。

三季度在佩洛西窜访台湾的刺激下，叠加美国禁售 14nm 以上制程设备、美国科学芯片基金扶持本地产业、美国意图成立 CHIP4 联盟、美国计划禁运 EDA 工具等遏制中国芯片产业的政策，国人的

民族自尊心被彻底激发，整个板块在 EDA 的带领下，出现了一波急涨反弹行情。但是，2022 年行情演绎的关键词是景气度至上，短期景气度的权重在今天的行情里达到了极致。由于需求受到疫情影响，芯片行业的景气度在今年是所有行业里最差的，最直观的表现就是消费电子需求大幅下滑和库存累积。因此四季度板块持续回落，几乎收于全年最低点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.2178 元，本报告期内基金份额净值增长率为-29.77%，同期业绩比较基准收益率为-11.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内疫情政策的全面放开，过去三年的疫情终于落下帷幕。未来的主基调围绕疫后经济恢复，虽然恢复节奏曲折，但是一切只会更好。左右市场情绪的疫情因素大大降低，未来的市场终于回归基本面本身，站在当下的时间点，很多板块已经非常具备投资价值。

回归科技板块，芯片板块的两大主要矛盾：一是景气度拐点；二是美国制裁。都已到了临界拐点的时候。景气度下行在四季度继续消化之后，随着经济恢复需求重启，库存去化会进一步加速；而美国对中国半导体的制裁暨国庆期间极限施压之后，进一步的制裁已经乏善可陈。无论设备材料板块还是设计板块，目前已经具备较高的投资性价比。

因此，在当前的市场位置，积极布局，迎接即将到来的科技大行情。

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，本基金每年收益分配次数最多为六次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红。

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

2022 年度，基金托管人在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022 年度，诺安基金管理有限公司在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2022 年度，诺安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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 21966 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	诺安和鑫灵活配置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>我们审计了诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“诺安和鑫基金”)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,公允反映了诺安和鑫基金 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	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

	<p>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，我们独立于诺安和鑫基金，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>诺安和鑫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。其他信息包括诺安和鑫基金 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和鑫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和鑫基金、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和鑫基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(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，就可能对诺安和鑫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和鑫基金不能持续经营。</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：诺安和鑫灵活配置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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	500,802,712.55	357,591,513.97
结算备付金		691,207.40	2,517,933.75
存出保证金		729,790.70	1,604,715.67
交易性金融资产	7.4.7.2	2,652,972,465.31	3,714,611,642.86
其中：股票投资		2,652,972,465.31	3,714,611,642.86
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		-	9,994,207.33
应收股利		-	-

应收申购款		1,481,188.22	3,835,398.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	68,568.82
资产总计		3,156,677,364.18	4,090,223,981.09
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,694,094.18	10,948,221.20
应付管理人报酬		4,197,784.57	5,170,210.40
应付托管费		699,630.76	861,701.71
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	7.4.7.6	750,120.53	1,162,521.47
负债合计		10,341,630.04	18,142,654.78
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	2,583,672,492.98	2,348,357,065.80
未分配利润	7.4.7.8	562,663,241.16	1,723,724,260.51
净资产合计		3,146,335,734.14	4,072,081,326.31
负债和净资产总计		3,156,677,364.18	4,090,223,981.09

注：①：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2178 元，基金份额总额 2,583,672,492.98 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：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、营业总收入		-1,165,814,592.04	1,558,311,787.43
1. 利息收入		2,509,110.93	3,179,671.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,509,110.93	2,676,772.46
债券利息收入		-	502,899.45
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）		-116,736,065.90	1,149,787,278.11
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-121,379,508.36	1,143,895,529.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,088.98	-375,982.00
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	4,641,353.48	6,267,730.56
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	-1,059,565,006.10	360,494,765.47
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	7,977,369.03	44,850,071.94
减：二、营业总支出		60,601,246.14	115,017,496.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	51,712,669.23	83,572,420.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,618,778.10	13,928,736.82
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	269,798.81	17,516,338.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,226,415,838.18	1,443,294,291.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,226,415,838.18	1,443,294,291.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,226,415,838.18	1,443,294,291.43

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：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 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）	2,348,357,065.80	-	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31
二、本期期初净资产（基金净值）	2,348,357,065.80	-	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	235,315,427.18	-	-1,161,061,019.35	-925,745,592.17
（一）、综合收益总额	-	-	-1,226,415,838.18	-1,226,415,838.18
（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）	235,315,427.18	-	65,354,818.83	300,670,246.01
其中：1. 基金申购款	1,912,141,137.00	-	620,183,764.09	2,532,324,901.09
2. 基金赎回款	-1,676,825,709.82	-	-554,828,945.26	-2,231,654,655.08
（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）	2,583,672,492.98	-	562,663,241.16	3,146,335,734.14
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）	5,599,725,454.70	-	2,616,992,682.10	8,216,718,136.80
二、本期期初净资产	5,599,725,454.70	-	2,616,992,682.10	8,216,718,136.80

产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,251,368,388.90	-	-893,268,421.59	-4,144,636,810.49
（一）、综合收益总额	-	-	1,443,294,291.43	1,443,294,291.43
（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）	-3,251,368,388.90	-	-2,336,562,713.02	-5,587,931,101.92
其中：1. 基金申购款	4,793,507,549.28	-	2,945,496,061.01	7,739,003,610.29
2. 基金赎回款	-8,044,875,938.18	-	-5,282,058,774.03	-13,326,934,712.21
（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）	2,348,357,065.80	-	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31

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

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金是根据原诺安和鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“诺安和鑫保本混合基金”)《诺安和鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由原诺安和鑫保本混合基金转型而来。原诺安和鑫保本混合基金为契约型开放式,存续期限不定,原诺安和鑫保本混合基金第一个保本期于 2018 年 5 月 2 日到期,原诺安和鑫保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,自 2018 年 5 月 10 日起,诺安和鑫保本混合基金更名为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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×60%+中证全债指数×40%。

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》、《诺安和鑫灵活配置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。

本财务报表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稅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稅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稅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稅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)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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利

自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 基金收益分配后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；

(d) 每一基金份额享有同等分配权；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，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、应收证券清算款和应收申购款,金额分别为 357,591,513.97 元、2,517,933.75 元、1,604,715.67 元、68,568.82 元、9,994,207.33 元和 3,835,398.69 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、应收清算款和应收申购款,金额分别为 357,658,227.59 元、2,519,066.85 元、1,605,437.77 元、0.00 元、9,994,207.33 元和 3,835,398.69 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 3,714,611,642.86 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 3,714,611,642.86 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 10,948,221.20 元、5,170,210.40 元、861,701.71 元、893,584.63 元和 19,936.84 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 10,948,221.20 元、5,170,210.40 元、861,701.71 元、893,584.63 元和 19,936.84 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	500,802,712.55	357,591,513.97
等于：本金	500,703,173.40	357,591,513.97
加：应计利息	99,539.15	-
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	500,802,712.55	357,591,513.97
----	----------------	----------------

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		3,348,635,327.30	-	2,652,972,465.31	-695,662,861.99
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		3,348,635,327.30	-	2,652,972,465.31	-695,662,861.99
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		3,350,709,498.75	-	3,714,611,642.86	363,902,144.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,350,709,498.75	-	3,714,611,642.86	363,902,144.11

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	-	68,568.82
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	68,568.82

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	7,379.93	19,936.84
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	503,440.60	893,584.63
其中：交易所市场	503,440.60	893,584.63
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	239,300.00	249,000.00
合计	750,120.53	1,162,521.47

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	2,348,357,065.80	2,348,357,065.80
本期申购	1,912,141,137.00	1,912,141,137.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,676,825,709.82	-1,676,825,709.82
本期末	2,583,672,492.98	2,583,672,492.98

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	128,131,806.11	1,595,592,454.40	1,723,724,260.51

本期利润	-166,850,832.08	-1,059,565,006.10	-1,226,415,838.18
本期基金份额交易产生的变动数	9,841,890.37	55,512,928.46	65,354,818.83
其中：基金申购款	6,769,269.54	613,414,494.55	620,183,764.09
基金赎回款	3,072,620.83	-557,901,566.09	-554,828,945.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,877,135.60	591,540,376.76	562,663,241.16

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	2,440,538.31	2,602,578.72
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	28,546.86	40,010.25
其他	40,025.76	34,183.49
合计	2,509,110.93	2,676,772.46

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 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
卖出股票成交总额	2,483,930,430.93	8,219,200,991.42
减：卖出股票成本总额	2,598,667,178.35	7,075,305,461.87
减：交易费用	6,642,760.94	-
买卖股票差价收入	-121,379,508.36	1,143,895,529.55

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	7,174.98	-
债券投资收益—买卖债券（债转股及 债券到期兑付）差价收入	-5,086.00	-375,982.00
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	2,088.98	-375,982.00

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	25,449,549.74	823,349,222.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,805,297.00	812,443,990.90
减：应计利息总额	649,338.74	11,281,213.29
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-5,086.00	-375,982.00

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 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
股票投资产生的股利收益	4,641,353.48	6,267,730.56
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,641,353.48	6,267,730.56

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	-1,059,565,006.10	360,494,765.47
--股票投资	-1,059,565,006.10	360,494,765.47
--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	-1,059,565,006.10	360,494,765.47

7.4.7.15 其他收入

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
基金赎回费收入	7,843,727.45	44,255,431.72
基金转换费收入	133,641.58	594,640.22
合计	7,977,369.03	44,850,071.94

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	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
审计费用	110,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,298.81	3,146.89
律师费	-	2,000.00
账户维护费	37,500.00	45,000.00
交易费用	-	17,224,991.35
其他	-	1,200.00
合计	269,798.81	17,516,338.24

注：此处“其他”列示的是银行间市场清算所股份有限公司查询服务费。

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
交通银行股份有限公司	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	51,712,669.23	83,572,420.94
其中：支付销售机构的客户维护费	15,170,863.31	32,820,555.82

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	8,618,778.10	13,928,736.82

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。

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
交通银行股份有限公司-活期存款	500,802,712.55	2,440,538.31	357,591,513.97	2,602,578.72

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301095	广立微	2022年07月28日	6个月	新股锁定	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301121	紫建电子	2022年08月01日	6个月	新股锁定	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022年08月03日	6个月	新股锁定	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022年08月19日	6个月	新股锁定	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-

		日								
301161	唯万密封	2022年09月06日	6个月	新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022年08月10日	6个月	新股锁定	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股锁定	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301197	工大科雅	2022年07月29日	6个月	新股锁定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股锁定	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301227	森鹰窗业	2022年09月16日	6个月	新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股锁定	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022年08月31日	6个月	新股锁定	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股锁定	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股锁定	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股锁定	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022年07月21日	6个月	新股锁定	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022年08月19日	6个月	新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-

301276	嘉曼服饰	2022年09月01日	6个月	新股锁定	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022年11月09日	6个月	新股锁定	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股锁定	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301282	金禄电子	2022年08月18日	6个月	新股锁定	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022年08月26日	6个月	新股锁定	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022年09月21日	6个月	新股锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股锁定	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022年08月26日	6个月	新股锁定	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022年08月09日	6个月	新股锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022年07月19日	6个月	新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301308	江波龙	2022年07月27日	6个月	新股锁定	55.67	56.72	409	22,769.03	23,198.48	-
301309	万得凯	2022年09月08日	6个月	新股锁定	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船	2022年	6个月	新股	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-

	智能	11月23日		锁定						
301313	凡拓数创	2022年09月22日	6个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年09月29日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年08月03日	6个月	新股锁定	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022年09月22日	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301326	捷邦科技	2022年09月09日	6个月	新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301327	华宝新能	2022年09月08日	6个月	新股锁定	237.50	176.97	121	28,737.50	21,413.37	-
301328	维峰电子	2022年08月30日	6个月	新股锁定	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022年08月10日	6个月	新股锁定	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股锁定	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301338	凯格精机	2022年08月08日	6个月	新股锁定	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022年09月02日	6个月	新股锁定	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022年08月30日	6个月	新股锁定	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022年11月02日	6个月	新股锁定	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301363	美好医疗	2022年09月28日	6个月	新股锁定	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-

		日								
301368	丰立智能	2022年12月07日	6个月	新股锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股锁定	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301398	星源卓镁	2022年12月08日	6个月	新股锁定	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
600703	三安光电	2022年12月14日	6个月	非公开发行锁定	15.50	16.04	2,258,064	34,999,992.00	36,219,346.56	-
688271	联影医疗	2022年08月12日	6个月	新股锁定	109.88	171.68	7,365	809,266.20	1,264,423.20	-
688371	菲沃泰	2022年07月26日	6个月	新股锁定	18.54	19.61	16,203	300,403.62	317,740.83	-
688401	路维光电	2022年08月10日	6个月	新股锁定	25.08	41.55	4,947	124,070.76	205,547.85	-
688455	科捷智能	2022年09月07日	6个月	新股锁定	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-

注：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。

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交通银行股份有限公司，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(净资产)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可

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、存出保证金和应收申购款等。

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	500,802,712.55	-	-	-	-	500,802,712.55
结算备付金	691,207.40	-	-	-	-	691,207.40
存出保证金	729,790.70	-	-	-	-	729,790.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-2,652,972,465.31	-2,652,972,465.31
应收申购款	300.00	-	-	-	1,480,888.22	1,481,188.22
资产总计	502,224,010.65	-	-	-	-2,654,453,353.53	3,156,677,364.18
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,694,094.18	4,694,094.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,197,784.57	4,197,784.57
应付托管费	-	-	-	-	699,630.76	699,630.76
其他负债	-	-	-	-	750,120.53	750,120.53
负债总计	-	-	-	-	10,341,630.04	10,341,630.04
利率敏感度缺口	502,224,010.65	-	-	-	-2,644,111,723.49	3,146,335,734.14
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	357,591,513.97	-	-	-	-	357,591,513.97
结算备付金	2,517,933.75	-	-	-	-	2,517,933.75
存出保证金	1,604,715.67	-	-	-	-	1,604,715.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-3,714,611,642.86	-3,714,611,642.86
应收清算款	-	-	-	-	9,994,207.33	9,994,207.33
其他资产	-	-	-	-	68,568.82	68,568.82
应收申购款	1,955.00	-	-	-	3,833,443.69	3,835,398.69
资产总计	361,716,118.39	-	-	-	-3,728,507,862.70	4,090,223,981.09
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	10,948,221.20	10,948,221.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,170,210.40	5,170,210.40
应付托管费	-	-	-	-	861,701.71	861,701.71
其他负债	-	-	-	-	1,162,521.47	1,162,521.47
负债总计	-	-	-	-	18,142,654.78	18,142,654.78
利率敏感度缺口	361,716,118.39	-	-	-	-3,710,365,207.92	4,072,081,326.31

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 0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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 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	2,652,972,465.31	84.32	3,714,611,642.86	91.22
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	2,652,972,465.31	84.32	3,714,611,642.86	91.22

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%	123,175,587.53	164,990,506.42
	业绩比较基准下降 5%	-123,175,587.53	-164,990,506.42

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	2,614,026,606.67	3,709,853,381.27
第二层次	-	4,758,261.59
第三层次	38,945,858.64	-
合计	2,652,972,465.31	3,714,611,642.86

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	34,999,992.00	34,999,992.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	9,002,572.91	9,002,572.91
转出第三层次	-	6,879,489.97	6,879,489.97
当期利得或损失总额	-	1,822,783.70	1,822,783.70
其中：计入损益的利得或损失	-	1,822,783.70	1,822,783.70
期末余额	-	38,945,858.64	38,945,858.64
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,786,114.10	1,786,114.10
项目	上年度可比同期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估值	不可观察输入值
----	--------	-------	---------

	值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	38,945,858.64	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%-247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

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	2,652,972,465.31	84.04
	其中:股票	2,652,972,465.31	84.04
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	501,493,919.95	15.89
8	其他各项资产	2,210,978.92	0.07
9	合计	3,156,677,364.18	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	180,376.84	0.01
B	采矿业	1,301,439.00	0.04
C	制造业	1,783,607,519.44	56.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	230,112.94	0.01
E	建筑业	115,588.33	0.00
F	批发和零售业	1,323,947.25	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	165,670.15	0.01
H	住宿和餐饮业	150,574.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	860,389,804.03	27.35
J	金融业	349,306.48	0.01
K	房地产业	129,556.95	0.00
L	租赁和商务服务业	30,661.01	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,116,761.63	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,236,664.03	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,972.76	0.00
Q	卫生和社会工作	1,407,899.35	0.04
R	文化、体育和娱乐业	214,610.32	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,652,972,465.31	84.32

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	600536	中国软件	5,017,139	292,649,717.87	9.30
2	002180	纳思达	4,779,989	248,033,629.21	7.88
3	300661	圣邦股份	1,411,638	243,648,718.80	7.74
4	688521	芯原股份	5,208,429	229,535,466.03	7.30
5	002371	北方华创	1,009,833	227,515,374.90	7.23
6	688126	沪硅产业	12,910,029	227,345,610.69	7.23

7	002268	电科网安	5,686,004	173,593,702.12	5.52
8	688012	中微公司	1,754,265	171,935,512.65	5.46
9	300604	长川科技	3,628,228	161,746,404.24	5.14
10	688082	盛美上海	1,152,066	92,050,073.40	2.93
11	603501	韦尔股份	1,160,789	89,485,224.01	2.84
12	688153	唯捷创芯	1,959,569	71,974,969.37	2.29
13	600703	三安光电	3,849,864	63,534,634.56	2.02
14	688152	麒麟信安	337,753	57,721,987.70	1.83
15	688409	富创精密	532,997	57,622,305.67	1.83
16	301208	中亦科技	1,077,727	54,888,636.11	1.74
17	688372	伟测科技	550,694	52,448,096.56	1.67
18	301095	广立微	517,599	46,079,959.37	1.46
19	688120	华海清科	139,010	31,214,695.50	0.99
20	600938	中国海油	84,004	1,276,860.80	0.04
21	688271	联影医疗	7,365	1,264,423.20	0.04
22	301269	华大九天	11,677	1,049,259.55	0.03
23	688439	振华风光	7,096	843,572.48	0.03
24	301238	瑞泰新材	34,966	786,385.34	0.02
25	688172	燕东微	40,177	762,559.46	0.02
26	301267	华夏眼科	10,052	727,950.26	0.02
27	688114	华大智造	5,336	592,882.96	0.02
28	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.02
29	300979	华利集团	9,246	528,039.06	0.02
30	688428	诺诚健华	35,350	498,788.50	0.02
31	688503	聚和材料	3,277	488,633.47	0.02
32	688279	峰昭科技	5,505	473,980.50	0.02
33	688112	鼎阳科技	4,901	457,018.25	0.01
34	301153	中科江南	3,973	422,886.12	0.01
35	301239	普瑞眼科	5,747	405,209.20	0.01
36	688728	格科微	23,033	403,998.82	0.01
37	688392	骄成超声	2,745	397,228.95	0.01
38	301219	腾远钴业	5,762	397,174.66	0.01
39	301175	中科环保	63,694	386,240.38	0.01
40	688275	万润新能	2,166	379,374.90	0.01
41	301029	怡合达	5,540	364,199.60	0.01
42	688639	华恒生物	2,302	357,385.50	0.01
43	300973	立高食品	3,593	345,574.74	0.01
44	688798	艾为电子	3,592	343,143.76	0.01
45	301200	大族数控	8,566	335,787.20	0.01
46	688400	凌云光	13,111	334,723.83	0.01
47	301050	雷电微力	4,192	323,496.64	0.01

48	301268	铭利达	6,407	321,695.47	0.01
49	301216	万凯新材	11,195	321,072.60	0.01
50	688371	菲沃泰	16,203	317,740.83	0.01
51	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.01
52	688091	上海谊众	4,480	312,704.00	0.01
53	688660	电气风电	51,238	307,940.38	0.01
54	688262	国芯科技	7,129	298,063.49	0.01
55	301302	华如科技	4,651	297,803.53	0.01
56	688131	皓元医药	2,737	296,636.06	0.01
57	688381	帝奥微	7,362	292,418.64	0.01
58	605117	德业股份	878	290,793.60	0.01
59	688351	微电生理	10,946	289,740.62	0.01
60	688630	芯碁微装	3,397	283,445.68	0.01
61	688320	禾川科技	6,048	283,046.40	0.01
62	688373	盟科药业	31,886	282,509.96	0.01
63	688231	隆达股份	7,835	279,866.20	0.01
64	301090	华润材料	27,635	278,008.10	0.01
65	301018	申菱环境	7,811	267,526.75	0.01
66	688190	云路股份	3,026	265,924.88	0.01
67	688432	有研硅	20,044	265,382.56	0.01
68	688035	德邦科技	4,981	257,069.41	0.01
69	688383	新益昌	2,701	256,270.88	0.01
70	301207	华兰疫苗	5,687	253,526.46	0.01
71	688776	国光电气	1,447	253,340.76	0.01
72	301215	中汽股份	47,421	245,166.57	0.01
73	688238	和元生物	12,836	244,654.16	0.01
74	301099	雅创电子	3,510	241,944.30	0.01
75	688789	宏华数科	1,400	241,682.00	0.01
76	688276	百克生物	3,486	240,917.46	0.01
77	301308	江波龙	4,090	240,303.86	0.01
78	301168	通灵股份	3,281	237,445.97	0.01
79	688269	凯立新材	2,717	233,118.60	0.01
80	301327	华宝新能	1,208	226,041.12	0.01
81	688205	德科立	4,519	225,407.72	0.01
82	688306	均普智能	47,094	223,696.50	0.01
83	301330	熵基科技	6,937	222,941.03	0.01
84	301263	泰恩康	6,813	221,422.50	0.01
85	688182	灿勤科技	18,387	211,082.76	0.01
86	301391	卡莱特	2,470	210,066.09	0.01
87	688800	瑞可达	1,967	209,839.56	0.01
88	301152	天力锂能	4,326	207,837.72	0.01

89	688401	路维光电	4,947	205,547.85	0.01
90	688489	三未信安	1,995	202,153.35	0.01
91	688533	上声电子	3,493	200,498.20	0.01
92	688668	鼎通科技	3,037	200,442.00	0.01
93	688677	海泰新光	1,768	199,784.00	0.01
94	301349	信德新材	1,798	197,357.88	0.01
95	688403	汇成股份	18,553	194,620.97	0.01
96	301286	侨源股份	7,839	193,701.69	0.01
97	301120	新特电气	10,311	191,887.71	0.01
98	688317	之江生物	5,740	191,716.00	0.01
99	688498	源杰科技	1,582	189,096.46	0.01
100	688308	欧科亿	2,457	185,503.50	0.01
101	301096	百诚医药	2,714	185,393.34	0.01
102	301363	美好医疗	4,447	184,567.07	0.01
103	301171	易点天下	9,845	183,224.80	0.01
104	688690	纳微科技	3,477	180,004.29	0.01
105	688201	信安世纪	3,151	178,913.78	0.01
106	688560	明冠新材	3,832	177,421.60	0.01
107	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.01
108	688206	概伦电子	6,000	168,720.00	0.01
109	688280	精进电动	21,211	167,566.90	0.01
110	688059	华锐精密	1,023	164,703.00	0.01
111	301039	中集车辆	20,640	164,500.80	0.01
112	301256	华融化学	18,308	163,307.36	0.01
113	688237	超卓航科	2,891	161,664.72	0.01
114	301127	天源环保	16,843	160,850.65	0.01
115	301296	新巨丰	10,411	160,276.85	0.01
116	688161	威高骨科	3,069	160,171.11	0.01
117	301103	何氏眼科	5,065	159,648.80	0.01
118	300996	普联软件	3,856	158,288.80	0.01
119	301089	拓新药业	2,198	158,256.00	0.01
120	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.01
121	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.00
122	301328	维峰电子	1,910	153,250.76	0.00
123	301223	中荣股份	8,148	152,636.35	0.00
124	688621	阳光诺和	1,485	152,064.00	0.00
125	688184	帕瓦股份	4,358	151,353.34	0.00
126	301073	君亭酒店	2,148	150,574.80	0.00
127	605111	新洁能	1,940	150,505.20	0.00
128	301339	通行宝	9,127	150,339.65	0.00
129	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.00

130	688766	普冉股份	986	149,822.70	0.00
131	301377	鼎泰高科	7,695	149,789.85	0.00
132	301121	紫建电子	2,896	148,772.60	0.00
133	301069	凯盛新材	5,386	148,545.88	0.00
134	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.00
135	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.00
136	688282	理工导航	3,185	145,395.25	0.00
137	688663	新风光	3,279	144,276.00	0.00
138	301248	杰创智能	4,716	143,743.68	0.00
139	300986	志特新材	3,685	142,793.75	0.00
140	301230	泓博医药	2,687	142,167.64	0.00
141	688391	钜泉科技	1,397	140,524.23	0.00
142	301097	天益医疗	2,486	140,409.28	0.00
143	301160	翔楼新材	3,918	139,559.16	0.00
144	301212	联盛化学	4,158	138,170.34	0.00
145	688676	金盘科技	3,750	135,675.00	0.00
146	688697	纽威数控	5,837	133,141.97	0.00
147	301100	风光股份	5,985	132,627.60	0.00
148	688305	科德数控	1,496	132,396.00	0.00
149	688130	晶华微	3,112	132,353.36	0.00
150	301149	隆华新材	12,138	132,304.20	0.00
151	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.00
152	300925	法本信息	10,195	132,025.25	0.00
153	688625	呈和科技	2,672	130,714.24	0.00
154	301338	凯格精机	2,568	130,358.99	0.00
155	300917	特发服务	4,737	129,556.95	0.00
156	688733	壹石通	3,409	128,417.03	0.00
157	688209	英集芯	6,822	126,957.42	0.00
158	688267	中触媒	3,390	125,565.60	0.00
159	301283	聚胶股份	2,344	125,419.01	0.00
160	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.00
161	301112	信邦智能	3,984	123,862.56	0.00
162	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.00
163	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.00
164	688345	博力威	2,332	122,360.04	0.00
165	688687	凯因科技	5,354	121,803.50	0.00
166	300997	欢乐家	9,279	120,627.00	0.00
167	688247	宣泰医药	7,155	119,846.25	0.00
168	688259	创耀科技	1,595	119,640.95	0.00
169	301151	冠龙节能	7,025	119,495.25	0.00
170	301132	满坤科技	4,672	118,322.32	0.00

171	688132	邦彦技术	4,844	118,193.60	0.00
172	688626	翔宇医疗	3,652	116,425.76	0.00
173	688273	麦澜德	3,568	116,316.80	0.00
174	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.00
175	301166	优宁维	2,528	115,605.44	0.00
176	301258	富士莱	2,942	115,473.50	0.00
177	688456	有研粉材	3,396	115,464.00	0.00
178	301060	兰卫医学	5,869	115,091.09	0.00
179	688370	丛麟科技	3,254	114,963.82	0.00
180	300941	创识科技	5,983	114,035.98	0.00
181	301282	金禄电子	4,333	113,385.23	0.00
182	688257	新锐股份	2,899	113,292.92	0.00
183	605499	东鹏饮料	632	112,432.80	0.00
184	301179	泽宇智能	2,941	112,257.97	0.00
185	301015	百洋医药	4,614	109,997.76	0.00
186	301306	西测测试	2,543	109,602.67	0.00
187	300918	南山智尚	10,626	109,235.28	0.00
188	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.00
189	301221	光庭信息	2,791	108,597.81	0.00
190	301180	万祥科技	6,536	107,517.20	0.00
191	688682	霍莱沃	1,324	105,205.04	0.00
192	301220	亚香股份	2,849	104,928.67	0.00
193	688253	英诺特	4,364	103,950.48	0.00
194	688667	菱电电控	1,191	103,640.82	0.00
195	688291	金橙子	3,961	103,619.76	0.00
196	688103	国力股份	1,595	102,622.30	0.00
197	688767	博拓生物	2,220	102,564.00	0.00
198	688768	容知日新	907	102,454.72	0.00
199	688070	纵横股份	2,407	101,743.89	0.00
200	688251	井松智能	3,392	100,844.16	0.00
201	301030	仕净科技	2,417	100,813.07	0.00
202	301046	能辉科技	2,891	100,173.15	0.00
203	301017	漱玉平民	5,550	99,844.50	0.00
204	688102	斯瑞新材	6,030	99,434.70	0.00
205	688670	金迪克	2,310	99,306.90	0.00
206	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.00
207	300932	三友联众	6,885	98,799.75	0.00
208	301116	益客食品	5,764	98,506.76	0.00
209	301126	达嘉维康	6,615	98,497.35	0.00
210	688698	伟创电气	4,751	98,393.21	0.00
211	301193	家联科技	2,970	98,336.70	0.00

212	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.00
213	688315	诺禾致源	3,711	97,933.29	0.00
214	301078	孩子王	7,551	97,785.45	0.00
215	688636	智明达	918	96,867.36	0.00
216	688173	希荻微	4,236	96,284.28	0.00
217	688419	耐科装备	3,039	96,123.57	0.00
218	301298	东利机械	6,340	96,051.00	0.00
219	300993	玉马遮阳	7,375	95,875.00	0.00
220	301118	恒光股份	3,142	94,919.82	0.00
221	300968	格林精密	11,620	93,192.40	0.00
222	688601	力芯微	1,644	92,705.16	0.00
223	688283	坤恒顺维	1,595	92,525.95	0.00
224	301155	海力风电	1,054	92,066.90	0.00
225	688355	明志科技	2,710	91,950.30	0.00
226	301259	艾布鲁	4,828	91,732.00	0.00
227	301181	标榜股份	2,564	91,688.64	0.00
228	300940	南极光	4,909	91,651.03	0.00
229	688079	美迪凯	10,622	91,242.98	0.00
230	601825	沪农商行	15,480	91,022.40	0.00
231	003022	联泓新科	2,995	90,898.25	0.00
232	301196	唯科科技	2,705	90,833.90	0.00
233	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.00
234	688203	海正生材	5,761	90,159.65	0.00
235	688121	卓然股份	3,681	89,963.64	0.00
236	688618	三旺通信	1,117	89,248.30	0.00
237	301136	招标股份	7,172	89,076.24	0.00
238	688049	炬芯科技	3,260	88,183.00	0.00
239	301185	鸥玛软件	5,776	87,910.72	0.00
240	300962	中金辐照	5,757	87,794.25	0.00
241	688661	和林微纳	1,452	87,555.60	0.00
242	688252	天德钰	5,201	87,220.77	0.00
243	301318	维海德	2,052	87,053.44	0.00
244	300967	晓鸣股份	5,061	87,049.20	0.00
245	301092	争光股份	3,230	87,016.20	0.00
246	301326	捷邦科技	2,264	87,002.05	0.00
247	301227	森鹰窗业	2,840	86,972.16	0.00
248	688087	英科再生	2,469	85,797.75	0.00
249	301137	哈焊华通	6,431	85,596.61	0.00
250	301026	浩通科技	2,027	85,134.00	0.00
251	301222	浙江恒威	3,315	83,604.30	0.00
252	688115	思林杰	2,153	83,428.75	0.00

253	688737	中自科技	2,186	82,674.52	0.00
254	301198	喜悦智行	3,397	82,343.28	0.00
255	688244	永信至诚	1,506	82,077.00	0.00
256	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.00
257	301161	唯万密封	3,460	80,697.58	0.00
258	688678	福立旺	4,198	80,559.62	0.00
259	688628	优利德	2,789	80,183.75	0.00
260	301199	迈赫股份	4,014	79,918.74	0.00
261	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.00
262	301006	迈拓股份	5,051	78,846.11	0.00
263	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.00
264	301125	腾亚精工	3,270	78,774.30	0.00
265	300930	屹通新材	3,220	77,666.40	0.00
266	301197	工大科雅	3,791	77,521.79	0.00
267	301135	瑞德智能	3,376	77,310.40	0.00
268	300966	共同药业	2,858	77,166.00	0.00
269	301237	和顺科技	2,610	77,073.30	0.00
270	301110	青木股份	2,013	76,212.18	0.00
271	300942	易瑞生物	4,428	75,895.92	0.00
272	301288	清研环境	4,516	75,191.40	0.00
273	301021	英诺激光	2,899	74,765.21	0.00
274	300926	博俊科技	3,584	74,654.72	0.00
275	688689	银河微电	3,258	74,477.88	0.00
276	301111	粤万年青	3,783	74,222.46	0.00
277	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
278	300614	百川畅银	3,283	74,097.31	0.00
279	301285	鸿日达	5,643	73,945.48	0.00
280	003031	中瓷电子	759	73,091.70	0.00
281	301163	宏德股份	2,764	72,665.56	0.00
282	301048	金鹰重工	8,424	71,772.48	0.00
283	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.00
284	688793	倍轻松	1,454	71,289.62	0.00
285	688226	威腾电气	2,693	70,718.18	0.00
286	688329	艾隆科技	1,846	70,351.06	0.00
287	301276	嘉曼服饰	3,026	70,269.50	0.00
288	301020	密封科技	4,210	70,264.90	0.00
289	300937	药易购	2,434	70,245.24	0.00
290	300945	曼卡龙	4,731	70,208.04	0.00
291	688633	星球石墨	1,558	69,642.60	0.00
292	001270	铖昌科技	568	69,296.00	0.00
293	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.00

294	688292	浩瀚深度	4,503	69,121.05	0.00
295	601568	北元集团	12,108	68,652.36	0.00
296	688210	统联精密	3,105	68,527.35	0.00
297	301130	西点药业	2,370	68,421.90	0.00
298	688609	九联科技	10,372	68,351.48	0.00
299	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.00
300	301138	华研精机	2,849	67,720.73	0.00
301	688662	富信科技	2,556	67,682.88	0.00
302	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
303	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.00
304	301319	唯特偶	1,149	66,253.15	0.00
305	300978	东箭科技	5,930	66,178.80	0.00
306	605376	博迁新材	1,421	65,977.03	0.00
307	688683	莱尔科技	3,296	65,952.96	0.00
308	603529	爱玛科技	1,427	65,456.49	0.00
309	301028	东亚机械	7,329	65,447.97	0.00
310	688577	浙海德曼	1,503	64,914.57	0.00
311	301300	远翔新材	2,107	63,702.75	0.00
312	301011	华立科技	2,275	63,495.25	0.00
313	300952	恒辉安防	3,398	63,134.84	0.00
314	301270	汉仪股份	2,095	62,884.70	0.00
315	688659	元琛科技	3,671	62,884.23	0.00
316	688786	悦安新材	1,513	62,744.11	0.00
317	003035	南网能源	11,046	62,630.82	0.00
318	688718	唯赛勃	3,145	62,616.95	0.00
319	688071	华依科技	1,101	62,217.51	0.00
320	688219	会通股份	7,336	61,695.76	0.00
321	300985	致远新能	2,945	61,668.30	0.00
322	688195	腾景科技	2,693	61,561.98	0.00
323	688557	兰剑智能	1,812	61,336.20	0.00
324	688613	奥精医疗	2,617	61,290.14	0.00
325	688799	华纳药厂	1,917	61,018.11	0.00
326	688611	杭州柯林	1,400	60,704.00	0.00
327	688685	迈信林	2,612	60,441.68	0.00
328	301158	德石股份	3,783	59,960.55	0.00
329	301133	金钟股份	2,860	59,888.40	0.00
330	300814	中富电路	3,280	59,236.80	0.00
331	301012	扬电科技	1,691	59,032.81	0.00
332	688113	联测科技	1,415	59,019.65	0.00
333	688597	煜邦电力	3,907	58,761.28	0.00
334	301002	崧盛股份	2,601	58,522.50	0.00

335	300910	瑞丰新材	474	58,448.94	0.00
336	300987	川网传媒	3,905	58,340.70	0.00
337	600906	财达证券	7,597	57,509.29	0.00
338	688669	聚石化学	2,681	57,480.64	0.00
339	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
340	301228	实朴检测	3,721	57,377.82	0.00
341	300950	德固特	3,279	57,087.39	0.00
342	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
343	688296	和达科技	2,173	56,215.51	0.00
344	300963	中洲特材	3,679	55,847.22	0.00
345	301182	凯旺科技	2,932	55,180.24	0.00
346	300922	天秦装备	4,008	54,989.76	0.00
347	301045	天禄科技	3,350	54,404.00	0.00
348	301233	盛帮股份	1,576	54,354.58	0.00
349	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.00
350	301016	雷尔伟	2,747	54,170.84	0.00
351	301066	万事利	4,810	54,016.30	0.00
352	301055	张小泉	3,541	53,894.02	0.00
353	688171	纬德信息	2,821	53,570.79	0.00
354	688314	康拓医疗	1,085	52,047.45	0.00
355	688590	新致软件	5,422	51,942.76	0.00
356	301063	海锅股份	1,524	51,846.48	0.00
357	300972	万辰生物	4,300	51,772.00	0.00
358	301038	深水规院	3,458	51,109.24	0.00
359	688216	气派科技	2,000	51,040.00	0.00
360	300958	建工修复	2,993	50,940.86	0.00
361	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.00
362	300998	宁波方正	2,003	50,715.96	0.00
363	601963	重庆银行	7,472	50,660.16	0.00
364	688076	诺泰生物	2,189	50,215.66	0.00
365	300956	英力股份	3,707	50,118.64	0.00
366	688787	海天瑞声	817	48,766.73	0.00
367	300971	博亚精工	2,445	48,386.55	0.00
368	301098	金埔园林	3,069	48,306.06	0.00
369	301059	金三江	2,581	47,748.50	0.00
370	688319	欧林生物	3,412	47,324.44	0.00
371	688448	磁谷科技	1,985	46,667.35	0.00
372	300943	春晖智控	3,813	46,022.91	0.00
373	688656	浩欧博	1,371	45,955.92	0.00
374	301040	中环海陆	2,401	45,907.12	0.00
375	688501	青达环保	1,759	45,470.15	0.00

376	300975	商络电子	7,375	45,430.00	0.00
377	300931	通用电梯	6,713	44,238.67	0.00
378	605358	立昂微	1,026	43,707.60	0.00
379	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.00
380	600916	中国黄金	3,371	42,609.44	0.00
381	688255	凯尔达	1,648	42,370.08	0.00
382	688511	天微电子	1,490	42,345.80	0.00
383	688350	富淼科技	2,552	41,954.88	0.00
384	688260	昀冢科技	2,990	41,590.90	0.00
385	300886	华业香料	1,903	41,466.37	0.00
386	301049	超越科技	1,954	41,170.78	0.00
387	301041	金百泽	2,150	41,129.50	0.00
388	301025	读客文化	4,027	40,793.51	0.00
389	301062	上海艾录	5,225	40,755.00	0.00
390	688191	智洋创新	3,203	40,614.04	0.00
391	688316	青云科技	1,428	40,326.72	0.00
392	300961	深水海纳	3,936	40,304.64	0.00
393	688509	正元地信	9,851	39,798.04	0.00
394	300948	冠中生态	3,229	39,781.28	0.00
395	300960	通业科技	2,332	39,737.28	0.00
396	301033	迈普医学	1,076	39,682.88	0.00
397	688622	禾信仪器	1,204	39,130.00	0.00
398	300920	润阳科技	2,503	38,871.59	0.00
399	301027	华蓝集团	2,856	38,556.00	0.00
400	301032	新柴股份	5,124	38,481.24	0.00
401	301010	晶雪节能	2,172	38,335.80	0.00
402	605589	圣泉集团	1,750	37,432.50	0.00
403	688468	科美诊断	3,919	37,112.93	0.00
404	301072	中捷精工	1,802	36,941.00	0.00
405	688109	品茗科技	1,301	36,818.30	0.00
406	300992	泰福泵业	1,998	35,864.10	0.00
407	688607	康众医疗	1,890	35,815.50	0.00
408	688655	迅捷兴	3,083	35,300.35	0.00
409	301068	大地海洋	1,436	35,268.16	0.00
410	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.00
411	600032	浙江新能	3,045	34,987.05	0.00
412	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
413	301037	保立佳	2,115	33,988.05	0.00
414	301036	双乐股份	2,047	33,939.26	0.00
415	688679	通源环境	3,139	33,932.59	0.00
416	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.00

417	688517	金冠电气	2,892	33,229.08	0.00
418	300929	华骐环保	2,923	33,176.05	0.00
419	300995	奇德新材	1,909	33,044.79	0.00
420	301007	德迈仕	3,022	32,879.36	0.00
421	003021	兆威机电	680	32,687.60	0.00
422	605338	巴比食品	1,012	32,110.76	0.00
423	300860	锋尚文化	614	31,946.42	0.00
424	601156	东航物流	2,090	31,893.40	0.00
425	605507	国邦医药	1,202	31,816.94	0.00
426	605090	九丰能源	1,526	31,511.90	0.00
427	301053	远信工业	1,544	31,327.76	0.00
428	688328	深科达	1,499	30,969.34	0.00
429	688565	力源科技	3,450	30,567.00	0.00
430	600927	永安期货	1,859	29,967.08	0.00
431	001227	兰州银行	7,868	29,662.36	0.00
432	601187	厦门银行	5,129	29,389.17	0.00
433	688395	正弦电气	1,627	29,383.62	0.00
434	301109	军信股份	1,838	29,077.16	0.00
435	300869	康泰医学	862	28,075.34	0.00
436	601665	齐鲁银行	6,731	28,068.27	0.00
437	688367	工大高科	1,717	27,162.94	0.00
438	605089	味知香	370	27,039.60	0.00
439	601089	福元医药	1,749	26,812.17	0.00
440	300861	美畅股份	545	26,792.20	0.00
441	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
442	688092	爱科科技	1,137	26,401.14	0.00
443	603071	物产环能	1,627	26,324.86	0.00
444	605077	华康股份	864	26,213.76	0.00
445	605337	李子园	1,103	25,843.29	0.00
446	605377	华旺科技	1,050	25,767.00	0.00
447	603324	盛剑环境	732	25,671.24	0.00
448	301079	邵阳液压	1,396	25,560.76	0.00
449	603191	望变电气	1,149	25,530.78	0.00
450	688038	中科通达	2,132	25,349.48	0.00
451	300900	广联航空	879	25,253.67	0.00
452	003029	吉大正元	716	25,246.16	0.00
453	001213	中铁特货	5,818	25,133.76	0.00
454	605286	同力日升	597	25,115.79	0.00
455	603122	合富中国	2,198	24,617.60	0.00
456	003009	中天火箭	623	24,577.35	0.00
457	688272	富吉瑞	1,263	24,502.20	0.00

458	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
459	688681	科汇股份	1,899	24,231.24	0.00
460	688067	爱威科技	1,259	23,581.07	0.00
461	601921	浙版传媒	3,154	23,339.60	0.00
462	003005	竞业达	577	23,195.40	0.00
463	603171	税友股份	637	23,186.80	0.00
464	001201	东瑞股份	802	23,033.44	0.00
465	605060	联德股份	883	22,790.23	0.00
466	003026	中晶科技	460	22,264.00	0.00
467	300887	谱尼测试	680	22,174.80	0.00
468	603255	鼎际得	489	21,956.10	0.00
469	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.00
470	600935	华塑股份	4,812	21,654.00	0.00
471	603209	兴通股份	595	21,610.40	0.00
472	300870	欧陆通	478	21,204.08	0.00
473	300873	海晨股份	774	21,014.10	0.00
474	605167	利柏特	2,471	20,805.82	0.00
475	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.00
476	003038	鑫铂股份	460	20,276.80	0.00
477	300872	天阳科技	1,568	20,274.24	0.00
478	300953	震裕科技	240	19,836.00	0.00
479	001205	盛航股份	808	19,812.16	0.00
480	605339	南侨食品	864	19,656.00	0.00
481	001215	千味央厨	295	19,340.20	0.00
482	688701	卓锦股份	2,340	19,211.40	0.00
483	003040	楚天龙	1,101	19,201.44	0.00
484	605068	明新旭腾	641	19,018.47	0.00
485	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.00
486	001228	永泰运	383	18,962.33	0.00
487	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
488	605186	健麾信息	626	18,842.60	0.00
489	605555	德昌股份	917	18,615.10	0.00
490	605296	神农集团	740	18,522.20	0.00
491	603206	嘉环科技	1,210	18,500.90	0.00
492	003028	振邦智能	432	18,234.72	0.00
493	605305	中际联合	508	17,983.20	0.00
494	300878	维康药业	722	17,905.60	0.00
495	003012	东鹏控股	2,278	17,905.08	0.00
496	605080	浙江自然	374	17,652.80	0.00
497	003039	顺控发展	1,024	17,315.84	0.00
498	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00

499	300909	汇创达	579	17,254.20	0.00
500	001208	华菱线缆	1,754	17,171.66	0.00
501	300893	松原股份	621	16,704.90	0.00
502	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
503	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
504	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
505	001217	华尔泰	1,239	16,206.12	0.00
506	605133	嵘泰股份	618	16,197.78	0.00
507	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
508	001216	华瓷股份	1,177	16,066.05	0.00
509	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.00
510	003020	立方制药	486	15,697.80	0.00
511	300982	苏文电能	317	15,628.10	0.00
512	003016	欣贺股份	1,681	15,431.58	0.00
513	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
514	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
515	300902	国安达	551	15,240.66	0.00
516	605368	蓝天燃气	1,204	14,869.40	0.00
517	603759	海天股份	1,656	14,837.76	0.00
518	003019	宸展光电	691	14,725.21	0.00
519	605099	共创草坪	624	14,476.80	0.00
520	605268	王力安防	1,642	14,449.60	0.00
521	605208	永茂泰	1,081	14,420.54	0.00
522	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
523	003037	三和管桩	1,274	14,345.24	0.00
524	605169	洪通燃气	1,293	14,326.44	0.00
525	003042	中农联合	546	14,206.92	0.00
526	601686	友发集团	2,374	14,101.56	0.00
527	601528	瑞丰银行	2,230	14,071.30	0.00
528	605183	确成股份	741	13,997.49	0.00
529	003030	祖名股份	480	13,977.60	0.00
530	605598	上海港湾	553	13,769.70	0.00
531	605151	西上海	722	13,681.90	0.00
532	603070	万控智造	775	13,640.00	0.00
533	605336	帅丰电器	911	13,501.02	0.00
534	605016	百龙创园	623	13,500.41	0.00
535	003033	征和工业	301	13,364.40	0.00
536	603176	汇通集团	1,924	13,333.32	0.00
537	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
538	003025	思进智能	619	12,862.82	0.00
539	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00

540	605389	长龄液压	498	12,803.58	0.00
541	003027	同兴环保	523	12,782.12	0.00
542	603230	内蒙新华	1,141	12,585.23	0.00
543	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
544	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
545	605179	一鸣食品	939	11,962.86	0.00
546	605098	行动教育	405	11,858.40	0.00
547	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
548	605162	新中港	1,377	11,814.66	0.00
549	603836	海程邦达	733	11,698.68	0.00
550	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
551	300890	翔丰华	286	11,583.00	0.00
552	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.00
553	605056	咸亨国际	933	11,391.93	0.00
554	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
555	605500	森林包装	1,128	11,302.56	0.00
556	605007	五洲特纸	598	11,272.30	0.00
557	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
558	003013	地铁设计	724	11,185.80	0.00
559	003006	百亚股份	804	11,103.24	0.00
560	300891	惠云钛业	1,143	11,007.09	0.00
561	300908	仲景食品	285	10,929.75	0.00
562	001206	依依股份	449	10,919.68	0.00
563	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
564	605277	新亚电子	705	10,842.90	0.00
565	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
566	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
567	300876	蒙泰高新	350	10,755.50	0.00
568	603216	梦天家居	772	10,599.56	0.00
569	003010	若羽臣	562	10,593.70	0.00
570	603213	镇洋发展	799	10,562.78	0.00
571	001218	丽臣实业	490	10,422.30	0.00
572	605365	立达信	645	10,371.60	0.00
573	605228	神通科技	1,217	10,320.16	0.00
574	605122	四方新材	703	10,320.04	0.00
575	605028	世茂能源	615	10,313.55	0.00
576	001212	中旗新材	400	10,252.00	0.00
577	605058	澳弘电子	548	10,220.20	0.00
578	605300	佳禾食品	576	10,189.44	0.00
579	605289	罗曼股份	474	10,124.64	0.00
580	003032	传智教育	586	10,114.36	0.00

581	605378	野马电池	473	10,065.44	0.00
582	601279	英利汽车	2,004	10,060.08	0.00
583	605599	菜百股份	980	9,976.40	0.00
584	605566	福莱茵特	435	9,952.80	0.00
585	300864	南大环境	535	9,897.50	0.00
586	605259	绿田机械	295	9,885.45	0.00
587	605319	无锡振华	764	9,878.52	0.00
588	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
589	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
590	605567	春雪食品	629	9,705.47	0.00
591	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
592	003015	日久光电	1,128	9,689.52	0.00
593	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
594	003018	金富科技	1,027	9,643.53	0.00
595	605005	合兴股份	634	9,624.12	0.00
596	300881	盛德鑫泰	291	9,338.19	0.00
597	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
598	001207	联科科技	682	9,241.10	0.00
599	003036	泰坦股份	776	9,164.56	0.00
600	001266	宏英智能	346	9,155.16	0.00
601	001219	青岛食品	354	9,126.12	0.00
602	300877	金春股份	569	9,121.07	0.00
603	300868	杰美特	593	9,055.11	0.00
604	003023	彩虹集团	385	8,958.95	0.00
605	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
606	605177	东亚药业	439	8,788.78	0.00
607	603511	爱慕股份	553	8,632.33	0.00
608	300882	万胜智能	572	8,602.88	0.00
609	605299	舒华体育	738	8,560.80	0.00
610	605258	协和电子	340	8,544.20	0.00
611	605086	龙高股份	443	8,514.46	0.00
612	603219	富佳股份	528	8,474.40	0.00
613	300907	康平科技	473	8,457.24	0.00
614	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
615	605196	华通线缆	1,172	8,180.56	0.00
616	605488	福莱新材	603	8,056.08	0.00
617	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
618	003004	声迅股份	306	8,020.26	0.00
619	605011	杭州热电	525	7,990.50	0.00
620	300892	品渥食品	272	7,969.60	0.00
621	001288	运机集团	537	7,969.08	0.00

622	001210	金房节能	311	7,939.83	0.00
623	300879	大叶股份	466	7,894.04	0.00
624	605580	恒盛能源	654	7,893.78	0.00
625	605189	富春染织	423	7,817.04	0.00
626	605287	德才股份	349	7,814.11	0.00
627	605180	华生科技	499	7,789.39	0.00
628	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
629	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
630	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
631	003041	真爱美家	419	7,374.40	0.00
632	605069	正和生态	790	7,347.00	0.00
633	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
634	603048	浙江黎明	464	6,927.52	0.00
635	605055	迎丰股份	1,146	6,921.84	0.00
636	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
637	605303	园林股份	610	6,612.40	0.00
638	001202	炬申股份	459	6,595.83	0.00
639	605298	必得科技	508	6,548.12	0.00
640	603150	万朗磁塑	251	6,518.47	0.00
641	605155	西大门	490	6,374.90	0.00
642	300889	爱克股份	479	6,131.20	0.00
643	001209	洪兴股份	450	6,102.00	0.00
644	605577	龙版传媒	588	5,844.72	0.00
645	300991	创益通	406	5,464.76	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002180	纳思达	379,346,760.29	9.32
2	600536	中国软件	364,227,894.94	8.94
3	688052	纳芯微	156,393,719.98	3.84
4	688234	天岳先进	154,672,639.48	3.80
5	300604	长川科技	152,789,838.57	3.75
6	002371	北方华创	136,948,929.60	3.36
7	002268	电科网安	129,992,045.65	3.19
8	300567	精测电子	129,626,417.80	3.18
9	688082	盛美上海	113,258,721.93	2.78
10	688153	唯捷创芯	101,846,400.98	2.50
11	603986	兆易创新	94,993,419.32	2.33

12	688120	华海清科	84,526,082.07	2.08
13	688152	麒麟信安	65,081,698.55	1.60
14	600703	三安光电	64,998,473.00	1.60
15	688372	伟测科技	60,146,160.47	1.48
16	688409	富创精密	58,093,599.50	1.43
17	688536	思瑞浦	55,396,554.25	1.36
18	301208	中亦科技	51,174,445.73	1.26
19	301095	广立微	49,986,036.90	1.23
20	688521	芯原股份	44,803,933.17	1.10

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	300604	长川科技	280,607,003.69	6.89
2	688052	纳芯微	254,086,301.73	6.24
3	688234	天岳先进	231,335,842.11	5.68
4	600703	三安光电	195,602,128.75	4.80
5	600536	中国软件	182,617,767.83	4.48
6	002371	北方华创	170,182,419.29	4.18
7	002268	电科网安	161,119,733.63	3.96
8	002180	纳思达	137,896,829.75	3.39
9	688339	亿华通	120,381,020.94	2.96
10	603650	彤程新材	108,421,061.71	2.66
11	300207	欣旺达	91,658,025.69	2.25
12	603986	兆易创新	88,994,773.00	2.19
13	300567	精测电子	82,307,336.76	2.02
14	603501	韦尔股份	61,267,073.48	1.50
15	300661	圣邦股份	57,270,768.00	1.41
16	688012	中微公司	47,884,713.94	1.18
17	688536	思瑞浦	43,993,764.98	1.08
18	603078	江化微	41,118,888.00	1.01
19	688120	华海清科	31,569,553.89	0.78
20	603290	斯达半导	15,228,147.08	0.37

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	2,596,593,006.90
卖出股票收入（成交）总额	2,483,930,430.93

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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，除芯原股份外，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。

芯原微电子(上海)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上海监管局的行政监管措施。

截至本报告期末，芯原股份（688521）为本基金前十大重仓股。芯原股份是国内市占率第一，

全球市占率第七的芯片 IP 提供商。随着中美科技对抗态势逐渐加剧，IP 与 EDA 等芯片设计环节中最重要的“卡脖子”环节，在中美科技竞争中占有战略制高地。且随着芯片制程的不断进步，芯片设计环节越来越复杂，设计公司将越来越依靠上游的 IP 服务商，IP 整个行业的近几年增速维持高位，全球芯片 IP 市场 290 亿元，芯原股份市占率 2%。除了 IP 业务以外，芯原股份的定制芯片量产业务也发展迅速，近些年，互联网公司、汽车公司造芯运动的发展如火如荼，这些系统厂商对定制化芯片设计的需求越来越高，芯原股份的量产芯片设计业务结合他们的强势 IP，发展迅速，其客户下游覆盖数据中心、汽车、消费电子，这块业务的爆发将为公司长期提供利润增长。

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	729,790.70
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,481,188.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,210,978.92

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
220,964	11,692.73	268,839,565.04	10.41%	2,314,832,927.94	89.59%

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	1,571,822.04	0.0608%

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	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年05月10日）基金份额总额	270,829,069.66
本报告期期初基金份额总额	2,348,357,065.80
本报告期基金总申购份额	1,912,141,137.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,676,825,709.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,583,672,492.98

§ 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。

本报告期内，本基金托管人重大人事变动情况如下：徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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 110,000.00 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
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

构	
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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	588,227,251.31	11.78%	424,289.29	11.83%	本报告期新增
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	842,159,191.93	16.86%	607,073.49	16.93%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	1,132,638,909.72	22.68%	816,974.85	22.78%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	1	1,005,924,164.12	20.14%	715,520.95	19.95%	-
招商证券	2	1,152,892,522.45	23.09%	826,193.07	23.04%	-
中金公司	1	272,154,291.66	5.45%	196,305.79	5.47%	本报告期新增
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 2 个交易单元：方正证券股份有限公司（1 个交易单元）、中国国际金融股份有限公司（1 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	49,605,508.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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
4	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022 年 01 月 24 日
5	诺安基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022 年 01 月 31 日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 02 月 10 日
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国元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》	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旗下部分基金在华龙证券开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 03 月 15 日
10	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
11	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
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 03 月 24 日
13	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
14	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022 年 03 月 31 日
15	诺安和鑫灵活配置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 04 月 01 日
16	诺安基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022 年 04 月 01 日
17	诺安和鑫灵活配置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 04 月 01 日
18	诺安和鑫灵活配置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 04 月 01 日
19	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
20	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
21	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022 年 04 月 22 日
22	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
23	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	《上海证券报》	2022 年 04 月 29 日

	金的公告		
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城国瑞证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2022 年 05 月 25 日
25	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 05 月 30 日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝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 15 日
27	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
28	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
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金财富为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022 年 06 月 24 日
30	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
31	诺安和鑫灵活配置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
32	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
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宏信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 08 月 01 日
34	诺安和鑫灵活配置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
35	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
36	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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2022 年 09 月 01 日

	售业务的公告	《证券日报》	
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2022 年 09 月 07 日
38	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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 09 月 09 日
39	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
40	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
41	诺安和鑫灵活配置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
42	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
43	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资三安光电非公开发行股票的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》	2022 年 12 月 16 日
44	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行招赢通平台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 12 月 28 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 18 日披露了《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》，自 2023 年 2 月 18 日起，增聘邓心怡女士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和鑫保本混合型证券投资基金公开募集的文件。
- ② 原诺安和鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的相关公告。
- ③ 《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ④ 《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- ⑤ 《诺安和鑫灵活配置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 报告期内诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2023 年 03 月 31 日