

诺安平衡证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	54
10.1	基金份额持有人大会决议	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安平衡证券投资基金
基金简称	诺安平衡混合
基金主代码	320001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 05 月 21 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	966,208,050.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	76,689,525.27
本期利润	51,456,432.59
加权平均基金份额本期利润	0.0610
本期加权平均净值利润率	4.55%
本期基金份额净值增长率	4.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	311,775,561.92
期末可供分配基金份额利润	0.3227
期末基金资产净值	1,277,983,612.71
期末基金份额净值	1.3227
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	537.06%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.34%	1.98%	0.94%	0.56%	-4.28%	1.42%
过去三个月	-4.78%	1.70%	-2.73%	0.54%	-2.05%	1.16%
过去六个月	4.68%	1.45%	0.55%	0.55%	4.13%	0.90%
过去一年	3.99%	1.29%	-7.98%	0.64%	11.97%	0.65%
过去三年	27.58%	1.12%	-7.26%	0.73%	34.84%	0.39%
自基金合同生效起至今	537.06%	1.31%	220.08%	1.06%	316.98%	0.25%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2023 年 6 月 30 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		
邓心怡	本基金基金经理	2022 年 10 月	-	10 年	硕士，具有基金从业资格

		15 日			格。曾任职于中国对外贸易信托有限公司，从事投资研究工作，2020 年 11 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部副总经理，现任研究部总经理。2022 年 7 月起任诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任诺安平衡证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 5 月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 6 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，国内经济延续温和复苏的态势，但二季度经济出现边际增速的回落，这既有此前积压性需求释放完毕的影响，也有疫后疤痕效应的体现，还有需求不及预期后企业存货去化的行为。

国内方面，上半年的疤痕效应在以下两个方面相互加强：疫后居民消费倾向回落，劳动参与率上升，使得工资和核心通胀偏低，继而压制居民消费意愿和风险偏好。预期这一影响在中期维度依然会影响居民的消费意愿，但影响将逐级回落，到明年将逐步消解。

海外方面，美国进入加息尾声，美国经济软着陆的场景可能出现。二季度以来，美国劳动力市场维持偏紧的格局，但美债和美元市场相对钝化，市场定价美国将进入加息尾声，欧洲可能处于加息中期阶段。从通胀看，美国 6 月 CPI 降至 3%，核心 CPI 回落幅度不大，考虑到核心通胀受住房分项影响巨大、而领先的房租指标显示未来会出现下降，未来通胀数据可能不再对美国货币政策产生较

大制约。考虑到发达国家居民在疫后消费倾向和风险偏好处于高位，股市仍然较强，美国居民消费和企业融资回落幅度有限，软着陆的场景可能出现。

在此过程中，A 股在二季度指数中枢震荡，风格频繁切换，逐渐形成围绕人工智能发展的 AI 主题主线和围绕国企改革相关的中特估值主线，顺周期和电新板块经过较长时间调整，也进入具备性价比的观察区间。

基金在上半年聚焦消费复苏、科技安全和人工智能领域的投资机会，过程中关注相关公司的估值性价比和稳态市场空间，动态调整持仓结构。

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 1.3227 元，本报告期内基金份额净值增长率为 4.68%，同期业绩比较基准收益率为 0.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济修复的方向明确，近期地产板块的预期修复，将密切观察后续的落地措施和相应的地产投资和销售数据。在宏观层面，关注海外的加息进度和经济软着陆预期，国内经济修复进度与市场预期的匹配性尚待跟踪，尤其是围绕地产和消费数据的相关板块。

在经济内生性修复预期不变的前提下，看好下半年的三条主线：

一是消费板块的复苏，随着国内温和复苏的趋势得到经济数据确认，居民部门的消费倾向回升，过程和幅度可能超出当前市场预期。

二是围绕人工智能和安全的科技主线，科技变革有望加快推进中国式现代化、推动国内经济结构性提升，包括以信创和数据要素为代表的软科技安全、以半导体为代表的硬科技安全和能源安全，以及全球共振中人工智能领域的涌现式迭代创新。在 AI 领域的主题型机会更关注基础设施层的算力、主题层面的国产化和应用端产品落地。

在人工智能方面，产业发展变化和业绩兑现的情况十分值得关注和期待。每一次科技革命，大多具有相似的特征和发展顺序，先在基础设施端创新，继而从易到难在应用端创新，最后以这个创新为起点进行某个领域的商业模式革新。比如从互联网到移动互联网的跃迁，在产业的角度走了 10 年，智能手机和移动通信的基础设施创新，推动了从互联网到移动互联网的跃迁，真正开启了“场景”概念，通过智能手机获取基于“位置”的服务，最终带来了包括地图导航、打车、外卖、直播等等应用服务创新，最后引发了传统业态的商业模式变革。

站在当下，我们目前只看到了大模型作为人工智能革命中基础设施的能力跃升，远未看到大模型的能力边界，也还没有完成对大模型能力的“可解释性”的研究。至于真正应用 AI 的产品，即使

在海外也还没有完成产品的打磨，更没走到对传统业态和生产方式的革新，产业的演进和迭代速度十分值得关注：ChatGPT 在 2022 年 11 月上线，仅仅几个月之后，我们已经能看到多个互联网巨头跟进推出了各自的大模型，应用端也看到包括微软的 Windows Copilot 等产品开始试用和落地，与移动互联网的新硬件、新应用、新模式的演进相比，人工智能的演进和迭代更为迅速，期待在近三年看到人工智能由易到难地快速、充分嵌入现有的各领域的生产场景，提高渗透率，实现从应用到商业模式的革新。

三是具备盈利提升能力的、低估值、高股息资产的价值重估，主要是围绕国企改革的中特估主题。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	81,900,695.15	86,699,574.18
结算备付金		4,133,608.22	3,828,493.14
存出保证金		416,732.62	187,332.96
交易性金融资产	6.4.7.2	1,179,751,818.78	999,311,413.66
其中：股票投资		923,293,619.57	771,709,138.12
基金投资		-	-
债券投资		256,458,199.21	227,602,275.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	835,098.22
应收股利		-	-

应收申购款		38,182,213.99	35,029.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,304,385,068.76	1,090,896,942.10
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		18,234,715.10	1,047,901.35
应付赎回款		2,851,376.05	77,038.86
应付管理人报酬		1,487,895.68	1,389,302.88
应付托管费		247,982.58	231,550.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		195,008.34	192,331.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,384,478.30	2,355,845.49
负债合计		26,401,456.05	5,293,970.20
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	966,208,050.79	859,157,507.60
未分配利润	6.4.7.8	311,775,561.92	226,445,464.30
净资产合计		1,277,983,612.71	1,085,602,971.90
负债和净资产总计		1,304,385,068.76	1,090,896,942.10

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3227 元，基金份额总额 966,208,050.79 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01 日至2023年06月 30日	上年度可比期间 2022年01月01日 至2022年06月30 日
一、营业总收入		61,430,142.14	-100,442,689.08
1. 利息收入		184,818.03	172,548.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	184,818.03	172,548.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,421,266.32	-46,936,990.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	83,039,097.82	-50,006,954.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-528,126.61	-1,634,205.06
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	3,910,295.11	4,704,168.67
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-25,233,092.68	-53,908,161.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	57,150.47	229,914.60
减：二、营业总支出		9,973,709.55	10,658,579.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,437,734.42	9,025,284.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,406,288.94	1,504,214.18
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1,670.03	832.19
8. 其他费用	6.4.7.17	128,016.16	128,247.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,456,432.59	-111,101,268.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,456,432.59	-111,101,268.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		51,456,432.59	-111,101,268.10

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安平衡证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	859,157,507.60	-	226,445,464.30	1,085,602,971.90
二、本期期初净资产（基金净值）	859,157,507.60	-	226,445,464.30	1,085,602,971.90
三、本期增减变动额（减）	107,050,543.19	-	85,330,097.62	192,380,640.81

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	51,456,432.59	51,456,432.59
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	107,050,543.19	-	33,873,665.03	140,924,208.22
其中: 1. 基金申购款	171,097,240.22	-	55,436,935.10	226,534,175.32
2. 基金赎回款	-64,046,697.03	-	-21,563,270.07	-85,609,967.10
(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)	966,208,050.79	-	311,775,561.92	1,277,983,612.71
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	917,312,051.96	-	336,000,042.78	1,253,312,094.74
二、本期期初净资产(基金净值)	917,312,051.96	-	336,000,042.78	1,253,312,094.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	40,256,571.11	-	-75,668,088.18	-35,411,517.07
(一)、综合收益总额	-	-	-111,101,268.10	-111,101,268.10
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	40,256,571.11	-	35,433,179.92	75,689,751.03
其中: 1. 基金申购款	222,830,334.12	-	64,147,172.57	286,977,506.69
2. 基金赎回款	-182,573,763.01	-	-28,713,992.65	-211,287,755.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	957,568,623.07	-	260,331,954.60	1,217,900,577.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

齐斌

田冲

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《诺安平衡证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至6月30日期间的经营成果和净资产(基金净值)变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	81,900,695.15
等于：本金	81,893,159.01
加：应计利息	7,536.14
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	81,900,695.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	949,180,713.62	-	923,293,619.57	-25,887,094.05
贵金属投资-金交所黄	-	-	-	-

金合约					
债券	交易所市场	251,063,925.79	630,111.31	256,458,199.21	4,764,162.11
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	251,063,925.79	630,111.31	256,458,199.21	4,764,162.11
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,200,244,639.41	630,111.31	1,179,751,818.78	-21,122,931.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,142.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,255,940.33
其中：交易所市场	3,255,940.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,395.94
合计	3,384,478.30

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	859,157,507.60	859,157,507.60
本期申购	171,097,240.22	171,097,240.22
本期赎回（以“-”号填列）	-64,046,697.03	-64,046,697.03
本期末	966,208,050.79	966,208,050.79

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	655,186,406.36	-428,740,942.06	226,445,464.30
本期利润	76,689,525.27	-25,233,092.68	51,456,432.59
本期基金份额交易产生的变动数	90,874,044.17	-57,000,379.14	33,873,665.03
其中：基金申购款	143,507,279.99	-88,070,344.89	55,436,935.10
基金赎回款	-52,633,235.82	31,069,965.75	-21,563,270.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	822,749,975.80	-510,974,413.88	311,775,561.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	活期存款利息收入	143,096.22
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	38,661.98	
其他	3,059.83	
合计	184,818.03	

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	卖出股票成交总额	3,713,230,207.52
减：卖出股票成本总额	3,619,162,954.21	
减：交易费用	11,028,155.49	

买卖股票差价收入	83,039,097.82
----------	---------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益--利息收入	851,393.99
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,379,520.60
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	-528,126.61

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	335,362,575.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	333,736,898.42
减：应计利息总额	2,982,109.97
减：交易费用	23,087.32
买卖债券差价收入	-1,379,520.60

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,910,295.11
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,910,295.11

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

1. 交易性金融资产	-25,233,092.68
--股票投资	-31,968,030.07
--债券投资	6,734,937.39
--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	-25,233,092.68

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	56,189.96
基金转换费收入	960.51
合计	57,150.47

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	320.22
账户维护费	18,600.00
合计	128,016.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,437,734.42	9,025,284.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,134,593.72	1,019,084.29

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,406,288.94	1,504,214.18

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	占基金总份额的比例	基金份额	占基金总份额的比例
中国中化集团公司	175,587,304.69	18.17%	175,587,304.69	20.44%

注：关联方投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司-活期存款	81,900,695.15	143,096.22	98,797,816.21	148,060.12

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2023 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
00128	陕西	2023年	6个月	新股锁	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

6	能源	03月31日		定							
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-	
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-	
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-	
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-	

		日								
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	2,045	63,088.25	48,323.35	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股锁定	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301355	湖南	2023年	6个月	新股锁	23.77	42.89	1,245	29,593.65	53,398.05	-

8	裕能	02月01日		定							
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-	
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	
301395	仁信新材	2023年06月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-	
301395	仁信新材	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-	
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-	
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-	

		日								
301486	致尚科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股锁定	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	3,389	22,299.62	25,688.62	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	6,084	120,828.24	109,877.04	-
688307	中润光学	2023年02月08日	6个月	新股锁定	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-

688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023年04月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	10,764	61,247.16	58,233.24	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	4,348	48,262.80	74,089.92	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	994	39,750.06	36,489.74	-
688485	九州一轨	2023年01月11日	6个月	新股锁定	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年05月08日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
68852	航天	2023年	6个月	新股锁	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

3	环宇	05月26日		定							
688531	日联科技	2023年03月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-	
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-	
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-	
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-	
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-	
688593	新相微	2023年05月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	
688603	天承科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-	
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-	
688620	安凯微	2023年06月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-	
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-	
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-	

		日								
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：1、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

2、本基金持有的流通受限股票“301281 科源制药”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股；本基金持有的流通受限股票“301322 绿通科技”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股；本基金持有的流通受限股票“688507 索辰科技”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股；以上流通受限股票转增股本数量与金额已包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督

察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	15,943,506.36

合计	-	15,943,506.36
----	---	---------------

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	50,569,094.42	29,925,584.39
AAA 以下	205,889,104.79	52,903,240.57
未评级	-	128,829,944.22
合计	256,458,199.21	211,658,769.18

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到

期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例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 2023 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而

发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	81,900,695.15	-	-	-	-	81,900,695.15
结算备付金	4,133,608.22	-	-	-	-	4,133,608.22
存出保证金	416,732.62	-	-	-	-	416,732.62
交易性金融资产	17,183,218.25	3,822,573.90	214,181,062.93	21,271,344.13	923,293,619.57	1,179,751,818.78
应收申购款	-	-	-	-	38,182,213.99	38,182,213.99
资产总计	103,634,254.24	3,822,573.90	214,181,062.93	21,271,344.13	961,475,833.56	1,304,385,068.76
负债						
应付清算款	-	-	-	-	18,234,715.10	18,234,715.10
应付赎回款	-	-	-	-	2,851,376.05	2,851,376.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,487,895.68	1,487,895.68
应付托管费	-	-	-	-	247,982.58	247,982.58
应交税费	-	-	-	-	195,008.34	195,008.34
其他负债	-	-	-	-	3,384,478.30	3,384,478.30
负债总计	-	-	-	-	26,401,456.05	26,401,456.05
利率敏感度缺	103,634,254.24	3,822,573.90	214,181,062.93	21,271,344.13	935,074,377.51	1,277,983,612.76

口	24	0	93	3	51	.71
上年度末 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	86,699,574.18	-	-	-	-	86,699,574.18
结算备付金	3,828,493.14	-	-	-	-	3,828,493.14
存出保证金	187,332.96	-	-	-	-	187,332.96
交易性金融资产	39,688,342.36	22,549,054.80	34,134,515.13	131,230,363.25	771,709,138.12	999,311,413.66
应收清算款	-	-	-	-	835,098.22	835,098.22
应收申购款	-	-	-	-	35,029.94	35,029.94
资产总计	130,403,742.64	22,549,054.80	34,134,515.13	131,230,363.25	772,579,266.28	1,090,896,942.10
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1,047,901.35	1,047,901.35
应付赎回款	-	-	-	-	77,038.86	77,038.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,389,302.88	1,389,302.88
应付托管费	-	-	-	-	231,550.47	231,550.47
应交税费	-	-	-	-	192,331.15	192,331.15
其他负债	-	-	-	-	2,355,845.49	2,355,845.49
负债总计	-	-	-	-	5,293,970.20	5,293,970.20
利率敏感度缺口	130,403,742.64	22,549,054.80	34,134,515.13	131,230,363.25	767,285,296.08	1,085,602,971.90

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	市场利率下降27个基点	-	2,592,887.40
	市场利率上升27个基点	-	-2,592,887.40

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，债券投资和股票投资的比重根据基金管理人市场的判断灵活配置，目标配置比例为：股票、存托凭证的比例为 65%，债券资产的比例为 30%，现金的比例为 5%；原则上可能的资产配置比例为：股票、存托凭证的比例为 45-75%，债券资产的比例为 20-50%，现金的比例为 5-10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	923,293,619.57	72.25	771,709,138.12	71.09
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	923,293,619.57	72.25	771,709,138.12	71.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023 年 06 月 30 日)	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 5%	55,390,451.59

业绩比较基准下降 5%	-55,390,451.59	-44,972,252.52
-------------	----------------	----------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,177,104,077.93	830,754,943.95
第二层次	865,434.18	144,773,450.58
第三层次	1,782,306.67	23,783,019.13
合计	1,179,751,818.78	999,311,413.66

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	923,293,619.57	70.78
	其中：股票	923,293,619.57	70.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	256,458,199.21	19.66
	其中：债券	256,458,199.21	19.66
	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	86,034,303.37	6.60
8	其他各项资产	38,598,946.61	2.96
9	合计	1,304,385,068.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	532,430,341.61	41.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	9,531,776.15	0.75
F	批发和零售业	27,705,143.59	2.17
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	310,797,844.07	24.32
J	金融业	16,651,600.00	1.30
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	22,232,028.00	1.74
M	科学研究和技术服务业	428,733.73	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	200,462.09	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,256,460.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	923,293,619.57	72.25

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	227,623	42,793,124.00	3.35
2	300002	神州泰岳	2,927,400	40,983,600.00	3.21
3	002555	三七互娱	1,091,000	38,054,080.00	2.98
4	688110	东芯股份	946,438	34,166,411.80	2.67
5	688082	盛美上海	297,188	32,809,555.20	2.57
6	300308	中际旭创	220,552	32,520,392.40	2.54
7	688766	普冉股份	298,673	31,904,249.86	2.50
8	688072	拓荆科技	73,742	31,411,879.74	2.46
9	002436	兴森科技	2,019,600	31,303,800.00	2.45
10	002230	科大讯飞	454,777	30,906,644.92	2.42
11	688111	金山办公	62,837	29,672,888.14	2.32
12	601360	三六零	2,215,300	27,779,862.00	2.17
13	002475	立讯精密	842,800	27,348,860.00	2.14
14	300299	富春股份	3,058,700	23,980,208.00	1.88
15	603019	中科曙光	454,400	23,128,960.00	1.81
16	688120	华海清科	88,373	22,274,414.65	1.74
17	300475	香农芯创	825,600	21,160,128.00	1.66
18	002605	姚记科技	449,900	20,888,857.00	1.63
19	603738	泰晶科技	1,211,400	20,121,354.00	1.57
20	300638	广和通	833,780	18,910,130.40	1.48
21	002025	航天电器	286,600	18,285,080.00	1.43
22	002654	万润科技	2,009,200	17,359,488.00	1.36
23	002917	金奥博	1,358,591	16,792,184.76	1.31
24	300033	同花顺	95,000	16,651,600.00	1.30
25	603986	兆易创新	142,100	15,098,125.00	1.18

26	000977	浪潮信息	293,300	14,225,050.00	1.11
27	300188	美亚柏科	653,900	13,594,581.00	1.06
28	002463	沪电股份	643,500	13,474,890.00	1.05
29	300476	胜宏科技	555,600	13,395,516.00	1.05
30	301308	江波龙	123,600	12,577,536.00	0.98
31	688143	长盈通	317,328	11,963,265.60	0.94
32	688521	芯原股份	165,538	11,905,492.96	0.93
33	000066	中国长城	836,900	11,574,327.00	0.91
34	000032	深桑达 A	289,400	9,521,260.00	0.75
35	000021	深科技	454,375	9,082,956.25	0.71
36	600760	中航沈飞	194,220	8,739,900.00	0.68
37	002919	名臣健康	178,800	8,063,880.00	0.63
38	688041	海光信息	110,982	7,576,741.14	0.59
39	000768	中航西飞	255,700	6,839,975.00	0.54
40	603108	润达医疗	348,000	6,465,840.00	0.51
41	688012	中微公司	39,075	6,113,283.75	0.48
42	688008	澜起科技	106,352	6,106,731.84	0.48
43	002517	恺英网络	381,400	6,003,236.00	0.47
44	300996	普联软件	165,900	5,093,130.00	0.40
45	600556	天下秀	700,200	4,964,418.00	0.39
46	300280	紫天科技	102,000	4,872,540.00	0.38
47	300315	掌趣科技	620,100	4,836,780.00	0.38
48	688502	茂莱光学	24,484	4,700,928.00	0.37
49	688080	映翰通	94,903	4,640,756.70	0.36
50	603893	瑞芯微	59,900	4,363,715.00	0.34
51	603712	七一二	133,200	4,023,972.00	0.31
52	300296	利亚德	536,200	3,501,386.00	0.27
53	688601	力芯微	74,043	3,487,425.30	0.27
54	688343	云天励飞	48,447	3,081,713.67	0.24
55	300182	捷成股份	476,000	3,003,560.00	0.24
56	603444	吉比特	5,300	2,602,883.00	0.20
57	002236	大华股份	119,900	2,368,025.00	0.19
58	600435	北方导航	198,500	2,280,765.00	0.18
59	603005	晶方科技	104,500	2,110,900.00	0.17
60	688786	悦安新材	45,359	2,104,204.01	0.16
61	002913	奥士康	51,748	1,975,738.64	0.15
62	002371	北方华创	5,900	1,874,135.00	0.15
63	688568	中科星图	22,679	1,827,473.82	0.14
64	301153	中科江南	22,800	1,709,088.00	0.13
65	688249	晶合集成	60,837	1,143,066.15	0.09
66	688114	华大智造	8,969	776,356.64	0.06

67	603313	梦百合	50,200	503,506.00	0.04
68	603365	水星家纺	35,500	499,130.00	0.04
69	600690	海尔智家	21,200	497,776.00	0.04
70	603818	曲美家居	91,900	496,260.00	0.04
71	603208	江山欧派	13,500	491,670.00	0.04
72	603833	欧派家居	5,100	488,580.00	0.04
73	600877	电科芯片	32,100	479,574.00	0.04
74	688147	微导纳米	9,000	475,020.00	0.04
75	688213	思特威	8,283	423,592.62	0.03
76	688105	诺唯赞	12,840	391,491.60	0.03
77	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
78	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
79	600977	中国电影	18,000	252,900.00	0.02
80	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
81	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
82	688132	邦彦技术	4,844	131,659.92	0.01
83	688370	丛麟科技	3,254	123,586.92	0.01
84	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
85	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
86	688175	高凌信息	2,851	94,425.12	0.01
87	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
88	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.01
89	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
90	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
91	688472	阿特斯	4,348	74,089.92	0.01
92	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
93	688469	中芯集成	10,764	58,233.24	0.00
94	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
95	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
96	301358	湖南裕能	1,245	53,398.05	0.00
97	301260	格力博	2,045	48,323.35	0.00
98	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
99	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
100	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
101	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
102	688484	南芯科技	994	36,489.74	0.00
103	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
104	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
105	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
106	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
107	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00

108	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
109	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
110	601061	中信金属	3,389	25,688.62	0.00
111	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
112	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
113	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
114	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
115	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
116	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
117	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
118	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
119	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
120	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
121	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
122	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
123	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
124	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
125	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
126	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
127	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
128	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
129	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
130	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
131	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
132	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
133	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
134	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
135	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
136	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
137	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
138	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
139	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
140	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
141	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
142	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
143	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
144	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
145	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
146	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
147	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
148	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00

149	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
150	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
151	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
152	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
153	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
154	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
155	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
156	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
157	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
158	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
159	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
160	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
161	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
162	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
163	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
164	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
165	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
166	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
167	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
168	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
169	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
170	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
171	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
172	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
173	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
174	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
175	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
176	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
177	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
178	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
179	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688111	金山办公	97,464,152.18	8.98
2	000032	深桑达A	80,144,214.86	7.38
3	002368	太极股份	67,957,805.32	6.26
4	600536	中国软件	67,923,015.02	6.26

5	688256	寒武纪	63,979,255.40	5.89
6	688082	盛美上海	57,271,438.80	5.28
7	688120	华海清科	56,325,618.82	5.19
8	000858	五粮液	54,908,465.63	5.06
9	600600	青岛啤酒	53,882,356.00	4.96
10	603986	兆易创新	53,309,161.85	4.91
11	688072	拓荆科技	50,407,768.47	4.64
12	688012	中微公司	50,291,948.60	4.63
13	688981	中芯国际	47,979,896.88	4.42
14	002027	分众传媒	46,994,864.39	4.33
15	002271	东方雨虹	44,979,457.54	4.14
16	300308	中际旭创	44,939,132.00	4.14
17	688521	芯原股份	43,222,873.99	3.98
18	688158	优刻得	41,998,248.10	3.87
19	300002	神州泰岳	39,946,349.91	3.68
20	688036	传音控股	38,977,150.67	3.59
21	688766	普冉股份	37,223,836.08	3.43
22	601138	工业富联	36,153,370.24	3.33
23	688110	东芯股份	35,463,967.10	3.27
24	002605	姚记科技	35,457,377.00	3.27
25	300033	同花顺	35,219,683.00	3.24
26	002230	科大讯飞	35,182,532.83	3.24
27	301102	兆讯传媒	35,139,300.00	3.24
28	601360	三六零	34,990,963.91	3.22
29	688023	安恒信息	34,820,274.96	3.21
30	688223	晶科能源	33,993,540.44	3.13
31	603019	中科曙光	33,096,649.08	3.05
32	000021	深科技	32,480,326.74	2.99
33	688095	福昕软件	32,256,719.61	2.97
34	002555	三七互娱	31,992,466.92	2.95
35	002156	通富微电	31,985,151.19	2.95
36	300339	润和软件	30,980,865.17	2.85
37	300474	景嘉微	27,956,250.82	2.58
38	002436	兴森科技	27,847,370.62	2.57
39	000977	浪潮信息	27,342,887.79	2.52
40	002475	立讯精密	26,980,220.00	2.49
41	601998	中信银行	25,998,566.03	2.39
42	300133	华策影视	25,995,102.27	2.39
43	603650	彤程新材	25,979,653.02	2.39
44	002463	沪电股份	25,920,500.00	2.39
45	300638	广和通	25,494,599.40	2.35

46	300299	富春股份	25,284,882.44	2.33
47	002236	大华股份	24,995,086.07	2.30
48	603501	韦尔股份	24,794,278.91	2.28
49	003021	兆威机电	23,957,744.81	2.21
50	001215	千味央厨	23,469,310.32	2.16
51	301153	中科江南	23,364,876.96	2.15
52	603589	口子窖	22,991,428.80	2.12
53	600132	重庆啤酒	22,952,859.00	2.11
54	300475	香农芯创	22,058,290.00	2.03

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	119,053,174.44	10.97
2	600536	中国软件	107,652,339.03	9.92
3	600763	通策医疗	81,722,010.54	7.53
4	002368	太极股份	70,828,010.12	6.52
5	688111	金山办公	70,626,683.80	6.51
6	000032	深桑达 A	69,889,274.53	6.44
7	688012	中微公司	61,831,232.61	5.70
8	688363	华熙生物	59,599,172.73	5.49
9	000858	五粮液	58,013,395.71	5.34
10	002459	晶澳科技	57,148,563.37	5.26
11	603288	海天味业	56,430,721.64	5.20
12	600600	青岛啤酒	54,104,086.00	4.98
13	688409	富创精密	47,029,505.62	4.33
14	002271	东方雨虹	46,958,244.60	4.33
15	688158	优刻得	44,573,728.09	4.11
16	688036	传音控股	44,567,641.65	4.11
17	601138	工业富联	42,980,970.32	3.96
18	001215	千味央厨	42,795,368.44	3.94
19	300316	晶盛机电	42,482,683.47	3.91
20	688120	华海清科	41,316,574.67	3.81
21	688981	中芯国际	40,928,368.05	3.77
22	688223	晶科能源	39,932,903.18	3.68
23	300725	药石科技	39,840,205.77	3.67
24	300308	中际旭创	36,454,204.76	3.36
25	688023	安恒信息	35,476,744.30	3.27
26	600131	国网信通	34,735,184.89	3.20
27	300973	立高食品	34,557,308.68	3.18

28	688095	福昕软件	33,896,080.01	3.12
29	300604	长川科技	33,260,741.89	3.06
30	301269	华大九天	33,133,269.35	3.05
31	301102	兆讯传媒	32,765,185.77	3.02
32	002180	纳思达	32,329,865.08	2.98
33	601888	中国中免	31,415,556.00	2.89
34	688152	麒麟信安	31,351,569.52	2.89
35	603589	口子窖	31,297,868.89	2.88
36	300339	润和软件	31,199,809.86	2.87
37	603986	兆易创新	30,655,134.88	2.82
38	002156	通富微电	30,328,511.29	2.79
39	688372	伟测科技	29,083,106.26	2.68
40	603650	彤程新材	27,784,813.68	2.56
41	688521	芯原股份	27,716,053.86	2.55
42	300996	普联软件	26,807,035.33	2.47
43	000021	深科技	26,433,853.32	2.43
44	688082	盛美上海	26,412,327.72	2.43
45	003021	兆威机电	26,190,379.91	2.41
46	002236	大华股份	25,779,502.80	2.37
47	601998	中信银行	25,352,674.00	2.34
48	301153	中科江南	24,433,334.22	2.25
49	300133	华策影视	23,699,742.60	2.18
50	603501	韦尔股份	23,637,076.35	2.18
51	300474	景嘉微	23,317,236.00	2.15
52	688680	海优新材	22,963,323.69	2.12
53	688268	华特气体	22,908,385.82	2.11

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,802,715,465.73
卖出股票收入（成交）总额	3,713,230,207.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	256,458,199.21	20.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	256,458,199.21	20.07

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	501,845	56,466,499.47	4.42
2	113616	韦尔转债	254,600	29,636,277.04	2.32
3	110081	闻泰转债	230,000	25,697,477.81	2.01
4	128122	兴森转债	125,541	20,060,419.96	1.57
5	127012	招路转债	145,000	18,199,247.94	1.42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除三七互娱外，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。

三七互娱网络科技集团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的立案调查。

截至本报告期末，三七互娱（002555）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司估值较低，有恢复增长的潜力，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有三七互娱。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	416,732.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,182,213.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,598,946.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	56,466,499.47	4.42
2	113616	韦尔转债	29,636,277.04	2.32
3	110081	闻泰转债	25,697,477.81	2.01
4	128122	兴森转债	20,060,419.96	1.57
5	127012	招路转债	18,199,247.94	1.42
6	127036	三花转债	17,183,218.25	1.34
7	128132	交建转债	16,229,997.66	1.27
8	113021	中信转债	10,360,316.71	0.81
9	113619	世运转债	9,031,754.79	0.71
10	113024	核建转债	8,298,961.62	0.65

11	127025	冀东转债	7,934,759.93	0.62
12	110068	龙净转债	6,489,541.78	0.51
13	111010	立昂转债	6,226,301.22	0.49
14	113044	大秦转债	5,775,808.22	0.45
15	128035	大族转债	3,822,573.90	0.30

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
44,185	21,867.33	339,166,888.73	35.10%	627,041,162.06	64.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	79,637.42	0.0082%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年05月21日）基金份额总额	2,206,708,982.01
本报告期期初基金份额总额	859,157,507.60
本报告期基金总申购份额	171,097,240.22

减：本报告期基金总赎回份额	64,046,697.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	966,208,050.79

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

俞任君先生担任公司监事，赵星明先生、梅律吾先生不再担任公司监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	803,379,168.20	10.72%	748,190.25	11.13%	-
中国银河 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	2,159,732,385.79	28.81%	2,011,363.67	29.92%	-
中泰证券	1	850,806,435.72	11.35%	613,690.41	9.13%	-
中信建投 证券	1	3,291,552,425.44	43.90%	3,065,423.74	45.61%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	392,107,365.74	5.23%	282,827.55	4.21%	本报告期 新增

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 1 个证券公司 1 个交易单元：中邮证券有限责任公司（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》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	45,238,392.20	7.56%	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	154,933,115.72	25.89%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	102,351,441.97	17.11%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	285,405,006.89	47.70%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	10,429,288.34	1.74%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2023 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2023年01月05日

	申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	
3	诺安平衡证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023年01月20日
4	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2023年01月20日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源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》	2023年03月20日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加银泰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》	2023年03月20日
7	诺安平衡证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023年03月31日
8	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2023年03月31日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金开展基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2023年04月19日
10	诺安平衡证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2023年04月20日
11	诺安平衡证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年04月20日
12	诺安平衡证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 1 期	基金管理人网站	2023年04月20日
13	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 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》	2023年04月22日
14	诺安平衡证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023年04月22日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构并开通定投、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》	2023年05月15日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行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》	2023年05月24日

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230606	175,587,304.69	-	-	175,587,304.69	18.17%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形,敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 8 月 26 日披露了《诺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,调低本基金的管理费率及托管费率,并对基金合同等法律文件的有关条款进行修订。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安平衡证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安平衡证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安平衡证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤报告期内诺安平衡证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2023 年 08 月 31 日